

УТВЕРЖДЕН
решением Совета директоров Фонда
Протокол № 113 от «27» декабря 2022 года
Председатель Совета директоров


_____ / Белов А.М./

**ПОРЯДОК
РАЗМЕЩЕНИЯ СРЕДСТВ ПЕНСИОННЫХ РЕЗЕРВОВ,
СОБСТВЕННЫХ СРЕДСТВ И ИНВЕСТИРОВАНИЯ СРЕДСТВ
ПЕНСИОННЫХ НАКОПЛЕНИЙ
АКЦИОНЕРНОГО ОБЩЕСТВА «ХАНТЫ-МАНСИЙСКИЙ
НЕГОСУДАРСТВЕННЫЙ ПЕНСИОННЫЙ ФОНД»
НА 2023 ГОД
(редакция № 12)**

Ханты-Мансийск, 2022 г.

Оглавление

1.	Введение.....	3
2.	Принципы инвестирования.....	3
3.	Пенсионные накопления.....	3
3.1.	Инвестиционная стратегия и целевая доходность.....	3
3.2.	Состав и структура активов.....	4
3.3.	Виды допустимых сделок.....	5
4.	Пенсионные резервы.....	6
4.1.	Рыночные портфели под управлением УК.....	6
4.1.1.	Инвестиционная стратегия и целевая доходность.....	6
4.1.2.	Состав и структура активов.....	6
4.1.3.	Виды допустимых сделок.....	7
4.2.	Инвестиции Фонда в инвестиционные паи закрытых паевых инвестиционных фондов	8
4.2.1.	Инвестиционная стратегия.....	8
4.2.2.	Состав и структура имущества ЗПИФ.....	8
4.2.3.	Виды сделок и дополнительные требования Фонда по сделкам с инвестиционными паями.....	12
4.2.4.	План снижения инвестиций в инвестиционные паи ЗПИФ.....	12
4.3.	Дефолтные активы.....	13
4.3.1.	Управление дефолтными активами.....	13
5.	Собственные средства.....	13
5.1.	Цель размещения.....	13
5.2.	Состав и структура собственных средств.....	13
6.	Ограничения по рискам.....	13
6.1.	Ограничения рисков и порядок их установления.....	13
6.2.	Порядок выявления/устранения нарушений по ограничению рисков.....	14
7.	Заключительные положения.....	14
	Приложения №№ 1-6.....	15-26

1. Введение

1.1. Порядок размещения средств пенсионных резервов (далее – ПР), собственных средств (далее – СС) и инвестирования средств пенсионных накоплений (далее – ПН, совместно именуемые Активы) АО «Ханты-Мансийский НПФ» (далее – Порядок) определяет принципы, стратегию и целевые показатели инвестиций, состав и структуру Активов, дополнительные (к установленным законодательством) требования (ограничения) к составу и структуре Активов, утверждает Инвестиционные декларации (Приложения №№ 1-6), а также ограничения по рискам, принимаемым АО «Ханты-Мансийский НПФ» (далее также – Фонд).

1.2. Порядок утверждается Советом директоров Фонда на календарный год. При отсутствии изменений действие Порядка продлевается на каждый следующий календарный год на тех же условиях.

1.3. Контроль за соблюдением и обеспечением выполнения Порядка осуществляет Президент Фонда.

2. Принципы инвестирования

2.1. Организация управления Активами Фонда осуществляется на принципах разумности, добросовестности и с должной степенью осмотрительности, исключительно в интересах застрахованных лиц и участников, а также в целях обеспечения уставной деятельности, соответственно. Организация управления ПН и ПР не должна допускать размещение в активы, не соответствующие интересам застрахованных лиц и участников. Сделки в рамках размещения средств пенсионных накоплений или пенсионных резервов должны заключаться на наилучших доступных для Фонда условиях на момент заключения сделки.

2.2. Инвестирование Активов Фонда осуществляется на следующих принципах:

- обеспечения сохранности указанных средств;
- обеспечения доходности, диверсификации и ликвидности инвестиционных портфелей;
- определения инвестиционной стратегии на основе объективных критериев, поддающихся количественной оценке;
- учета надежности ценных бумаг;
- информационной открытости процесса размещения средств ПР и инвестирования средств ПН для Фонда, его вкладчиков, участников и застрахованных лиц;
- прозрачности процесса размещения средств ПР и инвестирования средств ПН для органов государственного, общественного надзора и контроля, специализированного депозитария, и подконтрольности им;
- профессионального управления инвестиционным процессом.

3. Пенсионные накопления

3.1. Инвестиционная стратегия и целевая доходность

3.1.1. Инвестиционная стратегия Фонда по инвестированию пенсионных накоплений является умеренно-консервативной и направлена на:

- сохранность пенсионных средств;
- выполнение пенсионных обязательств;
- получение среднерыночной доходности с учетом целевых показателей инвестиций и рисков, принимаемых Фондом.

3.1.2. Целевая доходность по ПН на календарный год определена в размере 6,5% годовых.

3.2. Состав и структура активов

3.2.1. Для реализации инвестиционной стратегии, достижения целевых показателей инвестиций и минимизации рисков, при выборе активов (эмитентов, банков) Фонд в рамках законодательных ограничений определил самостоятельные (дополнительные) требования к разрешенным активам по пенсионным накоплениям (Таблица № 1).

Таблица № 1. Требования к разрешенным активам ПН

Класс разрешенных активов	Цели управления активами	Требования к активу/эмитенту/кредитной организации
Государственные ценные бумаги Российской Федерации (ГЦБ РФ)	1) получение купонного дохода; 2) получение дохода за счет роста цены облигаций; 3) повышение ликвидности инвестиционного портфеля за счет приобретения облигаций федерального займа (далее – ОФЗ) и/или облигаций с дюрацией менее 1 года;	1) выпущены Минфином Российской Федерации; 2) обращаются на рынке Российской Федерации (далее также – РФ); 3) наличие листинга (высшего уровня) на ПАО «Московская Биржа» (далее – Московская Биржа)
Государственные ценные бумаги субъектов Российской Федерации (ГЦБ субъектов РФ)	4) снижение кредитного риска по инвестиционному портфелю за счет приобретения ОФЗ и облигаций с высоким кредитным рейтингом;	1) рейтинг не ниже суверенного; 2) наличие листинга на Московская Биржа
Корпоративные облигации	5) управление дюрацией инвестиционного портфеля	1) подконтрольность государству (напрямую или опосредованно) ¹ ; 2) вхождение в Ломбардный список Центрального Банка Российской Федерации (далее – ЦБ РФ); 3) информационная прозрачность деятельности эмитента
Депозиты и денежные средства в валюте Российской Федерации и в иностранной валюте (доллары США и Евро) в кредитных организациях	1) получение процентов по депозитам; 2) получение дохода за счет изменения курса валют; 3) защита инвестиционного портфеля от рыночного риска; 4) управление ликвидностью инвестиционного портфеля	1) иностранная валюта – доллары США и Евро; 2) контролируемые государством (напрямую или опосредованно); 3) входящие в систему страхования вкладов; 4) входящие в десять крупнейших кредитных организаций РФ по активам
Акции российских акционерных обществ (АО)	1) получение дивидендов; 2) получение дохода за счет роста цены акций	1) наличие листинга (высшего уровня) на Московская Биржа; 2) вхождение в расчет индекса МосБиржи; 3) информационная прозрачность деятельности эмитента

¹ за исключением эмитента ПАО «ЛУКОЙЛ»

3.2.2. Фонд с целью контроля за рисками и инвестициями определяет закрытый поименный список эмитентов ценных бумаг и банков, который указан в Приложении № 1.

3.2.3. Фонд в рамках законодательных требований к структуре инвестиционного портфеля пенсионных накоплений с учетом целевой доходности и рисков, а также необходимой диверсификации активов, устанавливает:

1) целевую структуру активов (Таблица № 2):

Таблица № 2. Целевая структура активов ПН

Вид актива	Доля, % от портфеля
ГЦБ РФ и ГЦБ субъектов РФ	30
Корпоративные облигации	55
Акции российских АО	5
Депозиты и денежные средства в валюте РФ и иностранной валюте	10
ИТОГО портфель	100

2) самостоятельные (дополнительные) требования к структуре в виде предельных значений долей (допустимых отклонений от целевой структуры активов):

- по классам активов,
 - по каждому эмитенту (банку),
 - по группам связанных эмитентов (юридических лиц),
 - по отраслям (секторам),
- которые указаны в Приложении № 1.

3.2.4. Фонд в целях формирования структуры активов для достижения оптимального соотношения доходности и рисков, повышения эффективности инвестиций за счет реализации долгосрочного потенциала фондового и долгового рынков с учетом длинных пенсионных обязательств, определяет дополнительный целевой показатель (параметр) по инвестиционному портфелю ПН на календарный год:

- целевую дюрацию (средневзвешенная дюрация) долгового портфеля установить в диапазоне 0 – 3,5 года.

3.2.5. Порядок выявления нарушений (отклонений) по ПН (по инвестиционному портфелю управляющей компании по договору доверительного управления) по составу и/или структуре, определения сроков устранения (указанных в договоре доверительного управления или установленных законодательством) и необходимых мер воздействия на управляющую компанию (далее также – УК), в том числе пересмотра условий договоров доверительного управления (включая пересмотр инвестиционной декларации, размера вознаграждения УК) или расторжения указанных договоров, определяется внутренними документами Фонда и договором доверительного управления с УК.

3.3. Виды допустимых сделок

3.3.1. Сделки со средствами ПН совершаются на организованных торгах на условиях поставки против платежа и на основе заявок на покупку и заявок на продажу ценных бумаг по наилучшим из указанных в них ценам при условии, что заявки адресованы всем участникам торгов, и информация, позволяющая идентифицировать подавших заявки участников торгов, не раскрывается в ходе торгов другим участникам.

3.3.2. Сделки с ценными бумагами могут совершаться без соблюдения условий, указанных в п. 3.3.1, в случаях, предусмотренных законодательством.

3.3.3. Сделки, связанные с инвестированием в облигации, совершаются, если срок погашения таких облигаций не наступил.

3.3.4. Сделки с иностранной валютой заключаются только на организованных торгах или с кредитными организациями, включенными в Приложение № 1, при условии их соответствия требованиям законодательства.

3.3.5. Сделки репо могут заключаться только на организованных торгах при условии, что контрагентом по договору репо является центральный контрагент.

4. Пенсионные резервы

Размещение средств пенсионных резервов осуществляется Фондом самостоятельно и через управляющие компании, которые управляют рыночными портфелями и активами, обязательства по которым не исполнены должником в установленный срок (далее – дефолтные активы).

4.1. Рыночные портфели под управлением УК

4.1.1. Инвестиционная стратегия и целевая доходность

4.1.1.1. Инвестиционная стратегия Фонда по размещению пенсионных резервов является умеренно-консервативной и направлена на:

- сохранность пенсионных средств;
- выполнение пенсионных обязательств;
- получение среднерыночной доходности с учетом целевых показателей инвестиций и рисков, принимаемых Фондом;

4.1.1.2. Целевая доходность по рыночному портфелю ПР на календарный год определена в размере 6,5% годовых.

4.1.2. Состав и структура активов

4.1.2.1. Для реализации инвестиционной стратегии, достижения целевых показателей инвестиций и минимизации рисков, при выборе активов (эмитентов, банков) Фонд в рамках законодательных ограничений определил самостоятельные (дополнительные) требования к разрешенным активам по пенсионным резервам (Таблица № 3).

Таблица № 3. Требования к разрешенным активам ПР

Класс разрешенных активов	Цели управления активами	Требования к активу/эмитенту/банку
ГЦБ РФ	1) получение купонного дохода; 2) получение дохода за счет роста цены облигаций; 3) повышение ликвидности инвестиционного портфеля за счет приобретения ОФЗ и/или облигаций с дюрацией менее 1 года;	1) выпущены Минфином РФ; 2) обращаются на рынке РФ; 3) наличие листинга (высшего уровня) на Московская Биржа
ГЦБ субъектов РФ	4) снижение кредитного риска по инвестиционному портфелю за счет приобретения ОФЗ и облигаций с высоким кредитным рейтингом;	1) рейтинг не ниже суверенного; 2) наличие листинга на Московская Биржа
Корпоративные облигации	5) управление дюрацией инвестиционного портфеля	1) подконтрольность государству (напрямую или опосредованно) ¹ ; 2) вхождение в Ломбардный список ЦБ РФ; 3) наличие листинга на Московская Биржа; 4) информационная прозрачность деятельности эмитента

¹ за исключением эмитента ПАО «ЛУКОЙЛ»

Депозиты и денежные средства в валюте Российской Федерации и в иностранной валюте (доллары США и Евро) в кредитных организациях	<ol style="list-style-type: none"> 1) получение процентов по депозитам; 2) получение дохода за счет изменения курса валют; 3) защита инвестиционного портфеля от рыночного риска; 4) управление ликвидностью инвестиционного портфеля 	<ol style="list-style-type: none"> 1) иностранная валюта – доллары США и Евро; 2) контролируемые государством (напрямую или опосредованно); 3) входящие в систему страхования вкладов ² 4) входящие в десять крупнейших банков РФ по активам
Акции российских АО	<ol style="list-style-type: none"> 1) получение дивидендов; 2) получение дохода за счет роста цены акций 	<ol style="list-style-type: none"> 1) наличие листинга на Московская Биржа; 2) включение в расчет индекса МосБиржи; 3) информационная прозрачность деятельности эмитента

4.1.2.2. Фонд с целью контроля за рисками и инвестициями определяет закрытый поименный список эмитентов ценных бумаг и банков, который указан в Приложении № 2.

4.1.2.3. Фонд в рамках законодательных требований к структуре инвестиционного портфеля пенсионных резервов с учетом целевой доходности и рисков, а также необходимой диверсификации активов, устанавливает:

1) целевую структуру активов (Таблица № 4):

Таблица № 4. Целевая структура активов ПР

Вид актива	Доля, % от портфеля
ГЦБ РФ и ГЦБ субъектов РФ	30
Корпоративные облигации	55
Акции российских АО	5
Депозиты и денежные средства в валюте РФ и иностранной валюте	10
ИТОГО портфель	100

2) самостоятельные (дополнительные) требования к структуре в виде предельных значений долей (допустимых отклонений от целевой структуры активов):

- по классам активов,
- по каждому эмитенту (банку),

² за исключением НКО НКЦ

- по группам связанных эмитентов (юридических лиц),
 - по отраслям (секторам),
- которые указаны в Приложении № 2.

4.1.2.4. Порядок выявления нарушений (отклонений) по ПР (по инвестиционному портфелю УК по договору доверительного управления) по составу и/или структуре, определения сроков устранения (указанных в договоре доверительного управления или установленных законодательством) и необходимых мер воздействия на УК, в том числе пересмотра условий договоров доверительного управления (включая пересмотр инвестиционной декларации, размера вознаграждения УК) или расторжения указанных договоров, определяется внутренними документами Фонда и договором доверительного управления с УК.

4.1.3. Виды допустимых сделок

4.1.3.1. Сделки с разрешенными активами при управлении рыночным портфелем ПР совершаются на организованных торгах на условиях поставки против платежа и на основе заявок на покупку и заявок на продажу ценных бумаг по наилучшим из указанных в них ценам при условии, что заявки адресованы всем участникам торгов, и информация, позволяющая идентифицировать подавших заявки участников торгов, не раскрывается в ходе торгов другим участникам.

4.1.3.2. Сделки с ценными бумагами могут совершаться без соблюдения условий, указанных в п. 4.1.3.1, в случаях, предусмотренных законодательством.

4.1.3.3. Сделки, связанные с инвестированием в облигации, совершаются, если срок погашения таких облигаций не наступил.

4.1.3.4. Сделки с иностранной валютой заключаются только на организованных торгах или с кредитными организациями, включенными в Приложение № 2, при условии их соответствия требованиям законодательства.

4.1.3.5 Сделки репо могут заключаться только на организованных торгах при условии, что контрагентом по договору репо является центральный контрагент.

4.2. Инвестиции Фонда в инвестиционные паи закрытых паевых инвестиционных фондов

4.2.1. Инвестиционная стратегия

Стратегия Фонда по размещению средств ПР в инвестиционные паи закрытых паевых инвестиционных фондов (далее – ЗПИФ) направлена на:

- сохранность пенсионных средств;
- снижение вложений Фонда в паи ЗПИФ в составе инвестиционного портфеля ПР за счет частичного погашения паев и ликвидации ЗПИФ;
- реализацию строительных проектов на земельных участках, права на которые принадлежат Группе АО «Ханты-Мансийский НПФ» на дату утверждения данной редакции Порядка.¹

Приоритетной задачей управления имуществом ЗПИФ в составе пенсионных резервов Фонда является увеличение ликвидности имущества паевых инвестиционных фондов для обеспечения погашения инвестиционных паев.

В Приложении № 2 устанавливаются закрытый список ЗПИФ и индивидуальные лимиты по каждому ЗПИФ, инвестиционные паи которых входят в пенсионные резервы Фонда, а также ограничения на совокупную долю паев ЗПИФ.

4.2.2. Состав и структура имущества ЗПИФ

4.2.2.1. Для реализации стратегии Фонда по размещению средств ПР в инвестиционные паи ЗПИФ, обеспечения ликвидности и минимизации рисков по

¹ термин Группа используется в значении, соответствующем Международным стандартам финансовой отчетности (МСФО), введенным в действие на территории Российской Федерации Приказом Минфина России от 28.12.2015 N 217н.

данным инвестициям, Фонд в рамках законодательных ограничений определил для каждой категории ЗПИФ самостоятельные (дополнительные) требования к имуществу.

4.2.2.2. Требования Фонда к имуществу ЗПИФ состоят из индивидуальных требований в зависимости от специфики каждой категории ЗПИФ (Таблица № 5) и общих требований (Таблица № 6) для рыночных активов, которые могут входить в состав всех ЗПИФ.

Таблица № 5. Индивидуальные требования к имуществу ЗПИФ

Категория ЗПИФ	Вид имущества	Цели управления имуществом	Требования к имуществу ЗПИФ
Комбинированный фонд	Денежные требования по кредитным договорам или договорам займа, исполнение обязательств по которым обеспечено залогом (за исключением последующего залога), поручительством или банковской гарантией	1) получение % по договорам займа/ кредитным договорам; 2) финансирование проектов на территории автономного округа с учетом требований п. 4.2.1. Порядка	1) могут входить только денежные требования по кредитным договорам или договорам займа, денежные средства по которым направляются на финансирование инвестиционных проектов на территории автономного округа, а также денежные требования, находящиеся в составе имущества ЗПИФ, на дату утверждения Порядка; 2) денежные средства по договорам займов выдаются только организациям, входящим в Группу АО «Ханты-Мансийский НПФ»
	Доли российских обществ с ограниченной ответственностью		Доли ООО и непубличных АО могут быть в составе активов только в отношении организаций, входящих в Группу АО «Ханты-Мансийский НПФ»
	Акции российских непубличных АО		
	Недвижимое имущество и право аренды недвижимого имущества		Недвижимое имущество и ДУДС могут быть приобретены только у организаций, входящих в Группу АО «Ханты-Мансийский НПФ»
	Имущественные права из договоров участия в долевом строительстве объектов недвижимого имущества, заключенных в соответствии с Федеральным законом от 30.12.2004 № 214-ФЗ «Об участии в		

	<p>долевом строительстве многоквартирных домов и иных объектов недвижимости и о внесении изменений в некоторые законодательные акты Российской Федерации» (далее – ДУДС);</p>		
	<p>Дебиторская задолженность, в том числе текущая, просроченная и/или пролонгированная, возникшая из обязательств по договорам купли-продажи, мены, аренды, подряда, возмездного оказания услуг, займа, кредитного договора, договора участия в долевом строительстве, договора финансирования под уступку денежного требования, банковского вклада, или из смешанного договора, в котором содержатся элементы различных из указанных в настоящем пункте договоров, а так же в результате регресса или по отступному</p>		<p>Дебиторская задолженность может приобретаться только у организаций, входящих в Группу АО «Ханты-Мансийский НПФ» и только в отношении организаций-должников, входящих в Группу АО «Ханты-Мансийский НПФ»</p>
<p>Фонд недвижимости</p>	<p>Недвижимое имущество и права аренды недвижимого имущества</p>	<p>1) получение дохода от продажи недвижимости;</p>	<p>1) могут входить только недвижимое имущество, права аренды недвижимого имущества и имущественные</p>

	Имущественные права из ДУДС	2) получение дохода от сдачи в аренду недвижимости; 3) финансирование строительных проектов на территории автономного округа с учетом требований п. 4.2.1. Порядка	права из ДУДС, находящиеся на территории автономного округа, а также недвижимое имущество, права аренды недвижимого имущества, имущественные права из ДУДС, находящиеся в составе ЗПИФ или которые будут находиться в составе ЗПИФ по договорным отношениям, заключенным на дату утверждения Порядка
Рентный фонд	Недвижимое имущество и права аренды недвижимого имущества	1) получение дохода от сдачи в аренду недвижимости; 2) получение дохода от продажи недвижимости	1) могут входить только недвижимое имущество и права аренды недвижимого имущества, находящегося на территории автономного округа

Таблица № 6. Требования к рыночным активам в составе имущества ЗПИФ

Вид имущества	Цели управления имуществом	Требования к имуществу ЗПИФ
ГЦБ РФ	1) получение купонного дохода; 2) получение дохода за счет роста цены облигаций; 3) повышение ликвидности инвестиционного портфеля за счет приобретения ОФЗ и/или облигаций с дюрацией менее 1 года;	1) выпущены Минфином РФ; 2) обращаются на рынке РФ; 3) наличие листинга (высшего уровня) на Московская Биржа
ГЦБ субъектов РФ	4) снижение кредитного риска по инвестиционному портфелю за счет приобретения ОФЗ и облигаций с высоким кредитным рейтингом;	1) рейтинг не ниже суверенного; 2) наличие листинга на Московская Биржа
Корпоративные облигации	5) управление дюрацией инвестиционного портфеля	1) подконтрольность государству (напрямую или опосредованно); ¹ 2) вхождение в Ломбардный список ЦБ РФ; 3) наличие листинга на Московская Биржа; 4) информационная прозрачность деятельности эмитента

¹ за исключением эмитента ПАО «ЛУКОЙЛ»

Депозиты и денежные средства в кредитных организациях	1) получение процентов по депозитам; 2) защита инвестиционного портфеля от рыночного риска; 3) управление ликвидностью инвестиционного портфеля	1) контролируемые государством (напрямую или опосредованно); 2) входящие в пять крупнейших банков РФ по активам
-------------------------------------------------------	-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

Фонд с целью контроля за рисками и инвестициями по рыночным активам, определяет закрытый поименный список эмитентов ценных бумаг и банков, входящих в имущество ЗПИФ, полный состав которого указан для каждой категории паевого инвестиционного фонда в Приложениях №№ 3-5.

4.2.2.3. Фонд в рамках законодательных требований к структуре активов паевых инвестиционных фондов с учетом необходимой ликвидности и диверсификации активов, устанавливает самостоятельные (дополнительные) требования к структуре в виде предельных значений долей:

- по классам активов,
- по каждому эмитенту (банку),

входящих в состав имущества ЗПИФ, по каждой категории паевого инвестиционного фонда, которые указаны в Приложениях №№ 3-5.

4.2.3. Виды сделок и дополнительные требования Фонда по сделкам с инвестиционными паями

4.2.3.1. Не допускается приобретение инвестиционных паев любых паевых инвестиционных фондов.

4.2.3.2. В целях сохранения контроля Фонда за имущественным комплексом в ЗПИФ и недопущения убыточной реализации паев, продажа инвестиционных паев не допускается.

4.2.4. План снижения инвестиций в инвестиционные паи ЗПИФ

4.2.4.1. В целях реализации завершающего этапа мероприятий по снижению инвестиций в инвестиционные паи ЗПИФ в составе инвестиционного портфеля ПР Фондом осуществляется переход от частичного погашения инвестиционных паев к следующей стадии - ликвидации ЗПИФ.

4.2.4.2. К 01.01.2024г. в составе инвестиционного портфеля ПР останутся инвестиционные паи следующих ЗПИФов:

- ЗПИФ недвижимости «Югра», в составе имущества которого находится недвижимость для целей ее последующей продажи;
- ЗПИФ комбинированный «Югра-комбинированный», в составе имущества которого находятся денежные требования по займам или денежные средства для завершения строительных проектов Группы АО «Ханты-Мансийский НПФ».

4.3. Дефолтные активы

4.3.1. Управление дефолтными активами

4.3.1.1. Цель управления дефолтными активами – проведение (осуществление) мероприятий, направленных на погашение активов, приобретенных Фондом до финансового кризиса 2008-2009 годов, обязательства по которым не были исполнены должником в установленный срок, путем взыскания задолженности, применение судебных процедур (в том числе в рамках дел о банкротстве) и иных, предусмотренных законодательством РФ, мер.

4.3.1.2. По задолженности ООО «ХАНТЫ-МАНСИЙСК СТРОЙРЕСУРС» определен особый порядок погашения, который устанавливается между должниками, кредиторами и Фондом в отдельном соглашении.

5. Собственные средства

5.1. Цель размещения

Размещение СС Фонда направлено на:

- сохранность средств;
- получение среднерыночной доходности при инвестировании свободных средств;
- обеспечение текущей деятельности и развития Фонда;
- выполнение законодательных требований к собственным средствам негосударственных пенсионных фондов.

5.2. Состав и структура собственных средств

5.2.1. Состав и структура СС определяются Приложением № 6 к Порядку.

5.3. Виды допустимых сделок

5.3.1. Сделки с ценными бумагами из списка, установленного в Приложении №6 к Порядку, совершаются на организованных торгах на условиях поставки против платежа и на основе заявок на покупку и заявок на продажу ценных бумаг по наилучшим из указанных в них ценам при условии, что заявки адресованы всем участникам торгов, и информация, позволяющая идентифицировать подавших заявки участников торгов, не раскрывается в ходе торгов другим участникам.

5.3.2. Сделки репо могут заключаться только на организованных торгах при условии, что контрагентом по договору репо является центральный контрагент, имеющий рейтинг долгосрочной кредитоспособности не ниже уровня, установленного Советом директоров Банка России, но не более 15% от инвестиционного портфеля СС.

6. Ограничения по рискам

6.1. Ограничения рисков

6.1.1. В целях минимизации и контроля рисков, для каждого портфеля Фонда (ПР, ПН, СС, ЗПИФ) Порядок устанавливает следующие виды ограничений, которые указаны в Приложениях:

- ограничения по допустимым видам сделок;
- ограничения структуры активов, составляющих инвестиционный портфель;
- ограниченный поименный список эмитентов ценных бумаг и банков, в которые разрешено размещать средства Фонда;
- ограничения суммарной доли по отраслям эмитентов акций;
- ограничения суммарной доли по группам связанных эмитентов (юридических лиц);
- ограничения по объему вложений в ценные бумаги одного эмитента.

6.1.2. Для ограничения рыночного (процентного) риска вводятся дополнительные ограничения по средневзвешенной дюрации долговых ценных бумаг, входящих в портфель ПР и ПН Фонда:

- по государственным ценным бумагам и государственным ценным бумагам субъектов РФ – не более 7 лет;
- по облигациям российских эмитентов/облигациям российских хозяйственных обществ (помимо государственных ценных бумаг РФ, субъектов РФ) – не более 5 лет.

6.1.3. С целью обеспечения возможности реализации (продажи) активов из состава инвестиционного портфеля ПР и ПН Фонда по цене, близкой к рыночной, настоящим Порядком устанавливаются дополнительные требования к ликвидности: не менее 5% рыночной стоимости инвестиционного портфеля ПР и ПН Фонда должны составлять ликвидные активы.

Ликвидными признаются активы при соблюдении следующих условий:

- денежные средства на банковских счетах в полном объеме;
- сумма банковского депозита в полном объеме, если дата погашения приходится на срок, не превышающий три месяца от текущей даты;
- позиция в ценных бумагах в объеме, не превышающем 30% от объема торгов на Московская Биржа с данным выпуском за последний календарный месяц, либо в полном объеме, если дата погашения или безотзывной оферты приходится на срок, не превышающий один месяц от текущей даты.

6.2. Порядок выявления/устранения нарушений по ограничению рисков

Контроль соблюдения установленных ограничений рисков осуществляется в рамках организации инвестиционного контроля Фонда. Выявление, проверка и разработка (определение) необходимых мероприятий по устранению нарушений по ограничению рисков Фондом (управляющими компаниями) и недопущению аналогичных нарушений в дальнейшей деятельности осуществляются в порядке, предусмотренном внутренними документами Фонда.

7. Заключительные положения

7.1. Порядок вступает в силу с даты его утверждения Советом директоров Фонда.

7.2. Фонд обязан привести состав и структуру активов в соответствие с требованиями настоящей редакции Порядка в течение 3-х месяцев с даты ее утверждения.

7.3. При изменении законодательных требований (ограничений), которые приводят к противоречию с условиями Порядка, Порядок применяется в части, не противоречащей законодательным требованиям (ограничениям), соответствующие поправки вносятся в Порядок в течение 3-х месяцев.

7.4. Изменения в Порядок, в том числе в Инвестиционные декларации, представленные в приложениях к Порядку, утверждаются решением Совета директоров Фонда по представлению Президента Фонда.

**Инвестиционная декларация
АО «Ханты-Мансийский НПФ» для инвестирования
средств пенсионных накоплений**

№	Направления инвестирования	Предельное значение, %
1.	Денежные средства на банковских счетах (включая средства на специальных брокерских счетах), включая банковские депозиты, в рублях РФ	80
2.	Денежные средства на банковских счетах в долларах США и Евро, включая банковские депозиты в долларах США и Евро	25
3.	Государственные ценные бумаги РФ	100¹
3.1.	Министерство финансов РФ	100
4.	Государственные ценные бумаги субъектов РФ	30
4.1.	Правительство Москвы	10
4.2.	Комитет финансов Ленинградской области	10
4.3.	Министерство экономики и финансов Московской области	10
5.	Облигации российских эмитентов²	80
5.1.	ПАО «Газпром»	10
5.2.	ООО «Газпром капитал» ³	10
5.3.	ПАО «Газпром нефть»	10
5.4.	Банк ГПБ (АО)	10
5.5.	ОАО «РЖД»	10
5.6.	Банк ВТБ (ПАО)	10
5.7.	АО «ДОМ.РФ»	10
5.8.	ПАО «НК «Роснефть»	10
5.9.	ПАО «Ростелеком»	10
5.10.	ПАО «РусГидро»	10
5.11.	ПАО «ФСК ЕЭС»	10
5.12.	ПАО «ГТЛК»	10
5.13.	ПАО «Транснефть»	10
5.14.	ПАО «ЛУКОЙЛ»	10
5.15.	ПАО Сбербанк	10
5.16.	АО «Россельхозбанк»	10
5.17.	ПАО АНК «Башнефть»	10
5.18.	Государственная компания «Автодор»	10
5.19.	АО «ФПК»	10
5.20.	АО «Почта России»	10
5.21.	ПАО «Россети Московский регион»	10
5.22.	ПАО «Россети»	10
6.	Банковские депозиты (в рублях РФ, долларах США и Евро)	30
6.1.	ПАО Сбербанк	10
6.2.	Банк ГПБ (АО)	10
6.3.	Банк ВТБ (ПАО)	10
6.4.	АО «Россельхозбанк»	10
7.	Акции российских акционерных обществ	40
7.1.	Нефтегазовая отрасль	20
7.1.1.	ПАО «ЛУКОЙЛ»	5
7.1.2.	ПАО «НОВАТЭК»	5
7.1.3.	ПАО «Газпром»	5
7.1.4.	ПАО «НК «Роснефть»	5

7.2.	Электроэнергетика	5
7.2.1.	ПАО «РусГидро»	5
7.3.	Телекоммуникации	10
7.3.1.	ПАО «Ростелеком»	5
7.3.2.	ПАО «МТС»	5
7.4.	Банковский сектор	10
7.4.1.	ПАО Сбербанк	5
7.4.2.	Банк ВТБ (ПАО)	5
7.5.	Прочие отрасли	15
7.5.1.	ПАО «ГМК «Норильский никель»	5
7.5.2.	ПАО «Магнит»	5
7.5.3.	ПАО «Северсталь»	5

¹ максимальная доля государственных ценных бумаг РФ одного выпуска – не более 35% от средств пенсионных накоплений.

² помимо государственных ценных бумаг РФ, государственных ценных бумаг субъектов РФ и субординированных облигаций.

³ при наличии поручительства ПАО «Газпром».

При реорганизации, изменении наименования или организационно-правовой формы юридического лица (эмитента / банка), все установленные в Инвестиционной декларации нормативы в отношении данного юридического лица сохраняются.

**Инвестиционная декларация
АО «Ханты-Мансийский НПФ» для размещения
средств пенсионных резервов**

№	Направления размещения	Предельное значение, %
1.	Денежные средства на банковских счетах в рублях РФ	30
2.	Денежные средства на банковских счетах в долларах США и Евро, включая банковские депозиты в долларах США и Евро	25
3.	Государственные ценные бумаги РФ	100¹
3.1.	Министерство финансов РФ	100
4.	Государственные ценные бумаги субъектов РФ	30
4.1.	Правительство Москвы	10
4.2.	Комитет финансов Ленинградской области	10
4.3.	Министерство экономики и финансов Московской области	10
5.	Облигации российских эмитентов	100
5.1.	ПАО «Газпром»	10
5.2.	ООО «Газпром капитал» ²	10
5.3.	ПАО «Газпром нефть»	10
5.4.	Банк ГПБ (АО)	10
5.5.	ОАО «РЖД»	12 ³
5.6.	Банк ВТБ (ПАО)	10
5.7.	АО «ДОМ.РФ»	12 ³
5.8.	ПАО «НК «Роснефть»	12 ³
5.9.	ПАО «Ростелеком»	10
5.10.	ПАО «РусГидро»	10
5.11.	ПАО «ФСК ЕЭС»	10
5.12.	ПАО «ГТЛК»	10
5.13.	ПАО «Транснефть»	10
5.14.	ПАО «ЛУКОЙЛ»	10
5.15.	ПАО Сбербанк	12 ³
5.16.	АО «Россельхозбанк»	10
5.17.	ПАО АНК «Башнефть»	10
5.18.	Государственная компания «Автодор»	10
5.19.	АО «ФПК»	10
5.20.	АО «Почта России»	10
5.21.	ПАО «Россети Московский регион»	10
5.22.	ПАО «Россети»	10
6.	Банковские депозиты (в рублях РФ, долларах США и Евро)	30
6.1.	ПАО Сбербанк	12 ⁴
6.2.	Банк ГПБ (АО)	12 ⁴
6.3.	Банк ВТБ (ПАО)	12 ⁴
6.4.	НКО НКЦ (АО)	12 ⁴
6.5.	АО «Россельхозбанк»	12 ⁴
7.	Инвестиционные паи ЗПИФ⁵	30
7.1.	Паи ЗПИФ недвижимости «Проектный»	10
7.2.	Паи ЗПИФ недвижимости «Югра»	10
7.3.	Паи ЗПИФ рентный «Югра Рентный Фонд»	10

7.4.	Паи ЗПИФ комбинированный «Югра-комбинированный»	10
8.	Акции российских эмитентов	40
8.1.	Нефтегазовая отрасль	35
8.1.1.	ПАО «Газпром»	7 ⁶
8.1.2.	ПАО «ЛУКОЙЛ»	7 ⁶
8.1.3.	ПАО «Сургутнефтегаз»	5
8.1.4.	ПАО «НК «Роснефть»	5
8.1.5.	ПАО «НОВАТЭК»	5
8.2.	Электроэнергетика	5
8.2.1.	ПАО «РусГидро»	5
8.3.	Телекоммуникации	15
8.3.1.	ПАО «Ростелеком»	5
8.3.2.	ПАО «МТС»	7 ⁶
8.4.	Банковский сектор	15
8.4.1.	ПАО Сбербанк	7 ⁶
8.4.2.	Банк ВТБ (ПАО)	5
8.5.	Прочие отрасли	25
8.5.1.	ПАО «ГМК «Норильский никель»	7 ⁶
8.5.2.	ПАО «Магнит»	5
8.5.3.	ПАО «Северсталь»	7 ⁶

¹ максимальная доля государственных ценных бумаг РФ одного выпуска – не более 35% от средств пенсионных резервов.

² при наличии поручительства ПАО «Газпром».

³ максимальная доля ценных бумаг одного эмитента с 01.07.2023г. – не более 11%, с 01.01.2024г. – не более 10%. Не допускается увеличение доли ценных бумаг одного эмитента свыше 10% путем их приобретения.

⁴ максимальная доля денежных средств на счетах и в депозитах одной кредитной организации с 01.07.2023г. – не более 11%, с 01.01.2024г. – не более 10%. Не допускается увеличение доли денежных средств и депозитов в одной кредитной организации свыше 10% путем открытия новых депозитов/размещения денежных средств на счетах в данной кредитной организации.

⁵ максимальная доля инвестиционных паев одного паевого инвестиционного фонда с 01.01.2024г. – не более 10% активов, и не более 7% активов при приобретении инвестиционных паев (с учетом приобретаемых), с 01.01.2025г. – не более 7% активов.

⁶ максимальная доля акций одного эмитента с 01.07.2023г. – не более 6%, с 01.01.2024г. – не более 5%. Не допускается увеличение доли акций одного эмитента свыше 5% путем их приобретения.

При реорганизации, изменении наименования или организационно-правовой формы юридического лица (эмитента / банка), все установленные в Инвестиционной декларации нормативы в отношении данного юридического лица сохраняются.

**Инвестиционная декларация
для Закрытых паевых инвестиционных фондов недвижимости, в инвестиционные
паи которых размещены средства пенсионных резервов
АО «Ханты-Мансийский НПФ»**

№	Направления размещения	Предельное значение, %
1.	Денежные средства на банковских счетах	100
2.	Недвижимое имущество и право аренды недвижимого имущества¹	100
3.	Банковские депозиты	75
3.1.	ПАО Сбербанк	25
3.2.	Банк ГПБ (АО)	25
3.3.	Банк ВТБ (ПАО)	25
4.	Имущественные права из договоров участия в долевом строительстве объектов недвижимого имущества, заключенных в соответствии с Федеральным законом от 30.12.2004 № 214-ФЗ¹	100
5.	Государственные ценные бумаги РФ	100
5.1.	Министерство финансов РФ	100
6.	Государственные ценные бумаги субъектов РФ	30
6.1.	Правительство Москвы	10
6.2.	Комитет финансов Ленинградской области	10
6.3.	Правительство Ханты-Мансийского автономного округа – Югры	10
7.	Облигации российских хозяйственных обществ	60
7.1.	ПАО «Газпром»	10
7.2.	ОАО «РЖД»	10
7.3.	ПАО «ЛУКОЙЛ»	10
7.4.	АО «ДОМ.РФ»	10
7.5.	ПАО «НК «Роснефть»	10
7.6.	ПАО «Ростелеком»	10

¹ только недвижимое имущество, права аренды недвижимого имущества и имущественные права из ДУДС, находящиеся на территории Ханты-Мансийского автономного округа-Югры, а также недвижимое имущество, права аренды недвижимого имущества, имущественные права из ДУДС, находящиеся в составе ЗПИФ или которые будут находиться в составе ЗПИФ по договорным отношениям, заключенным на момент утверждения настоящего Порядка.

При реорганизации, изменении наименования или организационно-правовой формы юридического лица (эмитента / банка), все установленные в Инвестиционной декларации нормативы в отношении данного юридического лица сохраняются.

**Инвестиционная декларация
для Закрытых паевых инвестиционных рентных фондов, в инвестиционные паи
которых размещены средства пенсионных резервов
АО «Ханты-Мансийский НПФ»**

№	Направления размещения	Предельное значение, %
1.	Денежные средства на банковских счетах	100
2.	Недвижимое имущество и право аренды недвижимого имущества¹	100
3.	Банковские депозиты	75
3.1.	ПАО Сбербанк	25
3.2.	Банк ГПБ (АО)	25
3.3.	Банк ВТБ (ПАО)	25
4.	Государственные ценные бумаги РФ	100
4.1.	Министерство финансов РФ	100
5.	Государственные ценные бумаги субъектов РФ	30
5.1.	Правительство Москвы	10
5.2.	Комитет финансов Ленинградской области	10
5.3.	Правительство Ханты-Мансийского автономного округа –Югры	10
6.	Облигации российских хозяйственных обществ	40
6.1.	ПАО «Газпром»	10
6.2.	ОАО «РЖД»	10
6.3.	ПАО «ЛУКОЙЛ»	10
6.4.	АО «ДОМ.РФ»	10
6.5.	ПАО «НК «Роснефть»	10
6.6.	ПАО «Ростелеком»	10

¹ только недвижимое имущество и права аренды недвижимого имущества, находящегося на территории Ханты-Мансийского автономного округа-Югры.

При реорганизации, изменении наименования или организационно-правовой формы юридического лица (эмитента / банка), все установленные в Инвестиционной декларации нормативы в отношении данного юридического лица сохраняются.

**Инвестиционная декларация
для Закрытых паевых инвестиционных комбинированных фондов, в
инвестиционные паи которых размещены средства пенсионных
резервов АО «Ханты-Мансийский НПФ»**

№	Направления размещения	Предельное значение, %
1.	Денежные средства на банковских счетах	100
2.	Банковские депозиты	80
2.1.	ПАО Сбербанк	25
2.2.	Банк ГПБ (АО)	25
2.3.	Банк ВТБ (ПАО)	25
2.4.	АО «Россельхозбанк»	5
3.	Акции российских акционерных обществ¹	100
4.	Государственные ценные бумаги РФ	50
4.1.	Министерство финансов РФ	50
5.	Государственные ценные бумаги субъектов РФ	20
5.1.	Правительство Москвы	10
5.2.	Комитет финансов Ленинградской области	10
6.	Облигации российских хозяйственных обществ	80
6.1.	ПАО «Газпром»	10 ¹
6.2.	ООО «Газпром капитал» (не более 5%) ²	
6.3.	ПАО «Газпром нефть»	10
6.4.	Банк ГПБ (АО)	10
6.5.	ОАО «РЖД»	10
6.6.	Банк ВТБ (ПАО)	10
6.7.	АО «ДОМ.РФ»	10
6.8.	ПАО «НК «Роснефть»	10
6.9.	ПАО «Ростелеком»	10
6.10.	ПАО «РусГидро»	10
6.11.	ПАО «ФСК ЕЭС»	10
6.12.	ПАО «ГТЛК»	10
6.13.	ПАО «Транснефть»	10
6.14.	ПАО «ЛУКОЙЛ»	10
6.15.	ПАО Сбербанк	10
6.16.	АО «Россельхозбанк»	10
7.	Денежные требования по кредитным договорам или договорам займа, исполнение обязательств по которым обеспечено залогом (за исключением последующего залога), поручительством или банковской гарантией	100
8.	Имущество (в том числе имущественные права), являвшееся предметом залога и приобретенное (оставленное за собой) в соответствии с гражданским законодательством Российской Федерации при обращении на него взыскания в случае неисполнения или ненадлежащего исполнения обеспеченного залогом обязательства, денежное требование по которому составляют активы фонда ³	100
9.	Доли российских обществ с ограниченной ответственностью	100

10.	Недвижимое имущество и право аренды недвижимого имущества	100
11.	Имущественные права из ДУДС	100
12.	Дебиторская задолженность, в том числе текущая, просроченная и/или пролонгированная, возникшая из обязательств по договорам купли-продажи, мены, аренды, подряда, возмездного оказания услуг, займа, кредитного договора, договора участия в долевом строительстве, договора финансирования под уступку денежного требования, банковского вклада, или из смешанного договора, в котором содержатся элементы различных из указанных в настоящем пункте договоров, а так же в результате регресса или по отступному	100
13.	Уличные светодиодные экраны	5

¹ общая максимальная доля для группы связанных эмитентов.

² при наличии поручительства ПАО «Газпром».

³ в состав имущественных прав по обязательствам из договоров займа могут входить займы, выданные на финансирование проектов на территории Ханты-Мансийского автономного округа-Югры, а также имущественные права, находящиеся в составе имущества ПИФ, на момент утверждения настоящего Порядка.

При реорганизации, изменении наименования или организационно-правовой формы юридического лица (эмитента / банка), все установленные в Инвестиционной декларации нормативы в отношении данного юридического лица сохраняются.

**Инвестиционная декларация АО «Ханты-Мансийский НПФ»
для размещения собственных средств**

№	Направления инвестирования	Предельное значение, %
1.	Денежные средства на банковских счетах (включая средства на специальных брокерских счетах), включая банковские депозиты, в рублях РФ ¹	100
2.	Денежные средства на банковских счетах в долларах США и Евро, включая банковские депозиты в долларах США и Евро*	25
3.	Государственные ценные бумаги РФ	100
3.1.	Министерство финансов РФ	100
4.	Государственные ценные бумаги субъектов РФ	100
4.1.	Правительство Москвы	50
4.2.	Комитет финансов Ленинградской области	50
4.3.	Министерство экономики и финансов Московской области	50
5.	Облигации российских эмитентов	100
5.1.	ОАО «РЖД»	50
5.2.	АО «ДОМ.РФ»	50
5.3.	ПАО «НК «Роснефть»	50
5.4.	ПАО «Ростелеком»	50
5.5.	ПАО «РусГидро»	50
5.6.	ПАО «ФСК ЕЭС»	50
5.7.	ПАО «ГТЛК»	50
5.8.	ПАО «Транснефть»	50
5.9.	ПАО Сбербанк	50
5.10.	АО «Россельхозбанк»	50
5.11.	ПАО АНК «Башнефть»	50
5.12.	Государственная компания «Автодор»	50
5.13.	АО «ФПК»	50
5.14.	АО «Почта России»	50
5.15.	ПАО «Россети Московский регион»	50
5.16.	ПАО «Россети»	50
6.	Банковские депозиты (в рублях РФ, долларах США и Евро)	100
6.1.	ПАО Сбербанк	100
6.2.	АО «Россельхозбанк»	100
7.	Акции российских акционерных обществ	20
7.1.	Нефтегазовая отрасль	15
7.1.1.	ПАО «ЛУКОЙЛ»	5
7.1.2.	ПАО «НОВАТЭК»	5
7.1.4.	ПАО «НК «Роснефть»	5
7.2.	Электроэнергетика	5
7.2.1.	ПАО «РусГидро»	5
7.3.	Телекоммуникации	10
7.3.1.	ПАО «Ростелеком»	5
7.3.2.	ПАО «МТС»	5
7.4.	Банковский сектор	5
7.4.1.	ПАО Сбербанк	5
7.5.	Прочие отрасли	15

7.5.1.	ПАО «ГМК «Норильский никель»	5
7.5.2.	ПАО «Магнит»	5
7.5.3	ПАО «Северсталь»	5
8.	Ценные бумаги, доли в обществах с ограниченной ответственностью, депозиты и недвижимость, находящиеся в составе имущества Фонда на момент утверждения Порядка	100

¹ денежные средства на расчетных счетах (включая средства на специальных брокерских счетах) в кредитных организациях, не являющихся аффилированными лицами Фонда, управляющей компании, специализированного депозитария и/или актуария Фонда.

При реорганизации, изменении наименования или организационно-правовой формы юридического лица (эмитента / банка), все установленные в Инвестиционной декларации нормативы в отношении данного юридического лица сохраняются.

Пролито, пронумеровано 24 (двадцать четыре) лист (а, ов)
Председатель Совета директоров
АО «Ханты-Мансийский НПФ»  А.М. Белов