

Центральный Банк
Российской Федерации (Банк России)
ЗАРЕГИСТРИРОВАНО

Дата 02.07.2020

№ 3417-6

**Изменения и дополнения №6
в Правила доверительного управления
«Система Капитал – Высокие технологии»**
открытым паевым инвестиционным фондом рыночных финансовых инструментов

УТВЕРЖДЕНЫ
Приказом Генерального директора
ООО УК «Система Капитал»
№ 521 от «04» июня 2020 г.

Правила доверительного управления Фондом зарегистрированы Банком России «09» ноября 2017г. № 3417

Текст в старой редакции	Текст в новой редакции
<p>22.2. Активы, допущенные к организованному торгам (или в которых биржей принято решение о включении в список) на биржах Российской Федерации и биржах, расположенных в иностранных государствах, отвечающих условиям, предусмотренным Указанием Банка России от 05.09.2016 N 4129-У «О составе и структуре паевых инвестиционных фондов», за исключением иностранных паев фондов для квалифицированных инвесторов:</p> <ol style="list-style-type: none">1) государственные ценные бумаги субъектов РФ и муниципальные ценные бумаги;2) акции российских эмитентов;3) акции иностранных эмитентов;4) акции иностранных инвестиционных фондов;5) паи (акции) иностранных инвестиционных фондов, если: – присвоенный указанным паем (акциям) код CFI имеет значения: первая буква имеет значение «E», при условии, что вторая буква имеет значение «U», третья буква имеет значение «O» или «C», пятая буква имеет значение «C» или «D», или «M», или «R» или «S», за исключением случаев, когда шестая буква имеет значения «Z» или «A», или – присвоенный указанным паем (акциям) код CFI имеет значения: первая буква – значение «C», вторая буква имеет значение «E», третья буква – значение «O» либо «C», пятая буква – значение «B», или «E», или «V», или «L», или «C», или «D», или «F», при условии, что шестая буква имеет значения «X», или – присвоенный указанным паем код CFI имеет значения: первая буква имеет значение "C", вторая буква имеет значения «I»	<p>22.2. Активы, допущенные к организованному торгам (или в отношении которых биржей принято решение о включении в котировальные списки) на биржах Российской Федерации и биржах, расположенных в иностранных государствах, отвечающих условиям, предусмотренным Указанием Банка России от 05.09.2016 N 4129-У «О составе и структуре активов акционерных фондов и активов паевых инвестиционных фондов», и включенных в перечень иностранных бирж, предусмотренный пунктом 4 статьи 51.1 Федерального закона от 22 апреля 1996 года N 39-ФЗ "О рынке ценных бумаг" (далее - перечень иностранных бирж), за исключением инвестиционных паев фондов для квалифицированных инвесторов:</p> <ol style="list-style-type: none">1) государственные ценные бумаги субъектов РФ и муниципальные ценные бумаги;2) акций российских эмитентов;3) акции иностранных эмитентов;4) акции акционерных инвестиционных фондов;5) паи (акции) иностранных инвестиционных фондов, если: – присвоенный указанным паем (акциям) код CFI имеет следующие значения: первая буква имеет значение «E», при условии, что вторая буква имеет значение «U», третья буква имеет значение «O» или «C», пятая буква имеет значение «C» или «D», или «M», или «R» или «S», за исключением случаев, когда шестая буква имеет значения «Z» или «A», или – присвоенный указанным паем (акциям) код CFI имеет следующие значения: первая буква – значение «C», вторая буква имеет значение «E», третья буква – значение «O» либо «C», пятая буква – значение «B», или «E», или «V», или «L», или «C», или «D», или «F», при условии, что шестая буква имеет значения «X», или – присвоенный указанным паем (акциям) код CFI имеет значения: первая буква – значение «C», вторая буква имеет значение «E», третья буква – значение «O» либо «C», пятая буква – значение «B», или «E», или «V», или «L», или «C», или «D», или «F», при условии, что шестая буква имеет значения «X»,

<p>или «Е» или «В», или «Р», или «Н», или «М», третья буква имеет значение «О» или «С», или «М», или «Х», пятая буква имеет значение «В» или «С», или «D», или «Е», или «L», или «M», или «X», или «V», или «F» при условии, что шестая буква имеет значение «U» или «Y»,</p> <p>или</p> <p>– присвоенный указанным акциям код CFI имеет следующие значения: первая буква имеет значение "С", вторая буква имеет значение «Е» или «В», или «Р», или «Н», или «М», третья буква имеет значение «О» или «С», или «M», или «X», пятая буква имеет значение «В» или «С», или «D», или «Е», или «L», или «M», или «X», или «V», или «F» при условии, что шестая буква имеет значение «S» или «Q»;</p> <p>6) облигации российских эмитентов;</p> <p>7) облигации иностранных эмитентов;</p> <p>8) инвестиционные паи открытых паевых инвестиционных фондов, относящихся к категории фондов рыночных финансовых инструментов;</p> <p>9) производные финансовые инструменты при условии, что их стоимости зависит от изменения стоимости активов, которые могут входить в состав Фонда (в том числе изменения индекса, рассчитываемого исходя из стоимости активов, которые могут входить в состав Фонда), от величины процентных ставок, уровня инфляции, курсов валют;</p> <p>10) российские и иностранные депозитарные расписки на ценные бумаги, указанные в настоящем пункте;</p> <p>и активы, являющиеся клиринговыми сертификатами участия.</p>	<p>или</p> <p>– присвоенный указанным паям код CFI имеет следующие значения: первая буква имеет значение "С", вторая буква имеет значение «I» или «E» или «B», или «P», или «H», или «M», третья буква имеет значение «O» или «C», или «M», или «X», пятая буква имеет значение «B» или «C», или «M», или «X», пятая буква имеет значение «V» или «C», или «D», или «E», или «L», или «M», или «X», или «V», или «F» при условии, что шестая буква имеет значение «S» или «Q»;</p> <p>6) облигации российских эмитентов;</p> <p>7) облигации иностранных эмитентов;</p> <p>8) инвестиционные паи открытых паевых инвестиционных фондов, относящихся к категории фондов рыночных финансовых инструментов;</p> <p>9) производные финансовые инструменты при условии, что изменение их стоимости зависит от изменения стоимости активов, которые могут входить в состав Фонда (в том числе изменения индекса, рассчитываемого исходя из стоимости активов, которые могут входить в состав Фонда), от величины процентных ставок, уровня инфляции, курсов валют;</p> <p>10) российские и иностранные депозитарные расписки на ценные бумаги, указанные в настоящем пункте;</p> <p>и активы, являющиеся клиринговыми сертификатами участия.</p>
<p>или «V», или «F» при условии, что шестая буква имеет значение «U» или «Y»,</p> <p>или</p> <p>– присвоенный указанным акциям код CFI имеет следующие значения: первая буква имеет значение "С", вторая буква имеет значение «I» или «E» или «B», или «P», или «H», или «M», третья буква имеет значение «O» или «C», или «M», или «X», пятая буква имеет значение «B» или «C», или «D», или «E», или «L», или «M», или «X», или «V», или «F» при условии, что шестая буква имеет значение «S» или «Q»;</p> <p>6) облигации российских эмитентов;</p> <p>7) облигации иностранных эмитентов;</p> <p>8) инвестиционные паи открытых паевых инвестиционных фондов, относящихся к категории фондов рыночных финансовых инструментов;</p> <p>9) производные финансовые инструменты при условии, что изменение их стоимости зависит от изменения стоимости активов, которые могут входить в состав Фонда (в том числе изменения индекса, рассчитываемого исходя из стоимости активов, которые могут входить в состав Фонда), от величины процентных ставок, уровня инфляции, курсов валют;</p> <p>10) российские и иностранные депозитарные расписки на ценные бумаги, указанные в настоящем пункте;</p> <p>и активы, являющиеся клиринговыми сертификатами участия.</p>	<p>или «V», или «F» при условии, что шестая буква имеет значение «U» или «Y»,</p> <p>или</p> <p>– присвоенный указанным акциям код CFI имеет следующие значения: первая буква имеет значение "С", вторая буква имеет значение «I» или «E» или «B», или «P», или «H», или «M», третья буква имеет значение «O» или «C», или «M», или «X», пятая буква имеет значение «B» или «C», или «D», или «E», или «L», или «M», или «X», или «V», или «F» при условии, что шестая буква имеет значение «S» или «Q»;</p> <p>6) облигации российских эмитентов;</p> <p>7) облигации иностранных эмитентов;</p> <p>8) инвестиционные паи открытых паевых инвестиционных фондов, относящихся к категории фондов рыночных финансовых инструментов;</p> <p>9) производные финансовые инструменты при условии, что изменение их стоимости зависит от изменения стоимости активов, которые могут входить в состав Фонда (в том числе изменения индекса, рассчитываемого исходя из стоимости активов, которые могут входить в состав Фонда), от величины процентных ставок, уровня инфляции, курсов валют;</p> <p>10) российские и иностранные депозитарные расписки на ценные бумаги, указанные в настоящем пункте;</p> <p>и активы, являющиеся клиринговыми сертификатами участия.</p>
<p>23.2. Оценочная стоимость ценных бумаг одного юридического лица, денежные средства в рублях и иностранной валюте на счетах и во вкладах (депозитах) в таком юридическом лице (если соответствующее лицо является кредитной организацией и иностранным банком иностранного государства), права требования к такому юридическому лицу в совокупности не должны превышать 14 процентов стоимости активов Фонда, с 1 июля 2021 года - 13 процентов стоимости активов Фонда, с 1 января 2022 года - 12 процентов стоимости активов Фонда, а с 1 января 2022 года - 11 процентов стоимости активов Фонда, а с 1 января</p>	<p>23.2. Оценочная стоимость ценных бумаг одного юридического лица, денежные средства в рублях и иностранной валюте на счетах и во вкладах (депозитах) в таком юридическом лице (если соответствующее лицо является кредитной организацией и иностранным банком иностранного государства), права требования к такому юридическому лицу в совокупности не должны превышать 15 процентов стоимости активов Фонда до 31 декабря 2019 года, с 1 января 2020 года - 14 процентов стоимости активов Фонда, с 1 июля 2020 года - 13 процентов стоимости активов Фонда, с 1 января 2021 года - 12 процентов стоимости активов Фонда, с 1 июля 2021</p>

года - 11 процентов стоимости активов Фонда, а с 1 января 2022 года - 10 процентов стоимости активов Фонда. Требования настоящего подпункта не распространяются на государственные ценные бумаги РФ и на права требования к центральному контрагенту.

Оценочная стоимость ценных бумаг одного субъекта РФ (административно-территориального образования иностранного государства), муниципального образования, государственных ценных бумаг одного иностранного государства не должна превышать 15 процентов стоимости активов Фонда до 31 декабря 2019 года, с 1 января 2020 года - 14 процентов стоимости активов Фонда, с 1 января 2021 года - 12 процентов стоимости активов Фонда, с 1 июля 2021 года - 11 процентов стоимости активов Фонда, а с 1 января 2022 года - 10 процентов стоимости активов Фонда.

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

Для целей настоящего подпункта ценные бумаги инвестиционных фондов, в том числе иностранных инвестиционных фондов, и ипотечные сертификаты участия рассматриваются как совокупность активов, в которые инвестировано имущество соответствующего фонда (ипотечного покрытия). Если лицо, обязанное по ценным бумагам инвестиционного фонда, не предоставляет и(или) не раскрывает информацию об активах, в которые инвестировано имущество инвестиционного фонда, то такие ценные бумаги могут приобретаться в состав активов Фонда (без учета требования, установленного абзацем первым настоящего подпункта), если в соответствии с личным законом лица, обязанного по ценным бумагам инвестиционным фондом, такие ценные бумаги могут приобретаться неквалифицированными инвесторами (неограниченным кругом лиц), а также при наличии одного из следующих обстоятельств: в соответствии с требованиями, предъявляемыми к деятельности инвестиционного фонда, или документами, регулирующими инвестиционную деятельность инвестиционного фонда (в том числе инвестиционной декларацией, проспектом эмиссии, правилами доверительного управления), доля ценных бумаг одного юридического лица не должна превышать 10 процентов стоимости активов инвестиционного фонда либо в соответствии с правом Европейского союза инвесторному фонду предоставлено право осуществления деятельности на территории всех государств - членов Европейского союза и его деятельность регулируется правом Европейского

года - 10 процентов стоимости активов Фонда. Требования настоящего подпункта не распространяются на государственные ценные бумаги РФ и на права требования к центральному контрагенту.

Оценочная стоимость ценных бумаг одного субъекта РФ (административно-территориального образования иностранного государства), муниципального образования, государственных ценных бумаг одного иностранного государства не должна превышать 14 процентов стоимости активов Фонда, с 1 июля 2021 года - 13 процентов стоимости активов Фонда, с 1 января 2022 года - 12 процентов стоимости активов Фонда, с 1 июля 2022 года - 11 процентов стоимости активов Фонда, а с 1 января 2023 года - 10 процентов стоимости активов Фонда.

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

Для целей настоящего подпункта ценные бумаги инвестиционных фондов, в том числе иностранных инвестиционных фондов, и ипотечные сертификаты участия рассматриваются как совокупность активов, в которые инвестировано имущество соответствующего фонда (ипотечного покрытия). Если лицо, обязанное по ценным бумагам инвестиционного фонда, не предоставляет и(или) не раскрывает информацию об активах, в которые инвестировано имущество инвестиционного фонда, то такие ценные бумаги могут приобретаться в состав активов Фонда (без учета требования, установленного абзацем первым настоящего подпункта), если в соответствии с личным законом лица, обязанного по ценным бумагам инвестиционным фондом, такие ценные бумаги могут приобретаться неквалифицированными инвесторами (неограниченным кругом лиц), а также при наличии одного из следующих обстоятельств: в соответствии с требованиями, предъявляемыми к деятельности инвестиционного фонда, или документами, регулирующими инвестиционную деятельность инвестиционного фонда (в том числе инвестиционной декларацией, проспектом эмиссии, правилами доверительного управления), доля ценных бумаг одного юридического лица не должна превышать 10 процентов стоимости активов инвестиционного фонда либо в соответствии с правом Европейского союза инвесторному фонду предоставлено право осуществления деятельности на территории всех государств - членов Европейского союза и его деятельность

Для целей расчета ограничения, указанного в настоящем подпункте, при определении доли оценочной стоимости активов Фонда в сумме денежных средств в рублях и в иностранной валюте на счетах в одном юридическом лице и стоимости прав требования к одному юридическому лицу, возникших на основании договора о брокерском обслуживании с таким лицом (при условии, что указанным договором предусмотрено исполнение обязательств в течение одного рабочего дня с даты предъявления указанных требований к исполнению), составляющих 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 и стоимость прав требований, которые не учитываются при расчете ограничений, указанных в настоящем подпункте, в отношении всех денежных средств в рублях и в иностранной валюте на счетах в одном юридическом лице, возникших на основании всех прав требований к юридическим лицам, составляющих Фонд, в совокупности не должны превышать общую сумму денежных средств, подлежащих выплате в связи с погашением и обменом инвестиционных паев Фонда на момент расчета ограничения.

Для целей расчета ограничения, указанного в настоящем подпункте, при определении доли оценочной стоимости активов Фонда в сумме денежных средств в рублях и в иностранной валюте на счетах в одном юридическом лице, составляющих Фонд, не учитывается сумма (или ее часть) денежных средств, находящихся на указанных счетах (одном из указанных счетов) и включенных в Фонд при выдаче и (или) обмене инвестиционных паев, в течение не более 2 рабочих дней с даты указанного включения.

регулируется правом Европейского союза.

Для целей расчета ограничения, указанного в настоящем подпункте, при определении доли оценочной стоимости активов в стоимости активов Фонда в сумме денежных средств в рублях и в иностранной валюте на счетах в одном юридическом лице и стоимости прав требований к одному юридическому лицу, возникших на основании договора о брокерском обслуживании с таким лицом (при условии, что указанным договором предусмотрено исполнение обязательств в течение одного рабочего дня с даты предъявления указанных требований к исполнению), составляющих 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 и стоимость прав требований, которые не учитываются при расчете ограничений, указанных в настоящем подпункте, в отношении всех денежных средств в рублях и в иностранной валюте на всех счетах и в отношении всех прав требований к юридическим лицам, возникших на основании указанных договоров о брокерском обслуживании, составляющих Фонд, в совокупности не должны превышать общую сумму денежных средств, подлежащих выплате в связи с погашением и обменом инвестиционных паев Фонда на момент расчета ограничения.

Для целей расчета ограничения, указанного в настоящем подпункте, при определении доли оценочной стоимости активов в стоимости активов Фонда в сумме денежных средств в рублях и в иностранной валюте на счетах в одном юридическом лице, составляющих Фонд, не учитывается сумма (или ее часть) денежных средств, находящихся на указанных счетах (одном из указанных счетов) и включенных в Фонд при выдаче и (или) обмене инвестиционных паев, в течение не более 2 рабочих дней с даты указанного включения.

Генеральный директор
ООО УК «Система Капитал»

И.Г. Бусаров

