



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
(НАУФОР)

ИНН 7712088223

От 07.11.2024 № 38-1-4/3747
на от

О порядке расчета величины
высоколиквидных активов и ожидаемых
оттоков денежных средств

Департамент инвестиционных финансовых посредников Банка России в связи с поступающими в Банк России обращениями по вопросам включения в расчет обязательного норматива краткосрочной ликвидности¹ активов, распоряжение которыми ограничено вследствие санкций², просит довести до членов Национальной ассоциации участников фондового рынка (НАУФОР), являющихся брокерами, следующее.

В соответствии с абзацем третьим пункта 2.4 Указания в расчет величины высоколиквидных активов не должны приниматься активы, распоряжение которыми ограничено в том числе вследствие санкций.

При этом в соответствии с пунктами 3.2 и 3.3 Указания в расчет величины ЧООДС³ брокер должен включать в том числе обязательства по возврату денежных средств клиентов по договорам о брокерском обслуживании, в соответствии с которыми клиентами предоставлено брокеру право использования их денежных средств в его интересах.

¹ Согласно требованиям Указания Банка России от 13.04.2020 № 5436-У «Об установлении обязательного норматива краткосрочной ликвидности для брокера, которому клиентами предоставлено право использования их денежных средств в его интересах».

² Недружественные действия иностранных государств, международных организаций, иностранных финансовых организаций, в том числе связанные с введением ограничительных мер в отношении Российской Федерации, российских юридических лиц и граждан Российской Федерации.

³ Чистый ожидаемый отток денежных средств, как этот термин используется в Указании.

Вместе с тем, принимая во внимание содержание абзаца второго пункта 3.2 Указания, считаем, что в ситуации, когда в отношении денежных средств клиента брокера установлено ограничение распоряжения вследствие санкций (далее – заблокированные денежные средства клиента), и при этом условия договора о брокерском обслуживании с данным клиентом с учетом требований гражданского законодательства предусматривают ограничение ответственности брокера за нарушение обязательства по возврату заблокированных денежных средств клиента брокера в полном объеме, то брокер вправе при расчете величины ожидаемых оттоков денежных средств согласно главе 3 Указания не учитывать обязательства по возврату таких денежных средств.

Директор Департамента
инвестиционных финансовых
посредников

О.Ю. Шишлянникова