Личный кабинет

ЦЕНТРАЛЬНЫЙ БАНК РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ (БАНК РОССИИ)

107016, Москва, ул. Неглинная, д. 12, к. В
www.cbr.ru
тел.: (499) 300-30-00, 8 (800) 300-30-00

Национальная ассоциация участников фондового рынка

ИНН 7712088223

От 11.03.2026 № Ц38-2-2/877

на от

О наиболее часто встречающихся ошибках при расчете размера собственных средств

Департамент инвестиционных финансовых посредников Банка России (далее – Департамент) в связи с выявлением в ходе надзорных мероприятий типовых ошибок, допускаемых профессиональными участниками рынка ценных бумаг (далее – профессиональные участники) при расчете размера собственных средств (далее – РСС) на основании требований Указания Банка России № 5099-У[1], просит Национальную ассоциацию участников фондового рынка (НАУФОР) довести до сведения членов саморегулируемой организации следующую информацию.

Наиболее часто выявляются следующие нарушения, допускаемые профессиональными участниками при расчете РСС:

- принятие к РСС акций и паев, не входящих в котировальный список первого уровня российских бирж или основной список иностранных бирж[2];

- принятие к РСС негосударственных облигаций, не входящих в котировальный список первого уровня российских бирж или в основной список иностранных бирж, не имеющих соответствующих гарантий, рейтингов, поручительств, рейтингов эмитентов, а также не относящихся к

[1] Указание Банка России от 22.03.2019 № 5099-У «О требованиях к расчету размера собственных средств при осуществлении профессиональной деятельности на рынке ценных бумаг, а также при получении лицензии (лицензий) на осуществление профессиональной деятельности на рынке ценных бумаг».

[2] Иностранная биржа должна удовлетворять не менее чем одному из критериев, установленных Банком России на основании пункта 4 статьи 51.1 Федерального закона «О рынке ценных бумаг».

проектам ТС и САЭ[3];

- принятие к РСС средств на расчетных счетах в российских кредитных организациях, не имеющих соответствующего кредитного рейтинга[4];

- принятие к РСС средств учредителей управления, в том числе переданных в качестве клирингового обеспечения.

Неверный расчет РСС влечет представление недостоверной информации в Банк России в составе отчетности по форме 0420413 «Расчет собственных средств», ее раскрытие на официальном сайте профессионального участника, что может привести к принятию необоснованных решений пользователями. Кроме того, устранение нарушений в расчете РСС может стать причиной снижения РСС ниже минимально допустимого значения.

Учитывая вышеизложенное, а также, наличие обязательного лицензионного требования к минимальному размеру собственных средств, предусмотренного подпунктом 2.1.1 пункта 2.1 Положения Банка России № 481-П[5], Департамент рекомендует профессиональным участникам усилить внутренний контроль, в том числе в рамках управления регуляторным и операционным рисками, за качеством активов, принимаемых к РСС.

И.о. директора
Департамента инвестиционных
финансовых посредников Банка России Н.А. Печелиев

---

[3] Проекты технологического суверенитета и проекты структурной адаптации экономики Российской Федерации.

[4] Без учета оснований, предусмотренных подпунктами 3.1.2, 3.1.3 пункта 3.1 Положения Банка России № 5099-У.

[5] Положение Банка России от 27.07.2015№ 481-П «О лицензионных требованиях и условиях осуществления профессиональной деятельности на рынке ценных бумаг, ограничениях на совмещение отдельных видов профессиональной деятельности на рынке ценных бумаг, а также о порядке и сроках представления в Банк России отчетов о прекращении обязательств, связанных с осуществлением профессиональной деятельности на рынке ценных бумаг, в случае аннулирования лицензии профессионального участника рынка ценных бумаг».