



ЦЕНТРАЛЬНЫЙ БАНК РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
(БАНК РОССИИ)

« 12 » апреля 2018 г.



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 62² 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) 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) и в соответствии с решением Совета директоров Банка России (протокол заседания Совета директоров Банка России от 26 марта 2018 года № 9) 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 1.1:

абзац шестой изложить в следующей редакции:

«открытие и ведение банковских счетов юридических лиц в драгоценных металлах, за исключением монет из драгоценных металлов;»;

дополнить абзацем следующего содержания:

«осуществление переводов по поручению юридических лиц, в том числе банков-корреспондентов, по их банковским счетам в драгоценных металлах.».

1.2. Дополнить пунктами 1.1¹ – 1.1³ следующего содержания:

«1.1¹. Центральный контрагент вправе привлекать денежные средства юридических лиц во вклады (до востребования и на определенный срок) исключительно от участников клиринга (в том числе в случае когда участник клиринга действует от имени и по поручению своих клиентов).

1.1². Центральный контрагент вправе осуществлять банковские операции и сделки с драгоценными металлами, если это не требует использования центральным контрагентом весоизмерительных приборов и разновесов.

1.1³. Центральный контрагент вправе по итогам клиринга осуществлять расчеты по банковским счетам в драгоценных металлах по обязательствам, стороной которых он является.».

1.3. В пункте 2.2:

абзацы седьмой и восьмой 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 6 декабря 2017 года № 4638-У «О формах,

порядке и сроках раскрытия кредитными организациями информации о своей деятельности», зарегистрированным Министерством юстиции Российской Федерации 25 декабря 2017 года № 49423 (далее – Указание Банка России № 4638-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 24 ноября 2016 года № 4212-У «О перечне, формах и порядке составления и представления форм отчетности кредитных организаций в Центральный банк Российской Федерации», зарегистрированным Министерством юстиции Российской Федерации 14 декабря 2016 года № 44718, 29 марта 2017 года № 46155, 25 декабря 2017 года № 49421) (далее – Указание Банка России № 4212-У);

МДР – минимальная величина средств, необходимая для покрытия потенциальных потерь в результате ухудшения финансового положения центрального контрагента вследствие уменьшения его доходов или увеличения расходов, не связанных с неисполнением или ненадлежащим исполнением (далее – неисполнением) обязательств участниками клиринга, 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 № 4638-У, составляющая 25 процентов от величины операционных расходов, отраженной в графе 4 строки 21 формы 0409807 «Отчет о финансовых результатах (публикуемая форма)», установленной Указанием Банка России № 4212-У;»;

абзац тринадцатый изложить в следующей редакции:

«ЗН1.0 – величина знаменателя норматива достаточности собственных средств (капитала) (Н1.0), рассчитанная в соответствии с подпунктом 2.1.1 пункта 2.1 Инструкции Банка России от 28 июня 2017 года № 180-И «Об обязательных нормативах банков», зарегистрированной Министерством юстиции Российской Федерации 12 июля 2017 года № 47383, 30 ноября 2017 года № 49055, 10 января 2018 года № 49586. При расчете данной

величины не учитываются остатки на балансовых и внебалансовых счетах (их частях), образовавшиеся в результате проведения операций при осуществлении клиринговой деятельности и функций центрального контрагента;»;

в абзаце четырнадцатом слова «№ 3081-У» заменить словами «№ 4638-У».

1.4. Абзац четвертый пункта 5.2 изложить в следующей редакции:

«ВЛР – величина высоколиквидных ресурсов центрального контрагента, использование которых предусмотрено правилами клиринга для покрытия убытков, возникающих при неисполнении участниками клиринга своих обязательств, не покрытых за счет обеспечения. 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 связи с неисполнением участником клиринга своих обязательств) определяется как справедливая стоимость портфеля ценных бумаг центрального контрагента и ценных бумаг, предоставленных участниками клиринга в качестве обеспечения и коллективного клирингового обеспечения и хранящихся на соответствующих счетах депо в расчетных депозитариях, а также сумма 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 № 30102, 30110, 30114, 30118, 30119, 30125, 30221 (в части незавершенных расчетов с Банком России), 30416, 30417, 30418, 30419, 30426, 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;».

2. Настоящее Указание подлежит официальному опубликованию и вступает в силу с 1 июня 2018 года.

Председатель
Центрального банка
Российской Федерации

Э.С. Набиуллина