

Положение об ограничении ответственности по ценовым показателям ИЦБ ДОМ.РФ

Ценовые показатели ИЦБ рассчитываются Биржей на основании статистических данных, предоставленных АО «ДОМ.РФ». Биржа не несет ответственности и не осуществляет проверки правильности статистических данных, предоставленных АО «ДОМ.РФ».

АО «ДОМ.РФ» формирует статистические данные, среди прочего, на основании доступных ему в соответствии с законодательством Российской Федерации данных из информационных отчетов сервисных агентов, осуществляющих обслуживание ипотечного покрытия ИЦБ. АО «ДОМ.РФ» не осуществляет проверки правильности и полноты данных в указанных информационных отчетах и, соответственно, не гарантирует правильность и полноту этих данных.

Пользователям информации о ценовых показателях ИЦБ необходимо ознакомиться с условиями расчета ценовых показателей ИЦБ, изложенными ниже, и принимать их во внимание при использовании их в своих целях. Перед принятием любых решений, основой которых являются ценовые показатели ИЦБ, следует рассмотреть их уместность и детально изучить Ценовую конвенцию и другие применимые документы. В частности, необходимо самостоятельно оценить свои возможности и готовность к использованию данных ценовых показателей и проконсультироваться с независимым финансовым специалистом. Несмотря на осмотрительность Биржи и АО «ДОМ.РФ» при подготовке данных, фактические данные, в том числе цены, доходность, дюрация, спреда, могут отклоняться в положительную или отрицательную сторону.

Раскрываемые ценовые показатели ИЦБ (доходность, дюрация, Z-спред)¹ рассчитаны в соответствии с Ценовой конвенцией, опубликованной на настоящем сайте, на основании статистических данных в качестве наблюдаемых параметров поведения участников рынка ипотечных ценных бумаг и ипотечного кредитования. Статистические данные не отражают возможных будущих изменений соответствующих параметров и не содержат прогнозов или обещаний изменения такой информации в будущем.

Ценовые показатели ИЦБ:

- не являются и не должны рассматриваться как часть эмиссионной документации ИЦБ, предложение или же приглашение для продажи или участия в подписке или же как побуждение к приобретению или же к подписке на ИЦБ;
- не являются основанием и на них нельзя полагаться в связи с каким-либо предложением, договором, обязательством или же инвестиционным или иным коммерческим решением, связанным с ним, равно как они не являются рекомендацией, прогнозом или обещанием относительно тех или иных ИЦБ;
- не являются порядком или рекомендацией определения ценовых характеристик для целей учета и контроля, расчета и соблюдения нормативов или иных обязательных требований и ограничений, обоснования инвестиционных решений в регуляторных и иных целях.

АО «ДОМ.РФ» действует от своего собственного имени, не является консультантом, юридическим, финансовым или иным советником, инвестиционным консультантом, доверенным лицом и не оказывают услуг фидуциарного характера.

Информация о ценовых показателях ИЦБ представляется по состоянию на дату раскрытия и может быть изменена без какого-либо уведомления, за исключением следующего. В случае задержки или отсутствия обновления статистических данных,

¹ Состав определяет Биржа.

расчет ценовых показателей ИЦБ производится на основе последних доступных статистических данных. Если статистические данные содержали ошибочные сведения, перерасчет соответствующих ценовых показателей может не производиться.

В части, не урегулированной данным Положением об ограничении ответственности, в отношении ценовых показателей ИЦБ действует положение об ограничении ответственности, предусмотренное Ценовой конвенцией.

Термины и определения

1. **ИЦБ** – облигации с ипотечным покрытием.
2. **Статистические данные** – параметры *CPR, CDR, WAC, WAM* и дополнительные параметры V_1, V_i и *CleanUP*, определенные в приложении 1 к Договору.
3. **Ценовая конвенция** – ценовая конвенция для ипотечных ценных бумаг, подготовленная и выпущенная совместно Биржей и ДОМ.РФ, опубликованная на официальном сайте Биржи, определяющая фиксированные ценовые характеристики ИЦБ по портфелям ипотек с последующей их трансформацией в денежные потоки по ИЦБ.
4. **Ценовые показатели** – определяемые в соответствии с Ценовой конвенцией ценовые характеристики ИЦБ: доходность, дюрация, Z-спред.