

«УТВЕРЖДЕНЫ»

Генеральный директор  
Акционерного общества  
«Управляющая компания  
Мономах»

\_\_\_\_\_ / Т.А. Бовкун /

«21» июня 2023 г.

«СОГЛАСОВАНО»

Генеральный директор  
Закрытого акционерного общества  
«Первый Специализированный Депозитарий»

\_\_\_\_\_ / Г.Н. Панкратова /

«21» июня 2023 г.

**ИЗМЕНЕНИЯ И ДОПОЛНЕНИЯ В ПРАВИЛА**  
**определения стоимости чистых активов**  
**Открытого паевого инвестиционного фонда рыночных финансовых**  
**инструментов «Мономах-Перспектива»**  
**под управлением Акционерного общества «Управляющая компания Мономах»**

Настоящие изменения и дополнения включают в себя новую редакцию в части безрисковой ставки в российских рублях Приложения 5 «Методика определения справедливой стоимости активов с учетом кредитных рисков» и применяются с 1 июля 2023 года.

Старая редакция	Новая редакция
<p><b>Безрисковая ставка:</b></p> <ul style="list-style-type: none"><li>В российских рублях:<ul style="list-style-type: none"><li>Для задолженности со сроком до погашения, не превышающим 1 календарный день – ставка Mosprime;</li><li>Ставка, определяемая из G-кривой (кривой бескупонной доходности Московской биржи - <a href="https://www.moex.com/s2532">https://www.moex.com/s2532</a>), построенной по российским государственным облигациям - для</li></ul></li></ul>	<p><b>Безрисковая ставка:</b></p> <ul style="list-style-type: none"><li>В российских рублях:<ul style="list-style-type: none"><li>Для задолженности со сроком до погашения, не превышающим 1 календарный день – ставка MosPrime (<a href="http://mosprime.com/">http://mosprime.com/</a>) (ставка RUONIA (<a href="http://ruonia.ru/">http://ruonia.ru/</a>) после прекращения расчета и публикации ставки MosPrime);</li><li>Ставка, определяемая из G-кривой (кривой бескупонной доходности</li></ul></li></ul>

задолженности со сроком до погашения, превышающим 1 календарный день.

Для целей расчета безрисковой ставки, используются следующие округления:

- Значение срока ставки определяется до 4 знаков после запятой;

- Итоговое значение ставки определяется до 2 знаков после запятой.

Московской биржи - <https://www.moex.com/s2532>), построенной по российским государственным облигациям - для задолженности со сроком до погашения, превышающим 1 календарный день.

Для целей расчета безрисковой ставки, используются следующие округления:

- Значение срока ставки определяется до 4 знаков после запятой;

- Итоговое значение ставки определяется до 2 знаков после запятой.