

**Изменения и дополнения № 18
в правила доверительного управления
Открытым индексным паевым инвестиционным фондом
«Альфа-Капитал Индекс ММВБ»
(Правила зарегистрированы ФСФР России 12 декабря 2006 г. за № 0695-94121916)**

1. Наименование на титульном листе Правил доверительного управления фонда изложить в следующей редакции:

«Правила доверительного управления Открытым паевым инвестиционным фондом рыночных финансовых инструментов «Альфа-Капитал Индекс ММВБ».

2. Изложить п. 1 Правил доверительного управления фонда в следующей редакции:

«1. Полное название паевого инвестиционного фонда (далее - фонд): Открытый паевой инвестиционный фонд рыночных финансовых инструментов «Альфа-Капитал Индекс ММВБ».

3. Изложить п. 2 Правил доверительного управления фонда в следующей редакции:

«2. Краткое название фонда ОПИФ рыночных финансовых инструментов «Альфа-Капитал Индекс ММВБ».

4. Изложить п. 22 Правил доверительного управления фонда в следующей редакции:

«22. Объекты инвестирования, их состав и описание.

22.1. Имущество, составляющее фонд может быть инвестировано в:

1) денежные средства в рублях и в иностранной валюте на счетах и во вкладах (депозитах) в российских кредитных организациях и иностранных юридических лицах, признанных банками по законодательству иностранных государств, являющихся членами Евразийского экономического союза (ЕАЭС), Организации экономического сотрудничества и развития (ОЭСР), Европейского союза, Китая, Индии, Бразилии, Южно-Африканской Республики (далее – иностранные государства), на территории которых они зарегистрированы (далее – иностранные банки) (далее инструменты денежного рынка);

2) обыкновенные и привилегированные акции и депозитарные расписки на акции, по которым рассчитывается Индекс ММВБ, являющийся композитным индексом российского фондового рынка, рассчитываемым на основе цен сделок, совершаемых с наиболее ликвидными ценными бумагами эмитентов, виды экономической деятельности которых относятся к основным секторам экономики (далее - индекс). Индекс рассчитывается на основе информации о сделках, совершаемых с ценными бумагами российских и иностранных эмитентов, допущенными Публичным акционерным обществом «Московская Биржа ММВБ-РТС» (ПАО Московская Биржа) (далее – Биржа) к обращению;

3) права требования из договоров, заключенных для целей доверительного управления в отношении указанных активов;

4) иные активы, включаемые в состав активов фонда в связи с оплатой расходов, связанных с доверительным управлением имуществом, составляющим фонд.

22.2. Имущество, составляющее фонд, может быть инвестировано в ценные бумаги, обязанные лица по которым зарегистрированы в Российской Федерации, в государствах, являющихся членами Организации Объединенных Наций (ООН), и (или) Содружества независимых государств (СНГ), и (или) Европейского Союза (ЕС), и (или) Всемирной торговой организации (ВТО), и (или) Совета по сотрудничеству стран Персидского залива, и (или) Африканского союза, и (или) Группы разработки финансовых мер по борьбе с отмыванием денег (ФАТФ), а также в государствах Тайвань, Соединенное Королевство Великобритании и Северной Ирландии (включая его заморские территории и коронные владения, в том числе, но не ограничиваясь: Бермуды, Британские Виргинские острова, Каймановы острова, Гибралтар, Теркс и Кайкос, Остров Мэн, Гернси, Джерси), Китайская Народная Республика (включая специальный административный район Гонконг).

22.3. Денежные средства во вкладах (депозитах) в российских кредитных организациях и иностранных банках могут входить в состав фонда только при условии, что в случае досрочного расторжения указанного договора российская кредитная организация или иностранный банк обязана

(обязан) вернуть сумму вклада (депозита, остатка на счете) и проценты по нему в срок, не превышающий семь рабочих дней».

5. Изложить п. 23 Правил доверительного управления фонда в следующей редакции:

«23. Структура активов фонда должна соответствовать следующим требованиям:

23.1. Количество ценных бумаг, входящих в состав активов фонда, должно быть пропорционально количеству ценных бумаг, по которым рассчитывается индекс и разница между выраженной в процентах долей ценных бумаг одного эмитента в суммарной стоимости ценных бумаг, по которым рассчитывается индекс, и долей оценочной стоимости этих ценных бумаг в стоимости активов фонда не может превышать 3 (Три) процента, при этом оценочная стоимость ценных бумаг одного юридического лица, денежные средства в рублях и в иностранной валюте на счетах и во вкладах (депозитах) в таком юридическом лице (если соответствующее юридическое лицо является кредитной организацией или иностранным банком иностранного государства), права требования к этому юридическому лицу, возникающие в результате приобретения (отчуждения) ценных бумаг, а также возникающие на основании договора на брокерское обслуживание с таким юридическим лицом, в совокупности не должны превышать 15 процентов стоимости активов фонда. Требования настоящего абзаца не распространяются на права требования к центральному контрагенту.

23.2. Доля стоимости инструментов денежного рынка со сроком до погашения (закрытия) менее трех месяцев, ценных бумаг, входящих в расчет Индекса, от стоимости чистых активов фонда в совокупности должна превышать большую из следующих величин:

- пять процентов;
- величину чистого месячного оттока инвестиционных паев, являющуюся минимальной из шести наибольших величин чистых месячных оттоков инвестиционных паев за последние 36 календарных месяцев. Величина чистого месячного оттока инвестиционных паев определяется как отношение в процентах разности количества инвестиционных паев, в отношении которых по лицевым счетам в реестре владельцев инвестиционных паев были внесены расходные записи в результате их погашения или обмена, и количества инвестиционных паев, в отношении которых по лицевым счетам в реестре владельцев инвестиционных паев были внесены приходные записи в результате их выдачи или обмена за календарный месяц к общему количеству выданных инвестиционных паев по данным реестра владельцев инвестиционных паев на последний день предыдущего календарного месяца.

Для целей настоящего подпункта учитываются денежные средства, распоряжение которыми не ограничено на основании решения органа государственной власти, на которые не установлено обременение, ценные бумаги, права по продаже или иной передаче по договору которых не ограничены.

Для целей настоящего подпункта используется рейтинг долгосрочной кредитоспособности в той же валюте (национальной и (или) иностранной), в какой предполагается осуществление выплат по указанным ценным бумагам согласно решению о выпуске таких ценных бумаг.

23.3. Оценочная стоимость ценных бумаг одного юридического лица, денежные средства в рублях и в иностранной валюте на счетах и во вкладах (депозитах) в таком юридическом лице (если соответствующее юридическое лицо является кредитной организацией или иностранным банком иностранного государства), права требования к этому юридическому лицу, возникающие в результате приобретения (отчуждения) ценных бумаг, а также возникающие на основании договора на брокерское обслуживание с таким юридическим лицом, в совокупности не должны превышать 15 процентов стоимости активов фонда. Требования настоящего абзаца не распространяются на права требования к центральному контрагенту.

Для целей настоящего подпункта российские и иностранные депозитарные расписки рассматриваются как ценные бумаги, права собственности на которые удостоверяют соответствующие депозитарные расписки.

Для целей расчета ограничения, указанного в абзаце первом настоящего подпункта, в сумме денежных средств в рублях и в иностранной валюте на счетах в одном юридическом лице, составляющей фонд, не учитывается сумма (или ее часть) денежных средств, подлежащих выплате в связи с погашением и обменом инвестиционных паев фонда на момент расчета ограничения. При этом общая сумма денежных средств, которая не учитывается при расчете указанного ограничения, в отношении всех денежных средств в рублях и в иностранной валюте на всех счетах, составляющих фонд, не может превышать общую сумму денежных средств, подлежащих выплате в связи с погашением и обменом инвестиционных паев фонда на момент расчета ограничения.

Размер принятых обязательств по поставке активов по сделкам, дата исполнения которых не ранее 3 рабочих дней с даты заключения сделки и заемные средства, предусмотренные подпунктом 5 пункта 1 статьи 40 Федерального закона от 29 ноября 2001 года N 156-ФЗ, в совокупности не должны превышать 40 процентов стоимости чистых активов фонда.

На дату заключения договоров займа, кредитных договоров или сделок, дата исполнения которых не ранее 3 рабочих дней с даты заключения сделки, совокупная стоимость активов, указанных в абзаце четыре настоящего подпункта, с учетом заключенных ранее сделок, указанных в настоящем абзаце, и заемных средств, предусмотренных подпунктом 5 пункта 1 статьи 40 Федерального закона от 29 ноября 2001 г. N 156-ФЗ, не должна превышать 20 процентов стоимости чистых активов фонда.

23.4. При определении структуры активов фонда учитываются активы, принятые к расчету стоимости его чистых активов.

Требования настоящего пункта применяются до даты возникновения основания прекращения фонда».

6. Изложить п. 82. Правил доверительного управления фонда в следующей редакции:

«82. Инвестиционные паи могут обмениваться на инвестиционные паи:

Открытого паевого инвестиционного фонда рыночных финансовых инструментов «Альфа-Капитал Облигации Плюс»,

Открытого паевого инвестиционного фонда рыночных финансовых инструментов «Альфа-Капитал Баланс»,

Открытого паевого инвестиционного фонда рыночных финансовых инструментов «Альфа-Капитал Ресурсы»,

Открытого паевого инвестиционного фонда рыночных финансовых инструментов «Альфа-Капитал Торговля»,

Открытого паевого инвестиционного фонда рыночных финансовых инструментов «Альфа-Капитал Золото»,

Открытого паевого инвестиционного фонда рыночных финансовых инструментов «Альфа-Капитал Технологии»,

Открытого паевого инвестиционного фонда рыночных финансовых инструментов «Альфа-Капитал Бренды»,

Открытого паевого инвестиционного фонда рыночных финансовых инструментов «Альфа-Капитал Инфраструктура»,

Открытого паевого инвестиционного фонда рыночных финансовых инструментов «Альфа-Капитал Резерв»,

Открытого паевого инвестиционного фонда рыночных финансовых инструментов «Альфа-Капитал Еврооблигации»,

Открытого паевого инвестиционного фонда рыночных финансовых инструментов «Альфа-Капитал Ликвидные акции» под управлением Общества с ограниченной ответственностью «Управляющая компания «Альфа-Капитал»».

**Генеральный директор
ООО УК «Альфа-Капитал»**

И.В. Кривошеева