



Банк России

Центральный банк Российской Федерации



## Департамент рынка ценных бумаг и товарного рынка

Селютина Л.К.

Екатеринбург  
19 октября 2017

Вид организации	30.09.2017	За 9 месяцев 2017 г.		
	Кол-во	Выдано	Аннулировано	Прирост/убыль
Всего финпосредников, в т.ч.	588[284]	13	63	-7,2%
Брокер, дилер, ДУ, депозитарий	583[284]	11	63	-8,2%
Товар.брокер	2[0]	0	0	
Клиент.брокер	3[0]	2	0	200,0%
Форекс-дилер	8[0]	2	0	33,3%
Регистратор	35[0]	0	0	
Биржа, клиринг	11[2]	0	1	-8,3%
<b>Всего</b>	<b>642[286]</b>	<b>15</b>	<b>64</b>	<b>-7,1%</b>

[в т.ч. кредитных организаций]

Динамика аннулирования лицензий ПУРЦБ в 2017 г. существенно замедлилась.

За 9 месяцев 2017 г. ушло с рынка 64 организации (за аналогичный период 2016 г. – 164 организации)



	1 кв. 2016	2 кв. 2016	3 кв. 2016	4 кв. 2016	1 кв. 2017	2 кв. 2017	3 кв. 2017
<b>Ушло организаций* , в т.ч. по основаниям</b>	<b>50</b>	<b>37</b>	<b>77</b>	<b>40</b>	<b>30</b>	<b>14</b>	<b>20</b>
По нарушению	18	12	45	14	10	3	4
Отзыв банковской лицензии	12	12	15	11	6	3	8
По заявлению	17	11	10	14	11	6	8
Иное	3	2	7	1	3	2	0

на 01.01.2016 г - 829 финпосредников.

За 2016 г. ушло с рынка 204 организации (из них 199 финпосредников), из них

- отозвана лицензия (лицензии) за нарушение законодательства – 89;
- в связи с отзывом банковской лицензии – 50;
- по заявлению (добровольно) - 52;
- по иным основаниям – 13.

пришло на рынок 13 организаций (из них 8 финпосредников).

на 01.01.2017 г - 638 финпосредников.

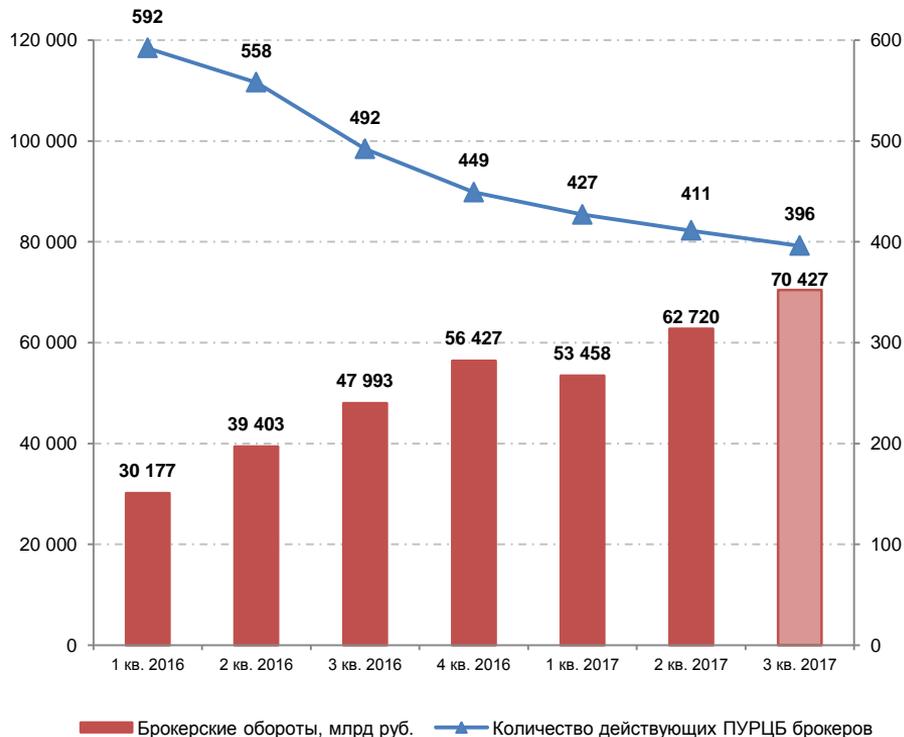
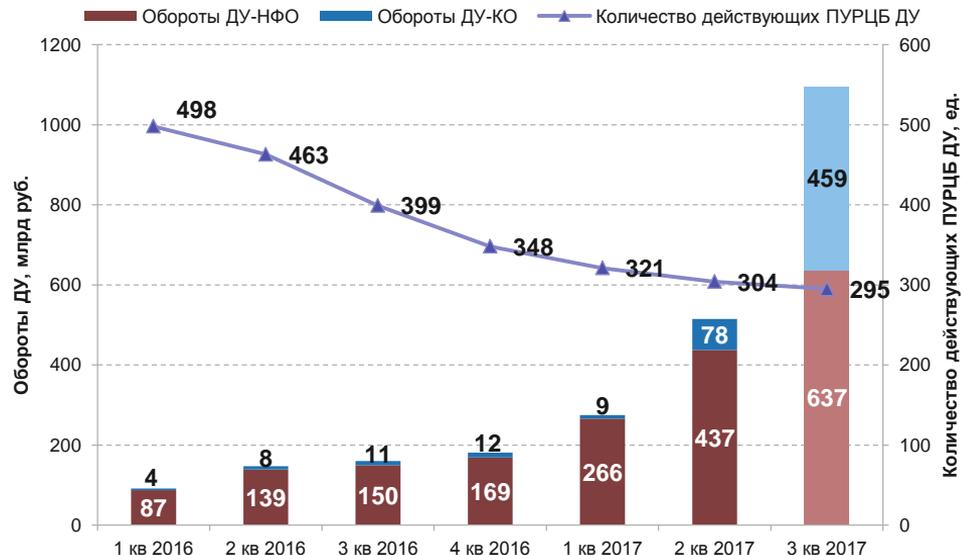
За 9 месяцев 2017 г. ушло с рынка 64 организации (из них 63 финпосредника), из них

- отозвана лицензия (лицензии) за нарушение законодательства – 17;
- в связи с отзывом банковской лицензии – 17;
- по заявлению (добровольно) - 25;
- по иным основаниям – 5.

пришло на рынок 15 организаций (из них 13 финпосредников).

Снижение количества ПУРЦБ не сказалось негативным образом на деловой активности и объемных показателях развития рынка

\*Финпосредники, регистраторы, биржи, клиринги

**Динамика брокерских оборотов (млрд руб.) и количества брокеров\* (шт.)**

**Динамика оборотов ДУ (млрд руб.) и количества доверительных управляющих\* (шт.)**


**Снижение количества ПУРЦБ не сказалось негативным образом на деловой активности и объемных показателях развития рынка**

\*данные по оборотам за 3 кв. 2017 предварительные, включая РЕПО

### Внутренний учет

• Положение о правилах ведения внутреннего учета (577-П) вступило в силу 01.10.2017

### Требования к минимальному размеру СС

• Указание № 4373-У «О требованиях к собственным средствам профессиональных участников рынка ценных бумаг» вступило в силу 27.06.2017

### Требования к системе управления рисками

• Нормативный акт о требованиях к системе управления рисками ПУРЦБ находится на регистрации в Минюсте

### Норматив «Показатель краткосрочной ликвидности»

• Указание Банка России 4402-У «О требованиях к осуществлению брокерской деятельности в части расчета показателя краткосрочной ликвидности ...» вступило в силу 01.09.2017

### Норматив «Показатель достаточности капитала»

• Проект нормативного акта утвержден на КФН и готовится к рассмотрению на Совете директоров Банка России

### Требования по заключению сделок с непокрытой позицией

• Поправки позволят открывать непокрытые позиции с меньшим обеспечением на сегментах спот-рынка, срочного и валютного рынков

### Расчет размера собственных средств

• Разрабатываются изменения в порядок расчета размера собственных средств ПУРЦБ

### Предоставление отчетности в формате XBRL

• Рассмотрен и одобрен на КФН нормативный акт, устанавливающий требования к предоставлению отчетности и иной информации в формате XBRL

## Критерии категоризации

ТИП ОРГАНИЗАЦИИ	Критерий	Малые	Средние	Крупные
БРОКЕРЫ	Обороты брокерские (обычные), млн руб.	до 10 000	более 10 000, но не более 100 000	более 100 000
	Количество клиентов на брок. обслуживании, лиц	до 1000	более 1 000, но не более 100 000	более 100 000
ДУ	Обороты ДУ (обычные), млн руб.	до 20 000	более 20 000, но не более 200 000	более 200 000
	Количество клиентов на ДУ, лиц	до 500	более 500, но не более 5 000	более 5 000
ДЕПОЗИТАРИИ	Активы на хранении, млн руб.	до 200	более 200, но не более 2 000	более 2 000
ДИЛЕРЫ	Дилерские обороты (обычные), млн руб.	до 50 000	более 50 000, но не более 500 000	более 500 000
РЕГИСТРАТОРЫ	Число зарегистрированных лиц, шт.	-	не более 1 000 000	более 1 000 000
БИРЖИ	Объем торгов в квартал, млн руб.	до 10 000	более 10 000, но не более 100 000	более 100 000

## Региональная статистика по категоризации (планируемое распределение с 1 ноября 2017)

ХАБ	Крупные	Средние	Малые	Общий итог
ДРЦБиТР	43	81	19	143
ВВГУ		6	87	93
ГУ по ЦФО	1	40	298	339
Уральское ГУ		8	59	67
<b>Общий итог</b>	<b>44</b>	<b>135</b>	<b>463</b>	<b>642</b>

Информация приведена для фин. посредников, депозитариев, регистраторов и инфраструктурных организаций, включая КО.

### В зависимости от видов деятельности

- Лицензирование клиентского брокера
- Методические рекомендации по непрерывности

2016

### Дифференциация по размеру

- Крупные
- Средние
- Малые

481-П

- ✓ Внутренний аудит (только для крупных)
- ✓ Снижение необходимого минимума работников (для депозитариев)
- ✓ Отмена для средних регистраторов требований по совету директоров и снижение регионального присутствия

2017

### Установление дифференцированных требований в нормативных актах Банка России

- Отчетность
- СУР

2018

**!** Критерии дифференцирования по размеру рассчитываются по данным отчетности как самостоятельно участником рынка, так и Банком России

<b>«ЗЕЛЕНый» РИСК-ПРОФИЛЬ РЕЖИМ №1</b>	<b>«ЖЕЛТый» РИСК-ПРОФИЛЬ РЕЖИМ №2</b>	<b>«ОРАНЖЕВый» РИСК-ПРОФИЛЬ РЕЖИМ №3</b>	<b>«КРАСНый» РИСК-ПРОФИЛЬ РЕЖИМ №4</b>
<p><i>низкая интенсивность анализа деятельности НФО, мониторинг триггеров, реагирование на надзорные факты</i></p>	<p><i>средняя интенсивность анализа деятельности НФО, мониторинг триггеров и осуществление плановых мероприятий</i></p>	<p><i>высокая интенсивность анализа деятельности НФО, рассмотрение вопроса о применения мер по восстановлению деятельности, ограничению или приостановлению действия лицензии/ проведения отдельных операций, рассмотрение планов восстановления платежеспособности</i></p>	<p><i>выполнение мероприятий, направленных на прекращение доступа НФО на финансовый рынок</i></p>
<p>Для малых и средних компаний минимальная надзорная нагрузка и преимущественно надзор по триггерам</p>	<p>Для крупных компаний – более обширная отчетность (расширенные данные по стресс-тестированию, рискам и т.п.), регулярные встречи, индивидуальные запросы и т.д.</p>	<p>Вне зависимости от размера пристальное внимание регулятора и повышенная надзорная нагрузка, возможно приостановление определенных операций</p>	<p>Мероприятия регулятора по выводу компании с рынка</p>

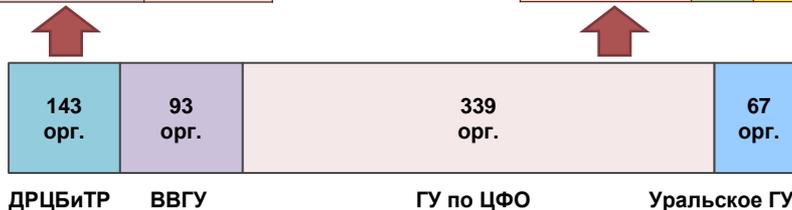
**ДРЦБ – основной надзорный департамент за ПУРЦБ**

ДРЦБитР

Категория	I	II	III	IV	не проводилось**	Всего по категории
Крупные	31	12				43
Средние	30	35	8		8	81
Малые	13	4			1	19
<b>Всего организаций</b>	<b>74</b>	<b>51</b>	<b>8</b>	<b>1</b>	<b>9</b>	<b>143</b>

ГУ по ЦФО

Категория	I	II	III	IV	не проводилось**	Всего по категории
Крупные	1					1
Средние	23	15	2			40
Малые	131	134	24	7	2	298
<b>Всего организаций</b>	<b>155</b>	<b>149</b>	<b>26</b>	<b>7</b>	<b>2</b>	<b>339</b>



ВВГУ

Категория	I	II	III	IV	не проводилось**	Всего по категории
Крупные						0
Средние	2	3		1		6
Малые	45	26	14	2		87
<b>Всего организаций</b>	<b>47</b>	<b>29</b>	<b>14</b>	<b>3</b>	<b>0</b>	<b>93</b>

Уральское ГУ

Категория	I	II	III	IV	не проводилось**	Всего по категории
Крупные						0
Средние	6	2				8
Малые	30	28	1			59
<b>Всего организаций</b>	<b>36</b>	<b>30</b>	<b>1</b>	<b>0</b>	<b>0</b>	<b>67</b>

\*По планируемому (с 1 ноября 2017 г.) распределению ПУРЦБ по хадам и итогам ранжирования на 30.09.2017

\*\* Серым цветом выделены компании по которым не определялся риск-профиль (по форекс-дилерам, товарным и клиентским брокерам)



- ✓ Завершение передачи Досье – **01.11.2017**
- ✓ Знакомство поднадзорных с новыми кураторами
- ✓ Будет использоваться **конференц-связь** через **Отделения Банка России** на местах

### ПУРЦБ

143

ЦА

339

ЦФО

93

ВВГУ

67

УГУ

## Поднадзорные Банка России: области надзора

- анализ финансового состояния,
- оценка деятельности,
- взаимодействие с членами СРО и Банком России
- внутренние процессы
- структура СРО и персонал

## Надзор за членами СРО

Соблюдение требований Базовых стандартов, законодательства и т.д.

## Регулирование и развитие рынка

1. Разработка и развитие базовых стандартов
2. Участие в Рабочих группах по разработке НПА в Банке России
3. Инициирование поправок в действующее регулирование, способствующих развитию бизнеса



## БАЗОВЫЕ СТАНДАРТЫ:

- ✓ **корпоративного управления** (по каждому виду деятельности);
- ✓ **защиты прав и интересов физических и юридических лиц** - получателей финансовых услуг (по каждому виду деятельности, за исключением дилерской);
- ✓ **по управлению рисками** (только для форекс -дилеров)
- ✓ **совершения операций** (по каждому виду деятельности);

## КОМИТЕТЫ:

- ✓ по брокерской деятельности;
- ✓ по дилерской деятельности;
- ✓ по деятельности управляющих;
- ✓ по депозитарной деятельности;
- ✓ по деятельности регистраторов;
- ✓ по деятельности форекс-дилеров.

Утвержден для форекс-дилеров