



ЦЕНТРАЛЬНЫЙ БАНК РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
(БАНК РОССИИ)

УКАЗАНИЕ

« 27 » августа 2019г.

№ 5239-У



О внесении изменения в пункт 2.4

Указания Банка России от 21 августа 2017 года № 4501-У

**«О требованиях к организации профессиональным участником
рынка ценных бумаг системы управления рисками,
связанными с осуществлением профессиональной деятельности на
рынке ценных бумаг и с осуществлением операций с собственным
имуществом, в зависимости от вида деятельности и характера
совершаемых операций»**

1. На основании пункта 5 статьи 10¹⁻¹, пунктов 3 и 34 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; № 52, ст. 7920; 2018, № 1, ст. 65, ст. 70; № 17, ст. 2424; № 18, ст. 2560; № 32, ст. 5088; № 49, ст. 7524; № 53, ст. 8440; 2019, № 25, ст. 3169; № 30, ст. 4150) абзац первый подпункта 2.4.2 пункта 2.4 Указания Банка России от 21 августа 2017 года № 4501-У «О требованиях к организации профессиональным участником рынка ценных бумаг системы управления рисками, связанными с осуществлением профессиональной деятельности на рынке ценных бумаг и с осуществлением операций с собственным имуществом, в зависимости от вида деятельности и характера совершаемых операций», зарегистрированного Министерством юстиции Российской Федерации 21 декабря 2017 года № 49364, изложить в следующей редакции:

«2.4.2. Обеспечение проведения стресс-тестирования рисков (в том числе прямое и обратное стресс-тестирование рисков) профессиональных участников, осуществляющих брокерскую деятельность при совершении отдельных операций и сделок за счет клиентов, в договорах о брокерском обслуживании которых предусмотрены право использовать денежные средства клиента профессионального участника в интересах брокеров, а также возможность возникновения непокрытых позиций, предусмотренных пунктами 4 и 6 Указания Банка России от 8 октября 2018 года № 4928-У «О требованиях к осуществлению брокерской деятельности при совершении брокером отдельных сделок с ценными бумагами и заключении договоров, являющихся производными финансовыми инструментами, критериях ликвидности ценных бумаг, предоставляемых в качестве обеспечения обязательств клиента перед брокером, при совершении брокером таких сделок и заключении таких договоров, а также об обязательных нормативах брокера, совершающего такие сделки и заключающего такие договоры», зарегистрированного Министерством юстиции Российской Федерации 4 марта 2019 года № 53942, и (или) возможность заключения по поручению клиентов профессионального участника договоров, являющихся производными финансовыми инструментами (далее – брокер).».

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

Председатель
Центрального банка
Российской Федерации

Э.С. Набиуллина