



**ЦЕНТРАЛЬНЫЙ БАНК
РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
(Банк России)**

**Департамент рынка
ценных бумаг и товарного рынка**

107016, Москва, ул. Неглинная, 12
www.cbr.ru
тел.: (499) 300-30-00

От 18.12.2019 № 55-3-3-1-1/3545
на от

Личный кабинет

Национальная ассоциация
участников фондового рынка
(НАУФОР)
ИНН 7712088223

Саморегулируемая организация
«Национальная финансовая
ассоциация»
ИНН 7717088481

О расчете размера
собственных средств ПУРЦБ

В связи с изменением требований к расчету размера собственных средств (установлены Указанием Банка 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», далее – Указание № 5099-У) Департамент рынка ценных бумаг и товарного рынка просит довести до сведения профессиональных участников рынка ценных бумаг, не являющихся кредитными организациями, управляющими компаниями инвестиционных фондов, паевых инвестиционных фондов и негосударственных пенсионных фондов (далее – ПУРЦБ), следующую информацию.

Согласно подпунктам 2.1.10-2.1.11 пункта 2.1 Указания № 5099-У ПУРЦБ должен принимать к расчету размера собственных средств маржинальные займы, предоставленные как клиентам, отнесенным в соответствии с договором о брокерском обслуживании к категории клиентов со стандартным и повышенным уровнем риска (далее – КСУР и КПУР, соответственно), так и клиентам с особым уровнем риска (далее – КОУР).

Вместе с тем, следует учитывать, что норма¹ о включении в состав собственных средств маржинальных займов, предоставленных клиентам, отнесенным в соответствии с договором о брокерском обслуживании к категории КОУР действует до 01.01.2020. После указанной даты маржинальные займы, предоставленные указанной категории клиентов, принимаются к расчету размера собственных средств как активы,

¹ Пункт 2.1.11 пункта 2.1 Указания Банка от 22.03.2019 № 5099-У

предусмотренные подпунктом 2.1.15 пункта 2.1 Указания № 5099-У, если они соответствуют условиям, установленным пунктом 3.6 Указания № 5099-У.

При этом маржинальные займы, предоставленные клиентам, отнесенным в соответствии с договором о брокерском обслуживании к категории КОУР, в случае изменения категории указанных клиентов не могут рассматриваться как маржинальные займы, предоставленные клиентам категорий КСУР и КПУР, так как на момент выдачи займа такие клиенты относились к категории КОУР.

На основании изложенного, маржинальные займы, предоставленные клиентам, отнесенным в соответствии с договором о брокерском обслуживании к категории КОУР, в случае изменения категории указанных клиентов, после 01.01.2020 могут приниматься к расчету размера собственных средств ПУРЦБ на основании подпункта 2.1.15 пункта 2.1 Указания № 5099-У при условии соблюдения требований пункта 3.6 Указания № 5099-У.

Директор

Л.К. Селютина