

УТВЕРЖДЕНО

Приказом Генерального директора

АО «ФБ «Август» К.А. Роговского

от 19.12.2022 г. № 19-12-22/1

ПОЛОЖЕНИЕ

Акционерного общества «Финансовый брокер «Август»

о доверительном управлении ценными бумагами

(новая редакция)

1. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ

1.1 Настоящее Положение Акционерного общества «Финансовый брокер «Август» о доверительном управлении ценными бумагами (далее – Положение) регулирует осуществление деятельности по управлению ценными бумагами в Акционерном обществе «Финансовый брокер «Август» (далее – Управляющий)).

1.2 В Положении используются следующие термины и определения:

контролер – должностное лицо Управляющего, отвечающее за осуществление внутреннего контроля;

учредитель управления – юридическое или физическое лицо, которому Управляющий оказывает или предполагает оказать услуги по доверительному управлению;

руководитель – единоличный исполнительный орган Управляющего;

фактический риск – риск, который несет учредитель управления за определенный период времени (включает в себя риск убытков, в том числе риск изменения стоимости активов);

стандартная стратегия управления – единые правила и принципы формирования состава и структуры активов, находящихся в доверительном управлении Управляющего, в соответствии с которыми осуществляется доверительное управление ценными бумагами и денежными средствами нескольких учредителей управления. При этом доверительное управление согласно стандартной стратегии управления не подразумевает идентичный состав, диверсификацию и структуру активов для каждого учредителя управления, чьи активы управляются в соответствии со стандартной стратегией управления. Перечень стратегий доверительного управления, относящихся к стандартным стратегиям управления, определяется приказом руководителя и раскрывается на сайте Управляющего в сети Интернет по адресу <https://www.fbaugust.ru/>.

стандартный инвестиционный профиль – инвестиционный профиль стандартной стратегии управления, определенный Управляющим исходя из существа стандартной стратегии управления.

1.3 Положение устанавливает совокупность требований, условий, мер и процедур, выполнение которых обязательно сотрудниками при оказании Управляющим услуг по управлению ценными бумагами. Внесение изменений (дополнений), а также утверждение Положения в новой редакции осуществляется на основании приказа руководителя.

1.4 В офисе, а также на официальном сайте Управляющего в сети Интернет предоставляется информация:

о полном и сокращенном фирменном наименовании Управляющего в соответствии со сведениями, указанными в едином государственном реестре юридических лиц и в уставе Управляющего;

об адресе Управляющего, адресе электронной почты и контактном телефоне, адресе официального сайта Управляющего в сети Интернет;

о лицензии на осуществление деятельности по управлению ценными бумагами, включая номер, дату выдачи и срок действия лицензии;

об органе, выдавшем лицензию на осуществление деятельности по управлению ценными бумагами (его наименование, адрес и телефоны);

о членстве в саморегулируемой организации, с указанием наименования такой саморегулируемой организации, адресе сайта саморегулируемой организации в сети Интернет и о ее стандартах по защите прав и интересов получателей финансовых услуг;

об органе, осуществляющем полномочия по контролю и надзору за деятельностью Управляющего;

о финансовых услугах, оказываемых на основании договора доверительного управления, и дополнительных услугах Управляющего, в том числе оказываемых Управляющим за дополнительную плату;

о порядке получения финансовой услуги, в том числе документах, которые должны быть предоставлены для ее получения;

о способах и адресах направления обращений (жалоб) Управляющему, в саморегулируемую организацию, в орган, осуществляющий полномочия по контролю и надзору за деятельностью Управляющего;

о способах защиты прав учредителя управления, включая информацию о наличии возможности и способах досудебного или внесудебного урегулирования спора, в том числе о претензионном порядке урегулирования спора;

о способах и порядке изменения условий договора доверительного управления, в том числе в результате внесения Управляющим изменений во внутренние документы, ссылка на которые содержится в договоре доверительного управления.

1.5 Для приема на обслуживание Управляющим юридическое или физическое лицо предоставляют документы и сведения согласно Правил внутреннего контроля Управляющего в целях противодействия легализации (отмыванию) доходов, полученных преступным путем, и финансированию терроризма.

1.6 До приема на обслуживание юридическое или физическое лицо должно быть ознакомлено со следующими документами, размещенными на официальном сайте Управляющего в информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»:

- Декларацией о рисках,

- Политикой осуществления прав по ценным бумагам, находящимся в доверительном управлении АО «ФБ «Август»,
- Мерами АО «ФБ «Август» по недопущению установления приоритета интересов одного или нескольких учредителей управления над интересами других учредителей управления,
- Правилами АО «ФБ «Август» выявления и контроля конфликта интересов, а также предотвращения его последствий,
- Методикой АО «ФБ «Август» оценки стоимости объектов доверительного управления, принадлежащих учредителю управления, стратегиям,
- Положением о вознаграждении Управляющего АО «ФБ «Август» /Приказом об утверждении тарифов по стандартным стратегиям (при условии осуществления доверительного управления в соответствии со стандартной стратегией управления) /Приказом об утверждении тарифов для юридических лиц за ведение инвестиционного портфеля по стратегиям (для юридических лиц).

1.7 При приеме на обслуживание юридическое или физическое лицо:

- заключает с Управляющим договор на доверительное управление на рынке ценных бумаг;
- заключает дополнительное соглашение, устанавливающее размер и/или порядок расчета стоимости услуг Управляющего (при условии, что такое дополнительное соглашение устанавливает иной размер и/или порядок расчета стоимости услуг Управляющего, чем установленный Положением о вознаграждении Управляющего АО «ФБ «Август»/Приказом об утверждении тарифов по стандартным стратегиям/ Приказом об утверждении тарифов для юридических лиц за ведение инвестиционного портфеля по стратегиям);
- подписывает инвестиционный профиль учредителя управления, составленный на основе Порядка определения инвестиционного профиля клиента АО «ФБ «Август» и перечня сведений, необходимых для его определения (за исключением стандартного инвестиционного профиля в соответствии со стандартной стратегией управления).

1.8 Управление ценными бумагами и денежными средствами нескольких учредителей управления в соответствии со стандартной стратегией управления, может осуществляться только при условии, что для указанных учредителей управления определен единый стандартный инвестиционный профиль.

1.9 Перечень стандартных стратегий управления и перечень стандартных инвестиционных профилей, определенных Управляющим для этих стандартных стратегий управления утверждается приказом руководителя. При этом перечень действующих стандартных стратегий управления и перечень соответствующих им стандартных инвестиционных профилей

размещаются на официальном сайте Управляющего в информационно-телекоммуникационной сети «Интернет».

1.10 Управляющий предоставляет следующую информацию о стандартной стратегии управления, предназначенной для учредителей управления, не являющихся квалифицированными инвесторами:

- 1) цель инвестирования;
- 2) предполагаемый возраст физического лица, которому может предлагаться данная стандартная стратегия управления (только для физических лиц);
- 3) примерные среднемесячные доходы и примерные среднемесячные расходы за последние 12 месяцев физического лица, которому может предлагаться данная стандартная стратегия управления (только для физических лиц).

1.11 При оказании услуг по доверительному управлению ценными бумагами Управляющий принимает все зависящие от него разумные меры для обеспечения соответствия доверительного управления инвестиционному профилю учредителя управления, составленному согласно Порядку определения инвестиционного профиля клиента АО «ФБ «Август» и перечня сведений, необходимых для его определения.

1.12 Характеристики инвестиционного профиля учредителя управления указываются в приложении к договору доверительного управления на рынке ценных бумаг (за исключением стандартного инвестиционного профиля в соответствии со стандартной стратегией управления).

1.13 Управляющий не осуществляет управление ценными бумагами и денежными средствами учредителя управления в случае, если для такого учредителя управления не определен инвестиционный профиль в соответствии с Порядком определения инвестиционного профиля клиента АО «ФБ «Август» и перечня сведений, необходимых для его определения, либо в случае отсутствия согласия учредителя управления с указанным инвестиционным профилем.

1.14 При изменении инвестиционного профиля учредителя управления Управляющий обязан привести портфель учредителя управления в соответствие с новым инвестиционным профилем учредителя управления в течение срока, установленного в договоре доверительного управления между Управляющим и учредителем управления.

1.15 Для целей обмена конфиденциальной информацией между Управляющим и учредителем управления может использоваться только адрес электронной почты, указанный учредителем управления в Анкете клиента (приложение № 1 к договору доверительного управления), в отношении которого учредитель управления не уведомил Управляющего о компрометации адреса электронной почты. При изменении адреса электронной почты учредителя управления, с момента поступления уведомления от учредителя управления о соответствующем

изменении, Управляющий для обмена конфиденциальной информацией может использовать только тот адрес электронной почты, который сообщил учредитель управления в уведомлении.

1.16 Все обращения (жалобы, претензии), поступившие от учредителей управления должны незамедлительно передаваться для рассмотрения контролеру Управляющего. Контролер обязан обеспечить рассмотрение обращений (жалоб, претензий) и подготовку ответа на них в порядке, установленном действующим законодательством РФ, документами НАУФОР, Инструкцией (положением) о внутреннем контроле в Акционерном обществе «Финансовый брокер «Август».

2. ИНФОРМИРОВАНИЕ УЧРЕДИТЕЛЯ УПРАВЛЕНИЯ О РИСКАХ

2.1 Информирование учредителя управления о рисках осуществляется путем размещения действующей редакции Декларации о рисках в открытом доступе на сайте Управляющего в сети Интернет. На основании письменного запроса учредителя управления, Управляющий обязан предоставить Декларацию о рисках на бумажном носителе.

2.2 Требование п. 2.1 настоящего Положения не распространяется на следующие категории учредителей управления:

- (а) квалифицированный инвестор в силу закона;
- (б) квалифицированный инвестор в отношении соответствующих финансовых инструментов (услуг);
- (в) иностранная финансовая организация;
- (г) эмитент ценных бумаг, в отношении которых Управляющий оказывает ему услугу доверительного управления.

2.3 Факт ознакомления учредителя управления с Декларацией о рисках подтверждается наличием в договоре доверительного управления указания на тот факт, что учредитель управления лично ознакомлен с Декларацией о рисках, опубликованной на официальной странице АО «ФБ «Август» в сети Интернет: <https://fbaugust.ru>.

2.4 При внесении изменений в текст Декларации о рисках Управляющий уведомляет об этом учредителей управления, которые ранее были ознакомлены с этой декларацией, путем раскрытия соответствующей информации на своем официальном сайте в информационно-телекоммуникационной сети Интернет: <https://fbaugust.ru>.

2.5 На основании письменного запроса учредителя управления, Управляющий обязан предоставить Декларацию о рисках в новой редакции на бумажном носителе. Плата за предоставление запрошенных учредителем управления документов не взимается.

Глава 3. УСЛОВИЯ И ПОРЯДОК ОПРЕДЕЛЕНИЯ РИСКА (ФАКТИЧЕСКОГО РИСКА)

УЧРЕДИТЕЛЯ УПРАВЛЕНИЯ

3.1 Управляющий определяет риск (фактический риск) учредителя управления, не являющегося квалифицированным инвестором, при осуществлении доверительного управления активами учредителя управления по каждому отдельному договору доверительного управления (стратегии).

3.2 Управляющий не реже одного раза в квартал определяет риск (фактический риск) учредителя управления.

3.3 Управляющий определяет риск (фактический риск) учредителя управления в соответствии со следующей методикой определения риска (фактического риска) учредителя управления:

3.3.1 Управляющий осуществляет расчет относительного изменения стоимости активов учредителя управления, переданных в доверительное управление Управляющему по следующей формуле:

$$\Delta_{n+1} = (1 - ((\sum_{i=1}^n M_i/n) / (\sum_{i=1}^n S_i/n))) * 100, \text{ где}$$

Δ_{n+1} – относительного изменения стоимости активов учредителя управления, переданных в доверительное управление Управляющему за n месяцев с даты первого поступления активов в доверительное управление;

M_i - стоимость активов учредителя управления, находящихся в доверительном управлении Управляющего, на конец i – го месяца, рассчитанная в соответствии с Методикой оценки стоимости объектов доверительного управления или методикой определения стоимости объектов доверительного управления, предусмотренной договором доверительного управления с учредителем управления.

S_i – стоимость активов учредителя управления, переданных в доверительное управление Управляющему, на конец i – го месяца;

n - количество месяцев, прошедших с даты первого поступления активов в доверительное управление.

3.3.2 Риск (фактический риск) учредителя управления за n месяцев, прошедших с даты первого поступления активов в доверительное управление, равен отрицательному значению показателя Δ_{n+1} .

4. ПОРЯДОК И СРОКИ ПРЕДОСТАВЛЕНИЯ ОТЧЕТНОСТИ УЧРЕДИТЕЛЮ УПРАВЛЕНИЯ, А ТАКЖЕ КОПИЙ ОТЧЕТНОСТИ ЛИЦАМ, С КОТОРЫМИ ПРЕКРАЩЕНЫ ДОГОВОРНЫЕ ОТНОШЕНИЯ

4.1 Управляющий информирует учредителя управления об оказанных услугах, выполненных операциях и состоянии имущества путем подготовки и направления Отчета о выполненных операциях и состоянии имущества (далее – Отчет).

4.2 Порядок и сроки информирования учредителя управления направлены на обеспечение своевременного получения и ознакомление учредителя управления с предоставляемой информацией. Одобрение отчетности Управляющего, предоставляемой учредителю управления, не связано с возможностью реализации учредителем управления принадлежащих ему прав и не может быть осуществлено против его воли.

4.3 Отчет должен содержать достаточную информацию о виде и стоимости оказанных услуг, совершенных сделках и операциях, открытых позициях и обязательствах при доверительном управлении имуществом учредителя управления. Не допускается включение в Отчет недостоверной и/или вводящей в заблуждение информации.

4.4 Порядок и сроки предоставления Отчета учредителю управления определяются в договоре доверительного управления. Отчет направляется учредителю управления в электронной форме на адрес электронной почты, указанный учредителем управления в Анкете клиента (приложение №1 к договору доверительного управления).

4.5 В случае не предоставления Управляющему мотивированного отказа в утверждении Отчета в течение 5-ти рабочих дней с даты отправки Отчета учредителю управления Отчет считается одобренным учредителем управления.

4.6 В течении 5-ти рабочих дней с даты получения Управляющим мотивированного отказа учредителя управления Управляющий направляет учредителю управления ответ, содержащий результаты рассмотрения возражений учредителя управления по Отчету и разъяснения по дальнейшему порядку разрешения спора. Ответ направляется в письменной форме, а также дополнительно в той форме, в которой возражения в отношении Отчета поступили от учредителя управления.

4.7 Отчеты, мотивированные отказы учредителя управления от подписания Отчета и ответы Управляющего на них хранятся в течение пяти лет.

4.8 По требованию учредителя управления или лиц, с которыми договорные отношения прекращены, Управляющий предоставляет копии Отчета на бумажном носителе в течение 10 рабочих дней с даты получения Управляющим соответствующего требования.

5. ПОРЯДОК ОБЕСПЕЧЕНИЯ УПРАВЛЕНИЯ РИСКАМИ НЕСООТВЕТСТВИЯ УПРАВЛЕНИЯ ЦЕННЫМИ БУМАГАМИ И ДЕНЕЖНЫМИ СРЕДСТВАМИ УЧРЕДИТЕЛЕЙ УПРАВЛЕНИЯ ИХ ИНВЕСТИЦИОННОМУ ПРОФИЛЮ

5.1 При оказании услуг по доверительному управлению ценными бумагами Управляющий принимает все зависящие от него разумные меры для обеспечения соответствия доверительного управления инвестиционному профилю учредителя управления, составленному согласно Порядку определения инвестиционного профиля клиента АО «ФБ «Август» и перечня сведений, необходимых для его определения.

5.2 Состав и структура каждого портфеля учредителя управления, характер операций с активами при осуществлении доверительного управления, должны быть адекватны инвестиционному профилю учредителя управления. При выборе активов Управляющий руководствуется ожидаемым сроком получения денежных средств, уровнем ожидаемой доходности, уровнем риска и степенью ликвидности актива.

5.3 В случаях, предусмотренных договором доверительного управления, состав и структура инвестиционного портфеля подлежат согласованию с учредителем управления.

5.4 При изменении инвестиционного профиля учредителя управления Управляющий обязан привести портфель учредителя управления в соответствие с новым инвестиционным профилем учредителя управления в течение срока, установленного в договоре доверительного управления между Управляющим и учредителем управления.

5.5 Ежеквартально риск-менеджер Управляющего осуществляет мониторинг соответствия результатов доверительного управления инвестиционному профилю учредителя управления.

5.6 По результатам мониторинга, указанного в п. 5.5 настоящего Положения, риск-менеджер не позднее 20 рабочих дней с даты окончания квартала направляет генеральному директору Перечень портфелей учредителей управления, результаты доверительного управления, а также состав и структура которых перестали соответствовать инвестиционному профилю учредителей управления.

5.7 Генеральный директор в течение 10 рабочих дней с даты получения результатов мониторинга принимает решение о необходимости внесения изменений в состав и структуру портфелей учредителя управления, а также в характер операций с активами при осуществлении доверительного управления портфелей, включенных в Перечень, указанный в п. 5.6 настоящего Положения.

6. ЗАКЛЮЧИТЕЛЬНЫЕ ПОЛОЖЕНИЯ

6.1 Настоящее Положение доводится до сведения сотрудников Управляющего. Требования Положения подлежат обязательному исполнению.

6.2 Настоящее Положение вступает в силу по истечении 10 календарных дней со дня раскрытия на официальном сайте Управляющего в сети Интернет.