**Утверждено Приказом**

**Генерального директора**

**№ 57/23 от 25 мая 2023 г.**

**Изменения и дополнения № 5**

**в правила доверительного управления**

**Биржевого паевого инвестиционного фонда**

**рыночных финансовых инструментов**

**«Альфа-Капитал Космос»**

(Правила зарегистрированы Банком России 19 августа 2021 года № 4561)

**1. Изложить пп. 13, 14 Правил доверительного управления фонда в следующей редакции:**

«13. Утратил силу.

14. Утратил силу.».

**2. Изложить п.24 Правил доверительного управления фонда в следующей редакции:**

«24. Инвестиционная политика управляющей компании:

Инвестиционной политикой управляющей компании является долгосрочное вложение средств в активы, предусмотренные п.25 настоящих Правил и краткосрочное вложение средств в производные финансовые инструменты.

Производные финансовые инструменты могут составлять активы при условии, что:

1) указанные договоры заключены на торгах фондовых, валютных бирж в соответствии с утвержденными ими спецификациями, определяющими стандартные условия соответствующих договоров (контрактов).

**Сведения о способе реализации управляющей компанией инвестиционной стратегии пассивного управления**

Управляющей компанией при осуществлении доверительного управления фондом реализует стратегию пассивного управления путем следования доходности фонда индикатору (индексу), установленному настоящими правилами в качестве индикатора (индекса) в пределах заданного отклонения посредством полного или частичного соответствия состава и структуры активов фонда составу и структуре активов, входящих в расчет индикатора (индекса), при соблюдении требований к составу и структуре активов, установленных инвестиционной декларацией Фонда, а также положений инвестиционной политики (далее - целевой показатель).

Преимущественными объектами инвестирования являются финансовые инструменты, входящие в базу расчета целевого показателя (далее – преимущественные активы).

Способом (критерием) выбора активов при принятии инвестиционных решений является выбор активов с точки зрения наилучшего соотношения рисков и ожидаемой доходности отдельных активов и (или) инвестиционного портфеля фонда в совокупности.

Название (обозначение) целевого показателя: «Индекс Альфа - Капитал Космос Рублевый».

Источник раскрытия сведения о порядке расчета указанного целевого показателя: https://www.alfacapital.ru/disclosure/indicators/cosmos.

Лицо, осуществляющее расчет целевого показателя: Публичное акционерное общество «Московская Биржа ММВБ-РТС», ОГРН 1027739387411.».

**3.** **Изложить пп. и), л) пп.5) п. 31 Правил доверительного управления фонда в следующей редакции:**

«и) сделки по приобретению в состав фонда ценных бумаг, выпущенных (выданных) участниками управляющей компании, их основными и преобладающими хозяйственными обществами, дочерними и зависимыми обществами управляющей компании, а также специализированным депозитарием, регистратором;

л) сделки по приобретению в состав фонда имущества у специализированного депозитария, с которым управляющей компанией заключен договор, либо по отчуждению имущества указанному лицу, за исключением случаев оплаты расходов, перечисленных в пункте 97 настоящих Правил, а также иных случаев, предусмотренных настоящими Правилами;».

**4. Изложить п. 40 Правил доверительного управления фонда в следующей редакции:**

«40. Инвестиционные паи свободно обращаются по завершении (окончании) формирования фонда.

Специализированный депозитарий и регистратор не могут являться владельцами инвестиционных паев.».

**5. Изложить п. 65 Правил доверительного управления фонда в следующей редакции:**

«65. Выдача инвестиционных паев после даты завершения (окончания) формирования фонда должна осуществляться в один день не позднее одного рабочего дня, следующего за днем включения денежных средств (иного имущества), переданных (переданного) в оплату инвестиционных паев, в состав фонда.

Сумма денежных средств (стоимость имущества), на которую выдается инвестиционный пай после завершения (окончания) формирования фонда, определяется исходя из расчетной стоимости инвестиционного пая.

Выдача инвестиционных паев после даты завершения (окончания) формирования фонда осуществляется при условии передачи в их оплату денежных средств в размере не менее 75 (Семьдесят пять) рублей и (или) иного имущества стоимостью не менее 75 (Семьдесят пять) рублей. В оплату паев принимаются бездокументарные ценные бумаги, предусмотренные подпунктом 1.1.) пункта 25.1 настоящих Правил.

Количество инвестиционных паев, выдаваемых управляющей компанией после завершения (окончания) формирования фонда, определяется путем деления суммы денежных средств (стоимости имущества), включенных (включенного) в состав фонда, на расчетную стоимость инвестиционного пая, определенную на последний момент ее определения, предшествующий моменту выдачи инвестиционных паев.

Количество инвестиционных паев, выдаваемых управляющей компанией после завершения (окончания) формирования фонда, не может быть определено исходя из расчетной стоимости инвестиционного пая, определенной на момент времени, предшествующий наступлению более позднего из двух событий - подачи заявки на приобретение инвестиционных паев и поступления денежных средств (иного имущества) в оплату инвестиционных паев.».

**6. Изложить п. 88 Правил доверительного управления фонда в следующей редакции:**

«88. Выплата денежной компенсации осуществляется в российских рублях путем ее перечисления на банковский счет лица, которому были погашены инвестиционные паи. В случае если учет прав на погашенные инвестиционные паи осуществлялся на лицевом счете номинального держателя, выплата денежной компенсации может также осуществляться путем ее перечисления на специальный депозитарный счет этого номинального держателя.»

**7. Изложить п.94 Правил доверительного управления фонда в следующей редакции:**

«94. За счет имущества, составляющего фонд, выплачиваются вознаграждения управляющей компании в размере 1,5 (Одна целая пять десятых) процента среднегодовой стоимости чистых активов фонда, а также специализированному депозитарию, регистратору и бирже в размере не более 0,13 (Ноль целых тринадцать сотых) процента среднегодовой стоимости чистых активов фонда. Максимальный размер сумм указанных вознаграждений составляет 1,63 (Одна целая шестьдесят три сотых) процента среднегодовой стоимости чистых активов фонда.».

**8. Изложить п.96 Правил доверительного управления фонда в следующей редакции:**

«96. Вознаграждение специализированному депозитарию, регистратору и бирже выплачивается в срок, предусмотренный в договорах указанных лиц с управляющей компанией.».

**9. Изложить п.98 Правил доверительного управления фонда в следующей редакции:**

«98. Расходы, не предусмотренные пунктом 97 настоящих Правил, а также вознаграждение в части превышения размеров, указанных в пункте 94 настоящих Правил, или управляющей компании - 1,5 (Одна целая пять десятых) процента среднегодовой стоимости чистых активов фонда, специализированному депозитарию, регистратору и бирже – 0,13 (Ноль целых тринадцать сотых) процента среднегодовой стоимости чистых активов фонда, при этом максимальный размер сумм указанных вознаграждений составляет 1,63 (одна целая шестьдесят три сотых) процента среднегодовой стоимости чистых активов фонда выплачиваются управляющей компанией за счёт своих собственных средств.».

**10. Изложить п.100 Правил доверительного управления фонда в следующей редакции:**

«100. Стоимость чистых активов фонда определяется в российских рублях в порядке и сроки, предусмотренные нормативными актами Банка России.

Расчетная стоимость инвестиционного пая Фонда определяется на каждую дату, на которую определяется стоимость чистых активов Фонда, путем деления стоимости чистых активов Фонда на количество инвестиционных паев по данным реестра владельцев инвестиционных паев Фонда на дату определения расчетной стоимости.».

**11. Изложить пп.2) п.113 Правил доверительного управления фонда в следующей редакции:**

«2) сумм вознаграждений управляющей компании, специализированного депозитария, регистратора, биржи, начисленных на день возникновения основания прекращения фонда;».

**12. Изложить пп.118, 119 Правил доверительного управления фонда в следующей редакции:**

«118. Изменения и дополнения, которые вносятся в настоящие Правила, вступают в силу по истечении одного месяца со дня раскрытия сообщения о регистрации таких изменений Банком России, если они связаны:

1) с изменением инвестиционной декларации фонда;

2) с увеличением размера вознаграждения управляющей компании, специализированного депозитария, регистратора;

3) с увеличением расходов и (или) расширением перечня расходов, подлежащих оплате за счет имущества, составляющего фонд;

4) с введением скидок в связи с погашением инвестиционных паев или увеличением их размеров;

5) с увеличением величины максимального отклонения цены покупки (продажи) инвестиционных паев, публично объявляемой маркет-мейкером биржевого фонда на организованных торгах, проводимых биржей, от расчетной цены одного инвестиционного пая;

6) с уменьшением объема сделок с инвестиционными паями на проводимых биржей организованных торгах, совершаемых маркет-мейкером в течение торгового дня, по достижении которого его обязанность маркет-мейкера в этот день прекращается;

7) с установлением или исключением права владельцев инвестиционных паев на получение дохода от доверительного управления фондом, а также с изменением правил и сроков выплаты такого дохода;

8) с иными изменениями и дополнениями, предусмотренными нормативными актами Банка России.

119. Изменения, которые вносятся в настоящие Правила, вступают в силу со дня их регистрации Банком России, если они касаются:

1) изменения наименований управляющей компании, специализированного депозитария, регистратора, а также иных сведений об указанных лицах;

2) уменьшения размера вознаграждения управляющей компании, специализированного депозитария, регистратора, а также уменьшения размера и (или) сокращения перечня расходов, подлежащих оплате за счет имущества, составляющего фонд;

3) отмены скидок или уменьшения их размеров;

4) изменения наименования Уполномоченного лица или биржи, предусмотренных правилами, либо иных сведений об Уполномоченном лице или о бирже;

5) включения в правила фонда сведения о новом уполномоченном лице или новой бирже

6) иных положений, предусмотренных нормативными актами Банка России.».

Генеральный директор И.В. Кривошеева