# Указание Банка России от 02.04.2021 N 5769-У "О внесении изменений в Указание Банка России от 29 октября 2018 года N 4952-У "О методике оценки экономического положения центрального контрагента" (Зарегистрировано в Минюсте России 02.06.2021 N 63779)

ЦЕНТРАЛЬНЫЙ БАНК РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ

# УКАЗАНИЕ
# ОТ 2 АПРЕЛЯ 2021 Г. N 5769-У

# О ВНЕСЕНИИ ИЗМЕНЕНИЙ
# В УКАЗАНИЕ БАНКА РОССИИ ОТ 29 ОКТЯБРЯ 2018 ГОДА N 4952-У
# "О МЕТОДИКЕ ОЦЕНКИ ЭКОНОМИЧЕСКОГО ПОЛОЖЕНИЯ
# ЦЕНТРАЛЬНОГО КОНТРАГЕНТА"

На основании статьи 72 Федерального закона от 10 июля 2002 года N 86-ФЗ "О Центральном банке Российской Федерации (Банке России)" (Собрание законодательства Российской Федерации, 2002, N 28, ст. 2790; 2018, N 18, ст. 2557):

1. Внести в Указание Банка России от 29 октября 2018 года N 4952-У "О методике оценки экономического положения центрального контрагента", зарегистрированное Министерством юстиции Российской Федерации 17 января 2019 года N 53408, 31 марта 2020 года N 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 N 753-П "Об обязательных резервах кредитных организаций", зарегистрированным Министерством юстиции Российской Федерации 28 мая 2021 г. N 63663 (далее - Положение Банка России N 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 N 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 N 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 11.1 Федерального закона "О клиринге, клиринговой деятельности и центральном контрагенте" (Собрание законодательства Российской Федерации, 2011, N 7, ст. 904; 2016, N 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 N 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 N 52339, 3 ноября 2020 года N 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 11.1 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 N 199-И "Об обязательных нормативах и надбавках к нормативам достаточности капитала банков с универсальной лицензией", зарегистрированной Министерством юстиции Российской Федерации 27 декабря 2019 года N 57008, 31 марта 2020 года N 57913, 11 сентября 2020 года N 59770, 3 ноября 2020 года N 60730 (далее - Инструкция Банка России N 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) (ПАЗ) 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 N 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 N 4336-У "Об оценке экономического положения банков", зарегистрированного Министерством юстиции Российской Федерации 19 мая 2017 года N 46771, 15 марта 2018 года N 50380, 23 мая 2018 года N 51155, 22 февраля 2019 года N 53872 (далее - Указание Банка России N 4336-У)";

абзац восьмой изложить в следующей редакции:

"Аср - 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 N 4927-У, с учетом требований, предусмотренных для определения показателя А подпунктом 3.1.2 пункта 3.1 Указания Банка России N 4336-У.";

абзац пятый подпункта 3.6.2 изложить в следующей редакции:

"Кср - 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 N 446-П "О порядке определения доходов, расходов и прочего совокупного дохода кредитных организаций", зарегистрированному Министерством юстиции Российской Федерации 6 февраля 2015 года N 35910, 8 декабря 2015 года N 40025, 31 июля 2018 года N 51743)" исключить;

абзац пятый после цифр "0409807" дополнить словами ", рассчитанное в соответствии с подпунктом 3.3.3 пункта 3.3 Указания Банка России N 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:

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

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 | Н4ЦК | ≤ 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 N ПСД-6) вступает в силу с 1 апреля 2022 года.

Председатель Центрального банка
Российской Федерации

Э.С.НАБИУЛЛИНА

---

Версия #1
Журнал АО создал 2 апреля 2021 19:34:00
Журнал АО обновил 26 февраля 2024 15:26:21