

**ЦЕНТРАЛЬНЫЙ БАНК РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
(БАНК РОССИИ)**

« ___ » _____ 2018 г.

№ _____

г. Москва

У К А З А Н И Е

О внесении изменений в Положение Банка России от 1 марта 2017 года № 580-П «Об установлении дополнительных ограничений на инвестирование средств пенсионных накоплений негосударственного пенсионного фонда, осуществляющего обязательное пенсионное страхование, случаев, когда управляющая компания, действуя в качестве доверительного управляющего средствами пенсионных накоплений, вправе заключать договоры репо, требований, направленных на ограничение рисков, при условии соблюдения которых такая управляющая компания вправе заключать договоры, являющиеся производными финансовыми инструментами, дополнительных требований к кредитным организациям, в которых размещаются средства пенсионных накоплений и накопления для жилищного обеспечения военнослужащих, а также дополнительного требования, которое управляющая компания обязана соблюдать в период действия договора доверительного управления средствами пенсионных накоплений для финансирования накопительной пенсии»

1. На основании статьи 24¹ и пункта 11 статьи 36¹⁵ Федерального закона от 7 мая 1998 года № 75-ФЗ «О негосударственных пенсионных фондах» (Собрание законодательства Российской Федерации, 1998, № 19, ст. 2071; 2001, № 7, ст. 623; 2002, № 12, ст. 1093; 2003, № 2, ст. 166; 2004, № 49, ст. 4854; 2005, № 19, ст. 1755; 2006, № 43, ст. 4412; 2007, № 50, ст. 6247; 2008, № 18, ст. 1942; № 30, ст. 3616; 2009, № 29, ст. 3619; № 48, ст. 5731; № 52, ст. 6450, ст. 6454; 2010, № 17, ст. 1988; № 31, ст. 4196; 2011, № 29, ст. 4291; № 48, ст. 6728; № 49, ст. 7036, ст. 7037, ст. 7040, ст. 7061; 2012, № 31, ст. 4322; № 47, ст. 6391; № 50, ст. 6965, ст. 6966; 2013, № 19, ст. 2326; № 30, ст. 4044, ст. 4084; № 49, ст. 6352; № 52, ст. 6975; 2014, № 11, ст. 1098; № 30, ст. 4219; 2015, № 27, ст. 3958, ст. 4001; № 29, ст. 4357; 2016, № 1, ст. 41, ст. 47; № 27, ст. 4225; 2017, № 31, ст. 4754, ст. 4830; 2018, № 1, ст. 66; № 11, ст. 1584) внести в Положение Банка России от 1 марта 2017 года № 580-П «Об установлении дополнительных ограничений на инвестирование средств пенсионных накоплений негосударственного пенсионного фонда, осуществляющего обязательное пенсионное страхование, случаев, когда управляющая компания, действуя в качестве доверительного управляющего средствами пенсионных накоплений, вправе заключать договоры репо, требований, направленных на ограничение рисков, при условии соблюдения которых такая управляющая компания вправе заключать договоры, являющиеся производными финансовыми инструментами, дополнительных требований к кредитным организациям, в которых размещаются средства пенсионных накоплений и накопления для жилищного обеспечения военнослужащих, а также дополнительного требования, которое управляющая компания обязана соблюдать в период действия договора доверительного управления средствами пенсионных накоплений для финансирования накопительной пенсии», зарегистрированное Министерством юстиции Российской Федерации 23 июня 2017 года № 47127, 6 сентября 2017 года № 48089, следующие изменения.

1.1. В пункте 1.1:

в подпункте 1.1.2:

в абзаце третьем слова «(за исключением процентных ставок и уровня инфляции)» исключить;

дополнить абзацем следующего содержания:

«В целях применения абзацев второго и третьего настоящего подпункта рейтинг поручителя (гаранта) по облигациям используется только в случае, если поручительством обеспечивается исполнение обязательств по таким облигациям полностью и (или) гарантией обеспечивается исполнение обязательств по таким облигациям на сумму их номинальной стоимости и процентов по ним (государственной гарантией, выданной в соответствии с бюджетным законодательством Российской Федерации, обеспечивается исполнение обязательств по таким облигациям на сумму их номинальной стоимости).»;

в абзаце третьем подпункта 1.1.3 слова «Индекса ММВБ» заменить словами «Индекса МосБиржи»;

подпункт 1.1.7 дополнить абзацем следующего содержания:

«В целях применения абзацев первого и второго настоящего пункта в случае отсутствия у кредитной организации рейтинга, присвоенного по национальной рейтинговой шкале для Российской Федерации российскими кредитными рейтинговыми агентствами, и утверждения Советом директоров Банка России в соответствии со статьей 189⁴⁹ Федерального закона от 26 октября 2002 года № 127-ФЗ «О несостоятельности (банкротстве)» (Собрание законодательства Российской Федерации, 2002, № 43, ст. 4190; 2004, № 35, ст. 3607; 2005, № 1, ст. 18, ст. 46; № 44, ст. 4471; 2006, № 30, ст. 3292; № 52, ст. 5497; 2007, № 7, ст. 834; № 18, ст. 2117; № 30, ст. 3754; № 41, ст. 4845; № 49, ст. 6079; 2008, № 30, ст. 3616; № 49, ст. 5748; 2009, № 1, ст. 4, ст. 14; № 18, ст. 2153; № 29, ст. 3632; № 51, ст. 6160; № 52, ст. 6450; 2010, № 17, ст. 1988; № 31, ст. 4188, ст. 4196; 2011, № 1, ст. 41; № 7, ст. 905; № 19, ст. 2708; № 27, ст. 3880; № 29, ст. 4301; № 30, ст. 4576; № 48, ст. 6728;

№ 49, ст. 7015, ст. 7024, ст. 7040, ст. 7061, ст. 7068; № 50, ст. 7351, ст. 7357; 2012, № 31, ст. 4333; № 53, ст. 7607, ст. 7619; 2013, № 23, ст. 2871; № 26, ст. 3207; № 27, ст. 3477, ст. 3481; № 30, ст. 4084; № 51, ст. 6699; № 52, ст. 6975, ст. 6984; 2014, № 11, ст. 1095, ст. 1098; № 30, ст. 4217; № 49, ст. 6914; № 52, ст. 7543; 2015, № 1, ст. 10, ст. 11, ст. 35; № 27, ст. 3945, ст. 3958, ст. 3967, ст. 3977; № 29, ст. 4350, ст. 4355, ст. 4362; 2016, № 1, ст. 11, ст. 27, ст. 29; № 23, ст. 3296; № 26, ст. 3891; № 27, ст. 4225, ст. 4237, ст. 4293, ст. 4305; 2017, № 1, ст. 29; № 18, ст. 2661; № 25, ст. 3596; № 31, ст. 4767, ст. 4815; № 48, ст. 7052; 2018, № 1, ст. 54) (далее – Федеральный закон «О несостоятельности (банкротстве)») плана участия Банка России в осуществлении мер по предупреждению банкротства указанной кредитной организации, в течение срока реализации указанного плана требования подпункта 2.1.3 пункта 2.1 настоящего Положения не распространяются на такую кредитную организацию, информация о гарантировании Банком России непрерывности деятельности которой размещена на официальном сайте Банка России в информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»».

1.2. В пункте 1.2:

в абзаце первом слова «, в которые средства пенсионных накоплений инвестированы до вступления в силу настоящего Положения» исключить;

в подпункте 1.2.1:

абзац первый после слов «сертификаты участия,» дополнить словами «в которые средства пенсионных накоплений инвестированы до вступления в силу настоящего Положения,»;

абзац второй исключить;

подпункт 1.2.2 дополнить словами «, в которые средства пенсионных накоплений инвестированы до вступления в силу настоящего Положения»;

подпункт 1.2.3 изложить в следующей редакции:

«1.2.3. Ипотечные сертификаты участия, в состав ипотечного покрытия которых не входят объекты незавершенного строительства, и не

соответствующие требованиям подпункта 1.2.1 настоящего пункта, в которые средства пенсионных накоплений инвестированы до вступления в силу настоящего Положения.»;

в подпункте 1.2.4:

абзац второй дополнить словами «, в которые средства пенсионных накоплений инвестированы до вступления в силу настоящего Положения»;

дополнить абзацем следующего содержания:

«Облигации, включенные в котировальный список первого (высшего) уровня хотя бы одной из российских бирж и не соответствующие требованиям подпункта 1.1.2 пункта 1.1 настоящего Положения, в которые средства пенсионных накоплений инвестированы с даты вступления в силу настоящего Положения до 1 января 2018 года.»;

дополнить подпунктом 1.2.5 следующего содержания:

«1.2.5. Облигации, не соответствующие требованиям абзаца шестого подпункта 1.1.2 пункта 1.1 настоящего Положения, в которые средства пенсионных накоплений инвестированы до 1 сентября 2018 года.».

1.3. В пункте 1.3:

в подпункте 1.3.1 после слов «подпунктах 1.3.2 – 1.3.9» дополнить словами «и 1.3.14»;

в подпункте 1.3.4 абзац четвертый исключить;

дополнить подпунктом 1.3.14 следующего содержания:

«1.3.14. Сделки с облигациями могут совершаться без соблюдения требований, указанных в подпункте 1.3.1 настоящего пункта, если такие сделки совершаются на организованных торгах на основе адресных заявок, указанных в подпункте 1.13.1 пункта 1.13 Положения Банка России от 17 октября 2014 года № 437-П «О деятельности по проведению организованных торгов», зарегистрированного Министерством юстиции Российской Федерации 30 декабря 2014 года № 35494, 16 февраля 2018 года № 50066, на условиях поставки против платежа.».

1.4. В пункте 1.4:

в подпункте 1.4.4:

абзацы первый и второй изложить в следующей редакции:

«Совокупная стоимость активов, указанных в абзацах четвертом – девятом настоящего подпункта (включая ценные бумаги, ожидаемые к получению и (или) подлежащие передаче по второй части договора репо), с учетом приобретаемых составляет не более 10 процентов стоимости инвестиционного портфеля на момент заключения сделки по приобретению таких активов, с учетом положений абзаца второго пункта 4.2 настоящего Положения.

Совокупная стоимость активов, указанных в абзацах четвертом – девятом настоящего подпункта (включая ценные бумаги, ожидаемые к получению и (или) подлежащие передаче по второй части договора репо), с учетом приобретаемых составляет не более 10 процентов стоимости инвестиционного портфеля на момент заключения сделки по приобретению таких активов и не более 10 процентов стоимости инвестиционного портфеля до момента, по состоянию на который такая стоимость составит 10 или менее процентов стоимости инвестиционного портфеля, с учетом положений абзаца пятого пункта 4.1 настоящего Положения.»;

в абзаце пятом слова «Индекса ММВБ» заменить словами «Индекса МосБиржи»;

в абзаце шестом слова «и облигаций, указанных в абзаце четвертом подпункта 1.1.2 пункта 1.1 настоящего Положения» исключить;

в подпункте 1.4.5:

в абзаце первом после слов «в совокупности составляют не более 15 процентов стоимости инвестиционного портфеля» дополнить словами «до 31 декабря 2018 года, с 1 января 2019 года – не более 14 процентов стоимости инвестиционного портфеля, с 1 июля 2019 года – не более 13 процентов стоимости инвестиционного портфеля, с 1 января 2020 года – не более 12 процентов стоимости инвестиционного портфеля,

с 1 июля 2020 года – не более 11 процентов стоимости инвестиционного портфеля, а с 1 января 2021 года – не более 10 процентов стоимости инвестиционного портфеля.»;

абзацы второй и третий изложить в следующей редакции:

«Увеличение доли в инвестиционном портфеле активов, указанных в абзаце первом настоящего подпункта, путем совершения сделок по приобретению таких активов допускается при условии, что их совокупная стоимость с учетом приобретаемых составляет не более 10 процентов стоимости инвестиционного портфеля на момент заключения сделки по их приобретению.

При этом в составе ценных бумаг, указанных в абзацах первом и втором настоящего подпункта, также учитываются ценные бумаги, ожидаемые к получению и (или) подлежащие передаче по второй части договора репо.»;

дополнить абзацем четвертым следующего содержания:

«Ограничения настоящего подпункта в отношении денежных средств на счетах и прав требования по возврату ценных бумаг и денежных средств по второй части договора репо не применяются к денежным средствам на счетах, открываемых центральными контрагентами для целей клиринга, и правам требования к центральным контрагентам по возврату ценных бумаг и денежных средств по второй части договора репо.»;

в подпункте 1.4.9 слова «не ранее 3 рабочих дней» заменить словами «не ранее 4 рабочих дней»;

дополнить подпунктом 1.4.10 следующего содержания:

«1.4.10. Стоимость акций одного эмитента (включая акции, ожидаемые к получению и (или) подлежащие передаче по второй части договора репо) составляет не более 10 процентов стоимости инвестиционного портфеля до 31 декабря 2018 года, с 1 января 2019 года – не более 9 процентов стоимости инвестиционного портфеля, с 1 июля 2019 года – не более 8 процентов стоимости инвестиционного портфеля, с 1 января 2020 года – не более

7 процентов стоимости инвестиционного портфеля, с 1 июля 2020 года – не более 6 процентов стоимости инвестиционного портфеля, а с 1 января 2021 года – не более 5 процентов стоимости инвестиционного портфеля.

Увеличение доли в инвестиционном портфеле акций, указанных в абзаце первом настоящего подпункта, путем совершения сделок по приобретению таких акций допускается при условии, что их стоимость с учетом приобретаемых составляет не более 5 процентов стоимости инвестиционного портфеля на момент заключения сделки по их приобретению.».

1.5. В пункте 1.5:

в абзаце первом слова «1.4.5 – 1.4.9 пункта 1.4» заменить словами «1.4.5 – 1.4.10 пункта 1.4»;

абзац второй после слов «подпунктов 1.4.1 – 1.4.8» дополнить словами «и 1.4.10».

1.6. Пункт 1.7 дополнить абзацем следующего содержания:

«В целях применения абзацев первого и второго настоящего пункта в случае отсутствия у кредитной организации рейтинга, присвоенного по национальной рейтинговой шкале для Российской Федерации российскими кредитными рейтинговыми агентствами, и утверждения Советом директоров Банка России в соответствии со статьей 189⁴⁹ Федерального закона «О несостоятельности (банкротстве)» плана участия Банка России в осуществлении мер по предупреждению банкротства указанной кредитной организации, в течение срока реализации указанного плана требования подпункта 2.1.3 пункта 2.1 настоящего Положения не распространяются на такую кредитную организацию, информация о гарантировании Банком России непрерывности деятельности которой размещена на официальном сайте Банка России в информационно-телекоммуникационной сети «Интернет».».

2. Настоящее Указание в соответствии с решением Совета директоров Банка России (протокол заседания Совета директоров Банка России

от ____ 2018 года № __) вступает в силу по истечении 10 дней после дня его официального опубликования, за исключением абзацев четвертого и пятого подпункта 1.1, абзацев тринадцатого и четырнадцатого подпункта 1.2 пункта 1 настоящего Указания.

Абзацы четвертый и пятый подпункта 1.1, абзацы тринадцатый и четырнадцатый подпункта 1.2 пункта 1 настоящего Указания вступают в силу с 1 сентября 2018 года.

Председатель
Центрального банка
Российской Федерации

Э.С. Набиуллина