

УТВЕРЖДЕНО
правлением АО «Датабанк»
протокол № 06 от « 06 » апреля 2017 г.

Изменение № 2 в РД «ПОЛОЖЕНИЕ ОБ ИНДИВИДУАЛЬНОМ ДОВЕРИТЕЛЬНОМ УПРАВЛЕНИИ В АО «ДАТАБАНК», утвержденное правлением Банка (протокол № 05 от 16.03.2016 г.)

1. Пункт 4.1. положения изложить в следующей редакции:

4.1. С целью уведомления Учредителя управления о том, что проведение операций на рынке ценных бумаг сопряжено с определенными системными и рыночными рисками, которые могут повлечь за собой серьезные финансовые потери, а также о способах управления ценными бумагами, Доверительный управляющий при осуществлении деятельности по управлению ценными бумагами уведомляет:

- (а) об общих рисках операций на рынке ценных бумаг;
- (б) о рисках маржинальных и непокрытых сделок;
- (в) о рисках операций с производными финансовыми инструментами;
- (г) о рисках сделок с иностранными финансовыми инструментами;
- (д) о способах управления ценными бумагами и рисках связанных с ними.

2. Пункт 4.2. положения изложить в следующей редакции:

4.2. Информирование Учредителя управления о рисках и способах управления ценными бумагами осуществляется путем предоставления ему декларации о рисках. При этом декларация о рисках состоит из информации указанной в подпунктах «а» – «д» пункта 4.1. настоящего Положения.

3. Пункт 4.5. положения изложить в следующей редакции:

4.5. Декларация о рисках операций на рынке ценных бумаг должна соответствовать Приложению № 10 к Договору доверительного управления.

Декларация применяется исключительно в рамках профессиональной деятельности по доверительному управлению на рынке ценных бумаг.

Декларация о рисках операций на рынке ценных бумаг может быть дополнена, если это не меняет смысла текста, приведенного в Приложении № 10 к Договору доверительного управления, и не вводит клиентов в заблуждение.

3. В Приложение № 10 к договору доверительного управления, добавить раздел 5 следующего содержания:

5. Способы управления ценными бумагами и риски связанные с ними

Цель настоящего раздела – предоставить Учредителю управления информацию о способах управления ценными бумагами, которые использует доверительный управляющий, и о рисках, связанных с ними.

1. Активный - способ управления, используя который доверительный управляющий вправе распоряжаться имуществом клиента по собственному усмотрению на основании собственной оценки риска и доходности соответствующих активов. При активном управлении доверительный управляющий самостоятельно выбирает активы, в которые инвестируются средства клиента, их долю в портфеле и срок инвестирования – данный способ предполагает самые широкие полномочия управляющего.

Договор, предусматривающий активный способ управления, предполагает широкие

полномочия доверительного управляющего. Вы должны отдавать себе отчет в том, что, чем большие полномочия по распоряжению вашим имуществом имеет управляющий, тем большие риски, связанные с его выбором финансовых инструментов и операций, вы несете. В этом случае вы не сможете требовать какого-либо возмещения убытков со стороны вашего доверительного управляющего, если только они не были вызваны его недобросовестностью или действиями, очевидно не соответствующими вашим интересам. Оцените, соответствует ли предлагаемый способ управления Вашим интересам, и свою готовность нести соответствующие риски.

2. Пассивный - способ управления, используя который, доверительный управляющий формирует и поддерживает портфель клиента со строго заданными составом и структурой активов (полная репликация), либо со строго заданным индексом доходности (синтетическая репликация). Доверительный управляющий не вправе по собственному усмотрению принимать инвестиционное решение, изменяющее состав и структуру активов портфеля – данный способ ограничивает полномочия управляющего.

Договор, предусматривающий пассивный способ управления, ограничивает полномочия доверительного управляющего. В связи с этим доверительный управляющий не должен принимать меры по уменьшению ваших убытков в случае неблагоприятного изменения стоимости вашего портфеля. В связи с этим вы не сможете требовать какого-либо возмещения убытков со стороны Вашего доверительного управляющего за такое бездействие. Оцените, соответствует ли предлагаемый способ управления вашим интересам, и свою готовность нести соответствующие риски.

3. Смешанный - способ управления, сочетающий в себе черты активного и пассивного, например, способ управления, позволяющий управляющему по собственному усмотрению на основании собственной оценки риска и доходности соответствующих активов допускать существенное отклонение структуры активов от заданного показателя (индекса доходности, корзины финансовых инструментов и др.) - данный способ предполагает широкие полномочия управляющего в отношении определенной части портфеля и ограничивает их в отношении другой части.

Договор, предусматривающий смешанный способ управления, предполагает широкие полномочия доверительного управляющего в отношении определенной части портфеля и ограничивает их в отношении другой части. Вы должны отдавать себе отчет в том, что, чем большие полномочия по распоряжению вашим имуществом имеет доверительный управляющий, тем большие риски, связанные с его выбором финансовых инструментов и операций, вы несете. В этом случае вы не сможете требовать какого-либо возмещения убытков со стороны вашего доверительного управляющего, если только они не были вызваны его недобросовестностью или действиями, очевидно не соответствующими вашим интересам. В той части, в которой договор ограничивает полномочия управляющего, он не должен принимать меры по уменьшению ваших убытков в случае неблагоприятного изменения стоимости вашего портфеля. В связи с этим вы не сможете требовать какого-либо возмещения убытков со стороны вашего доверительного управляющего за такое бездействие. Оцените, соответствует ли предлагаемый способ управления вашим интересам, и свою готовность нести соответствующие риски

4. Настоящие изменения вступают в силу по истечении 10 дней после раскрытия их на официальном сайте Банка в сети Интернет.