|  |  |
| --- | --- |
| **«СОГЛАСОВАНО»**АО «Специализированный депозитарий «ИНФИНИТУМ»**Генеральный директор** **\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ Прасс П.И.** **«28» апреля 2022 г.** | **«УТВЕРЖДЕНЫ»**Приказом Генерального директораООО УК «Альфа-Капитал» № 98/22 от «28» апреля 2022 г.**Генеральный директор****\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_Кривошеева И.В.****«28» апреля 2022 г.** |

**ИЗМЕНЕНИЯ В ПРАВИЛА**

**определения стоимости чистых активов**

**Комбинированного закрытого паевого инвестиционного фонда «Альфа-Капитал пре-АйПиО»**

Настоящие Изменения в Правила определения стоимости чистых активов подлежат применению с «12» мая 2022 года.

|  |  |
| --- | --- |
| **Старая редакция**  | **Новая редакция** |
| **Приложение 8. Условия оценки справедливой стоимости в период сложившейся кризисной ситуации на финансовом рынке**2. Дефолт или просрочка по валютным обязательствам. 2.1. Для контрагента не считает событием дефолта или обесценения неисполнение обязательств в валюте, отличной от российского рубля, если имеются основания полагать, что дефолт произошел из-за событий, не связанных с деятельностью контрагента, например, введение санкций, запрета/невозможности расчётов со стороны иностранных контрагентов или российских государственных органов (определяется на основании мотивированного суждения Управляющей компании). 2.2. Неисполнение обязательств, в том числе по выплате купонов и дивидендов в иностранной валюте не считается событием по обесценению или дефолтом контрагента в отношении таких обязательств (дебиторской задолженности) до 30 апреля 2022 года включительно, в случае если такое неисполнение возникло в результате действий (бездействия) иностранных депозитарно-клиринговых компаний (в т.ч. Euroclear и Clearstream). 2.3. Для обязательств в иностранной валюте может не считаться событием дефолта исполнение этих обязательств в иной валюте. | **Приложение 8. Условия оценки справедливой стоимости в период сложившейся кризисной ситуации на финансовом рынке**2. Дефолт или просрочка по валютным обязательствам. 2.1. Для контрагента не считает событием дефолта или обесценения неисполнение обязательств в валюте, отличной от российского рубля, если имеются основания полагать, что дефолт произошел из-за событий, не связанных с деятельностью контрагента, например, введение санкций, запрета/невозможности расчётов со стороны иностранных контрагентов или российских государственных органов (определяется на основании мотивированного суждения Управляющей компании). 2.2. Неисполнение обязательств, в том числе по выплате купонов и дивидендов в иностранной валюте не считается событием по обесценению или дефолтом контрагента в отношении таких обязательств (дебиторской задолженности) **до 31 мая 2022 года включительно (или иной более поздней даты, установленной рекомендациями НАУФОР)**, в случае если такое неисполнение возникло в результате действий (бездействия) иностранных депозитарно-клиринговых компаний (в т.ч. Euroclear и Clearstream). 2.3. Для обязательств в иностранной валюте может не считаться событием дефолта исполнение этих обязательств в иной валюте. |