

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

**У К З А Н И Е**

«\_\_\_» \_\_\_\_\_ 20\_\_\_ г.

№ \_\_\_\_\_ -У

г. Москва

**О внесении изменений в Указание Банка России  
от 29 октября 2018 № 4952-У**

**«О методике оценки экономического положения центрального  
контрагента»**

На основании статьи 72 Федерального закона от 10 июля 2002 года № 86-ФЗ «О Центральном банке Российской Федерации (Банке России)» (Собрание законодательства Российской Федерации, 2002, № 28, ст. 2790; 2017, № 18, ст. 2669; 2020, № 14, ст. 2036):

1. Внести в Указание Банка России от 29 октября 2018 № 4952-У «О методике оценки экономического положения центрального контрагента», зарегистрированное Министерством юстиции Российской Федерации 17 января 2019 года № 53408, 31 марта 2020 года № 57917, следующие изменения.

1.1. Пункт 1.2 дополнить новыми абзацами следующего содержания:  
«наличие оснований для принятия органами управления центрального контрагента решения о начале реализации плана по восстановлению финансовой устойчивости центрального контрагента и (или) для принятия Банком России решения о начале реализации плана действий в отношении центрального контрагента, содержащего меры на случай, если мероприятия,

предусмотренные планом восстановления финансовой устойчивости центрального контрагента, не приведут к восстановлению его финансовой устойчивости, разработанных в соответствии со статьей 11.1 Федерального закона «О клиринге, клиринговой деятельности и центральном контрагенте;

наличие оснований для отзыва лицензии на осуществление банковских операций в соответствии со статьей 20 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; 2019, № 52, ст. 7825; «Российская газета», 01.07.2003, № 126);

наличие оснований для аннулирования лицензии на осуществление клиринговой деятельности в соответствии со статьей 28 Федерального закона «О клиринге, клиринговой деятельности и центральном контрагенте;».

1.2. В пункте 2.2:

абзац четвертый дополнить словами «, включая верхнюю границу диапазона»;

дополнить новым абзацем следующего содержания:

«центральный контрагент в отчетном периоде имел на своем балансе обязательства перед участниками клиринга, неисполненные в срок, не превышающий пять торговых дней со дня наступления даты исполнения обязательств, или обязательства по уплате обязательных платежей, в том числе перед Банком России, неисполненные в срок, не превышающий три дня со дня наступления даты исполнения обязательств;».

1.3. В пункте 2.3:

абзац третий дополнить словами «, включая границы диапазона»;

дополнить новыми абзацами следующего содержания:

«в деятельности центрального контрагента зафиксированы неисполненные предписания Банка России за нарушения федеральных законов и (или) издаваемых в соответствии с ними нормативных актов Банка России;

в деятельности центрального контрагента зафиксированы текущие убытки либо превышение использованной прибыли над фактически полученной и (или) непогашенные убытки предшествующих лет;

в деятельности центрального контрагента Банком России зафиксировано использование собственных средств (за исключением средств выделенного капитала) в отчетном периоде для покрытия убытков, связанных с дефолтом участника клиринга;

центральный контрагент в отчетном периоде имел на своем балансе обязательства перед участниками клиринга, неисполненные в срок, превышающий пять торговых дней со дня наступления даты исполнения обязательств, или обязательства по уплате обязательных платежей, в том числе перед Банком России, неисполненные в срок, превышающий три дня со дня наступления даты исполнения обязательств;

действуют запрет или ограничение на проведение центральным контрагентом отдельных операций, связанных с осуществлением клиринговой деятельности, и (или) запрет на осуществление отдельных банковских операций, предусмотренных лицензией на осуществление банковских операций;

наличие оснований для принятия органами управления центрального контрагента решения о начале реализации плана по восстановлению финансовой устойчивости центрального контрагента, разработанного в соответствии со статьей 11.1 Федерального закона «О клиринге, клиринговой деятельности и центральном контрагенте».

1.4. Пункт 2.4 дополнить словами «, и (или) для принятия Банком России решения о начале реализации плана действий в отношении центрального контрагента, содержащего меры на случай, если мероприятия, предусмотренные планом восстановления финансовой устойчивости центрального контрагента, не приведут к восстановлению его финансовой устойчивости, разработанного в отношении центрального контрагента в соответствии с пунктом 11.1 Федерального закона «О клиринге, клиринговой деятельности и центральном контрагенте».

1.5. В пункте 3.5:

в абзаце первом подпункта 3.5.2 после слов «27 декабря 2019 года № 57008» дополнить словами «, 31 марта 2020 года № 57913» и исключить слова «формы отчетности 0409118 «Данные о концентрации кредитного риска», установленной приложением 1 к Указанию Банка России № 4927-У (далее - форма 0409118)»;

в абзаце первом подпункта 3.5.3 исключить слова «формы 0409118».

1.6. В пункте 3.6:

в абзаце слова «чистой процентной маржи» заменить словами «чистого комиссионного дохода»;

абзац четвертый подпункта 3.6.1 дополнить предложением следующего содержания:

«Значение показателя «Прибыль (убыток) до налогообложения» для показателя ФР определяется с учетом требований для показателя ФР, установленных подпунктом 3.3.1 пункта 3.3 Указания Банка России от 3 апреля 2017 года № 4336-У «Об оценке экономического положения банков» (вместе с «Методикой оценки показателей прозрачности структуры собственности банка»), зарегистрированного Министерством юстиции Российской Федерации 19 мая 2017 года № 46771, 22 февраля 2019 года № 53872 и 31 марта 2020 года № 57917, (далее – Указание Банка России № 4336-У).»;

абзац восьмой подпункта 3.6.1 дополнить предложением следующего содержания:

«Значение показателя «Всего активов» для показателя  $A_{ср}$  определяется с учетом требований подпункта 3.1.2 пункта 3.1 Указания Банка России № 4336-У, установленных для показателя А.»;

в абзаце четвертом пункта 3.6.3 после цифр «51743» дополнить словами «(далее – Положение Банка России №446-П)»;

пункт 3.6.4 изложить в следующей редакции:

«3.6.4. Показатель чистого комиссионного дохода (ПД4) рассчитывается как процентное отношение (в процентах годовых) чистых комиссионных и аналогичных доходов к прибыли после налогообложения по формуле:

$$\text{ПД4} = \frac{\text{ЧД}_к}{\text{ПН}} \times 100\%$$

где:

$\text{ЧД}_к$  - чистые комиссионные доходы рассчитываются как разность между комиссионными и аналогичными доходами ( $\text{Д}_к$ ) и комиссионными и аналогичными расходами ( $\text{Р}_к$ ).

$\text{Д}_к$  – значение показателя «Комиссионные и аналогичные доходы», равного итогу по разделу 7 части 2 формы 0409102 приложения к Положению Банка России № 446-П.

$\text{Р}_к$  – значение показателя «Комиссионные и аналогичные расходы», равного итогу по разделу 7 части 4 формы 0409102 приложения к Положению Банка России № 446-П.

$\text{ПН}$  – значение показателя «Прибыль после налогообложения», равного показателю по разделу 1 части 6 формы 0409102 приложения к Положению Банка России № 446-П (символ 61101 формы 0409102).»;

1.7. Таблицу приложения 1 изложить в следующей редакции:

«

№ п/п	Наименование норматива	Условное обозначение	Значения (%)		
			группа 1	группа 2	группа 3
1	Норматив достаточности собственных средств (капитала)	Н1 <sub>цк</sub>	≥120	≥100 и <120	<100
2	Норматив достаточности совокупных ресурсов	Н2 <sub>цк</sub>	≤80	>80 и ≤100	>100
3	Норматив достаточности индивидуального	Н3 <sub>цк</sub>	≤0,8	>0,8 и ≤1	>1

	клирингового обеспечения				
4	Норматив ликвидности	$H_{4цк}$	$\leq 80$	$> 80$ и $\leq 100$	$> 100$

1.8. Строку 4 Таблицы приложения 3 изложить в следующей редакции:

«

4	Показатель чистого процентного дохода	ПД4	$> 50$	$> 40$ и $\leq 50$	$\geq 30$ и $\leq 40$	$< 30$	2
---	---------------------------------------	-----	--------	--------------------	-----------------------	--------	---

«

2. Настоящее Указание вступает в силу по истечении 10 дней после дня его официального опубликования в «Вестнике Банка России».

Председатель Центрального банка  
Российской Федерации  
Э.С.НАБИУЛЛИНА