

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	40
Акции российских АО	5
Депозиты и денежные средства в валюте РФ и иностранной валюте	25
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. 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.

(доллары США и Евро) в кредитных организациях		
Акции российских АО	1) получение дивидендов; 2) получение дохода за счет роста цены акций	1) наличие листинга на ММВБ; 2) включение в расчет индекса ММВБ; 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	40
Акции российских АО	5
Депозиты и денежные средства в валюте РФ и иностранной валюте	25
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 № 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.

4.2. 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;
- сокращение доли инвестиционных паев до 22% от ПР Фонда к концу 1-го квартала 2021 года;
- реализацию строительных проектов на земельных участках, права на которые принадлежат Группе АО «Ханты-Мансийский НПФ» на дату утверждения данной редакции Порядка.³

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

В Приложении № 2 устанавливаются закрытый список ЗПИФов, инвестиционные паи которых входят в пенсионные резервы Фонда, а также ограничения на совокупную долю паев ЗПИФов.

4.2.2. Состав и структура имущества ЗПИФов

4.2.2.1. Для реализации стратегии Фонда по размещению средств ПР в инвестиционные паи ЗПИФов, обеспечения ликвидности и минимизации рисков по данным инвестициям, Фонд в рамках законодательных ограничений определил для каждой категории ЗПИФа самостоятельные (дополнительные) требования к имуществу.

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

Таблица № 5. Индивидуальные требования к имуществу ЗПИФов

Категория ЗПИФа	Вид имущества	Цели управления имуществом	Требования к имуществу ЗПИФа
Комбинированный фонд	Денежные требования по кредитным договорам или договорам займа, исполнение обязательств по которым обеспечено	1) получение % по договорам займа/ кредитным договорам; 2) финансирование проектов на	1) могут входить только денежные требования по кредитным договорам или договорам займа, денежные средства по которым направляются на финансирование инвестиционных проектов на

³ 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.