

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

« ____ » _____ 2019 г.

№ _____

г. Москва

У К А З А Н И Е

**О внесении изменений в Инструкцию Банка России
от 14 ноября 2016 года № 175-И «О банковских операциях
небанковских кредитных организаций – центральных контрагентов,
об обязательных нормативах небанковских кредитных организаций –
центральных контрагентов и особенностях осуществления
Банком России надзора за их соблюдением»**

1. На основании статьи 62.2 Федерального закона от 10 июля 2002 года № 86-ФЗ "О Центральном банке Российской Федерации (Банке России)" (Собрание законодательства Российской Федерации, 2002, № 28, ст. 2790; 2003, № 2, ст. 157; № 52, ст. 5032; 2004, № 27, ст. 2711; № 31, ст. 3233; 2005, № 25, ст. 2426; № 30, ст. 3101; 2006, № 19, ст. 2061; № 25, ст. 2648; 2007, № 1, ст. 9, ст. 10; № 10, ст. 1151; № 18, ст. 2117; 2008, № 42, ст. 4696, ст. 4699; № 44, ст. 4982; № 52, ст. 6229, ст. 6231; 2009, № 1, ст. 25; № 29, ст. 3629; № 48, ст. 5731; 2010, № 45, ст. 5756; 2011, № 7, ст. 907; № 27, ст. 3873; № 43, ст. 5973; № 48, ст. 6728; 2012, № 50, ст. 6954; № 53, ст. 7591, ст. 7607; 2013, №

11, ст. 1076; № 14, ст. 1649; № 19, ст. 2329; № 27, ст. 3438, ст. 3476, ст. 3477; № 30, ст. 4084; № 49, ст. 6336; № 51, ст. 6695, ст. 6699; № 52, ст. 6975; 2014, № 19, ст. 2311, ст. 2317; № 27, ст. 3634; № 30, ст. 4219; № 40, ст. 5318; № 45, ст. 6154; № 52, ст. 7543; 2015, № 1, ст. 4, ст. 37; № 27, ст. 3958, ст. 4001; № 29, ст. 4348, ст. 4357; № 41, ст. 5639; № 48, ст. 6699; 2016, № 1, ст. 23, ст. 46, ст. 50; № 26, ст. 3891; № 27, ст. 4225, ст. 4273, ст. 4295; 2017, № 1, ст. 46; № 14, ст. 1997; № 18, ст. 2661, ст. 2669; № 27, ст. 3950; № 30, ст. 4456; № 31, ст. 4830; № 50, ст. 7562; 2018, № 1, ст. 66; № 9, ст. 1286; № 11, ст. 1584, ст. 1588; № 18, ст. 2557; № 24, ст. 3400; № 27, ст. 3950; № 31, ст. 4852; № 32, ст. 5115; № 49, ст. 7524; № 53, ст. 8411, ст. 8440) и пункта 3 части пятой статьи 1 Федерального закона "О банках и банковской деятельности" (в редакции Федерального закона от 3 февраля 1996 года № 17-ФЗ) (Ведомости Съезда народных депутатов РСФСР и Верховного Совета РСФСР, 1990, № 27, ст. 357; Собрание законодательства Российской Федерации, 1996, № 6, ст. 492; 1998, № 31, ст. 3829; 1999, № 28, ст. 3459, ст. 3469; 2001, № 26, ст. 2586; № 33, ст. 3424; 2002, № 12, ст. 1093; 2003, № 27, ст. 2700; № 50, ст. 4855; № 52, ст. 5033, ст. 5037; 2004, № 27, ст. 2711; № 31, ст. 3233; 2005, № 1, ст. 18, ст. 45; № 30, ст. 3117; 2006, № 6, ст. 636; № 19, ст. 2061; № 31, ст. 3439; № 52, ст. 5497; 2007, № 1, ст. 9; № 22, ст. 2563; № 31, ст. 4011; № 41, ст. 4845; № 45, ст. 5425; № 50, ст. 6238; 2008, № 10, ст. 895; 2009, № 1, ст. 23; № 9, ст. 1043; № 18, ст. 2153; № 23, ст. 2776; № 30, ст. 3739; № 48, ст. 5731; № 52, ст. 6428; 2010, № 8, ст. 775; № 27, ст. 3432; № 30, ст. 4012; № 31, ст. 4193; № 47, ст. 6028; 2011, № 7, ст. 905; № 27, ст. 3873, ст. 3880; № 29, ст. 4291; № 48, ст. 6730; № 49, ст. 7069; № 50, ст. 7351; 2012, № 27, ст. 3588; № 31, ст. 4333; № 50, ст. 6954; № 53, ст. 7605, ст. 7607; 2013, № 11, ст. 1076; № 19, ст. 2317, ст. 2329; № 26, ст. 3207; № 27, ст. 3438, ст. 3477; № 30, ст. 4048; № 40, ст. 5036; № 49, ст. 6336; № 51, ст. 6683, ст. 6699; 2014, № 6, ст. 563; № 19, ст. 2311; № 26, ст. 3379, ст. 3395; № 30, ст. 4219; № 40, ст. 5317, ст. 5320; № 45, ст. 6144, ст. 6154; № 49, ст. 6912; № 52, ст. 7543; 2015, № 1, ст. 37; № 17, ст. 2473; №

27, ст. 3947, ст. 3950; № 29, ст. 4355, ст. 4357, ст. 4385; № 51, ст. 7243; 2016, № 1, ст. 23; № 15, ст. 2050; № 26, ст. 3860; № 27, ст. 4294, ст. 4295; 2017, № 14, ст. 2000; № 18, ст. 2661, ст. 2669; № 25, ст. 3596; № 30, ст. 4456; № 31, ст. 4754, ст. 4761, ст. 4830; 2018, № 1, ст. 66; № 18, ст. 2560, ст. 2576; № 22, ст. 3043; № 24, ст. 3400; № 27, ст. 3950; № 31, ст. 4852; № 32, ст. 5100, ст. 5115; № 49, ст. 7524; № 53, ст. 8440) и в соответствии с решением Совета директоров Банка России (протокол заседания Совета директоров Банка России от __ 201__ года № __) внести в Инструкцию Банка России от 14 ноября 2016 года № 175-И "О банковских операциях небанковских кредитных организаций - центральных контрагентов, об обязательных нормативах небанковских кредитных организаций - центральных контрагентов и особенностях осуществления Банком России надзора за их соблюдением", зарегистрированную Министерством юстиции Российской Федерации 6 декабря 2016 года № 44577, следующие изменения.

1.1. В пункте 2.2:

в абзаце четвертом слова «Положением Банка России от 28 декабря 2012 года № 395-П «О методике определения величины собственных средств (капитала) кредитных организаций («Базель III»)», зарегистрированным Министерством юстиции Российской Федерации 22 февраля 2013 года № 27259, 29 ноября 2013 года № 30499, 2 октября 2014 года № 34227, 11 декабря 2014 года № 35134, 17 декабря 2014 года № 35225, 24 марта 2015 года № 36548, 5 июня 2015 года № 37549, 5 октября 2015 года № 39152, 8 декабря 2015 года № 40018, 17 декабря 2015 года № 40151, 26 августа 2016 года № 43442 («Вестник Банка России» от 27 февраля 2013 года № 11, от 30 ноября 2013 года № 69, от 8 октября 2014 года № 93, от 22 декабря 2014 года № 112, от 26 декабря 2014 года № 114, от 30 марта 2015 года № 27, от 16 июня 2015 года № 52, от 12 октября 2015 года № 86, от 16 декабря 2015 года № 115, от 24 декабря 2015 года № 118, от 8 сентября 2016 года № 80) (далее - Положение Банка России № 395-П)» заменить словами «Положением Банка

России от 4 июля 2018 года № 646-П «О методике определения собственных средств (капитала) кредитных организаций («Базель III»), зарегистрированным Министерством юстиции Российской Федерации 10 сентября 2018 года № 52122, 19 декабря 2018 года № 53064 («Вестник Банка России» от 28 сентября 2018 года № 75, от 16 января 2019 года № 2) (далее – Положение Банка России № 646-П)»;

в абзацах пятом и шестом слова «Положения Банка России № 395-П» заменить словами «Положения Банка России № 646-П»;

абзац седьмой изложить в следующей редакции:

«МЛикв - минимальная величина средств, необходимая для обеспечения прекращения или реструктуризации деятельности центрального контрагента, рассчитываемая ежегодно по состоянию на 1 января года, следующего за отчетным, не позднее пяти торговых дней после дня раскрытия годовой бухгалтерской (финансовой) отчетности в соответствии с Указанием Банка России от 27 ноября 2018 года № 4983-У «О формах, порядке и сроках раскрытия кредитными организациями информации о своей деятельности», зарегистрированным Министерством юстиции Российской Федерации 21 февраля 2019 года № 53861 (далее - Указание Банка России № 4983-У), составляющая 50 процентов от величины операционных расходов, отраженной в графе 4 строки 21 формы 0409807 «Отчет о финансовых результатах (публикуемая форма)», установленной Указанием Банка России от 8 октября 2018 года № 4927-У «О перечне, формах и порядке составления и представления форм отчетности кредитных организаций в Центральный банк Российской Федерации», зарегистрированным Министерством юстиции Российской Федерации 13 декабря 2018 года № 52992 (далее – Указание Банка России № 4927-У)»;

в абзаце восьмом слова «№ 4212-У» заменить словами «№ 4927-У»;

в абзацах восьмом и четырнадцатом слова «№ 4638-У» заменить словами «№ 4983-У»;

в абзаце четырнадцатом слова «вызванных неисполнением» заменить словами «в случае неисполнения»;

в абзаце тринадцатом после слов «10 января 2018 года № 49586» дополнить словами «5 апреля 2018 года № 50655, 11 июля 2018 года № 51589, 22 августа 2018 года № 51974, 25 сентября 2018 года № 52250, 28 декабря 2018 года № 53224».

1.2. В пункте 3.1. слова «при неисполнении» заменить словами «в случае неисполнения».

1.3. В пункте 3.2:

в абзаце первом и четвертом слова «при неисполнении» заменить словами «в случае неисполнения»;

в абзаце шестнадцатом слова «вызванных неисполнением» заменить словами «в случае неисполнения»;

в абзаце шестнадцатом после слов «2016, № 1, ст.23, ст. 47)» дополнить словами «(далее – Федеральный закон «О клиринге, клиринговой деятельности и центральном контрагенте»)»;

1.4. Главу 5 изложить в следующей редакции:

«Глава 5. Норматив ликвидности центрального контрагента

5.1. Норматив ликвидности центрального контрагента (далее - норматив Н4цк) характеризует способность центрального контрагента покрыть потенциальные потери, в случае неисполнения обязательств двумя крупнейшими по величине нетто-обязательств участниками клиринга, за счет высоколиквидных ресурсов центрального контрагента.

5.2. Норматив Н4цк определяется отношением величины высоколиквидных ресурсов центрального контрагента к величине потенциальных потерь центрального контрагента в случае неисполнения обязательств двумя крупнейшими по величине нетто-обязательств участниками клиринга на всех рынках и рассчитывается по формуле:

$$H4_{\text{цк}} = \frac{\text{ВЛР}}{\text{ПЛ}} \times 100\%$$

где:

ВЛР – величина высоколиквидных ресурсов центрального контрагента, использование которых предусмотрено правилами клиринга для покрытия убытков, возникающих в случае неисполнения обязательств двумя крупнейшими по величине нетто-обязательств участниками клиринга. Величина высоколиквидных ресурсов центрального контрагента (которыми должен располагать центральный контрагент в период времени, определенный правилами клиринга, за который центральный контрагент осуществляет урегулирование убытков, возникших в случае неисполнения обязательств двумя крупнейшими по величине нетто-обязательств участниками клирингами) определяется как сумма:

оценки стоимости ценных бумаг, определенная как справедливая стоимость ценных бумаг, входящих в портфель центрального контрагента;

справедливой стоимости ценных бумаг, предоставленных двумя крупнейшими по величине нетто-обязательств участниками клиринга, в случае неисполнения обязательств, в качестве обеспечения и коллективного клирингового обеспечения и хранящихся на счетах депо в расчетных депозитариях;

остатков на корреспондентских, клиринговых и иных счетах центрального контрагента (в размере, превышающем величину минимальных размеров денежных средств, требуемых к обязательному поддержанию (хранению) на соответствующих счетах), отраженных на балансовых счетах № 30104, 30110, 30114, 30118, 30119, 30221 (в части незавершенных расчетов с Банком России), 30416, 30417, 30418, 30419, 30602 в соответствии с Положением Банка России от 27 февраля 2017 года № 579-П «О плане счетов бухгалтерского учета для кредитных организаций и порядке его применения», зарегистрированным Министерством юстиции Российской Федерации 20 марта 2017 года № 46021, 20 июля 2017 года № 47474, 12

декабря 2017 года № 49220, 12 марта 2018 года № 50299, 3 декабря 2018 года № 52845, 16 января 2019 № 53372;

ПЛ – величина нетто-обязательств двух крупнейших по величине нетто-обязательств участников клиринга на рынках, которые обслуживает центральный контрагент, рассчитанная с учетом переоценки по итогам проведения клиринга и (или) торгов на организованных рынках, на которые приходится наибольший объем сделок с инструментами, составляющими нетто-обязательства на дату расчета норматива Н4цк. Величина нетто-обязательств по расчетным производным финансовым инструментам рассчитывается как величина накопленной (не оплаченной на момент расчета норматива) переоценки на дату расчета по соответствующему производному финансовому инструменту.

Величина ВЛР в части ценных бумаг, предоставленных двумя крупнейшими по величине нетто-обязательств участниками клиринга, в случае неисполнения обязательств, в качестве обеспечения и коллективного клирингового обеспечения, определяется с учетом дисконтов, установленных центральным контрагентом.

Ценные бумаги клиента участника клиринга не включаются в расчет величины ВЛР в случае если в соответствии со статьями 16, 22, 23 или 24.1 Федерального закона «О клиринге, клиринговой деятельности и центральном контрагенте» по требованию такого клиента участника клиринга центральным контрагентом ведется отдельный внутренний учет его обязательств и обеспечения.

Величина ВЛР в части портфеля ценных бумаг центрального контрагента определяется с учетом дисконтов, установленных Банком России для ценных бумаг, включенных в Ломбардный список Банка России в соответствии с Указанием Банка России от 10 августа 2012 года № 2861-У «О перечне ценных бумаг, входящих в Ломбардный список Банка России», зарегистрированным Министерством юстиции Российской Федерации 26

сентября 2012 года № 25541, 8 мая 2013 года № 28350, 14 ноября 2014 года № 34697, 11 декабря 2014 года № 35134, 16 января 2015 года № 35560 («Вестник Банка России» от 4 октября 2012 года № 59, от 22 мая 2013 года № 27, от 26 ноября 2014 года № 105, от 22 декабря 2014 года № 112, от 29 января 2015 года № 6).

Ставка дисконтирования принимается равной нулю для государственных долговых ценных бумаг, имеющих долгосрочный рейтинг выпуска ценных бумаг на уровне не ниже «АА» по классификации рейтинговых агентств «Эс-энд-Пи Глобал Рейтингс» (S&P Global Ratings) или «Фитч Рейтингс» (Fitch Ratings) либо «Аа2» по классификации рейтингового агентства «Мудис Инвесторс Сервис» (Moody's Investors Service) и эмитированных государством, национальная валюта которого входит в следующий перечень валют: доллары США, евро, фунты стерлингов, японские иены, швейцарские франки.

Другие ценные бумаги при расчете справедливой стоимости портфеля ценных бумаг центрального контрагента не учитываются.

Если величина ВЛР и (или) ПЛ равна нулю, то фиксируется нарушение значения норматива Н4цк.

5.3. Минимально допустимое числовое значение норматива Н4цк устанавливается в размере 100 процентов.».

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

Председатель
Центрального банка
Российской Федерации

Э.С. Набиуллина