

Центральный Банк
Российской Федерации (Банк России)

ЗАРЕГИСТРИРОВАНО

Дата

21.09.2020

№ 3906-2

УТВЕРЖДЕНЫ
Приказом № П- 136-20-УА от «01» сентября 2020 года

Генеральный директор
АО ВТБ Капитал Управление активами

/С.Г. Дюдин/



**ИЗМЕНЕНИЯ и ДОПОЛНЕНИЯ
В ПРАВИЛА ДОВЕРИТЕЛЬНОГО УПРАВЛЕНИЯ**

**Биржевым паевым инвестиционным фондом рыночных финансовых инструментов
«ВТБ – Корпоративные российские еврооблигации смарт бета».**

(Правила доверительного управления зарегистрированы Банком России 19 ноября 2019 года за № 3906)

Старая редакция	Новая редакция
7. Полное фирменное наименование специализированного депозитария фонда (далее - специализированный депозитарий): Закрытое акционерное общество ВТБ Специализированный депозитарий.	7. Полное фирменное наименование специализированного депозитария фонда (далее - специализированный депозитарий): Акционерное общество ВТБ Специализированный депозитарий.
9. Лицензия специализированного депозитария на осуществление деятельности специализированного депозитария инвестиционных фондов, паевых инвестиционных фондов и негосударственных пенсионных фондов, предоставленная Федеральной службой по финансовым рынкам от 25 ноября 1997 года № 22-000-1-00005.	9. Лицензия специализированного депозитария на осуществление деятельности специализированного депозитария инвестиционных фондов, паевых инвестиционных фондов и негосударственных пенсионных фондов, предоставленная ФКЦБ России от 25 ноября 1997 года № 22-000-1-00005.
10. Полное фирменное наименование лица, осуществляющего ведение реестра владельцев инвестиционных паев фонда (далее - регистратор): Акционерное общество ВТБ Регистратор.	10. Полное фирменное наименование лица, осуществляющего ведение реестра владельцев инвестиционных паев фонда (далее - регистратор): Акционерное общество ВТБ Специализированный депозитарий.
11. Место нахождения регистратора: 127015, г. Москва, ул. Правды, д. 23.	11. Место нахождения регистратора: 101000, г. Москва, ул. Мясницкая, д. 35.
12. Лицензия регистратора на осуществление деятельности по ведению реестра владельцев ценных бумаг № 045-13970-000001 от 21 февраля 2008 г., предоставленная Федеральной службой по финансовым рынкам.	12. Лицензия регистратора на осуществление деятельности специализированного депозитария инвестиционных фондов, паевых инвестиционных фондов и негосударственных пенсионных фондов, предоставленная ФКЦБ России от 25 ноября 1997 года № 22-000-1-00005.
24. Инвестиционной политикой управляющей компании является долгосрочное и/или краткосрочное вложение средств преимущественно в ценные бумаги, входящие в базу для расчёта Индекса..	24. Инвестиционной политикой управляющей компании является долгосрочное и/или краткосрочное вложение средств преимущественно в номинированные в долларах США облигации, выпущенные российскими эмитентами и/или от имени российских эмитентов, в том числе специальными юридическими лицами (Special Purpose Vehicle), иностранными эмитентами, международными финансовыми организациями, а также номинированные в долларах США государственные ценные бумаги Российской Федерации и иностранных государств.
Подпункт 1) пункта 25.1. Правил 1) активы, допущенные к организованным торгам (или в отношении которых биржей принято решение о включении в котировальные списки) на биржах Российской Федерации и биржах,	Подпункт 1) пункта 25.1. Правил 1) активы, допущенные к организованным торгам (или в отношении которых биржей принято решение о включении в котировальные списки) на биржах Российской Федерации и биржах,

<p>расположенных в иностранных государствах, являющихся членами Евразийского экономического союза (ЕАЭС), Организации экономического сотрудничества и развития (ОЭСР), Европейского союза, Китая, Индии, Бразилии, Южно-Африканской Республики (далее - иностранные государства) и включенных в перечень иностранных бирж, утвержденный Указанием Банка России от 28 января 2016 года N 3949-У «Об утверждении перечня иностранных бирж, прохождение процедуры листинга на которых является обязательным условием для принятия российской биржей решения о допуске ценных бумаг иностранных эмитентов к организованным торгам, а также условием для непроведения организациями, осуществляющими операции с денежными средствами или иным имуществом, идентификации бенефициарных владельцев иностранных организаций, чьи ценные бумаги прошли процедуру листинга на таких биржах», (далее - перечень иностранных бирж);</p>	<p>расположенных в иностранных государствах, являющихся членами Евразийского экономического союза (ЕАЭС), Организации экономического сотрудничества и развития (ОЭСР), Европейского союза, Китая, Индии, Бразилии, Южно-Африканской Республики (далее - иностранные государства), и отвечающих условиям, предусмотренным Указанием Банка России от 05.09.2016 № 4129-У «О составе и структуре активов акционерных инвестиционных фондов и активов паевых инвестиционных фондов» (далее - иностранные биржи);</p>
<p>25.2. В состав активов фонда могут входить, указанные в подпункте 1) пункта 25.1 настоящих Правил, следующие ценные бумаги, номинированные в долларах США:</p> <ul style="list-style-type: none"> - облигации, выпущенные российскими эмитентами и/или от имени российских эмитентов, в том числе от имени специальных юридических лиц (Special Purpose Vehicle), за исключением конвертируемых выпусков; - государственные ценные бумаги Российской Федерации; - государственные ценные бумаги иностранных государств; - облигации иностранных эмитентов; - облигации международных финансовых организаций; - российские и иностранные депозитарные расписки на государственные ценные бумаги Российской Федерации, государственные ценные бумаги иностранных государств, облигации иностранных эмитентов или облигации международных финансовых организаций; - активы, являющиеся клиринговыми сертификатами участия. 	<p>25.2. В состав активов фонда могут входить, указанные в подпункте 1) пункта 25.1 настоящих Правил, следующие ценные бумаги, номинированные в долларах США:</p> <ul style="list-style-type: none"> - облигации, выпущенные российскими эмитентами и/или от имени российских эмитентов, в том числе специальными юридическими лицами (Special Purpose Vehicle), за исключением конвертируемых выпусков; - государственные ценные бумаги Российской Федерации; - государственные ценные бумаги иностранных государств; - облигации иностранных эмитентов; - облигации международных финансовых организаций; - российские и иностранные депозитарные расписки на государственные ценные бумаги Российской Федерации, государственные ценные бумаги иностранных государств, облигации иностранных эмитентов или облигации международных финансовых организаций; - активы, являющиеся клиринговыми сертификатами участия.
<p>25.3. Имущество, составляющее фонд, может быть инвестировано в облигации, эмитентами которых могут быть:</p> <ul style="list-style-type: none"> - федеральные органы исполнительной власти Российской Федерации; - иностранные органы государственной власти; - международные финансовые организации; - российские юридические лица, в том числе Федеральные государственные унитарные предприятия и государственные корпорации; - иностранные юридические лица. 	<p>25.3. Имущество, составляющее фонд, может быть инвестировано в облигации, удовлетворяющие требованиям подпункта 1) пункта 25.1) настоящих Правил, эмитентами которых могут быть:</p> <ul style="list-style-type: none"> - федеральные органы исполнительной власти Российской Федерации; - иностранные органы государственной власти; - международные финансовые организации; - российские юридические лица, в том числе Федеральные государственные унитарные предприятия и государственные корпорации; - иностранные юридические лица.
<p>Первый и второй абзацы пункта 26.1. Правил Оценочная стоимость ценных бумаг одного</p>	<p>Первый и второй абзацы пункта 26.1. Правил Оценочная стоимость ценных бумаг одного</p>

юридического лица, денежные средства в рублях и в иностранной валюте на счетах и во вкладах (депозитах) в таком юридическом лице (если соответствующее лицо является кредитной организацией) или иностранным банком иностранного государства), права требования к такому 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 года - 11 процентов стоимости активов фонда, а с 1 января 2022 года - 10 процентов стоимости активов фонда. Требования настоящего абзаца не распространяются на государственные ценные бумаги Российской Федерации и на права требования к центральному контрагенту.

Оценочная стоимость 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 июля 2020 года - 13 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.

26.2. Оценочная стоимость ценных бумаг, указанных в пункте 25.2 настоящих Правил и входящих в базу для расчёта Индекса, в совокупности должна составлять не менее 80 процентов от общей стоимости активов фонда.

Подпункт 8) пункта 30 Правил

8) до возникновения основания прекращения фонда обеспечивать соответствие изменений расчетной цены изменениям количественных показателей биржевого индекса «Индекс МосБиржи Корпоративных Российских Еврооблигаций», рассчитываемого Публичным акционерным обществом «Московская биржа ММВБ-РТС» с отклонением не более чем на 5 (Пять) процентов.

юридического лица, денежные средства в рублях и в иностранной валюте на счетах и во вкладах (депозитах) в таком юридическом лице (если соответствующее лицо является кредитной организацией) или иностранным банком иностранного государства), права требования к такому 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, с 1 июля 2022 года - 11 процентов стоимости активов фонда, а с 1 января 2023 года - 10 процентов стоимости активов фонда. Требования настоящего абзаца не распространяются на государственные ценные бумаги Российской Федерации и на права требования к центральному контрагенту.

Оценочная стоимость 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.

26.2. Не менее двух третей рабочих дней в течение календарного года оценочная стоимость ценных бумаг, указанных в пункте 25.2 настоящих Правил за исключением клиринговых сертификатов участия, в совокупности должна составлять не менее 80 процентов от общей стоимости активов фонда.

Подпункт 8) пункта 30 Правил

8) до возникновения основания прекращения фонда обеспечивать соответствие изменений расчетной цены изменениям количественных показателей Индекса с отклонением не более чем на 5 (Пять) процентов.

Всего прошито, пронумеровано и скреплено
печатью 3 (ТФЧ) лист/а/ов.

Генеральный директор
АО ВТБ Капитал Управление активами

Дюдин Сергей Геннадьевич

2020 г.

