



НАЦІОНАЛЬНА КОМІСІЯ З ЦІННИХ ПАПЕРІВ ТА ФОНДОВОГО РИНКУ РІШЕННЯ

19.08.2021

м. Київ

N 667

Зареєстровано в Міністерстві юстиції України
07 жовтня 2021 р. за N 1307/36929

Про затвердження Змін до Положення щодо пруденційних нормативів професійної діяльності на фондовому ринку та вимог до системи управління ризиками

Відповідно до пункту 37⁵ частини другої статті 7, пункту 13 частини першої статті 8 Закону України "Про державне регулювання ринків капіталу та організованих товарних ринків" з метою приведення у відповідність до вимог Закону України від 19 червня 2020 року N 738-IX "Про внесення змін до деяких законодавчих актів України щодо спрощення залучення інвестицій та запровадження нових фінансових інструментів" Національна комісія з цінних паперів та фондового ринку

ВИРІШИЛА:

1. У заголовку та пункті 1 рішення Національної комісії з цінних паперів та фондового ринку від 01 жовтня 2015 року N 1597 "Про затвердження Положення щодо пруденційних нормативів професійної діяльності на фондовому ринку та вимог до системи управління ризиками", зареєстрованого в Міністерстві юстиції України 28 жовтня 2015 року за N 1311/27756, слова "фондовому ринку та вимог до системи управління ризиками" замінити словами "ринках капіталу та організованих товарних ринках".

2. Затвердити Зміни до Положення щодо пруденційних нормативів професійної діяльності на фондовому ринку та вимог до системи управління ризиками, затвердженого рішенням Національної комісії з цінних паперів та фондового ринку від 01 жовтня 2015 року N 1597, зареєстрованого в Міністерстві юстиції України 28 жовтня 2015 року за N 1311/27756 (зі змінами), що додаються (далі - Зміни).

3. Департаменту методології корпоративного управління, корпоративних фінансів, фінансових інструментів на ринках капіталу та організованих товарних ринків (Будьонний О.) забезпечити: подання цього рішення на державну реєстрацію до Міністерства юстиції України; оприлюднення цього рішення на офіційному вебсайті Національної комісії з цінних паперів та фондового ринку.

4. Це рішення набирає чинності з 01 квітня 2022 року, крім абзаців двадцять четвертого та двадцять п'ятого підпункту 3 пункту 4, абзацу дванадцятого підпункту 2 та абзаців п'ятого та шостого підпункту 6 пункту 5, абзаців п'ятого та шостого підпункту 4 пункту 6, абзацу одинадцятого підпункту 2 та абзаців п'ятого та шостого підпункту 5 пункту 7, абзацу сьомого підпункту 2 та абзаців десятого та одинадцятого підпункту 3 пункту 8, абзацу дванадцятого підпункту 3 та абзаців п'ятого та шостого підпункту 6 пункту 9, абзаців тринадцятого, двадцять п'ятого та двадцять шостого пункту 10, абзацу п'ятого підпункту 2 та абзаців п'ятого та шостого підпункту 5 пункту 12 Змін, які набирають чинності з дня набрання чинності нормативно-правовими актами Комісії, якими встановлюється мінімальний розмір початкового капіталу для відповідних видів професійної діяльності на ринках капіталу та організованих товарних ринках, але не раніше 01 липня 2022 року, а також абзацу п'ятого підпункту 4 та абзаців п'ятого та шостого підпункту 5 пункту 11 Змін, які набирають чинності з 01 січня 2023 року.

5. Встановити, що вимоги до мінімального розміру регулятивного капіталу оператора організованого ринку капіталу, передбачені абзацом дванадцятим підпункту 3 пункту 9 Змін, застосовуються до 31 грудня 2022 року з коефіцієнтом 0,75.

6. Контроль за виконанням цього рішення покласти на члена Національної комісії з цінних паперів та

Протокол засідання Комісії
від 19 серпня 2021 р. N 40

ЗАТВЕРДЖЕНО
Рішення Національної комісії з цінних паперів та фондового ринку
19 серпня 2021 року N 667

Зміни до Положення щодо пруденційних нормативів професійної діяльності на фондовому ринку та вимог до системи управління ризиками

1. У заголовку цього Положення слова "фондовому ринку та вимог до системи управління ризиками" замінити словами "ринках капіталу та організованих товарних ринках".

2. У розділі I:

1) у пункті 1 після слів "Це Положення визначає" слова "основні ризики професійної діяльності на фондовому ринку, встановлює" виключити, після слів "що застосовуються для" слова "їх вимірювання та оцінки, визначає вимоги до професійних учасників фондового ринку щодо запобігання та мінімізації впливу ризиків на їх діяльність, а також" замінити словами "вимірювання та оцінки ризиків професійної діяльності на ринках капіталу та організованих товарних ринках,";

2) у пункті 2:

в абзаці першому після слів "професійних учасників" слова "фондового ринку, що провадять такі види" замінити словами "ринків капіталу та організованих товарних ринків, що мають ліцензії на провадження таких видів";

в абзаці другому слова "цінними паперами" замінити словами "фінансовими інструментами";

в абзаці шостому слова "на фондовому ринку" замінити словами "фінансовими інструментами";

доповнити після абзацу шостого абзацом сьомим такого змісту:

"діяльність з організації торгівлі продукцією на товарних біржах";

У зв'язку з цим абзаці сьомий - восьмий вважати відповідно абзацами восьмим - дев'ятим;

3) у пункті 3 слова та цифри "фондовому ринку, крім Розрахункового центру з обслуговування договорів на фінансових ринках (далі - Розрахунковий центр) у частині дотримання вимог розділу VII стосовно коефіцієнта покриття зобов'язань учасників клірингу, а також розділів XII та XIII цього Положення" замінити словами "ринках капіталу";

4) у пункті 4:

абзац другий виключити.

У зв'язку з цим абзаці третій - шостий вважати відповідно абзацами другим - п'ятим;

абзац третій виключити.

У зв'язку з цим абзаці четвертий - п'ятий вважати відповідно абзацами третім - четвертим;

в абзаці третьому слова "фондового ринку" замінити словами "ринків капіталу та організованих товарних ринків";

в абзаці четвертому слова ""Про цінні папери та фондовий ринок", "Про державне регулювання ринку цінних паперів в Україні"" замінити словами ""Про ринки капіталу та організовані товарні ринки", "Про державне регулювання ринків капіталу та організованих товарних ринків", "Про товарні біржі"";

5) доповнити розділ I новим пунктом такого змісту:

"5. При поєднанні установою декількох видів професійної діяльності на ринках капіталу та організованих товарних ринках вимога до мінімального розміру її регулятивного капіталу є більшою з вимог до мінімального розміру регулятивного капіталу, встановлених для відповідних видів діяльності, що здійснюються установою."

3. Розділ II виключити.

У зв'язку з цим розділи III - XIII вважати відповідно розділами II - XII.

4. У розділі II:

1) у назві розділу слова "цінними паперами" замінити словами "фінансовими інструментами";

2) главу 1 викласти в такій редакції:

"1. Показники, що використовуються для вимірювання та оцінки ризиків діяльності з торгівлі фінансовими інструментами

1. Показники для вимірювання та оцінки ризиків діяльності з торгівлі фінансовими інструментами встановлюються в залежності від виду діяльності в межах професійної діяльності з торгівлі фінансовими інструментами, який відповідно до ліцензії має право здійснювати інвестиційна фірма, а саме:

- 1) субброкерська діяльність;
- 2) брокерська діяльність;
- 3) дилерська діяльність;
- 4) діяльність з управління портфелем фінансових інструментів;
- 5) інвестиційне консультування;
- 6) андеррайтинг та/або діяльність з розміщення з наданням гарантії;
- 7) діяльність з розміщення без надання гарантії.

2. Для вимірювання та оцінки ризиків діяльності з торгівлі фінансовими інструментами, що зазначена в підпунктах 3 та 6 пункту 1 цієї глави, використовуються такі показники:

- 1) розмір регулятивного капіталу;
- 2) норматив адекватності регулятивного капіталу;
- 3) норматив адекватності капіталу першого рівня;
- 4) коефіцієнт фінансового левериджу;
- 5) коефіцієнт абсолютної ліквідності;
- 6) норматив концентрації кредитного ризику.

3. Для вимірювання та оцінки ризиків діяльності з торгівлі фінансовими інструментами, що зазначена в підпунктах 1, 2 та 4 пункту 1 цієї глави, за умови, що така діяльність здійснюється з правом отримувати на власний рахунок та розпоряджатися коштами та фінансовими інструментами клієнтів, використовуються такі показники:

- 1) розмір регулятивного капіталу;
- 2) норматив адекватності регулятивного капіталу;
- 3) коефіцієнт абсолютної ліквідності;
- 4) норматив концентрації кредитного ризику;
- 5) норматив достатності регулятивного капіталу.

4. Для вимірювання та оцінки ризиків діяльності з торгівлі фінансовими інструментами, що зазначена в підпунктах 1, 2, 4, 5 та 7 пункту 1 цієї глави, за умови, що така діяльність здійснюється без права отримувати на власний рахунок та розпоряджатися коштами та фінансовими інструментами клієнтів, використовуються такі показники:

- 1) розмір регулятивного капіталу;
- 2) норматив концентрації кредитного ризику;
- 3) норматив достатності регулятивного капіталу;
- 4) коефіцієнт покриття операційного ризику.

5. Інвестиційні фірми, яким вперше видано ліцензію на провадження професійної діяльності з торгівлі фінансовими інструментами, при розрахунку нормативу адекватності регулятивного капіталу та нормативу адекватності капіталу першого рівня до закінчення першого повного фінансового року з дати видачі ліцензії не розраховують величину вимоги до капіталу установи під операційний ризик.

6. Нормативні значення нормативу достатності регулятивного капіталу та коефіцієнта покриття операційного ризику не поширюються на інвестиційні фірми до закінчення першого повного фінансового року з дати видачі ліцензії в разі, якщо такі інвестиційні фірми вперше отримали ліцензію на провадження професійної діяльності з торгівлі фінансовими інструментами.

7. Інвестиційні фірми, які уклали агентські договори, незалежно від виду діяльності в межах професійної діяльності з торгівлі фінансовими інструментами, який відповідно до ліцензії мають право здійснювати такі інвестиційні фірми, для вимірювання та оцінки ризиків діяльності з торгівлі фінансовими інструментами використовують показники, визначені пунктом 2 цієї глави.";

3) у главі 2:

у пункті 1 слова "фондовому ринку" замінити словами "ринках капіталу та організованих товарних ринках";

у підпункті 4 пункту 4 слово "дозволяється" замінити словом "слід";

у пункті 5:

доповнити після підпункту 5 підпунктом 6 такого змісту:

"6) короткострокової дебіторської заборгованості, термін сплати якої не настав (крім короткострокової дебіторської заборгованості, сумарний строк пролонгації якої перевищує 30 днів та термін сплати якої не

настав), у разі, якщо загальна її сума перевищує 25 % мінімального розміру регулятивного капіталу установи, у розмірі такого перевищення;"

У зв'язку з цим підпункти 6 - 18 вважати відповідно підпунктами 7 - 19;
доповнити після підпункту 9 підпунктом 10 такого змісту:

"10) прибутку поточного року, підтвердженого аудитором (аудиторською фірмою), що був розподілений у звітному році (у разі його включення до розрахунку);"

У зв'язку з цим підпункти 10 - 19 вважати відповідно підпунктами 11 - 20;
у підпункті 13 слова "перебувають у біржовому списку фондової біржі" замінити словами "допущені до торгів на організованих ринках капіталу";

у підпункті 15:

після слів "заборона щодо торгівлі якими на" слова "фондових біржах" замінити словами "організованих ринках капіталу";

після слів "(крім акцій приватних акціонерних товариств" слова ", які відповідно до законодавства України можуть перебувати у біржовому списку фондової біржі), рішеннями Комісії або рішеннями суду, що не перебувають в біржовому списку принаймні однієї з фондових бірж" замінити словами "), рішеннями Комісії або рішеннями суду, що не допущені до торгів на принаймні одному з організованих ринків капіталу";

доповнити підпункт словами ", депозитних сертифікатів банків";

у підпункті 16:

після слів "торгівля якими на" слова "фондових біржах" замінити словами "організованих ринках капіталу";

після слів "які відповідно до законодавства України не можуть" слова "перебувати у біржовому списку фондової біржі" замінити словами "бути допущені до торгів на організованих ринках капіталу";

після слів "системи депозитарного обліку цінних паперів або" слова "обіг яких зупинено на підставі рішення суду, рішення Комісії або постанови уповноваженої особи Комісії про накладання санкції за правопорушення на ринку цінних паперів" замінити словами "обіг яких/торгівлю якими зупинено на підставі рішення суду, рішення Комісії або постанови/розпорядження уповноваженої особи Комісії";

у підпункті 18 слова "перебувають у біржовому реєстрі принаймні однієї з фондових бірж" замінити словами "допущені до торгів на принаймні одному з регульованих ринків капіталу";

доповнити пункт 5 новим підпунктом такого змісту:

"21) фінансових інвестицій у статутний капітал підприємств-банкрутів, підприємств, щодо яких порушено справу про банкрутство, та підприємств, щодо яких проводиться процедура ліквідації, а також їх дебіторської заборгованості";

пункт 8 викласти в такій редакції:

"8. Мінімальний розмір регулятивного капіталу інвестиційної фірми повинен становити не менше мінімального розміру початкового капіталу, встановленого законодавством для відповідного виду діяльності в межах професійної діяльності з торгівлі фінансовими інструментами.

Для інвестиційної фірми, що надає додаткові послуги в межах професійної діяльності з торгівлі фінансовими інструментами (субброкерської діяльності, брокерської діяльності та діяльності з управління портфелем фінансових інструментів), а саме здійснює діяльність щодо надання клієнтам кредитів та позик для укладення деривативних контрактів та вчинення правочинів щодо фінансових інструментів, вимога до мінімального розміру регулятивного капіталу становить не менше мінімального розміру початкового капіталу, встановленого законодавством для відповідного виду діяльності в межах професійної діяльності з торгівлі фінансовими інструментами, збільшеного на 2,5 млн грн.

При провадженні інвестиційною фірмою декількох видів діяльності в межах професійної діяльності з торгівлі фінансовими інструментами вимога до мінімального розміру його регулятивного капіталу є більшою з вимог до мінімального розміру регулятивного капіталу, встановлених для відповідних видів діяльності, що здійснюються інвестиційною фірмою.";

пункт 9 виключити;

4) у главі 3:

у пункті 5 слово та цифри "підпункту 11" замінити словами та цифрами "підпунктів 6 та 13";

у пункті 6:

в абзаці першому цифру та слово "5 груп" замінити цифрою та словами "4 групи";

абзац четвертий підпункту 1 доповнити словами ", депозитні сертифікати банків";

в абзаці третьому підпункту 2:

слова "перебувають у біржовому реєстрі хоча б однієї з фондових бірж, крім" замінити словами та цифрою "допущені до торгів на хоча б одному з регульованих ринків капіталу, крім активів, визначених абзацом четвертим підпункту 1 цього пункту, цінних паперів венчурних інвестиційних фондів та";

цифри "12" замінити цифрами "14";
у підпункті 3:
в абзаці другому:
слова "які не перебувають у біржовому реєстрі, але перебувають у біржовому списку хоча б однієї з фондових бірж" замінити словами "які допущені до торгів на хоча б одному з організованих ринків капіталу, крім регульованих";
цифри "12" замінити цифрами "14";
доповнити після абзацу другого абзацом третім такого змісту:
"цінні папери венчурних інвестиційних фондів, які допущені до торгів на хоча б одному з регульованих ринків капіталу, крім відповідних активів, на суму яких зменшується розмір капіталу першого рівня згідно з підпунктом 14 пункту 5 глави 2 цього розділу";
У зв'язку з цим абзаци третій, четвертий вважати відповідно абзацами четвертим, п'ятим;
в абзаці четвертому слова "перебувають у біржовому реєстрі принаймні однієї з фондових бірж" замінити словами "допущені до торгів на принаймні одному з регульованих ринків капіталу";
у підпункті 4:
в абзаці третьому:
слова "не перебувають у біржовому реєстрі, але перебувають у біржовому списку хоча б однієї з фондових бірж" замінити словами "допущені до торгів на хоча б одному з організованих ринків капіталу, крім регульованих";
цифри "12" замінити цифрами "14";
в абзаці четвертому цифру "7" замінити цифрою "8";
в абзаці п'ятому слово та цифри "підпункту 11" замінити словами та цифрами "підпунктів 6 та 13";
підпункт 5 виключити;
у пункті 8 цифру "IV" замінити цифрою "III";
у пункті 9 слова "торговця цінними паперами" замінити словами "інвестиційної фірми";
5) у главі 4:
у пункті 5 цифру "IV" замінити цифрою "III";
у пункті 6 слова "торговця цінними паперами" замінити словами "інвестиційної фірми";
6) в абзаці першому пункту 2 глави 5 слова "торговця цінними паперами до розміру його" замінити словами "інвестиційної фірми до розміру її";
7) в абзаці четвертому пункту 3 глави 6 слова "перебувають в біржовому реєстрі принаймні однієї з фондових бірж (у тому числі торгівля якими на фондових біржах" замінити словами "допущені до торгів на принаймні одному з регульованих ринків капіталу (у тому числі торгівля якими на організованих ринках капіталу", слова "будь-якій фондовій біржі" замінити словами "будь-якому організованому ринку капіталу";
8) у главі 7:
у пункті 2 слова "до якої установа має вимоги, що представлені у вигляді активів" замінити словами "яка має зобов'язання перед установою за позиціями в активах";
у пункті 3 слова "що становлять вимоги до такого контрагента" замінити словами "за якими такий контрагент має зобов'язання перед установою";
в абзаці четвертому пункту 4 слова "що становлять її вимоги до k-го контрагента" замінити словами "за якими k-ий контрагент має зобов'язання перед установою";
у пункті 5:
в абзаці першому слова "що становлять вимоги установи до контрагента" замінити словами "за якими контрагент має зобов'язання перед установою";
в абзаці другому слова "юридичних осіб" замінити словом "контрагента";
в абзаці третьому слова "цінні папери" замінити словами "емсійні/неемсійні цінні папери, випущені/видані контрагентом,";
абзац четвертий викласти в такій редакції:
"заборгованість контрагента перед установою, у тому числі дебіторська заборгованість";
абзац п'ятий:
після слів "грошові кошти" доповнити словом "установи";
після слова "депозити" доповнити словом "установи";
у пункті 6:
в абзаці першому слова "фондової біржі, особи, що провадить клірингову діяльність, та Розрахункового центру" замінити словами "особи, яка провадить клірингову діяльність";
в абзаці другому слова "торговцем цінними паперами, та за одним контрагентом, що є банком або торговцем цінними паперами" замінити словами "інвестиційною фірмою, та за одним контрагентом, що є банком або інвестиційною фірмою";

- у пункті 7 слова "торговців цінними паперами" замінити словами "інвестиційних фірм";
у пункті 8 слова "торговцем цінними паперами" замінити словами "інвестиційною фірмою";
9) доповнити розділ двома новими главами такого змісту:

"8. Норматив достатності регулятивного капіталу

1. Норматив достатності регулятивного капіталу є показником, що відображає здатність інвестиційної фірми утримувати регулятивний капітал у розмірі не менше ніж 25 % від її фіксованих накладних витрат за попередній рік, тобто наявність у інвестиційної фірми достатнього регулятивного капіталу для покриття її фіксованих накладних витрат протягом 3 місяців, навіть за умови відсутності доходів протягом цього часу.
2. Норматив достатності регулятивного капіталу розраховується відповідно до пунктів 2 - 4 глави 3 розділу III цього Положення.
3. Нормативне значення нормативу достатності регулятивного капіталу для інвестиційної фірми становить не менше 1.

9. Коефіцієнт покриття операційного ризику

1. Коефіцієнт покриття операційного ризику відображає здатність інвестиційної фірми забезпечувати покриття своїх операційних ризиків регулятивним капіталом на рівні не менше ніж 15 % від її середньорічного позитивного нетто-доходу за 3 попередні фінансові роки.
2. Коефіцієнт покриття операційного ризику розраховується відповідно до пунктів 2 - 6 глави 4 розділу III цього Положення.
3. Нормативне значення коефіцієнта покриття операційного ризику для інвестиційної фірми становить не менше 1."

5. У розділі III:

1) у главі 1:

у пункті 1:

у підпункті 1 слова "власних коштів" замінити словами "регулятивного капіталу";

у підпункті 2 слова "власних коштів" замінити словами "регулятивного капіталу";

доповнити пункт 1 новим підпунктом такого змісту:

"5) норматив концентрації кредитного ризику";

у пункті 2:

слова "власних коштів" замінити словами "регулятивного капіталу";

слова "Компанії та Осіб" замінити словами "компанії з управління активами (далі - Компанія)";

слова "та Особи" виключити;

слова "фондовому ринку" замінити словами "ринках капіталу";

2) у главі 2:

у назві глави слова "власних коштів" замінити словами "регулятивного капіталу";

у пункті 1:

слова "Власні кошти" замінити словами "Регулятивний капітал";

слова "або Особа" виключити;

слова "фондовому ринку" замінити словами "ринках капіталу";

у пункті 2:

слова "Власні кошти розраховуються" замінити словами "Регулятивний капітал розраховується";

цифру "III" замінити цифрою "II";

слова "для розрахунку показника регулятивного капіталу установи" виключити;

пункт 3 викласти в такій редакції:

"3. Мінімальний розмір регулятивного капіталу Компанії повинен становити не менше мінімального розміру початкового капіталу, встановленого законодавством для зазначеного виду професійної діяльності на ринках капіталу.";

3) у главі 3:

у назві глави слова "власних коштів" замінити словами "регулятивного капіталу";

у пункті 1:

слова "власних коштів" замінити словами "регулятивного капіталу";

слова "або Особи" виключити;

слова "власні кошти" замінити словами "регулятивний капітал";

пункт 2 викласти в такій редакції:

"2. Норматив достатності регулятивного капіталу розраховується як відношення розміру регулятивного капіталу до величини, що становить 25 % від фіксованих накладних витрат установи за попередній фінансовий рік, за формулою

0,25 г

Регулятивний капітал

Фіксовані накладні витрати";

у пункті 3:

слова "Власні кошти розраховуються" замінити словами "Регулятивний капітал розраховується";

цифру "III" замінити цифрою "II";

слова "для розрахунку показника регулятивного капіталу установи" виключити;

у пункті 5 слова "власних коштів" замінити словами "регулятивного капіталу";

слова "та Осіб" виключити;

4) у главі 4:

у пункті 1:

слова "або Особи" виключити;

слова "власними коштами на рівні" замінити словами "регулятивним капіталом на рівні не менше ніж";

пункт 2 викласти в такій редакції:

"2. Коефіцієнт покриття операційного ризику розраховується як відношення розміру регулятивного капіталу установи до величини її операційного ризику за формулою

Регулятивний капітал

Величина операційного ризику";

у пункті 3:

слова "Власні кошти розраховуються" замінити словами "Регулятивний капітал розраховується";

цифру "III" замінити цифрою "II";

слова "для розрахунку показника регулятивного капіталу установи" виключити;

у пункті 6 слова "фондовому ринку" замінити словами "ринках капіталу";

у пункті 7 слова "та Осіб" виключити;

5) у главі 5:

у пункті 1 слова "або Особою" виключити;

у пункті 4 слова "та Осіб" виключити;

6) доповнити розділ III новою главою такого змісту:

"6. Норматив концентрації кредитного ризику

1. Норматив концентрації кредитного ризику встановлює обмеження кредитного ризику Компанії, що може виникнути внаслідок невиконання своїх зобов'язань окремим її контрагентом.

2. Норматив концентрації кредитного ризику розраховується в порядку, передбаченому главою 7 розділу II цього Положення.

3. Нормативне значення нормативу концентрації кредитного ризику щодо окремого контрагента, крім банків та інвестиційних фірм, становить не більше 25 %. При цьому значення нормативу концентрації кредитного ризику щодо окремого контрагента не має бути від'ємним.

4. Нормативне значення нормативу концентрації кредитного ризику щодо окремого контрагента, що є банком або інвестиційною фірмою, становить не більше 100 %. При цьому значення нормативу концентрації кредитного ризику щодо окремого контрагента не має бути від'ємним."

6. У розділі IV:

1) у главі 1:

у пункті 1:

у підпункті 1 слова "власних коштів" замінити словами "регулятивного капіталу";

доповнити пункт 1 новим підпунктом такого змісту:

"3) норматив концентрації кредитного ризику";

у пункті 2 слова "власних коштів" замінити словами "регулятивного капіталу";

2) у главі 2:

у назві глави слова "власних коштів" замінити словами "регулятивного капіталу";

у пункті 1:

слова "власних коштів" замінити словами "регулятивного капіталу";

слова "власні кошти" замінити словами "регулятивний капітал";

у пункті 2:

слова "власних коштів" замінити словами "регулятивного капіталу";

цифру "IV" замінити цифрою "III";

у пункті 3:

слова "власних коштів" замінити словами "регулятивного капіталу";

3) у главі 3:

у пункті 1 слова "власними коштами на рівні" замінити словами "регулятивним капіталом на рівні не менше ніж";

у пункті 2 цифру "IV" замінити цифрою "III";

4) доповнити розділ IV новою главою такого змісту:

"4. Норматив концентрації кредитного ризику

1. Норматив концентрації кредитного ризику встановлює обмеження кредитного ризику Центрального депозитарію, що може виникнути внаслідок невиконання своїх зобов'язань окремим його контрагентом.

2. Норматив концентрації кредитного ризику Центрального депозитарію розраховується в порядку, передбаченому главою 7 розділу II цього Положення, за виключенням врахування до складу активів, за якими контрагент має зобов'язання перед Центральним депозитарієм, грошових коштів на рахунках Центрального депозитарію, відкритих у Національному банку України або в інших банках, у тому числі іноземних, для отримання доходів та інших виплат за операціями емітентів (у тому числі тих, що розміщені та обертаються за межами України).

3. Нормативне значення нормативу концентрації кредитного ризику щодо окремого контрагента, крім банків та інвестиційних фірм, становить не більше 25 %. При цьому значення нормативу концентрації кредитного ризику щодо окремого контрагента не має бути від'ємним.

4. Нормативне значення нормативу концентрації кредитного ризику щодо окремого контрагента, що є банком або інвестиційною фірмою, становить не більше 100 %. При цьому значення нормативу концентрації кредитного ризику щодо окремого контрагента не має бути від'ємним."

7. У розділі V:

1) у главі 1:

у пункті 1:

в абзаці першому слова "фондовому ринку" замінити словами "ринках капіталу";

у підпункті 1 слова "власних коштів" замінити словами "регулятивного капіталу";

у підпункті 2 слова "власних коштів" замінити словами "регулятивного капіталу";

доповнити пункт 1 новим підпунктом такого змісту:

"4) норматив концентрації кредитного ризику";

у пункті 2:

слова "діяльності з торгівлі фінансовими інструментами та ліцензію на провадження депозитарної діяльності депозитарної установи" замінити словами "діяльності з торгівлі фінансовими інструментами та відповідно до рішення про видачу ліцензії має право надавати клієнтам додаткові послуги (депозитарна діяльність депозитарної установи)";

цифру "III" замінити цифрою "II";

слова "торговця цінними паперами" замінити словами "інвестиційної фірми";

у пункті 3:

слова "власних коштів" замінити словами "регулятивного капіталу";

слова "фондовому ринку" замінити словами "ринках капіталу";

2) у главі 2:

у назві глави слова "власних коштів" замінити словами "регулятивного капіталу";

у пункті 1:

слова "Власні кошти" замінити словами "Регулятивний капітал";

слова "фондовому ринку" замінити словами "ринках капіталу";

у пункті 2:

слова "Власні кошти розраховуються" замінити словами "Регулятивний капітал розраховується";

цифру "III" замінити цифрою "II";

слова "для розрахунку показника регулятивного капіталу установи" виключити;

пункт 3 викласти в такій редакції:

"3. Мінімальний розмір регулятивного капіталу депозитарної установи повинен становити не менше мінімального розміру початкового капіталу, встановленого законодавством для професійної діяльності на ринках капіталу - депозитарної діяльності депозитарної установи.";

3) у главі 3:

у назві глави слова "власних коштів" замінити словами "регулятивного капіталу";

у пункті 1:

слова "власних коштів" замінити словами "регулятивного капіталу";

слова "мінімальний розмір власних коштів у розмірі" замінити словами "регулятивний капітал у розмірі не менше ніж";

у пункті 2:

слова "власних коштів" замінити словами "регулятивного капіталу";

цифру "IV" замінити цифрою "III";

у пункті 3 слова "власних коштів" замінити словами "регулятивного капіталу";

4) у главі 4:

у пункті 1 слова "власними коштами на рівні" замінити словами "регулятивним капіталом на рівні не менше ніж";

у пункті 2 цифру "IV" замінити цифрою "III";

5) доповнити розділ V новою главою такого змісту:

"5. Норматив концентрації кредитного ризику

1. Норматив концентрації кредитного ризику встановлює обмеження кредитного ризику депозитарної установи, що може виникнути внаслідок невиконання своїх зобов'язань окремим її контрагентом.

2. Норматив концентрації кредитного ризику розраховується в порядку, передбаченому главою 7 розділу II цього Положення.

3. Нормативне значення нормативу концентрації кредитного ризику щодо окремого контрагента, крім банків та інвестиційних фірм, становить не більше 25 %. При цьому значення нормативу концентрації кредитного ризику щодо окремого контрагента не має бути від'ємним.

4. Нормативне значення нормативу концентрації кредитного ризику щодо окремого контрагента, що є банком або інвестиційною фірмою, становить не більше 100 %. При цьому значення нормативу концентрації кредитного ризику щодо окремого контрагента не має бути від'ємним."

8. У розділі VI:

1) у главі 1:

доповнити пунктом 1 такого змісту:

"1. Показники для вимірювання та оцінки ризиків клірингової діяльності встановлюються в залежності від виду діяльності в межах клірингової діяльності, яку відповідно до ліцензії має право здійснювати особа, яка провадить клірингову діяльність, а саме:

1) клірингова діяльність з визначення зобов'язань;

2) клірингова діяльність центрального контрагента."

У зв'язку з цим пункти 1 - 3 вважати відповідно пунктами 2 - 4;

у пункті 2:

в абзаці першому слова "особи, що провадить клірингову діяльність (крім Розрахункового центру)," замінити словами "клірингової діяльності з визначення зобов'язань";

підпункт 2 викласти в такій редакції:

"2) норматив достатності регулятивного капіталу;"

доповнити пункт 2 двома новими підпунктами такого змісту:

"3) норматив концентрації кредитного ризику;

4) коефіцієнт покриття операційного ризику";

пункти 3, 4 викласти в такій редакції:

"3. Для вимірювання та оцінки ризиків клірингової діяльності центрального контрагента додатково до показників, визначених підпунктами 1 - 3 пункту 2 цієї глави, використовуються такі показники:

1) норматив адекватності регулятивного капіталу;

2) коефіцієнт абсолютної ліквідності.

4. Нормативні значення нормативу достатності регулятивного капіталу та коефіцієнта покриття операційного ризику не поширюються на осіб, які провадять клірингову діяльність, до закінчення першого повного фінансового року з дати видачі ліцензії в разі, якщо такі особи вперше отримали ліцензію на провадження професійної діяльності на ринках капіталу - клірингової діяльності.";

2) у главі 2:

у пункті 1 слова "фондовому ринку" замінити словами "ринках капіталу та організованих товарних ринках";

у пункті 2:

слово "особи, що провадить клірингову діяльність," виключити;

слова та цифри "відповідно до пунктів 2 - 5 глави 2 розділу III" замінити словами та цифрами "в порядку, передбаченому главою 2 розділу II";

пункт 3 викласти в такій редакції:

"3. Мінімальний розмір регулятивного капіталу особи, яка провадить клірингову діяльність, повинен становити не менше мінімального розміру початкового капіталу, встановленого законодавством для відповідного виду діяльності в межах клірингової діяльності.";

3) глави 3 - 5 викласти в такій редакції:

"3. Норматив достатності регулятивного капіталу

1. Норматив достатності регулятивного капіталу є показником, що відображає здатність особи, яка провадить клірингову діяльність, утримувати розмір регулятивного капіталу у розмірі не менше ніж 25 % для клірингової діяльності з визначення зобов'язань та не менше ніж 50 % для клірингової діяльності

центрального контрагента від її фіксованих накладних витрат за попередній рік, тобто наявність у особи, яка провадить клірингову діяльність, достатнього капіталу для покриття її фіксованих накладних витрат протягом 3 або 6 місяців, навіть за умови відсутності доходів протягом цього часу.

2. Норматив достатності регулятивного капіталу для клірингової діяльності з визначення зобов'язань розраховується відповідно до пунктів 2 - 4 глави 3 розділу III цього Положення.

3. Норматив достатності регулятивного капіталу для клірингової діяльності центрального контрагента розраховується відповідно до пунктів 2 - 4 глави 3 розділу VII цього Положення.

4. Нормативне значення нормативу достатності регулятивного капіталу для особи, яка провадить клірингову діяльність, становить не менше 1.

4. Норматив концентрації кредитного ризику

1. Норматив концентрації кредитного ризику встановлює обмеження кредитного ризику особи, яка провадить клірингову діяльність, що може виникнути внаслідок невиконання своїх зобов'язань окремим її контрагентом.

2. Норматив концентрації кредитного ризику розраховується в порядку, передбаченому главою 7 розділу II цього Положення.

3. Нормативне значення нормативу концентрації кредитного ризику щодо окремого контрагента, крім банків та інвестиційних фірм, становить не більше 25 %. При цьому значення нормативу концентрації кредитного ризику щодо окремого контрагента не має бути від'ємним.

4. Нормативне значення нормативу концентрації кредитного ризику щодо окремого контрагента, що є банком або інвестиційною фірмою, становить не більше 100 %. При цьому значення нормативу концентрації кредитного ризику щодо окремого контрагента не має бути від'ємним.

5. Коефіцієнт покриття операційного ризику

1. Коефіцієнт покриття операційного ризику відображає здатність особи, яка провадить клірингову діяльність, забезпечувати покриття своїх операційних ризиків регулятивним капіталом на рівні не менше ніж 15 % від її середньорічного позитивного нетто-доходу за 3 попередні фінансові роки.

2. Коефіцієнт покриття операційного ризику розраховується відповідно до пунктів 2 - 6 глави 4 розділу III цього Положення.

3. Нормативне значення коефіцієнта покриття операційного ризику для особи, яка провадить клірингову діяльність, становить не менше 1.";

4) доповнити після глави 5 главою 6 такого змісту:

"6. Норматив адекватності регулятивного капіталу

1. Норматив адекватності регулятивного капіталу відображає наявність в особи, яка провадить клірингову діяльність, достатнього капіталу для покриття збитків, що можуть виникнути внаслідок реалізації основних ризиків її діяльності.

2. Норматив адекватності регулятивного капіталу - відношення розміру регулятивного капіталу до загальної вимоги до капіталу під ризику установи, яка визначається з урахуванням вимог до капіталу установи під кредитний та операційний ризику.

3. Норматив адекватності регулятивного капіталу розраховується відповідно до пунктів 3 - 8 глави 3 розділу II цього Положення.

4. Нормативне значення нормативу адекватності регулятивного капіталу для особи, яка провадить клірингову діяльність, становить не менше 8 відсотків."

У зв'язку з цим главу 6 вважати главою 7;

6) у главі 7:

у пункті 2 цифру "III" замінити цифрою "II";

у пункті 3 слово "що" замінити словом "яка".

9. У розділі VII:

1) у назві розділу слова "на фондовому ринку" замінити словами "фінансовими інструментами";

2) у главі 1:

у назві глави слова "на фондовому ринку" замінити словами "фінансовими інструментами";

у пункті 1:

у абзаці першому слова "на фондовому ринку" замінити словами "фінансовими інструментами";

у підпункті 1 слова "власних коштів" замінити словами "регулятивного капіталу";

у підпункті 2 слова "власних коштів" замінити словами "регулятивного капіталу";

доповнити пункт 1 новим підпунктом такого змісту:

"4) норматив концентрації кредитного ризику";

пункт 2 виключити.

У зв'язку з цим пункт 3 вважати пунктом 2;

у пункті 2:

слова "власних коштів" замінити словами "регулятивного капіталу";
після слів "не поширюються на" слова "фондові біржі" замінити словами "операторів організованих ринків капіталу";

слова "фондові біржі вперше отримали ліцензію на провадження професійної діяльності на фондовому ринку - діяльності з організації торгівлі на фондовому ринку" замінити словами "оператори організованих ринків капіталу вперше отримали будь-яку з ліцензій на провадження діяльності з організації торгівлі фінансовими інструментами";

3) у главі 2:

у назві глави слова "власних коштів" замінити словами "регулятивного капіталу";

у пункті 1:

слова "Власні кошти" замінити словами "Регулятивний капітал";

слова "фондова біржа" замінити словами "оператор організованого ринку капіталу";

слова "нею професійної діяльності на фондовому ринку" замінити словами "ним професійної діяльності на ринках капіталу";

у пункті 2:

слова "Власні кошти розраховуються" замінити словами "Регулятивний капітал розраховується";

цифру "III" замінити цифрою "II";

слова "для розрахунку показника регулятивного капіталу установи" виключити;

пункти 3, 4 викласти в такій редакції:

"3. Мінімальний розмір регулятивного капіталу оператора організованого ринку капіталу повинен становити не менше мінімального розміру початкового капіталу такого оператора організованого ринку капіталу, встановленого законодавством.

4. Якщо оператор організованого ринку капіталу має декілька ліцензій на провадження відповідних видів діяльності з організації торгівлі фінансовими інструментами, то вимога до мінімального розміру регулятивного капіталу такого оператора організованого ринку капіталу є максимальною з вимог до мінімального розміру початкового капіталу, встановлених законодавством для відповідних видів діяльності з організації торгівлі фінансовими інструментами.";

4) у главі 3:

у назві глави слова "власних коштів" замінити словами "регулятивного капіталу";

у пункті 1:

слова "власних коштів" замінити словами "регулятивного капіталу";

слова "фондової біржі" замінити словами "оператора організованого ринку капіталу";

слова "власні кошти" замінити словами "регулятивний капітал";

пункт 2 викласти в такій редакції:

"2. Норматив достатності регулятивного капіталу розраховується як відношення розміру регулятивного капіталу до величини, що становить 50 % від фіксованих накладних витрат установи за попередній фінансовий рік, за формулою

0,5 г

Регулятивний капітал

Фіксовані накладні витрати";

у пункті 3:

слова "Власні кошти розраховуються" замінити словами "Регулятивний капітал розраховується";

цифру "III" замінити цифрою "II";

слова "для розрахунку показника регулятивного капіталу установи" виключити;

у пункті 4 цифру "IV" замінити цифрою "III";

у пункті 5 слова "власних коштів для фондової біржі" замінити словами "регулятивного капіталу для оператора організованого ринку капіталу";

5) у главі 4:

у пункті 1:

слова "фондової біржі" замінити словами "оператора організованого ринку капіталу";

слова "власними коштами на рівні" замінити словами "регулятивним капіталом на рівні не менше ніж";

слово "ї" замінити словом "його";

у пункті 2 цифру "IV" замінити цифрою "III";

у пункті 3 слова "фондової біржі" замінити словами "оператора організованого ринку капіталу";

6) главу 5 викласти в такій редакції:

"5. Норматив концентрації кредитного ризику

1. Норматив концентрації кредитного ризику встановлює обмеження кредитного ризику оператора організованого ринку капіталу, що може виникнути внаслідок невиконання своїх зобов'язань окремим її контрагентом.

2. Норматив концентрації кредитного ризику розраховується в порядку, передбаченому главою 7 розділу II цього Положення.

3. Нормативне значення нормативу концентрації кредитного ризику щодо окремого контрагента, крім банків та інвестиційних фірм, становить не більше 25 %. При цьому значення нормативу концентрації кредитного ризику щодо окремого контрагента не має бути від'ємним.

4. Нормативне значення нормативу концентрації кредитного ризику щодо окремого контрагента, що є банком або інвестиційною фірмою, становить не більше 100 %. При цьому значення нормативу концентрації кредитного ризику щодо окремого контрагента не має бути від'ємним.";

7) главу 6 виключити.

10. Доповнити це Положення після розділу VII розділом VIII такого змісту:

"VIII. Пруденційні нормативи, що використовуються для вимірювання та оцінки ризиків діяльності з організації торгівлі продукцією на товарних біржах, їх розрахунок та нормативні значення

1. Показники, що використовуються для вимірювання та оцінки ризиків діяльності з організації торгівлі продукцією на товарних біржах

1. Для вимірювання та оцінки ризиків діяльності з організації торгівлі продукцією на товарних біржах використовуються такі показники:

- 1) розмір регулятивного капіталу;
- 2) норматив достатності регулятивного капіталу;
- 3) коефіцієнт покриття операційного ризику;
- 4) норматив концентрації кредитного ризику.

2. Нормативні значення нормативу достатності регулятивного капіталу та коефіцієнта покриття операційного ризику не поширюються на товарні біржі до закінчення першого повного фінансового року з дати видачі ліцензії в разі, якщо такі товарні біржі вперше отримали ліцензію на провадження діяльності з організації торгівлі продукцією на товарних біржах.

2. Розмір регулятивного капіталу

1. Регулятивний капітал є коштами, які товарна біржа може використовувати на покриття негативних фінансових наслідків реалізації ризиків, що виникають при провадженні нею професійної діяльності на організованих товарних ринках.

2. Регулятивний капітал розраховується в порядку, передбаченому главою 2 розділу II цього Положення.

3. Мінімальний розмір регулятивного капіталу товарної біржі повинен становити не менше мінімального розміру початкового капіталу товарної біржі, встановленого законодавством.

3. Норматив достатності регулятивного капіталу

1. Норматив достатності регулятивного капіталу є показником, що відображає здатність товарної біржі утримувати регулятивний капітал в розмірі, достатньому для покриття її фіксованих накладних витрат протягом 3 місяців, навіть за умови відсутності доходів протягом цього часу.

2. Норматив достатності регулятивного капіталу розраховується відповідно до пунктів 2 - 4 глави 3 розділу III цього Положення.

3. Нормативне значення нормативу достатності регулятивного капіталу для товарної біржі становить не менше 1.

4. Коефіцієнт покриття операційного ризику

1. Коефіцієнт покриття операційного ризику відображає здатність товарної біржі забезпечувати покриття своїх операційних ризиків регулятивним капіталом на рівні не менше ніж 15 % від її середньорічного позитивного нетто-доходу за 3 попередні фінансові роки.

2. Коефіцієнт покриття операційного ризику розраховується відповідно до пунктів 2 - 6 глави 4 розділу III цього Положення.

3. Нормативне значення коефіцієнта покриття операційного ризику для товарної біржі становить не менше 1.

5. Норматив концентрації кредитного ризику

1. Норматив концентрації кредитного ризику встановлює обмеження кредитного ризику товарної біржі, що може виникнути внаслідок невиконання своїх зобов'язань окремим її контрагентом.

2. Норматив концентрації кредитного ризику розраховується в порядку, передбаченому главою 7 розділу II цього Положення.

3. Нормативне значення нормативу концентрації кредитного ризику щодо окремого контрагента, крім банків та інвестиційних фірм, становить не більше 25 %. При цьому значення нормативу концентрації кредитного ризику щодо окремого контрагента не має бути від'ємним.

4. Нормативне значення нормативу концентрації кредитного ризику щодо окремого контрагента, що є банком або інвестиційною фірмою, становить не більше 100 %. При цьому значення нормативу концентрації кредитного ризику щодо окремого контрагента не має бути від'ємним."

У зв'язку з цим розділи VIII - XII вважати відповідно розділами IX - XIII.

11. У розділі IX:

1) у пункті 1 глави 1:

підпункт 4 викласти в такій редакції:

"4) розмір регулятивного капіталу;"

доповнити пункт 1 новим підпунктом такого змісту:

"5) норматив концентрації кредитного ризику";

2) у главі 3:

доповнити після пункту 1 пунктом 2 такого змісту:

"2. Норматив поточної ліквідності розраховується за формулою

$$\frac{\text{ГК} + \text{ПФІ}}{\text{ПЗ}} \quad \text{г } 100 \%$$

де

ГК - грошові кошти та їх еквіваленти;

ПФІ - поточні фінансові інвестиції;

ПЗ - поточні зобов'язання."

У зв'язку з цим пункти 2, 3 вважати відповідно пунктами 3, 4;

3) у главі 4:

у пункті 4:

абзац перший підпункту 1 доповнити літерою та цифрами "(K1 = 0)";

у підпункті 2:

абзац перший доповнити літерою та цифрами "(K2 = 0,2)";

абзац п'ятий викласти в такій редакції:

"цінні папери, які допущені до торгів на регульованому ринку капіталу;"

у підпункті 3:

абзац перший доповнити літерою та цифрами "(K3 = 0,3)";

абзац третій викласти в такій редакції:

"цінні папери, які допущені до торгів на хоча б одному з організованих ринків капіталу, крім регульованих;"

абзац перший підпункту 4 доповнити літерою та цифрами "(K4 = 0,5)";

абзац перший підпункту 5 доповнити літерою та цифрами "(K5 = 1)";

доповнити після пункту 4 пунктом 5 такого змісту:

"5. Якщо активи установи одночасно відповідають декільком ознакам, встановленим пунктом 4 цієї глави, що визначають їх належність до груп активів з різним ступенем ризику, такі активи відносяться до групи з більш високим ступенем ризику."

У зв'язку з цим пункт 5 вважати пунктом 6;

4) главу 5 викласти в такій редакції:

"5. Розмір регулятивного капіталу

1. Регулятивний капітал є коштами, які управитель може використовувати на покриття негативних фінансових наслідків реалізації ризиків, що виникають при провадженні ним професійної діяльності на ринках капіталу.

2. Регулятивний капітал розраховується в порядку, передбаченому главою 2 розділу II цього Положення.

3. Мінімальний розмір регулятивного капіталу управителя повинен становити не менше мінімального розміру початкового капіталу управителя, встановленого законодавством."

5) доповнити розділ IX новою главою такого змісту:

"6. Норматив концентрації кредитного ризику

1. Норматив концентрації кредитного ризику встановлює обмеження кредитного ризику управителя, що може виникнути внаслідок невиконання своїх зобов'язань окремим його контрагентом.

2. Норматив концентрації кредитного ризику розраховується в порядку, передбаченому главою 7 розділу II цього Положення.

3. Нормативне значення нормативу концентрації кредитного ризику щодо окремого контрагента, крім банків та інвестиційних фірм, становить не більше 25 %. При цьому значення нормативу концентрації

кредитного ризику щодо окремого контрагента не має бути від'ємним.

4. Нормативне значення нормативу концентрації кредитного ризику щодо окремого контрагента, що є банком або інвестиційною фірмою, становить не більше 100 %. При цьому значення нормативу концентрації кредитного ризику щодо окремого контрагента не має бути від'ємним."

12. У розділі X:

1) у главі 1:

у пункті 1:

доповнити підпунктом 1 такого змісту:

"1) розмір регулятивного капіталу;"

У зв'язку з цим підпункти 1, 2 вважати відповідно підпунктами 2, 3;

у підпункті 2 слова "власних коштів" замінити словами "регулятивного капіталу";

доповнити пункт 1 новим підпунктом такого змісту:

"4) норматив концентрації кредитного ризику";

у пункті 2 слова "власних коштів" замінити словами "регулятивного капіталу";

2) доповнити після глави 1 главою 2 такого змісту:

"2. Розмір регулятивного капіталу

1. Регулятивний капітал є коштами, які адміністратор недержавних пенсійних фондів може використовувати на покриття негативних фінансових наслідків реалізації ризиків, що виникають при провадженні ним професійної діяльності на ринках капіталу.

2. Регулятивний капітал розраховується в порядку, передбаченому главою 2 розділу II цього Положення.

3. Мінімальний розмір регулятивного капіталу адміністратора недержавних пенсійних фондів повинен становити не менше мінімального розміру початкового капіталу адміністратора недержавних пенсійних фондів, встановленого законодавством."

У зв'язку з цим глави 2, 3 вважати відповідно главами 3, 4;

3) у главі 3:

у назві глави слова "власних коштів" замінити словами "регулятивного капіталу";

у пункті 1:

слова "власних коштів" замінити словами "регулятивного капіталу";

слова "власні кошти" замінити словами "регулятивний капітал";

у пункті 2:

слова "власних коштів" замінити словами "регулятивного капіталу";

цифру "IV" замінити цифрою "III";

у пункті 3 слова "власних коштів" замінити словами "регулятивного капіталу";

4) у главі 4:

у пункті 1 слова "власними коштами на рівні" замінити словами "регулятивним капіталом на рівні не менше ніж";

у пункті 2 цифру "IV" замінити цифрою "III";

5) доповнити розділ X новою главою такого змісту:

"5. Норматив концентрації кредитного ризику

1. Норматив концентрації кредитного ризику встановлює обмеження кредитного ризику адміністратора недержавних пенсійних фондів, що може виникнути внаслідок невиконання своїх зобов'язань окремим його контрагентом.

2. Норматив концентрації кредитного ризику розраховується в порядку, передбаченому главою 7 розділу II цього Положення.

3. Нормативне значення нормативу концентрації кредитного ризику щодо окремого контрагента, крім банків та інвестиційних фірм, становить не більше 25 %. При цьому значення нормативу концентрації кредитного ризику щодо окремого контрагента не має бути від'ємним.

4. Нормативне значення нормативу концентрації кредитного ризику щодо окремого контрагента, що є банком або інвестиційною фірмою, становить не більше 100 %. При цьому значення нормативу концентрації кредитного ризику щодо окремого контрагента не має бути від'ємним."

13. Розділ XI виключити.

У зв'язку з цим розділи XII, XIII вважати відповідно розділами XI, XII.

14. У розділі XI:

у пункті 2 слова "Торговці цінними паперами" замінити словами "Інвестиційні фірми";

у пункті 3 слова "(крім розрахунку коефіцієнта покриття зобов'язань учасників клірингу, який розраховується кожний робочий день)" виключити;

у пункті 5 слова "фондового ринку" замінити словами "ринків капіталу та організованих товарних ринків".

**Т. в. о. директора департаменту
методології корпоративного управління,
корпоративних фінансів, фінансових
інструментів на ринках капіталу та
організованих товарних ринків**

Олександр БУДЬОННИЙ

© ТОВ "Інформаційно-аналітичний центр "ЛІГА", 2021
© ТОВ "ЛІГА ЗАКОН", 2021

