



ЦЕНТРАЛЬНЫЙ БАНК РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
(БАНК РОССИИ)

УКАЗАНИЕ

« 2 » апреля 2021 г.

№ 5469-У

г. Москва



**О внесении изменений в Указание Банка России
от 29 октября 2018 года № 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; 2018, № 18, ст. 2557):

1. Внести в Указание Банка России от 29 октября 2018 года № 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. В пункте 1.1 слова «Департаментом финансовой стабильности Банка России (далее – уполномоченное структурное подразделение Банка России)» заменить словами «структурным подразделением Банка России, осуществляющим надзор за центральными контрагентами (далее – уполномоченное структурное подразделение Банка России),».

1.2. В пункте 2.1:

абзац четвертый после слов «выраженное в процентах,» дополнить словами «равно или»;

абзац шестой изложить в следующей редакции:

«в деятельности центрального контрагента в отчетном периоде отсутствуют факты нарушения обязательных резервных требований в соответствии с Положением Банка России от 11 января 2021 года № 753-П «Об обязательных резервах кредитных организаций», зарегистрированным Министерством юстиции Российской Федерации 28 мая 2021 г. № 63663 (далее – Положение Банка России № 753-П);».

1.3. В пункте 2.2:

абзац четвертый дополнить словами «, включая значение нижней границы диапазона»;

абзацы седьмой – девятый изложить в следующей редакции:

«в деятельности центрального контрагента Банком России в отчетном периоде установлены факты непогашенного недовзноса в обязательные резервы, которые устранены в течение двух рабочих дней со дня их установления, и (или) факт однократного невыполнения обязанности по усреднению обязательных резервов, являющиеся нарушением обязательных резервных требований в соответствии с Положением Банка России № 753-П;

центральный контрагент в отчетном периоде имел на своем балансе обязательства перед участниками клиринга, не исполненные в срок, не превышающий пяти рабочих дней со дня наступления срока исполнения

обязательств, или обязательства по уплате обязательных платежей, в том числе перед Банком России, не исполненные в срок, не превышающий трех рабочих дней со дня наступления срока исполнения обязательств;

структура собственности в соответствии с главой 3 настоящего Указания признается достаточно прозрачной.»;

дополнить новым абзацем следующего содержания:

«К группе 2 не может быть отнесен центральный контрагент, имеющий хотя бы одно из оснований для отнесения его к группам 3 и 4.».

1.4. В пункте 2.3:

абзац третий дополнить словами «, включая значение нижней границы диапазона»;

абзац шестой изложить в следующей редакции:

«в деятельности центрального контрагента Банком России в отчетном периоде установлены факты непогашенного недовзноса в обязательные резервы, которые устранены в течение срока, превышающего два рабочих дня со дня установления указанных фактов, и (или) факты неоднократного невыполнения обязанности по усреднению обязательных резервов, являющиеся нарушением обязательных резервных требований в соответствии с Положением Банка России № 753-П;»;

абзацы восьмой и девятый изложить в следующей редакции:

«в деятельности центрального контрагента Банком России в отчетном периоде зафиксировано неоднократное неисполнение в установленный срок предписаний Банка России за нарушения федеральных законов и (или) издаваемых в соответствии с ними нормативных актов Банка России;

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

дополнить новыми абзацами следующего содержания:

«в деятельности центрального контрагента Банком России в отчетном периоде зафиксировано использование собственных средств в размере, превышающем средства выделенного капитала, для покрытия убытков, связанных с дефолтом участника клиринга;

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

в отношении центрального контрагента действует ограничение или запрет Банка России на проведение отдельных операций, связанных с осуществлением клиринговой деятельности, в соответствии с частью 7 статьи 25 Федерального закона «О клиринге, клиринговой деятельности и центральном контрагенте» и (или) запрет Банка России на осуществление отдельных банковских операций, предусмотренных лицензией на осуществление банковских операций, в соответствии с пунктом 3 части третьей статьи 74 Федерального закона «О Центральном банке Российской Федерации (Банке России)»;

центральным контрагентом принято решение о начале реализации плана восстановления финансовой устойчивости центрального контрагента, разработанного им в соответствии с частью 1 статьи 11¹ Федерального закона «О клиринге, клиринговой деятельности и центральном контрагенте» (Собрание законодательства Российской Федерации, 2011, № 7, ст. 904; 2016, № 1, ст. 23), в случае наступления события (событий), влекущего (влекущих) применение мероприятий по восстановлению финансовой устойчивости центрального контрагента, предполагающих привлечение источников финансирования, предусмотренных пунктом 2 графы «Содержание раздела» строки 5.2 приложения к Положению Банка России

от 2 июля 2018 года № 643-П «О требованиях к содержанию, порядке и сроках представления в Банк России плана восстановления финансовой устойчивости центрального контрагента, изменений, вносимых в него, о порядке оценки Банком России плана восстановления финансовой устойчивости центрального контрагента, о требованиях к виду и характеру событий, о наступлении которых центральный контрагент обязан информировать Банк России, а также о порядке информирования Банка России о наступлении в деятельности центрального контрагента событий, предусмотренных планом восстановления финансовой устойчивости центрального контрагента, и принятии решения о начале реализации плана восстановления финансовой устойчивости центрального контрагента», зарегистрированному Министерством юстиции Российской Федерации 4 октября 2018 года № 52339, 3 ноября 2020 года № 60731;

в деятельности центрального контрагента зафиксированы убытки, полученные в результате нарушения в отчетном периоде непрерывности работы клиринговых систем центрального контрагента.

К группе 3 не может быть отнесен центральный контрагент, имеющий основание для отнесения его к группе 4.».

1.5. В пункте 2.4 слово «(банкротства)» заменить словом «банкротства», слова «лицензии на осуществление клиринговой деятельности» заменить словами «аннулирования лицензии на осуществление клиринговой деятельности, и (или) Банком России принято решение о начале реализации плана действий в отношении центрального контрагента, разработанного Банком России в соответствии с частью 5 статьи 11¹ Федерального закона «О клиринге, клиринговой деятельности и центральном контрагенте».

1.6. В пункте 3.5:

абзац первый подпункта 3.5.2 изложить в следующей редакции:

«3.5.2. Показатель концентрации кредитных рисков на одного заемщика или группу связанных заемщиков (ПА2) для целей оценки экономического положения центрального контрагента определяется в порядке, установленном для расчета норматива Н6 «Максимальный размер риска на одного заемщика или группу связанных заемщиков», предусмотренного Инструкцией Банка России от 29 ноября 2019 года № 199-И «Об обязательных нормативах и надбавках к нормативам достаточности капитала банков с универсальной лицензией», зарегистрированной Министерством юстиции Российской Федерации 27 декабря 2019 года № 57008, 31 марта 2020 года № 57913, 11 сентября 2020 года № 59770, 3 ноября 2020 года № 60730 (далее – Инструкция Банка России № 199-И).»;

абзац первый подпункта 3.5.3 изложить в следующей редакции:

«3.5.3. Показатель концентрации кредитных рисков на связанное с центральным контрагентом лицо (группу связанных с центральным контрагентом лиц) (ПА3) для целей оценки экономического положения центрального контрагента определяется в порядке, установленном для расчета норматива Н25 «Максимальный размер риска на связанное с банком лицо (группу связанных с банком лиц)», предусмотренного Инструкцией Банка России № 199-И.».

1.7. В пункте 3.6:

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

в подпункте 3.6.1:

абзац четвертый после слов «форма 0409807)» дополнить словами «, с учетом требований, предусмотренных для определения показателя ФР подпунктом 3.3.1 пункта 3.3 Указания Банка России от 3 апреля 2017 года № 4336-У «Об оценке экономического положения банков», зарегистрированного Министерством юстиции Российской Федерации

19 мая 2017 года № 46771, 15 марта 2018 года № 50380, 23 мая 2018 года № 51155, 22 февраля 2019 года № 53872 (далее – Указание Банка России № 4336-У»);

абзац восьмой изложить в следующей редакции:

« A_{cp} – средняя величина активов, которая рассчитывается как среднее арифметическое (по данным отчетности по состоянию на первое число месяца, следующего за отчетным, за все месяцы, начиная с отчетности по состоянию на 1 января и заканчивая отчетностью на дату, на которую рассчитывается числитель) значений показателя «Всего активов» формы 0409806 «Бухгалтерский баланс (публикуемая форма)», установленной приложением 1 к Указанию Банка России № 4927-У, с учетом требований, предусмотренных для определения показателя А подпунктом 3.1.2 пункта 3.1 Указания Банка России № 4336-У.»;

абзац пятый подпункта 3.6.2 изложить в следующей редакции:

« K_{cp} – средняя величина капитала, которая рассчитывается как среднее арифметическое (по данным отчетности по состоянию на первое число месяца, следующего за отчетным, за все месяцы, начиная с отчетности по состоянию на 1 января и заканчивая отчетностью на дату, на которую рассчитывается числитель) значений показателя К.»;

в подпункте 3.6.3:

в абзаце четвертом слова «(приложение к Положению Банка России от 22 декабря 2014 года № 446-П «О порядке определения доходов, расходов и прочего совокупного дохода кредитных организаций», зарегистрированному Министерством юстиции Российской Федерации 6 февраля 2015 года № 35910, 8 декабря 2015 года № 40025, 31 июля 2018 года № 51743)» исключить;

абзац пятый после цифр «0409807» дополнить словами «, рассчитанное в соответствии с подпунктом 3.3.3 пункта 3.3 Указания Банка России № 4336-У»;

подпункт 3.6.4 изложить в следующей редакции:

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

$$\text{ПД4} = \frac{\text{ЧДк}}{\text{ПН}} \times 100\%,$$

где:

ЧДк – чистые комиссионные и аналогичные доходы, которые рассчитываются как разность между комиссионными и аналогичными доходами (Дк) и комиссионными и аналогичными расходами (Рк).

Дк – значение показателя «Комиссионные и аналогичные доходы», равного итогу по разделу 7 части 2 формы 0409102.

Рк – значение показателя «Комиссионные и аналогичные расходы», равного итогу по символам 47101–47109 формы 0409102.

ПН – значение показателя «Прибыль после налогообложения», равного значению символа 61101 формы 0409102.»;

первое предложение подпункта 3.6.5 дополнить словами «, за исключением показателя чистого комиссионного дохода (ПД4), предусмотренного подпунктом 3.6.4 настоящего пункта».

1.8. В приложении 1 строку 4 таблицы изложить в следующей редакции:

«	4	Норматив ликвидности	Н _{4цк}	≤ 80	> 80 и ≤ 100	».
---	---	----------------------	------------------	------	--------------	----

1.9. В приложении 3 строку 4 таблицы изложить в следующей редакции:

«	4	Показатель чистого комиссионного дохода	ПД4	> 50	> 40 и ≤ 50	≥ 30 и ≤ 40	< 30	2	».
---	---	---	-----	------	-------------	-------------	------	---	----

2. Настоящее Указание подлежит официальному опубликованию и в соответствии с решением Совета директоров Банка России (протокол заседания Совета директоров Банка России от 25 марта 2021 года № ПСД-6) вступает в силу с 1 апреля 2022 года.

Председатель
Центрального банка
Российской Федерации

Э.С. Набиуллина