

**ЦЕНТРАЛЬНЫЙ БАНК РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
(БАНК РОССИИ)**

« ____ » _____ 2016 г.

№ _____

г. Москва

У К А З А Н И Е

**О внесении изменений в Указание Банка России
от 21 июля 2014 года № 3329-У «О требованиях к собственным средствам
профессиональных участников рынка ценных бумаг и управляющих
компаний инвестиционных фондов, паевых инвестиционных фондов и
негосударственных пенсионных фондов»**

1. В соответствии с решением Совета директоров Банка России (протокол заседания Совета директоров Банка России от ____ 2016 года № ____) внести в Указание Банка России от 21 июля 2014 года № 3329-У «О требованиях к собственным средствам профессиональных участников рынка ценных бумаг и управляющих компаний инвестиционных фондов, паевых инвестиционных фондов и негосударственных пенсионных фондов», зарегистрированное Министерством юстиции Российской Федерации 15 августа 2014 года № 33608 («Вестник Банка России» от 27 августа 2014 года № 75), следующие изменения.

1.1 Пункт 2 изложить в следующей редакции:

«2. Минимальный размер собственных средств профессиональных участников рынка ценных бумаг рассчитывается в следующем порядке:

$$\text{МРСС} = X \times \text{НДСС},$$

где:

МРСС - минимальный размер собственных средств;

НДСС - норматив достаточности собственных средств;

X - постоянная величина, равная 2 миллионам рублей. Для депозитариев величина X рассчитывается по следующей формуле:

$$X = \frac{\sum_i \left(a_i \sum_j P_{i,j} Q_{i,j} \right)}{\text{НДСС}} + C,$$

где:

$Q_{i,j}$ - количество j -ых ценных бумаг на счете номинального держателя или счете лица, действующего в интересах других лиц, открытого депозитарию i -ым лицом, осуществляющим учет прав на ценные бумаги;

$P_{i,j}$ - рыночная цена j -ых ценных бумаг, учитываемых на счете номинального держателя или счете лица, действующего в интересах других лиц, открытого депозитарию i -ым лицом, осуществляющим учет прав на ценные бумаги, определенная в порядке, установленном для определения налоговой базы по налогу на доходы физических лиц в соответствии с главой 23 Налогового кодекса Российской Федерации (Собрание законодательства Российской Федерации, 2000, № 32, ст. 3340).

В случае отсутствия у j -ой ценной бумаги рыночной цены, для определения значения $P_{i,j}$ депозитарий использует:

для депозитарных расписок – произведение рыночной цены представляемых ценных бумаг на их количество, а в случае отсутствия рыночной цены - произведение номинальной стоимости представляемых ценных бумаг на их количество, умноженное на поправочный коэффициент, равный 3;

для инвестиционных паев паевых инвестиционных фондов - расчетную стоимость инвестиционных паев;

для иных ценных бумаг – произведение их номинальной стоимости на поправочный коэффициент, равный 3;

a_i - значение коэффициента, присвоенного i -му лицу, осуществляющему учет прав на ценные бумаги, согласно приложению к настоящему Указанию;

C - постоянная величина, равная 2 миллионам рублей.

Депозитарий использует рыночную цену ценных бумаг, установленную на дату расчета величины X .

Депозитарий при расчете величины X не использует следующие ценные бумаги:

ценные бумаги иностранных эмитентов, в отношении которых отсутствует информация об их рыночной цене или номинальной стоимости;

ценные бумаги, учитываемые на счете номинального держателя в реестре владельцев ценных бумаг, ведение которого не передано регистратору;

ценные бумаги, учитываемые на счете номинального держателя в реестре владельцев ценных бумаг, ведение которого не осуществляется регистратором в связи с прекращением договора на ведение реестра;

ценные бумаги, учитываемые на счете номинального держателя в депозитарии, указанном в строке 7 или 8 приложения к настоящему Указанию, если депозитарий, осуществляющий расчет величины X , и представил Банку России обоснование объективной невозможности открытия счета номинального держателя в депозитариях, указанных в строках 2 – 4 и 6 приложения к настоящему Указанию;

ценные бумаги, в отношении которых одновременно соблюдаются следующие условия:

лицо, осуществлявшее учет прав на такие ценные бумаги, прекратило свою деятельность либо у такого лица аннулирована лицензия в соответствии с которой осуществлялся учет прав;

ведение реестра владельцев таких ценных бумаг не осуществляется регистратором, в том числе в связи с прекращением договора на ведение реестра».

1.3. Приложение к Указанию Банка России от 21 июля 2014 года № 3329-У О требованиях к собственным средствам профессиональных участников рынка ценных бумаг и управляющих компаний инвестиционных фондов, паевых инвестиционных фондов и негосударственных пенсионных фондов» дополнить строкой 10 следующего содержания:

10	иностранная организация, осуществляющая учет прав на ценные бумаги и входящая в группу лиц с депозитарием для которого рассчитывается величина X	0
----	--	---

1.3. Примечание к таблице в приложении к Указанию Банка России от 21 июля 2014 года № 3329-У О требованиях к собственным средствам профессиональных участников рынка ценных бумаг и управляющих компаний инвестиционных фондов, паевых инвестиционных фондов и негосударственных пенсионных фондов» дополнить абзацами следующего содержания:

«Значение коэффициента a_i , установленного строкой 10, применяется при одновременном соблюдении следующих условий:

1) ценные бумаги, в отношении которых рассчитывается величина X, учитываются на счете, открытом лицу, указанному в строке 10, в иностранной организации, включенной в перечень, утвержденный Банком России в соответствии с пунктом 3 статьи 27⁵⁻³ и пунктом 9 статьи 51¹ 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; № 27, ст. 3880; № 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. 4349, ст. 4357; 2016, № 1, ст. 81);

2) указанный счет содержит сведения, позволяющие идентифицировать владельцев ценных бумаг и иных лиц, которые в соответствии с федеральными законами или их личным законом от своего имени осуществляют права по ценным бумагам, а также количество принадлежащих им ценных бумаг.

Значение коэффициента a_i вышестоящего депозитария, являющегося кредитной организацией, определяется на основе расчета собственных средств кредитной организации, раскрываемого ежемесячно на официальном сайте Банка России в информационно-телекоммуникационной сети «Интернет» или на основе информации полученной по запросу депозитария от вышестоящего депозитария, являющегося кредитной организацией.».

2. Настоящее Указание подлежит официальному опубликованию и вступает в силу с 1 октября 2016 года.

Председатель
Центрального банка
Российской Федерации

Э.С. Набиуллина