



Изменения и дополнения № 6
в Правила доверительного управления
Биржевым паевым инвестиционным фондом
рыночных финансовых инструментов
«Т-Капитал Индекс МосБиржи»

(Правила доверительного управления фондом зарегистрированы
Банком России 13.07.2020 в реестре паевых инвестиционных фондов за № 4100)

Старая редакция	Новая редакция
23. Перечень объектов инвестирования, их состав и описание. 23.1. Имущество, составляющее фонд, может быть инвестировано в: 1) активы, допущенные к организованным торгам (или в отношении которых биржей принято решение о включении в котировальные списки) на биржах Российской Федерации и биржах, расположенных в иностранных государствах, являющихся членами Евразийского экономического союза (ЕАЭС), Организации экономического сотрудничества и развития (ОЭСР), Европейского союза, Китая, Индии, Бразилии, Южно-Африканской Республики, Сингапура, Катара (далее - иностранные государства) и включенных в перечень иностранных бирж, предусмотренный пунктом 4 статьи 51.1 Федерального закона от 22 апреля 1996 года № 39-ФЗ «О рынке ценных бумаг» (Собрание законодательства Российской Федерации, 1996, N 17, ст. 1918; 2002, N 52, ст. 5141; 2018, N 53, ст. 8440) (далее - перечень иностранных бирж), и активы, являющиеся клиринговыми сертификатами участия, а именно: 1.1) акции российских акционерных обществ, за исключением акций акционерных инвестиционных фондов; 1.2) акции иностранных эмитентов; 1.3) российские и иностранные депозитарные расписки;	23. Перечень объектов инвестирования, их состав и описание. 23.1. Имущество, составляющее фонд, может быть инвестировано в: 1) активы, допущенные к организованным торгам (или в отношении которых биржей принято решение о включении в котировальные списки) на биржах Российской Федерации и биржах, расположенных в иностранных государствах, являющихся членами Евразийского экономического союза (ЕАЭС), Организации экономического сотрудничества и развития (ОЭСР), Европейского союза, Китая, Индии, Бразилии, Южно-Африканской Республики, Сингапура, Катара (далее - иностранные государства) и включенных в перечень иностранных бирж, предусмотренный пунктом 4 статьи 51.1 Федерального закона от 22 апреля 1996 года № 39-ФЗ «О рынке ценных бумаг» (Собрание законодательства Российской Федерации, 1996, N 17, ст. 1918; 2002, N 52, ст. 5141; 2018, N 53, ст. 8440) (далее - перечень иностранных бирж), а именно: 1.1) акции российских акционерных обществ, за исключением акций акционерных инвестиционных фондов; 1.2) российские депозитарные расписки; 1.3) производные финансовые инструменты (фьючерсные и опционные договоры (контракты) при соблюдении

1.4) производные финансовые инструменты (фьючерсные и опционные договоры (контракты) при соблюдении условий, предусмотренных абзацами 8 – 14 пункта 22 и пунктом 23.4 Правил. 2) 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, на территории которых они зарегистрированы (далее - иностранные банки), государственные ценные бумаги Российской Федерации и иностранных государств, (активы, указанные в настоящем подпункте далее по тексту, совместно именуются - инструменты денежного рынка). При этом 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. 3) права требования из договоров, заключенных для целей доверительного управления в отношении указанных в подпунктах 1) и 2) пункта 23.1 настоящих Правил активов. 4) иные активы, включаемые в состав активов фонда в связи с оплатой расходов, связанных с доверительным управлением имуществом, составляющим фонд. 23.2. В состав активов фонда могут входить как обыкновенные, так и привилегированные акции. Имущество, составляющее фонд, может быть инвестировано в облигации, эмитентами которых могут быть: а) российские органы государственной власти; б) иностранные органы государственной власти. 23.3. Лица, обязанные по: - акциям российских акционерных обществ, российским депозитарным распискам, клиринговым сертификатам участия, государственным ценным бумагам Российской Федерации, должны быть зарегистрированы в	условий, предусмотренных абзацами 8 – 14 пункта 22 и пунктом 23.4 Правил; 1.4) иностранные депозитарные расписки, предназначенные только для квалифицированных инвесторов, определенные в Указании Банка России от 1 октября 2024 года № 6885-У «О ценных бумагах и производных финансовых инструментах, предназначенных для квалифицированных инвесторов» (далее – ценные бумаги, предназначенные для квалифицированных инвесторов), эмитентами которых (лицами, обязанными по которым) являются: - RCS Stock Transfer, Inc., регистрационный номер в стране регистрации: 3639329, учреждено в Соединенных Штатах Америки, ISIN: US83418T1088, удостоверяет права собственности на акции иностранного акционерного общества - CIAN PLC (ЦИАН ПиЭлСи), регистрационный номер в стране регистрации: HE 371331, учрежденного в Республике Кипр; - RCS Issuer Services S.ar.l., регистрационный номер в стране регистрации: B137239, учреждено в Великом Герцогстве Люксембург, ISIN: US29760G1031, удостоверяет права собственности на акции иностранного акционерного общества - ETALON GROUP PLC (ЭТАЛОН ГРУП ПИЭЛСИ), регистрационный номер в стране регистрации: HE 368052, учрежденного в Республике Кипр; - The Bank of New York Mellon, регистрационный номер в стране регистрации: 4299124, учреждено в Соединенных Штатах Америки, ISIN: US69269L1044, удостоверяет права собственности на акции иностранного акционерного общества - Ozon Holdings PLC (Озон Холдингс ПиЭлСи), регистрационный номер в стране регистрации: HE 104496, учрежденного в Республике Кипр; - RCS Trust and Corporate Services Ltd, регистрационный номер в стране регистрации: 240440900406, учреждено в Республике Казахстан, ISIN: US33835G2057, удостоверяет права собственности на акции иностранного акционерного общества - Fix Price Group Plc (Фикс Прайс Груп ПЛС), регистрационный номер в стране регистрации: HE 434185, учрежденного в Республике Кипр; - RCS Trust and Corporate Services Ltd, регистрационный номер в стране регистрации:
---	---

Российской Федерации; - акциям иностранных эмитентов, иностранным депозитарным распискам, государственным ценным бумагам иностранных государств, должны быть зарегистрированы в государствах, включенных в Общероссийский классификатор стран мира. 23.4. Производные финансовые инструменты (имущественные права из фьючерсных и опционных договоров (контрактов)) могут входить в состав активов фонда при условии, что изменение их стоимости зависит от изменения стоимости активов, указанных в подпунктах 1.1) – 1.3) подпункта 1) пункта 23.1 настоящих Правил, индексов, рассчитываемых исходя из стоимости активов, которые могут входить в состав фонда в соответствии с подпунктами 1.1) – 1.3) подпункта 1) пункта 23.1 настоящих Правил (в том числе изменения значения индекса, рассчитываемого исходя из стоимости данных активов), от величины процентных ставок, уровня инфляции, курсов валют.	240440900406, учреждено в Республике Казахстан, ISIN: US7496552057, удостоверяет права собственности на акции иностранного акционерного общества - Ros Agro Plc (Рос Агро ПЛС), регистрационный номер в стране регистрации: HE 258621, учрежденного в Республике Кипр; - The Bank of New York Mellon, регистрационный номер в стране регистрации: 4299124, учреждено в Соединенных Штатах Америки, ISIN: US98387E2054, удостоверяет права собственности на акции иностранного акционерного общества - X5 Retail Group N.V., регистрационный номер в стране регистрации: 33143036, учрежденного в Королевстве Нидерландов; - RCS Trust and Corporate Services Ltd, регистрационный номер в стране регистрации: 240440900406, учреждено в Республике Казахстан, ISIN: US7496552057, удостоверяет права собственности на акции иностранного акционерного общества - O'KEY Group S.A. (АО О'КЕЙ ГРУПП), регистрационный номер в стране регистрации: В 80533, учрежденного в Великом Герцогстве Люксембург. <i>[Положения подпункта 1.4) подпункта 1) пункта 23.1 Правил применяются не ранее 01.01.2025 – даты вступления в силу Указания Банка России от 1 октября 2024 года № 6885-У «О ценных бумагах и производных финансовых инструментах, предназначенных для квалифицированных инвесторов»].</i> 2) денежные средства в рублях и в иностранной валюте на счетах и во вкладах (депозитах) в российских кредитных организациях, государственные ценные бумаги Российской Федерации (активы, указанные в настоящем подпункте далее по тексту, совместно именуются - инструменты денежного рынка). При этом денежные средства во вкладах (депозитах) в российских кредитных организациях могут входить в состав фонда только при условии, что в случае досрочного расторжения указанного договора российская кредитная организация обязана вернуть сумму вклада (депозита, остатка на счете) и проценты по нему в срок, не превышающий семь рабочих дней. 3) активы, являющиеся клиринговыми сертификатами участия. 4) права требования из договоров, заключенных для целей доверительного
---	---

управления в отношении указанных в подпунктах 1) - 3) пункта 23.1 настоящих Правил активов.

5) иные активы, включаемые в состав активов фонда в связи с оплатой расходов, связанных с доверительным управлением имуществом, составляющим фонд, или в связи с реализацией прав, закрепленных составляющими фонд ценными бумагами или предусмотренных составляющими фонд производными финансовыми инструментами (далее - инвестиционные права).

Предусмотренные подпунктом 5 пункта 23.1 Правил активы, включаемые в состав активов фонда в связи с реализацией инвестиционных прав, могут входить в состав активов фонда в течение одного месяца с даты реализации указанных инвестиционных прав. Стоимость предусмотренных подпунктом 5 пункта 23.1 Правил активов, включаемых в состав фонда в связи с реализацией инвестиционных прав, в совокупности не должна превышать 5 процентов стоимости активов фонда.

23.2. В состав активов фонда могут входить как обыкновенные, так и привилегированные акции.

Имущество, составляющее фонд, может быть инвестировано в облигации, эмитентами которых могут быть российские органы государственной власти.

23.3. Лица, обязанные по:

- акциям российских акционерных обществ, российским депозитарным распискам, клиринговым сертификатам участия, государственным ценным бумагам Российской Федерации, должны быть зарегистрированы в Российской Федерации;

- ценным бумагам, предназначенным для квалифицированных инвесторов, должны быть зарегистрированы в государствах, включенных в Общероссийский классификатор стран мира.

23.4. Производные финансовые инструменты (имущественные права из фьючерсных и опционных договоров (контрактов)) могут входить в состав активов фонда при условии, что изменение их стоимости зависит от изменения стоимости активов, указанных в подпунктах 1.1) – 1.3) подпункта 1) пункта 23.1 настоящих Правил, индексов, рассчитываемых исходя из стоимости активов, которые могут входить в состав фонда в соответствии с

	подпунктами 1.1) – 1.2), 1.4) подпункта 1) пункта 23.1 настоящих Правил (в том числе изменения значения индекса, рассчитываемого исходя из стоимости данных активов), от величины процентных ставок, уровня инфляции, курсов валют.
24. Структура активов фонда должна одновременно соответствовать следующим требованиям: 24.1. Рассчитываемые каждый рабочий день отклонения прироста (в процентах) расчетной стоимости инвестиционного пая за 20 (двадцать) рабочих дней и за 250 (двести пятьдесят) рабочих дней, предшествующих дню расчета отклонений, от прироста (в процентах) значения Индекса, за указанные периоды не должны превышать по модулю 0,5 (ноль целых пять десятых) процента и 3 (три) процента соответственно. 24.2. 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 юридическое лицо является кредитной организацией или иностранным банком иностранного государства), права требования к такому лицу в совокупности не должны превышать 20 (двадцать) процентов стоимости активов фонда. Требования настоящего абзаца не распространяются на государственные ценные бумаги Российской Федерации на права требования к центральному контрагенту. Оценочная стоимость государственных ценных бумаг одного иностранного государства не должна превышать 20 (двадцати) процентов стоимости активов фонда. Для целей настоящего пункта российские и иностранные депозитарные расписки рассматриваются как ценные бумаги, права собственности на которые удостоверяют соответствующие депозитарные расписки. Для целей расчета ограничений, указанных в абзаце первом настоящего пункта, 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	24. Структура активов фонда должна одновременно соответствовать следующим требованиям: 24.1. Рассчитываемые каждый рабочий день отклонения прироста (в процентах) расчетной стоимости инвестиционного пая за 20 (двадцать) рабочих дней и за 250 (двести пятьдесят) рабочих дней, предшествующих дню расчета отклонений, от прироста (в процентах) значения Индекса, за указанные периоды не должны превышать по модулю 0,5 (ноль целых пять десятых) процента и 3 (три) процента соответственно. 24.2. 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 юридическое лицо является кредитной организацией или иностранным банком иностранного государства), права требования к такому лицу в совокупности не должны превышать 20 (двадцать) процентов стоимости активов фонда. Требования настоящего абзаца не распространяются на государственные ценные бумаги Российской Федерации на права требования к центральному контрагенту. Для целей настоящего пункта российские и иностранные депозитарные расписки рассматриваются как ценные бумаги, права собственности на которые удостоверяют соответствующие депозитарные расписки. Для целей расчета ограничений, указанных в абзаце первом настоящего пункта, 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 таким юридическим лицом обязательств в течение одного рабочего дня с даты предъявления указанных требований к исполнению),

условии, что указанным договором предусмотрено исполнение таким юридическим лицом 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 инвестиционных паев фонда на момент расчета ограничения. При этом общая сумма денежных средств и стоимость прав требований, которые не учитываются при расчете указанного ограничения, указанного в абзаце первом настоящего пункта, 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 инвестиционных паев фонда на момент расчета ограничения. Для целей расчета ограничений, указанных в абзаце первом настоящего пункта, 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 инвестиционных паев, в течение не более 2 (двух) рабочих дней с даты указанного включения. 24.3. Стоимость лотов производных финансовых инструментов (если базовым (базисным) активом производного финансового инструмента является другой производный финансовый инструмент - стоимость лотов таких производных финансовых инструментов), стоимость ценных бумаг (сумма денежных средств), полученных управляющей компанией по первой части договора репо, размер принятых обязательств по поставке активов по иным сделкам, дата исполнения которых не ранее 4 рабочих дней с даты заключения сделки, и заемные средства, предусмотренные подпунктом 5 пункта 1 статьи 40 Федерального закона от 29 ноября 2001 года № 156-ФЗ «Об инвестиционных фондах», в совокупности не должны превышать	составляющих фонд, не учитывается сумма (или ее часть) денежных средств, подлежащих выплате в связи с погашением инвестиционных паев фонда на момент расчета ограничения. При этом общая сумма денежных средств и стоимость прав требований, которые не учитываются при расчете указанного ограничения, указанного в абзаце первом настоящего пункта, 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 инвестиционных паев фонда на момент расчета ограничения. Для целей расчета ограничений, указанных в абзаце первом настоящего пункта, 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 инвестиционных паев, в течение не более 2 (двух) рабочих дней с даты указанного включения. 24.3. Стоимость лотов производных финансовых инструментов (если базовым (базисным) активом производного финансового инструмента является другой производный финансовый инструмент - стоимость лотов таких производных финансовых инструментов), стоимость ценных бумаг (сумма денежных средств), полученных управляющей компанией по первой части договора репо, размер принятых обязательств по поставке активов по иным сделкам, дата исполнения которых не ранее 4 рабочих дней с даты заключения сделки, и заемные средства, предусмотренные подпунктом 5 пункта 1 статьи 40 Федерального закона от 29 ноября 2001 года № 156-ФЗ «Об инвестиционных фондах», в совокупности не должны превышать 40 процентов стоимости чистых активов фонда. На дату заключения сделок с
--	---

40 процентов стоимости чистых активов фонда. На дату заключения сделок с производными финансовыми инструментами, договоров репо, договоров займа, кредитных договоров или сделок, дата исполнения которых не ранее 4 рабочих дней с даты заключения сделки, совокупная стоимость активов, указанных в первом абзаце настоящего пункта, с учетом заключенных ранее договоров репо и сделок, указанных в настоящем абзаце и заемных средств, предусмотренных подпунктом 5 пункта 1 статьи 40 Федерального закона от 29 ноября 2001 года № 156-ФЗ «Об инвестиционных фондах», не должна превышать 20 процентов стоимости чистых активов фонда. Для целей пункта 24 настоящих Правил производные финансовые инструменты учитываются в объеме приобретаемых (отчуждаемых) базовых (базисных) активов таких производных финансовых инструментов, если базовым (базисным) активом является другой производный финансовый инструмент (индекс) - как базовые (базисные) активы таких производных финансовых инструментов (активы, входящие в список для расчета такого индекса) и открытой позиции, скорректированной по результатам клиринга. Договоры репо заключаются, если они соответствуют одному из следующих условий: - контрагентом по договору репо является центральный контрагент; - договор репо заключается на условиях поставки против платежа и предусмотренной договором репо обязанности каждой из сторон при изменении цены ценных бумаг, переданных по договору репо, уплачивать другой стороне денежные суммы и (или) передавать ценные бумаги в соответствии с пунктом 14 статьи 51.3 Федерального закона от 22 апреля 1996 года № 39-ФЗ «О рынке ценных бумаг» при условии, что предметом договора репо могут быть только активы, включаемые в состав активов фонда, в соответствии с инвестиционной декларацией фонда. Управляющая компания не вправе распоряжаться ценными бумагами, приобретенными по договорам репо, по которым управляющая компания является покупателем по первой части договора репо, за исключением их возврата по второй части такого договора репо.	производными финансовыми инструментами, договоров репо, договоров займа, кредитных договоров или сделок, дата исполнения которых не ранее 4 рабочих дней с даты заключения сделки, совокупная стоимость активов, указанных в первом абзаце настоящего пункта, с учетом заключенных ранее договоров репо и сделок, указанных в настоящем абзаце и заемных средств, предусмотренных подпунктом 5 пункта 1 статьи 40 Федерального закона от 29 ноября 2001 года № 156-ФЗ «Об инвестиционных фондах», не должна превышать 20 процентов стоимости чистых активов фонда. Для целей пункта 24 настоящих Правил производные финансовые инструменты учитываются в объеме приобретаемых (отчуждаемых) базовых (базисных) активов таких производных финансовых инструментов, если базовым (базисным) активом является другой производный финансовый инструмент (индекс) - как базовые (базисные) активы таких производных финансовых инструментов (активы, входящие в список для расчета такого индекса) и открытой позиции, скорректированной по результатам клиринга. Договоры репо заключаются, если они соответствуют одному из следующих условий: - контрагентом по договору репо является центральный контрагент; - договор репо заключается на условиях поставки против платежа и предусмотренной договором репо обязанности каждой из сторон при изменении цены ценных бумаг, переданных по договору репо, уплачивать другой стороне денежные суммы и (или) передавать ценные бумаги в соответствии с пунктом 14 статьи 51.3 Федерального закона от 22 апреля 1996 года № 39-ФЗ «О рынке ценных бумаг» при условии, что предметом договора репо могут быть только активы, включаемые в состав активов фонда, в соответствии с инвестиционной декларацией фонда. Управляющая компания не вправе распоряжаться ценными бумагами, приобретенными по договорам репо, по которым управляющая компания является покупателем по первой части договора репо, за исключением их возврата по второй части такого договора репо. Для целей абзацев первого и второго
---	--

Для целей абзацев первого и второго настоящего пункта не учитываются договоры репо, по которым управляющая компания является покупателем по первой части договора репо, а также опционные договоры (контракты), по которым управляющая компания имеет право требовать от контрагента покупки или продажи базового (базисного) актива. 24.4. Не менее двух третей рабочих дней в течение каждого календарного квартала (за исключением периода с даты возникновения основания прекращения фонда) оценочная стоимость ценных бумаг, являющихся согласно пункту 22 настоящих Правил преимущественными объектами инвестирования, в совокупности должна составлять не менее 80 процентов стоимости активов, составляющих фонд. Рабочим днем считается день, который не признается в соответствии с законодательством Российской Федерации выходным и (или) нерабочим праздничным днем. 24.5. При определении структуры активов фонда учитываются активы, принятые к расчету стоимости чистых активов фонда. 24.6. Требования пункта 24 настоящих Правил не применяются с даты возникновения основания прекращения фонда.	настоящего пункта не учитываются договоры репо, по которым управляющая компания является покупателем по первой части договора репо, а также опционные договоры (контракты), по которым управляющая компания имеет право требовать от контрагента покупки или продажи базового (базисного) актива. 24.4. Не менее двух третей рабочих дней в течение каждого календарного квартала (за исключением периода с даты возникновения основания прекращения фонда) оценочная стоимость ценных бумаг, являющихся согласно пункту 22 настоящих Правил преимущественными объектами инвестирования, в совокупности должна составлять не менее 80 процентов стоимости активов, составляющих фонд. Рабочим днем считается день, который не признается в соответствии с законодательством Российской Федерации выходным и (или) нерабочим праздничным днем. 24.5. При определении структуры активов фонда учитываются активы, принятые к расчету стоимости чистых активов фонда. 24.6. Требования пункта 24 настоящих Правил не применяются с даты возникновения основания прекращения фонда. 24.7. Оценочная стоимость ценных бумаг, предназначенных для квалифицированных инвесторов, в совокупности не должна превышать 40 (сорок) процентов стоимости активов фонда.
---	---

Генеральный директор

Р.З. Мучипов