

УТВЕРЖДЕНЫ
Приказом Генерального директора
ООО «УК «Финам Менеджмент»
№УКФ/ПР/240920/1 от 20.09.2024

Изменения и дополнения № 20
в Правила доверительного управления
Открытым паевым инвестиционным фондом
рыночных финансовых инструментов «Финам Первый»

№ п.п.	Старая редакция	Новая редакция
1.	<p>14. Инвестиционной политикой управляющей компании является долгосрочное вложение средств преимущественно в активы, допущенные к организованным торгам (или в отношении которых биржей принято решение о включении в котировальные списки) на биржах Российской Федерации.</p> <p>Производные финансовые инструменты могут составлять активы фонда при условии, что:</p> <p>1) производные финансовые инструменты допущены 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, в Китае, Индии, Бразилии, Южно-Африканской Республике, Сингапуре, Катаре (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» (далее – перечень иностранных бирж и Федеральный закон «О рынке ценных бумаг» соответственно);</p> <p>2) изменение стоимости производных финансовых инструментов зависит от изменения стоимости активов, которые могут входить в состав фонда (в том числе изменения значения индекса, рассчитываемого исходя из стоимости активов, которые могут входить в состав фонда), от величины процентных ставок, уровня инфляции, курсов валют;</p> <p>3) стоимость лотов производных финансовых инструментов (если базовым (базисным) активом производного финансового</p>	<p>14. Инвестиционной политикой управляющей компании является долгосрочное вложение средств преимущественно в активы, допущенные к организованным торгам (или в отношении которых биржей принято решение о включении в котировальные списки) на биржах Российской Федерации.</p> <p>14.1. Производные финансовые инструменты могут составлять активы фонда при условии, что:</p> <p>1) производные финансовые инструменты допущены 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, в Китае, Индии, Бразилии, Южно-Африканской Республике, Сингапуре, Катаре (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» (далее – перечень иностранных бирж и Федеральный закон «О рынке ценных бумаг» соответственно);</p> <p>2) изменение стоимости производных финансовых инструментов зависит от изменения стоимости активов, которые могут входить в состав фонда (в том числе изменения значения индекса, рассчитываемого исходя из стоимости активов, которые могут входить в состав фонда), от величины процентных ставок, уровня инфляции, курсов валют;</p> <p>3) стоимость лотов производных финансовых инструментов (если базовым (базисным) активом производного финансового инструмента является другой производный финансовый инструмент - стоимость лотов таких производных финансовых</p>

	<p>инструмента является другой производный финансовый инструмент - стоимость лотов таких производных финансовых инструментов), стоимость ценных бумаг (сумма денежных средств), полученных управляющей компанией фонда по первой части договора репо, размер принятых обязательств по поставке активов по иным сделкам, дата исполнения которых не ранее 4 (четырёх) 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» (далее – Федеральный закон «Об инвестиционных фондах»), в совокупности не должны превышать 40% (сорока процентов) стоимости чистых активов фонда;</p> <p>4) на дату заключения сделок с производными финансовыми инструментами, договоров репо, договоров займа, кредитных договоров или сделок, дата исполнения которых не ранее 4 (четырёх) рабочих дней с даты заключения сделки, совокупная стоимость активов, указанных в подпункте три 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 «Об инвестиционных фондах», не должна превышать 20% (двадцати процентов) стоимости чистых активов фонда.</p> <p>Активы фонда могут входить следующие виды производных финансовых инструментов:</p> <p>а. Фьючерсный договор (далее – «фьючерс» или «фьючерсный контракт»);</p> <p>б. Форвардный договор (далее – «форвард» или «форвардный контракт»);</p> <p>в. Опционный договор (далее – «опцион» или «опционный контракт»);</p> <p>г. Своп-договор (далее – «своп» или «своп контракт»).</p> <p>Для целей подпунктов 3 и 4 настоящего пункта производные финансовые инструменты учитываются в объеме открытой позиции, скорректированной по результатам клиринга.</p>	<p>инструментов), стоимость ценных бумаг (сумма денежных средств), полученных управляющей компанией фонда по первой части договора репо, размер принятых обязательств по поставке активов по иным сделкам, дата исполнения которых не ранее 4 (четырёх) 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» (далее – Федеральный закон «Об инвестиционных фондах»), в совокупности не должны превышать 40% (сорока процентов) стоимости чистых активов фонда;</p> <p>4) на дату заключения сделок с производными финансовыми инструментами, договоров репо, договоров займа, кредитных договоров или сделок, дата исполнения которых не ранее 4 (четырёх) рабочих дней с даты заключения сделки, совокупная стоимость активов, указанных в подпункте три 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 «Об инвестиционных фондах», не должна превышать 20% (двадцати процентов) стоимости чистых активов фонда.</p> <p>Активы фонда могут входить следующие виды производных финансовых инструментов:</p> <p>а. Фьючерсный договор (далее – «фьючерс» или «фьючерсный контракт»);</p> <p>б. Форвардный договор (далее – «форвард» или «форвардный контракт»);</p> <p>в. Опционный договор (далее – «опцион» или «опционный контракт»);</p> <p>г. Своп-договор (далее – «своп» или «своп контракт»).</p> <p>Для целей подпунктов 3 и 4 настоящего пункта производные финансовые инструменты учитываются в объеме открытой позиции, скорректированной по результатам клиринга.</p> <p>14.2. Производные финансовые инструменты, предназначенные для квалифицированных инвесторов, включая производные финансовые инструменты, определенные в Указании Банка России от 9 января 2023 года № 6347-У «О ценных бумагах и производных финансовых инструментах, предназначенных для квалифицированных инвесторов» не могут входить в состав фонда.</p>
2.	<p>Дополнить Правила доверительного управления Открытым паевым инвестиционным фондом рыночных финансовых инструментов «Финам Первый» пунктом 17.5. следующего содержания:</p> <p>«17.5. В состав активов фонда не могут входить ценные бумаги, выпущенные (выданные) в соответствии с законодательством Российской Федерации о рынке ценных бумаг, законодательством Российской Федерации об инвестиционных фондах и предназначенные для квалифицированных инвесторов, а также иные ценные бумаги, определенные в Указании</p>	

Банка России от 9 января 2023 года № 6347-У «О ценных бумагах и производных финансовых инструментах, предназначенных для квалифицированных инвесторов» (далее при совместном упоминании - ценные бумаги, предназначенные для квалифицированных инвесторов).».
--

**Генеральный директор
ООО «УК «Финам Менеджмент»**

/А.П. Бирман/