



ЦЕНТРАЛЬНЫЙ БАНК РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
(БАНК РОССИИ)

УКАЗАНИЕ МИНИСТЕРСТВА ЮСТИЦИИ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ

« 15 » мая 2019 г.

ЗАРЕГИСТРИРОВАНО № 5143-У

г. Москва

Регистрационный № 55501

от "06 августа 2019.

**О внесении изменений в Указание Банка России от 5 сентября 2016 года
№ 4129-У «О составе и структуре активов акционерных инвестиционных
фондов и активов паевых инвестиционных фондов»**

1. На основании пунктов 1 и 2 статьи 33, части первой статьи 34 Федерального закона от 29 ноября 2001 года № 156-ФЗ «Об инвестиционных фондах» (Собрание законодательства Российской Федерации, 2001, № 49, ст. 4562; 2004, № 27, ст. 2711; 2006, №17, ст. 1780; 2007, № 50, ст. 6247; 2008, № 30, ст. 3616; 2009, № 48, ст. 5731; 2010, № 17, ст. 1988; № 31, ст. 4193; 2011, № 48, ст. 6728; № 49, ст. 7040, ст. 7061; 2012, № 31, ст. 4334; 2013, № 26, ст. 3207; № 27, ст. 3477; № 30, ст. 4084; № 51, ст. 6695, ст. 6699; 2014, № 11, ст. 1098; 2015, № 27, ст. 4001; № 29, ст. 4357; 2016, № 1, ст. 47; № 23, ст. 3301; № 27, ст. 4225, ст. 4294; 2017, № 18, ст. 2661; № 31, ст. 4830; 2018, № 1, ст. 66, ст. 70, ст. 90) внести в Указание Банка России от 5 сентября 2016 года № 4129-У «О составе и структуре активов акционерных инвестиционных фондов и активов паевых инвестиционных фондов», зарегистрированное Министерством юстиции Российской Федерации 15 ноября 2016 года № 44339, 11 мая 2017 года № 46679, следующие изменения.

1.1. Главу 1 дополнить пунктом 1.7 следующего содержания:

«1.7. В целях применения пунктов 2.3, 2.9, 2.10, 3.1 и 3.3 настоящего Указания входящие в состав активов акционерного инвестиционного фонда, паевого инвестиционного фонда иностранные финансовые инструменты, не допущенные к обращению в Российской Федерации в качестве ценных бумаг, рассматриваются в качестве ценных бумаг в случае их признания в качестве ценных бумаг в соответствии с личным законом лица, обязанного по таким иностранным финансовым инструментам.».

1.2. Абзац второй пункта 2.1 дополнить словами «, и активы, являющиеся клиринговыми сертификатами участия».

1.3. В пункте 2.2:

абзац третий изложить в следующей редакции:

«Ценные бумаги, выпущенные (выданные) в соответствии с законодательством Российской Федерации о рынке ценных бумаг, законодательством Российской Федерации об инвестиционных фондах и предназначенные только для квалифицированных инвесторов (далее – ценные бумаги, предназначенные для квалифицированных инвесторов), могут входить в состав фонда, относящегося к категории фондов рыночных финансовых инструментов, при условии, что инвестиционная декларация (правила доверительного управления) такого фонда предусматривает (предусматривают) ценные бумаги, предназначенные для квалифицированных инвесторов, а также содержит (содержат) сведения о виде ценной бумаги, наименовании лица, обязанного по ценной бумаге, основном государственном регистрационном номере (регистрационном номере в стране регистрации) лица, обязанного по ценной бумаге.»;

дополнить новыми абзацами следующего содержания:

«Производные финансовые инструменты, порядок заключения, обращения и исполнения которых определяется в соответствии с законодательством Российской Федерации о рынке ценных бумаг и которые предназначены только для квалифицированных инвесторов (далее – производные финансовые инструменты, предназначенные для квалифицированных инвесторов), могут входить в состав фонда, относящегося к категории фондов рыночных финансовых инструментов, при условии, что инвестиционная декларация (правила доверительного управления) такого фонда предусматривает (предусматривают) производные финансовые инструменты, предназначенные для квалифицированных инвесторов, а также содержит (содержат) сведения о виде производного финансового инструмента и наименовании базового (базисного) актива производного финансового инструмента.

Оценочная стоимость ценных бумаг, предназначенных для квалифицированных инвесторов, и стоимость лотов производных финансовых инструментов, предназначенных для квалифицированных инвесторов, в совокупности не должны превышать 40 процентов стоимости активов фонда, относящегося к категории фондов рыночных финансовых инструментов. Для целей настоящего абзаца производные финансовые инструменты учитываются в объеме открытой позиции, скорректированной по результатам клиринга.

Денежные средства во вкладах (депозитах) в российских кредитных

организациях и иностранных банках могут входить в состав активов открытых и интервальных паевых инвестиционных фондов, относящихся к категории фондов рыночных финансовых инструментов, только при условии, что в случае досрочного расторжения указанного договора российская кредитная организация или иностранный банк обязана (обязан) вернуть сумму вклада (депозита, остатка на счете) и проценты по нему в срок, не превышающий 7 рабочих дней.»).

1.4. Абзац первый пункта 2.9 после слов «менее трех месяцев,» дополнить словами «прав требований к юридическому лицу, возникших на основании договора о брокерском обслуживании с таким лицом (при условии, что указанным договором предусмотрено исполнение таким юридическим лицом обязательств в течение одного рабочего дня с даты предъявления указанных требований к исполнению),»).

1.5. Пункт 2.10 изложить в следующей редакции:

«2.10. Оценочная стоимость ценных бумаг одного юридического лица, денежные средства в рублях и в иностранной валюте на счетах и во вкладах (депозитах) в таком юридическом лице (если юридическое лицо является кредитной организацией или иностранным банком иностранного государства), права требования к такому юридическому лицу, за исключением случая, указанного в абзаце пятом настоящего пункта, в совокупности не должны превышать 15 процентов стоимости активов инвестиционного фонда до 31 декабря 2019 года, с 1 января 2020 года – 14 процентов стоимости активов инвестиционного фонда, с 1 июля 2020 года – 13 процентов стоимости активов инвестиционного фонда, с 1 января 2021 года – 12 процентов стоимости активов инвестиционного фонда, с 1 июля 2021 года – 11 процентов стоимости активов инвестиционного фонда, а с 1 января 2022 года – 10 процентов стоимости активов инвестиционного фонда. Требования настоящего абзаца не распространяются на государственные ценные бумаги Российской Федерации и на права требования к центральному контрагенту, а также на имущественные права, указанные в абзаце десятом подпункта 2.4.1 пункта 2.4 настоящего Указания.

Оценочная стоимость ценных бумаг одного субъекта Российской Федерации (административно-территориального образования иностранного государства), муниципального образования, государственных ценных бумаг одного иностранного государства, за исключением случая, указанного в абзаце пятом настоящего пункта, не должна превышать 15 процентов стоимости активов инвестиционного фонда до 31 декабря 2019 года, с 1 января 2020 года – 14 процентов стоимости активов инвестиционного фонда, с 1 июля 2020 года – 13 процентов стоимости активов

инвестиционного фонда, с 1 января 2021 года – 12 процентов стоимости активов инвестиционного фонда, с 1 июля 2021 года – 11 процентов стоимости активов инвестиционного фонда, а с 1 января 2022 года – 10 процентов стоимости активов инвестиционного фонда.

Для целей настоящего пункта российские и иностранные депозитарные расписки рассматриваются как ценные бумаги, права собственности на которые удостоверяют соответствующие депозитарные расписки.

Для целей настоящего пункта ценные бумаги инвестиционных фондов, в том числе иностранных инвестиционных фондов, и ипотечные сертификаты участия рассматриваются как совокупность активов, в которые инвестировано имущество соответствующего фонда (ипотечного покрытия). Если лицо, обязанное по ценным бумагам инвестиционного фонда, не предоставляет и (или) не раскрывает информацию об активах, в которые инвестировано имущество инвестиционного фонда, такие ценные бумаги могут приобретаться в состав активов инвестиционного фонда для неквалифицированных инвесторов (без учета требования, установленного абзацем первым настоящего пункта), если в соответствии с личным законом лица, обязанного по ценным бумагам инвестиционного фонда, такие ценные бумаги могут приобретаться неквалифицированными инвесторами (неограниченным кругом лиц), а также при наличии одного из следующих обстоятельств: в соответствии с требованиями, предъявляемыми к деятельности инвестиционного фонда, или документами, регулирующими инвестиционную деятельность инвестиционного фонда (в том числе инвестиционной декларацией, проспектом эмиссии, правилами доверительного управления), доля ценных бумаг одного юридического лица не должна превышать 10 процентов стоимости активов инвестиционного фонда либо в соответствии с правом Европейского союза инвестиционному фонду предоставлено право осуществления деятельности на территории всех государств – членов Европейского союза и его деятельность регулируется правом Европейского союза.

В случае если инвестиционная декларация паевого инвестиционного фонда предусматривает, что рассчитываемые каждый рабочий день отклонения прироста (в процентах) расчетной стоимости инвестиционного пая за 20 рабочих дней и за 250 рабочих дней, предшествующих дню расчета отклонений, от прироста (в процентах) значения одного из фондовых индексов (включая версию фондового

индекса, отражающую изменение суммарной стоимости ценных бумаг с учетом результатов инвестирования выплат, в том числе дивидендных выплат, по указанным ценным бумагам), приведенного в приложении к настоящему Указанию, за указанные периоды не должны превышать по модулю 0,5 процента и 3 процента соответственно, оценочная стоимость активов, указанных в первом предложении абзаца первого настоящего пункта, в совокупности не должна превышать 20 процентов стоимости активов инвестиционного фонда, а оценочная стоимость активов, указанных в абзаце втором настоящего пункта, не должна превышать 20 процентов стоимости активов инвестиционного фонда.

Для целей абзаца пятого настоящего пункта при расчете прироста расчетной стоимости инвестиционного пая учитываются суммы начисленного дохода по инвестиционному паю, а также результат дробления инвестиционных паев. Требования абзаца пятого настоящего пункта не распространяются на государственные ценные бумаги Российской Федерации и на права требования к центральному контрагенту.

Для целей расчета ограничений, указанных в абзацах первом и пятом настоящего пункта, при определении доли оценочной стоимости активов в стоимости активов инвестиционного фонда в сумме денежных средств в рублях и в иностранной валюте на счетах в одном юридическом лице и стоимости прав требований к одному юридическому лицу, возникших на основании договора о брокерском обслуживании с таким лицом (при условии, что указанным договором предусмотрено исполнение таким юридическим лицом обязательств в течение одного рабочего дня с даты предъявления указанных требований к исполнению), составляющих фонд, не учитывается сумма (или ее часть) денежных средств, подлежащих выплате в связи с погашением и обменом инвестиционных паев паевого инвестиционного фонда или в связи с выплатой дохода от доверительного управления имуществом, составляющим такой фонд, на момент расчета ограничения.

При этом общая сумма денежных средств и стоимость прав требований, которые не учитываются при расчете ограничений, указанных в абзацах первом и пятом настоящего пункта, в отношении всех денежных средств в рублях и в иностранной валюте на всех счетах и в отношении всех прав требований к юридическим лицам, возникших на основании указанных договоров о брокерском обслуживании, составляющих фонд, в совокупности не должны превышать общую сумму денежных средств, подлежащих выплате в связи с погашением и обменом инвестиционных паев паевого инвестиционного фонда или в связи с выплатой дохода от доверительного

управления имуществом, составляющим такой фонд, на момент расчета ограничения.

Для целей расчета ограничений, указанных в абзацах первом и пятом настоящего пункта, при определении доли оценочной стоимости активов в стоимости активов инвестиционного фонда в сумме денежных средств в рублях и в иностранной валюте на счетах в одном юридическом лице, составляющих фонд, не учитывается сумма (или ее часть) денежных средств, находящихся на указанных счетах (одном из указанных счетов) и включенных в такой фонд при выдаче и (или) обмене инвестиционных паев, в течение не более 2 рабочих дней с даты указанного включения.

Стоимость лотов производных финансовых инструментов (если базовым (базисным) активом производного финансового инструмента является другой производный финансовый инструмент – стоимость лотов таких производных финансовых инструментов), стоимость ценных бумаг (сумма денежных средств), полученных управляющей компанией инвестиционного фонда по первой части договора репо, размер принятых обязательств по поставке активов по иным сделкам, дата исполнения которых не ранее 4 рабочих дней с даты заключения сделки (за исключением сделок с активами, предусмотренными подпунктом 2.4.1 пункта 2.4 настоящего Указания), и заемные средства, предусмотренные подпунктом 5 пункта 1 статьи 40 Федерального закона от 29 ноября 2001 года № 156-ФЗ, в совокупности не должны превышать 40 процентов стоимости чистых активов инвестиционного фонда.

На дату заключения сделок с производными финансовыми инструментами, договоров репо, договоров займа, кредитных договоров или сделок, дата исполнения которых не ранее 4 рабочих дней с даты заключения сделки (за исключением сделок с активами, предусмотренными подпунктом 2.4.1 пункта 2.4 настоящего Указания), совокупная стоимость активов, указанных в абзаце десятом 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 от 29 ноября 2001 года № 156-ФЗ, не должна превышать 20 процентов стоимости чистых активов инвестиционного фонда.

Для целей настоящего пункта производные финансовые инструменты учитываются в объеме приобретаемых (отчуждаемых) базовых (базисных) активов таких производных финансовых инструментов (если базовым (базисным) активом является другой производный финансовый инструмент (индекс) – как базовые (базисные) активы таких производных финансовых инструментов (активы, входящие в список для расчета такого индекса) и открытой позиции, скорректированной по

результатам клиринга.

Договоры репо заключаются, если они соответствуют одному из следующих условий: контрагентом по договору репо является центральный контрагент либо указанный договор заключается на условиях поставки против платежа и предусмотренной договором репо обязанности каждой из сторон при изменении цены ценных бумаг, переданных по договору репо, уплачивать другой стороне денежные суммы и (или) передавать ценные бумаги в соответствии с пунктом 14 статьи 51³ Федерального закона от 22 апреля 1996 года № 39-ФЗ «О рынке ценных бумаг» (Собрание законодательства Российской Федерации, 1996, 17, ст. 1918; 2001, № 33, ст. 3424; 2002, № 52, ст. 5141; 2004, № 27, ст. 2711; № 31, ст. 3225; 2005, № 11, ст. 900; № 25, ст. 2426; 2006, № 1, ст. 5; № 2, ст. 172; № 17, ст. 1780; № 31, ст. 3437; № 43, ст. 4412; 2007, № 1, ст. 45; № 18, ст. 2117; № 22, ст. 2563; № 41, ст. 4845; № 50, ст. 6247; 2008, № 52, ст. 6221; 2009, № 1, ст. 28; № 18, ст. 2154; № 23, ст. 2770; № 29, ст. 3642; № 48, ст. 5731; № 52, ст. 6428; 2010, № 17, ст. 1988; № 31, ст. 4193; № 41, ст. 5193; 2011, № 7, ст. 905; № 23, ст. 3262; № 29, ст. 4291; № 48, ст. 6728; № 49, ст. 7040; № 50, ст. 7357; 2012, № 25, ст. 3269; № 31, ст. 4334; № 53, ст. 7607; 2013, № 26, ст. 3207; № 30, ст. 4043, ст. 4082, ст. 4084; № 51, ст. 6699; № 52, ст. 6985; 2014, № 30, ст. 4219; 2015, № 1, ст. 13; № 14, ст. 2022; № 27, ст. 4001; № 29, ст. 4348, ст. 4357; 2016, № 1, ст. 50, ст. 81; № 27, ст. 4225; 2017, № 25, ст. 3592; № 27, ст. 3925; № 30, ст. 4444; № 48, ст. 7052; № 52, ст. 7920; 2018, № 1, ст. 65, ст. 70; № 17, ст. 2424; № 18, ст. 2560; № 32, ст. 5088; № 49, ст. 7524; № 53, ст. 8440) при условии, что предметом договора репо могут быть только активы, включаемые в состав активов инвестиционного фонда, в соответствии с инвестиционной декларацией (правилами доверительного управления) инвестиционного фонда.

Для целей абзаца десятого и одиннадцатого настоящего пункта не учитываются договоры репо, по которым управляющая компания является покупателем по первой части договора репо и которые предусматривают невозможность распоряжения приобретенными ценными бумагами, за исключением их возврата по второй части такого договора репо, а также опционные договоры, по которым управляющая компания имеет право требовать от контрагента покупки или продажи базового (базисного) актива.

Положения абзацев первого, второго, пятого, десятого, одиннадцатого, тринадцатого и четырнадцатого настоящего пункта применяются только к фондам для неквалифицированных инвесторов.

За счет активов фондов для квалифицированных инвесторов могут заключаться

договоры репо и совершаться сделки с производными финансовыми инструментами в случаях, предусмотренных правилами доверительного управления паевым инвестиционным фондом (инвестиционной декларацией инвестиционного фонда).

Требования абзацев первого, второго и пятого настоящего пункта не применяются до даты завершения (окончания) формирования паевого инвестиционного фонда и в течение месяца после этой даты.».

1.6. Подпункт 3.1.3 пункта 3.1 и подпункт 3.3.3 пункта 3.3 после слов «финансовыми инструментами» дополнить словами «(за исключением получения дохода и иных выплат по ценным бумагам и производным финансовым инструментам)».

1.7. Абзац четвертый пункта 4.2 изложить в следующей редакции:

«Управляющая компания закрытого паевого инвестиционного фонда, инвестиционная декларация и (или) категория которого не соответствуют требованиям настоящего Указания, не должна принимать заявки на приобретение дополнительных инвестиционных паев такого фонда.».

1.8. В приложении:

в пункте 1 слова «ASX-200» заменить словами «ASX 200»;

в пункте 4 слово «Ibovespa» заменить словами «Bovespa Index»;

в пункте 5 слова «Budapest SE» заменить словом «BUX»;

в пункте 10 слова «TA 25» заменить словами «TA-35»;

в пункте 11 слова «BSE Sensex» заменить словами «S&P BSE SENSEX»;

в пункте 13 слово «ICEX» заменить словами «OMX Iceland 8»;

пункт 16 после слов «S&P/TSX» дополнить словом «Composite»;

в пункте 17 слова «SSE Composite Index» заменить словами «Shanghai SE Composite»;

в пунктах 18 и 20 слово «Index» исключить;

в пункте 21 слова «DJ New Zealand» заменить словами «S&P/NZX 50»;

в пункте 25 слово «ММББ» заменить словами «Индекс МосБиржи»;

в пункте 26 слово «PTC» заменить словами «Индекс PTC»;

в пункте 28 слова «Blue-Chip SBITOP» заменить словами «SBI TOP»;

в пункте 35 слово «IPSA» заменить словами «S&P/CLX IPSA»;

в пункте 37 слово «OMXS30» заменить словами «OMX Stockholm 30»;

в пункте 38 слова «Tallinn SE General» заменить словами «OMX TALLINN_GI»;

дополнить пунктом 42 следующего содержания:

«42. Индекс МосБиржи голубых фишек (Россия).».

2. Настоящее Указание вступает в силу по истечении 10 дней после дня его официального опубликования.

И.о. Председателя
Центрального банка
Российской Федерации

Д.В. Тулин