



ЦЕНТРАЛЬНЫЙ БАНК РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
(БАНК РОССИИ)

« 1 » ИЮНЯ 2018 г.

УКАЗАНИЕ



№ 4805-У

О внесении изменений

в Указание Банка России от 18 апреля 2014 года № 3234-У

«О единых требованиях к правилам осуществления брокерской деятельности при совершении отдельных сделок за счет клиентов»

1. На основании пункта 4¹ статьи 3, пункта 3 статьи 42 Федерального закона от 22 апреля 1996 года № 39-ФЗ «О рынке ценных бумаг» (Собрание законодательства Российской Федерации, 1996, № 17, ст. 1918; 2001, № 33, ст. 3424; 2002, № 52, ст. 5141; 2004, № 27, ст. 2711; № 31, ст. 3225; 2005, № 11, ст. 900; № 25, ст. 2426; 2006, № 1, ст. 5; № 2, ст. 172; № 17, ст. 1780; № 31, ст. 3437; № 43, ст. 4412; 2007, № 1, ст. 45; № 18, ст. 2117; № 22, ст. 2563; № 41, ст. 4845; № 50, ст. 6247; 2008, № 52, ст. 6221; 2009, № 1, ст. 28; № 18, ст. 2154; № 23, ст. 2770; № 29, ст. 3642; № 48, ст. 5731; № 52, ст. 6428; 2010, № 17, ст. 1988; № 31, ст. 4193; № 41, ст. 5193; 2011, № 7, ст. 905; № 23, ст. 3262; № 29, ст. 4291; № 48, ст. 6728; № 49, ст. 7040; № 50, ст. 7357; 2012, № 25, ст. 3269; № 31, ст. 4334; № 53, ст. 7607; 2013, № 26, ст. 3207; № 30, ст. 4043, ст. 4082, ст. 4084; № 51, ст. 6699; № 52, ст. 6985; 2014, № 30, ст. 4219; 2015, № 1, ст. 13; № 14, ст. 2022; № 27, ст. 4001; № 29, ст. 4348,

ст. 4357; 2016, № 1, ст. 50, ст. 81; № 27, ст. 4225; 2017, № 25, ст. 3592; № 27, ст. 3925; № 30, ст. 4444; № 48, ст. 7052; 2018, № 1, ст. 65, ст. 70; № 17, ст. 2424) внести в Указание Банка России от 18 апреля 2014 года № 3234-У «О единых требованиях к правилам осуществления брокерской деятельности при совершении отдельных сделок за счет клиентов», зарегистрированного Министерством юстиции Российской Федерации 18 июня 2014 года № 32792, 24 февраля 2016 года № 41207, следующие изменения.

1.1. Пункт 1 дополнить словами «, за исключением своп-договоров, указанных в абзаце третьем пункта 5 Указания Банка России от 16 февраля 2015 года № 3565-У «О видах производных финансовых инструментов», зарегистрированного Министерством юстиции Российской Федерации 27 марта 2015 года № 36575, базисным активом которых является иностранная валюта.».

1.2. Абзац первый пункта 2 после слов «и денежными средствами» дополнить словами «(в том числе с иностранной валютой)».

1.3. В пункте 3 слова «(в том числе иностранной валюте)» исключить.

1.4. В пункте 11:

абзац десятый изложить в следующей редакции:

«в случае проведения брокером операции за счет клиентов, связанных с отчуждением (приобретением) иностранной валюты и ее обратным приобретением (отчуждением) брокером.»;

дополнить абзацем следующего содержания:

«в случае изменения брокером начальной ставки риска, предусмотренной пунктом 14 приложения 1 к настоящему Указанию.».

1.5. Пункт 18 изложить в следующей редакции:

«18. Заккрытие позиций по решению брокера осуществляется без соблюдения требований пункта 17 настоящего Указания в случаях, если:

покупка ценных бумаг, связанная с закрытием позиций, осуществляется по цене, не превышающей максимальную цену сделки с такими ценными бумагами, совершенной на анонимных торгах в течение последних 15 минут, или если эти торги приостановлены, – в течение последних 15 минут до их приостановления;

продажа ценных бумаг, связанная с закрытием позиций, осуществляется по цене не ниже минимальной цены сделки с такими ценными бумагами, совершенной на анонимных торгах в течение последних 15 минут, или если эти торги приостановлены, – в течение последних 15 минут до их приостановления;

покупка или продажа ценных бумаг, связанная с закрытием позиций, осуществляется в отношении ценных бумаг, не допущенных к анонимным торгам организатора торговли;

покупка облигаций, связанная с закрытием позиций, осуществляется по цене не выше лучшей котировки на продажу таких ценных бумаг, опубликованной в информационной системе Блумберг (Bloomberg) или в информационной системе Томсон Рейтерс (Thomson Reuters), более чем на величину произведения указанной котировки и одной четвертой начальной ставки риска по этой облигации, рассчитанной в соответствии с пунктом 17 приложения 1 к настоящему Указанию;

продажа облигаций, связанная с закрытием позиций,

осуществляется по цене не ниже лучшей котировки на покупку таких ценных бумаг, опубликованной в информационной системе Блумберг (Bloomberg) или в информационной системе Томсон Рейтерс (Thomson Reuters), более чем на величину произведения указанной котировки и одной четвертой начальной ставки риска по этой облигации, рассчитанной в соответствии с пунктом 17 приложения 1 к настоящему Указанию.».

1.6. Дополнить пунктом 18¹ следующего содержания:

«18¹. Заккрытие позиций клиента в соответствии с абзацами пятым и шестым пункта 18 настоящего Указания осуществляется в случае, если договором о брокерском обслуживании для облигаций определен источник информации о ценах или котировках, в соответствии с которыми будет осуществляться закрытие позиций клиента, а в случае, если таким источником является информационная система Блумберг (Bloomberg) или информационная система Томсон Рейтерс (Thomson Reuters), – также указано условное обозначение (указаны условные обозначения) котировок, применяемое (применяемые) для их идентификации в такой информационной системе.».

1.7. Пункт 12 приложения 1 к Указанию изложить в следующей редакции:

«12. Цена одной i -й ценной бумаги $P_{i,j}$ определяется исходя из информации о цене последней сделки с i -й ценной бумагой, совершенной на анонимных торгах, предоставляемой организатором торговли участникам торгов.

Цена одной i -й ценной бумаги иностранного эмитента $P_{i,j}$ по решению брокера определяется исходя из информации о цене последней сделки с i -й ценной бумагой, совершенной на торгах

иностранного организатора торговли (иностранной биржи), предоставляемой иностранным организатором торговли (иностранной биржей) участникам торгов, если объем торгов i -й ценной бумагой на этом иностранном организаторе торговли (иностранной бирже) за последний календарный месяц, предшествующий дню определения цены $P_{i,j}$, превышает объем торгов за тот же период у каждого российского организатора торговли.

Порядок выбора российского организатора торговли или иностранного организатора торговли (иностранной биржи), информация которого используется для определения цены i -й ценной бумаги, определяется брокером по соглашению с клиентом.

Цена $P_{i,j}$ по облигации определяется с учетом накопленного процентного (купонного) дохода.

Цена одной i -ой облигации $P_{i,j}$ по решению брокера определяется по средней цене такой облигации на основе цены лучшей котировки на покупку и цены лучшей котировки на продажу таких облигаций, опубликованных в информационной системе Блумберг (Bloomberg) или в информационной системе Томсон Рейтерс (Thomson Reuters) на момент определения $P_{i,j}$.

В случае если для определения цены i -ой ценной бумаги используется информация, публикуемая в информационной системе Блумберг (Bloomberg) или в информационной системе Томсон Рейтерс (Thomson Reuters), брокер по соглашению с клиентом определяет информационную систему, информация из которой используется для определения цены i -й ценной бумаги, а также условное обозначение (условные обозначения) котировок, применяемое (применяемые) для их идентификации в такой информационной системе.».

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

Председатель
Центрального банка
Российской Федерации

Э.С. Набиуллина