Указание Банка России от 19.10.2022 N 6294-У "О внесении изменений в Положение Банка России от 1 ноября 2018 года N 658-П" (Зарегистрировано в Минюсте России 09.02.2023 N 72292)

ЦЕНТРАЛЬНЫЙ БАНК РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ

УКАЗАНИЕ
ОТ 19 ОКТЯБРЯ 2022 Г. N 6294-У

О ВНЕСЕНИИ ИЗМЕНЕНИЙ
В ПОЛОЖЕНИЕ БАНКА РОССИИ ОТ 1 НОЯБРЯ 2018 ГОДА N 658-П

На основании пункта 1.1 статьи 2, пункта 9.1 части 1 статьи 25 Федерального закона от 7 февраля 2011 года N 7-ФЗ "О клиринге, клиринговой деятельности и центральном контрагенте" <1>:

<1> Собрание законодательства Российской Федерации, 2011, N 7, ст. 904; 2016, N 1, ст. 23; 2017, N 30, ст. 4456.

1. Внести в Положение Банка России от 1 ноября 2018 года N 658-П "О требованиях к квалифицированному центральному контрагенту, порядке признания качества управления центрального контрагента удовлетворительным, об основаниях и порядке принятия решения о признании качества управления центрального контрагента неудовлетворительным, порядке доведения информации о принятом решении до центрального контрагента" <2> следующие изменения:

<2> Зарегистрировано Минюстом России 6 февраля 2019 года, регистрационный N 53703, с изменениями, внесенными Указаниями Банка России от 30 сентября 2019 года N 5271-У (зарегистрировано Минюстом России 6 ноября 2019 года, регистрационный N 56422), от 27 февраля 2020 года N 5405-У (зарегистрировано Минюстом России 31 марта 2020 года, регистрационный N 57917), от 28 сентября 2020 года N 5568-У (зарегистрировано Минюстом России 3 ноября 2020 года, регистрационный N 60731), от 12 января 2021 года N 5706-У (зарегистрировано Минюстом России 18 февраля 2021 года, регистрационный N 62559), от 30 июня 2021 года N 5844-У (зарегистрировано Минюстом России 6 августа 2021 года, регистрационный N 64566).

1.1. В пункте 1.2 цифры "2.1 - 2.5, 2.7 - 2.41" заменить цифрами "2.1 - 2.41".

1.2. В пункте 1.6:

в абзацах первом и втором цифры "2.1 - 2.5, 2.7 - 2.41" заменить цифрами "2.1 - 2.41";

абзац четвертый дополнить словами ", 13 декабря 2019 года N 56796, 18 июня 2020 года N 58705, 30 сентября 2020 года N 60147, 26 марта 2021 года N 62892, 15 апреля 2021 года N 63150, 11 июня 2021 года N 63866, 14 декабря 2021 года N 66316, 27 июня 2022 года N 69018 (далее - Указание Банка России N 4927-У)";

абзац пятый изложить в следующей редакции:

"информации, состав которой определен на основании части 161 статьи 5 Федерального закона "О клиринге, клиринговой деятельности и центральном контрагенте" (Собрание законодательства Российской Федерации, 2011, N 7, ст. 904; 2016, N 1, ст. 23).".

1.3. В абзацах втором и третьем пункта 1.8 цифры "2.1 - 2.5, 2.7 - 2.41" заменить цифрами "2.1 - 2.41".

1.4. Пункты 1.10 - 1.12 изложить в следующей редакции:

"1.10. Уполномоченное структурное подразделение Банка России в срок, не превышающий пятнадцати рабочих дней со дня выявления Банком России факта невыполнения квалифицированным центральным контрагентом требований, установленных главой 2 настоящего Положения, проводит оценку влияния невыполнения указанных требований на финансовую устойчивость квалифицированного центрального контрагента, на стабильность финансового рынка Российской Федерации и возможность ее обеспечения в соответствии с целью деятельности Банка России, предусмотренной абзацем шестым части первой статьи 3 Федерального закона от 10 июля 2002 года N 86-ФЗ "О Центральном банке Российской Федерации (Банке России)" (Собрание законодательства Российской Федерации, 2002, N 28, ст. 2790; 2013, N 30, ст. 4084) (далее - оценка влияния невыполнения требований).

В случае если по итогам проведенной оценки влияния невыполнения требований не установлено негативное влияние на финансовую устойчивость квалифицированного центрального контрагента, на стабильность финансового рынка Российской Федерации и возможность ее обеспечения в соответствии с целью деятельности Банка России, предусмотренной абзацем шестым части первой статьи 3 Федерального закона от 10 июля 2002 года N 86-ФЗ "О Центральном банке Российской Федерации (Банке России)" (далее - негативное влияние), уполномоченное структурное подразделение Банка России направляет квалифицированному центральному контрагенту уведомление о выявлении Банком России невыполнения требований, предусмотренных настоящим пунктом, с указанием срока приведения квалифицированным центральным контрагентом своей деятельности в соответствие с указанными требованиями (далее - уведомление).

Уведомление направляется квалифицированному центральному контрагенту в срок, не превышающий пяти рабочих дней со дня завершения оценки влияния невыполнения требований, в форме электронного документа через личный кабинет в соответствии с порядком взаимодействия.

1.11. В случае если установлено негативное влияние (в том числе несоблюдение квалифицированным центральным контрагентом требований, установленных пунктами 2.2 или 2.18 настоящего Положения, или неоднократное в течение одного года несоблюдение квалифицированным центральным контрагентом требований, установленных главой 2 настоящего Положения) по итогам проведенной оценки влияния невыполнения требований или выявлен факт неприведения квалифицированным центральным контрагентом своей деятельности в соответствие с требованиями, установленными главой 2 настоящего Положения, в срок, предусмотренный в уведомлении, уполномоченное структурное подразделение Банка России подготавливает для направления на рассмотрение Комитета

финансового надзора Банка России мотивированное заключение, содержащее:

информацию о квалифицированном центральном контрагенте, допустившем невыполнение требований, установленных главой 2 настоящего Положения (полное фирменное наименование, регистрационный номер, присвоенный Банком России, основной государственный регистрационный номер, идентификационный номер налогоплательщика, адрес в пределах места нахождения);

информацию о невыполнении требований, установленных главой 2 настоящего Положения;

информацию об обстоятельствах, при которых квалифицированным центральным контрагентом было допущено невыполнение требований, установленных главой 2 настоящего Положения;

информацию о неприведении квалифицированным центральным контрагентом своей деятельности в соответствие с требованиями, установленными главой 2 настоящего Положения, в срок, предусмотренный в уведомлении (при наличии);

оценку влияния невыполнения требований;

оценку влияния на участников клиринга решения Комитета финансового надзора Банка России о признании качества управления квалифицированного центрального контрагента неудовлетворительным в случае принятия такого решения.

Уполномоченное структурное подразделение Банка России направляет на рассмотрение Комитета финансового надзора Банка России мотивированное заключение:

в срок, не превышающий двадцати пяти рабочих дней со дня выявления Банком России факта невыполнения квалифицированным центральным контрагентом требований, установленных главой 2 настоящего Положения, в случае, если по итогам проведенной оценки влияния невыполнения требований уполномоченным структурным подразделением Банка России установлено негативное влияние;

в срок, не превышающий пяти рабочих дней со дня выявления Банком России факта неприведения квалифицированным центральным контрагентом своей деятельности в соответствие с требованиями, установленными главой 2 настоящего Положения, в срок, предусмотренный в уведомлении.

1.12. По результатам рассмотрения мотивированного заключения Комитет финансового надзора Банка России с учетом информации, указанной в абзацах четвертом - шестом пункта 1.11 настоящего Положения, принимает решение о признании качества управления квалифицированного центрального контрагента неудовлетворительным либо о признании качества управления квалифицированного центрального контрагента удовлетворительным.".

1.5. Главу 1 дополнить пунктом 1.13 следующего содержания:

"1.13. В срок, не превышающий пяти рабочих дней со дня принятия Комитетом финансового надзора Банка России решения о признании качества управления квалифицированного центрального контрагента неудовлетворительным, уполномоченное структурное подразделение Банка России доводит до квалифицированного центрального контрагента информацию о принятии указанного решения в форме электронного документа через личный кабинет в соответствии с порядком взаимодействия с одновременным ее размещением на официальном сайте Банка России в информационно-телекоммуникационной сети "Интернет" с указанием даты вступления в силу решения о признании качества управления квалифицированного центрального контрагента неудовлетворительным.".

1.6. В пункте 2.1 слова "проводить на ежедневной основе" заменить словами "каждый календарный день, в котором квалифицированным центральным контрагентом осуществляется клиринг в соответствии с правилами клиринга (далее - торговый день), проводить".

1.7. В пункте 2.2 слова "проводить на ежедневной основе" заменить словами "каждый торговый день проводить".

1.8. Пункт 2.3 изложить в следующей редакции:

"2.3. Квалифицированный центральный контрагент должен обеспечить возможность предъявления внутри торгового дня требований к участникам клиринга о внесении дополнительного клирингового обеспечения, в том числе в случае изменения рыночных цен финансовых инструментов или иных инструментов, принимаемых квалифицированным центральным контрагентом в состав клирингового обеспечения.".

1.9. В пункте 2.4 после слова "должен" дополнить словами "каждый торговый день", слова "по состоянию на первое число каждого месяца, но не позднее пятого рабочего дня месяца, следующего за отчетным," исключить.

1.10. Пункты 2.5 - 2.7 изложить в следующей редакции:

"2.5. Квалифицированный центральный контрагент должен открывать:

корреспондентские счета и (или) торговые банковские счета, и (или) клиринговые банковские счета в рублях и (или) иностранной валюте, и (или) драгоценных металлах - исключительно в Банке России, расчетных небанковских кредитных организациях, банках-резидентах, определенных иностранными национальными банками или иностранными регуляторами финансовых рынков в качестве уполномоченных банков для осуществления переводов денежных средств в национальной валюте таких иностранных национальных банков или иностранных регуляторов финансовых рынков, банках-резидентах, имеющих кредитный рейтинг, присвоенный кредитным рейтинговым агентством, не ниже уровня, установленного Советом директоров Банка России в соответствии с пунктом 17.5 части первой статьи 18 Федерального закона от 10 июля 2002 года N 86-ФЗ "О Центральном банке Российской Федерации (Банке России)" (Собрание законодательства Российской Федерации, 2002, N 28, ст. 2790; 2017, N 30, ст. 4456; 2020, N 14, ст. 2027);

корреспондентские и (или) иные счета в рублях и (или) иностранной валюте, и (или) драгоценных металлах для исполнения обязательств - исключительно в национальных (центральных) банках государств, являющихся участниками Содружества Независимых Государств, а также в банках-нерезидентах и иностранных юридических лицах, осуществляющих соответствии со своим личным законом функции, аналогичные функциям центрального контрагента, клиринговой организации, организатора торговли и (или) расчетного депозитария, имеющих кредитный рейтинг, присвоенный кредитным рейтинговым агентством, не ниже уровня, установленного Советом директоров Банка России в соответствии с пунктом 17.5 части первой статьи 18 Федерального закона от 10 июля 2002 года N 86-ФЗ "О Центральном банке Российской Федерации (Банке России)", или иностранным кредитным рейтинговым агентством на уровне не ниже "BB-" по классификации иностранных кредитных рейтинговых агентств "Эс-энд-Пи Глобал Рейтингс" ("S&P Global Ratings") и (или) "Фитч Рейтингс" ("Fitch Ratings") и (или) "Ba3" по классификации иностранного кредитного рейтингового агентства "Мудис Инвесторс Сервис" ("Moody's Investors Service"), в банках-нерезидентах, определенных иностранными национальными банками или иностранными регуляторами финансовых рынков в качестве уполномоченных банков для осуществления переводов денежных средств в национальной валюте таких иностранных национальных банков или иностранных регуляторов финансовых рынков, в банках-нерезидентах, входящих в банковскую группу, головной кредитной организацией которой является российская кредитная организация, имеющая кредитный рейтинг, присвоенный кредитным рейтинговым агентством, не ниже уровня, установленного Советом директоров Банка России для банков-резидентов в соответствии с пунктом 17.5 части первой статьи 18 Федерального закона от 10 июля 2002 года N 86-ФЗ "О Центральном банке Российской Федерации (Банке России)".

В случае одновременного наличия кредитного рейтинга, присвоенного кредитным рейтинговым агентством, и кредитного рейтинга, присвоенного иностранным кредитным рейтинговым агентством, применяется кредитный рейтинг, присвоенный кредитным рейтинговым агентством.

2.6. Квалифицированный центральный контрагент должен размещать от своего имени и за свой счет временно свободные денежные средства в рублях и (или) иностранной валюте и (или) драгоценные металлы исключительно:

2.6.1. во вклады (депозиты) в следующих организациях:

банках-резидентах, имеющих кредитный рейтинг, присвоенный кредитным рейтинговым агентством, не ниже уровня, установленного Советом директоров Банка России в соответствии с пунктом 17.5 части первой статьи 18 Федерального закона от 10 июля 2002 года N 86-ФЗ "О Центральном банке Российской Федерации (Банке России)";

банках-резидентах, определенных иностранными национальными банками или иностранными регуляторами финансовых рынков в качестве уполномоченных банков для осуществления переводов денежных средств в национальной валюте таких иностранных национальных банков или иностранных регуляторов финансовых рынков;

банках-нерезидентах, иностранных юридических лицах, осуществляющих в соответствии со своим личным законом функции, аналогичные функциям центрального контрагента, клиринговой организации, организатора торговли и (или) расчетного депозитария, имеющих кредитный рейтинг, присвоенный кредитным рейтинговым агентством, не ниже уровня, установленного Советом директоров Банка России в соответствии с пунктом 17.5 части первой статьи 18 Федерального закона от 10 июля 2002 года N 86-ФЗ "О Центральном банке Российской Федерации (Банке России)", или иностранным кредитным рейтинговым агентством на уровне не ниже "BBB-" по классификации иностранных кредитных рейтинговых агентств "Эс-энд-Пи Глобал Рейтингс" ("S&P Global Ratings") и (или) "Фитч Рейтингс" ("Fitch Ratings") и (или) "Baa3" по классификации иностранного кредитного рейтингового агентства "Мудис Инвесторс Сервис" ("Moody's Investors Service");

Банке России;

национальных (центральных) банках государств, являющихся участниками Содружества Независимых Государств.

В случае одновременного наличия кредитного рейтинга, присвоенного кредитным рейтинговым агентством, и кредитного рейтинга, присвоенного иностранным кредитным рейтинговым агентством, применяется кредитный рейтинг, присвоенный кредитным рейтинговым агентством;

2.6.2. в долговые ценные бумаги, включенные в котировальный список первого (высшего) уровня хотя бы одной из российских бирж, государственные долговые ценные бумаги Российской Федерации и долговые ценные бумаги Банка России, а также в долговые ценные бумаги с кредитным рейтингом эмитента, кредитным рейтингом выпуска ценных бумаг или кредитным рейтингом юридического лица, являющегося поручителем (гарантом) по соответствующему выпуску ценных бумаг, присвоенным кредитным рейтинговым агентством не ниже уровня, установленного Советом директоров Банка России в соответствии с пунктом 17.5 части первой статьи 18 Федерального закона от 10 июля 2002 года N 86-ФЗ "О Центральном банке Российской Федерации (Банке России)", или иностранным кредитным рейтинговым агентством на уровне не ниже "BB-" по классификации иностранных кредитных рейтинговых агентств "Эс-энд-Пи Глобал Рейтингс" ("S&P Global Ratings") и (или) "Фитч Рейтингс" ("Fitch Ratings") и (или) "Ba3" по классификации иностранного кредитного рейтингового агентства "Мудис Инвесторс Сервис" ("Moody's Investors Service").

При этом портфель ценных бумаг квалифицированного центрального контрагента должен иметь дюрацию (дюрацию Маколея для долговых ценных бумаг, для которых такую дюрацию можно рассчитать) не более полутора лет, при расчете которой не учитываются государственные долговые ценные бумаги Российской Федерации и долговые ценные бумаги Банка России.

В случае одновременного наличия кредитного рейтинга эмитента и (или) кредитного рейтинга юридического лица, являющегося поручителем (гарантом) по соответствующему выпуску ценных бумаг, и кредитного рейтинга выпуска ценных бумаг применяется

кредитный рейтинг выпуска ценных бумаг, а в случае одновременного наличия кредитного рейтинга эмитента и кредитного рейтинга юридического лица, являющегося поручителем (гарантом) по соответствующему выпуску ценных бумаг, принимается наивысший из кредитных рейтингов, присвоенных кредитным рейтинговым агентством или иностранным кредитным рейтинговым агентством.

В случае одновременного наличия кредитного рейтинга, присвоенного кредитным рейтинговым агентством, и кредитного рейтинга, присвоенного иностранным кредитным рейтинговым агентством, применяется кредитный рейтинг, присвоенный кредитным рейтинговым агентством;

2.6.3. в иностранную валюту государств, имеющих суверенный кредитный рейтинг, в том числе иностранного государства, суверенный кредитный рейтинг которого используется для определения кредитоспособности стран, входящих в международное объединение и использующих иностранную валюту в качестве национальной, не ниже уровня, установленного Советом директоров Банка России в соответствии с пунктом 17.5 части первой статьи 18 Федерального закона от 10 июля 2002 года N 86-ФЗ "О Центральном банке Российской Федерации (Банке России)";

2.6.4. в драгоценные металлы в случае наличия у контрагента по сделке кредитного рейтинга, присвоенного кредитным рейтинговым агентством не ниже уровня, установленного Советом директоров Банка России в соответствии с пунктом 175 части первой статьи 18 Федерального закона от 10 июля 2002 года N 86-ФЗ "О Центральном банке Российской Федерации (Банке России)", или иностранным кредитным рейтинговым агентством на уровне не ниже "BB-" по классификации иностранных кредитных рейтинговых агентств "Эс-энд-Пи Глобал Рейтингс" ("S&P Global Ratings") и (или) "Фитч Рейтингс" ("Fitch Ratings") и (или) "Ba3" по классификации иностранного кредитного рейтингового агентства "Мудис Инвесторс Сервис" ("Moody's Investors Service").

В случае одновременного наличия у контрагента по сделке кредитного рейтинга, присвоенного кредитным рейтинговым агентством, и кредитного рейтинга, присвоенного иностранным кредитным рейтинговым агентством, применяется кредитный рейтинг, присвоенный кредитным рейтинговым агентством;

2.6.5. в производные финансовые инструменты с базисными активами, указанными в подпунктах 2.6.2 - 2.6.4 настоящего пункта, договоры репо, предметом которых являются ценные бумаги, указанные в подпункте 2.6.2 настоящего пункта, и (или) межбанковские кредиты с кредитным рейтингом контрагента, присвоенным кредитным рейтинговым агентством, не ниже уровня, установленного Советом директоров Банка России в соответствии с пунктом 17.5 части первой статьи 18 Федерального закона от 10 июля 2002 года N 86-ФЗ "О Центральном банке Российской Федерации (Банке России)", или иностранным кредитным рейтинговым агентством на уровне не ниже "BB-" по классификации иностранных кредитных рейтинговых агентств "Эс-энд-Пи Глобал Рейтингс" ("S&P Global Ratings") и (или) "Фитч Рейтингс" ("Fitch Ratings") и (или) "Ba3" по классификации иностранного кредитного рейтингового агентства "Мудис Инвесторс Сервис" ("Moody's Investors Service").

В случае одновременного наличия у контрагента кредитного рейтинга, присвоенного кредитным рейтинговым агентством, и кредитного рейтинга, присвоенного иностранным кредитным рейтинговым агентством, применяется кредитный рейтинг, присвоенный кредитным рейтинговым агентством;

2.6.6. в инструменты, не соответствующие требованиям, установленным подпунктами 2.6.2 - 2.6.5 настоящего пункта, в случаях приобретения квалифицированным центральным контрагентом инструментов в целях исполнения обязательств перед добросовестными участниками клиринга и (или) случаях приобретения инструментов в рамках своей деятельности как стороны всех договоров, обязательства из которых подлежат включению в клиринговый пул, а также в случаях осуществления операций купли-продажи иностранной валюты, ценных бумаг и (или) иных инструментов при полном предварительном обеспечении исполнения участником клиринга своих обязательств и операций купли-продажи драгоценных металлов, если расчеты осуществляются на условии полной предпоставки драгоценных металлов со стороны контрагента квалифицированного центрального контрагента.

2.7. Квалифицированный центральный контрагент должен открывать корреспондентские и (или) иные счета в рублях, и (или) иностранной валюте, и (или) драгоценных металлах для исполнения обязательств, а также размещать от своего имени и за свой счет временно свободные денежные средства в рублях и (или) иностранной валюте и (или) драгоценные металлы в инструменты, предусмотренные пунктом 2.6 настоящего Положения, в иностранных юридических лицах, осуществляющих в соответствии со своим личным законом функции, аналогичные функциям центрального контрагента, клиринговой организации, организатора торговли и (или) расчетного депозитария, а также в банках-нерезидентах, не удовлетворяющих требованиям, установленным абзацем пятым пункта 2.5, абзацем четвертым подпункта 2.6.1 и подпунктом 2.6.4 пункта 2.6 настоящего Положения (далее при совместном упоминании - иностранные организации), при условии оценки иностранных организаций в соответствии с реализуемыми квалифицированным центральным контрагентом процедурами в рамках системы управления рисками.

При этом в случае открытия квалифицированным центральным контрагентом счетов и размещения денежных средств и (или) драгоценных металлов в иностранных организациях в соответствии с абзацем первым настоящего пункта квалифицированным центральным контрагентом должны одновременно соблюдаться следующие требования:

не менее двадцати пяти торговых дней в течение любых 30 последовательных торговых дней совокупная величина остатков денежных средств в рублях и (или) иностранной валюте и (или) драгоценных металлов квалифицированного центрального контрагента на счетах в иностранных организациях не должна превышать значение 100 процентов от величины собственных средств (капитала) квалифицированного центрального контрагента, определенной в соответствии с пунктом 2.2 Инструкции Банка России от 14 ноября 2016 года N 175-И "О банковских операциях небанковских кредитных организаций - центральных контрагентов, об обязательных нормативах небанковских кредитных организаций - центральных контрагентов и особенностях осуществления Банком России надзора за их соблюдением" (зарегистрирована Минюстом России 6 декабря 2016 года, регистрационный

N 44577, с изменениями, внесенными Указаниями Банка России от 12 апреля 2018 года N 4773-У (зарегистрировано Минюстом России 8 мая 2018 года, регистрационный N 51015), от 30 сентября 2019 года N 5272-У (зарегистрировано Минюстом России 6 ноября 2019 года, регистрационный N 56430), от 27 февраля 2020 года N 5404-У (зарегистрировано Минюстом России 31 марта 2020 года, регистрационный N 57915) (далее - Инструкция Банка России N 175-И);

не менее двадцати пяти торговых дней в течение любых 30 последовательных торговых дней величина остатков денежных средств в рублях и (или) иностранной валюте и (или) драгоценных металлов квалифицированного центрального контрагента на счетах в одной иностранной организации или группе связанных иностранных организаций не должна превышать значение 25 процентов от величины собственных средств (капитала) квалифицированного центрального контрагента, определенной в соответствии с пунктом 2.2 Инструкции Банка России N 175-И.

Для целей настоящего Положения связанность иностранных организаций определяется в соответствии с частями второй - четвертой статьи 64.1 Федерального закона от 10 июля 2002 года N 86-ФЗ "О Центральном банке Российской Федерации (Банке России)" (Собрание законодательства Российской Федерации, 2002, N 28, ст. 2790; 2013, N 27, ст. 3438).".

1.11. В абзаце третьем пункта 2.8 слова "уполномоченного банка" заменить словами "уполномоченных банков", слова "с кредитными организациями, созданными в соответствии с законодательством Российской Федерации" исключить.

1.12. В пункте 2.10:

в абзаце первом слова "на ежедневной основе" заменить словами "каждый торговый день", слово "рабочих" заменить словом "торговых";

абзац второй изложить в следующей редакции:

"Результаты расчета коэффициентов ПК должны учитываться квалифицированным центральным контрагентом при предъявлении требований к участникам клиринга по индивидуальному клиринговому обеспечению и иному обеспечению (кроме коллективного клирингового обеспечения), предназначенному для обеспечения исполнения обязательств участников клиринга, допущенных к клирингу (далее при совместном упоминании - обеспечение), в соответствии с пунктом 2.18 настоящего Положения и в предоставляемой на ежеквартальной основе органам управления квалифицированного центрального контрагента информации об управлении кредитным риском квалифицированного центрального контрагента.".

1.13. В пункте 2.11:

абзац первый изложить в следующей редакции:

"2.11. Квалифицированный центральный контрагент должен каждый торговый день осуществлять мониторинг инструментов, предоставленных участниками клиринга в

качестве клирингового обеспечения, с целью выявления возможных рисков концентрации активов в клиринговом обеспечении в разбивке по:";

абзацы второй и третий после слов "в качестве" дополнить словом "клирингового".

1.14. В пункте 2.12 слова "по обязательствам участников клиринга, включенных в клиринговый пул," исключить, слово ", возникающим" исключить.

1.15. В пункте 2.13 слова "осуществлять ежедневный" заменить словами "каждый торговый день осуществлять".

1.16. В пункте 2.14 после слова "должен" дополнить словами "каждый торговый день", слова "по состоянию на первое число каждого месяца, но не позднее пятого рабочего дня месяца, следующего за отчетным," исключить.

1.17. В пункте 2.15 после слова "должен" дополнить словами "каждый торговый день", слова "по состоянию на первое число каждого месяца, но не позднее пятого рабочего дня месяца, следующего за отчетным," исключить.

1.18. В пункте 2.16:

в абзаце втором слова "в расчетных кредитных организациях" исключить;

абзац третий после слов "участникам клиринга" дополнить словами "и иным контрагентам".".

1.19. В пункте 2.17:

в абзаце втором слова "в расчетных кредитных организациях" исключить;

абзац третий после слов "участникам клиринга" дополнить словами "и иным контрагентам".

1.20. Пункт 2.18 изложить в следующей редакции:

"2.18. Квалифицированный центральный контрагент должен каждый торговый день предъявлять требования к участникам клиринга по обеспечению в отношении всех инструментов, принимаемых в состав обеспечения (за исключением денежных средств в рублях), рассчитываемые в соответствии с параметрами, используемыми в модели расчета размера обеспечения.".

1.21. В пункте 2.19:

в абзаце втором подпункта 2.19.4 слова "(для ценных бумаг, выпущенных резидентами)" исключить, дополнить словами ", с учетом абзацев третьего и четвертого подпункта 2.6.2 пункта 2.6 настоящего Положения";

подпункт 2.19.7 изложить в следующей редакции:

"2.19.7. иные ценные бумаги при условии, что по оценке квалифицированного центрального контрагента потенциальные потери, вызванные неисполнением или ненадлежащим исполнением участниками клиринга своих обязательств перед квалифицированным центральным контрагентом, покрываются данными ценными бумагами при условии применения в отношении таких ценных бумаг ставок индивидуального клирингового обеспечения, установленных с учетом повышенного коэффициента, рассчитываемого в соответствии с внутренней методикой квалифицированного центрального контрагента.".

1.22. В пункте 2.20 слова ", казначейские бумаги или бумаги центральных банков государств - членов Организации экономического сотрудничества и развития" исключить.

1.23. Пункт 2.22 дополнить словами ", а также недопущения негативного влияния".

1.24. Абзацы второй, третий, пятый, шестой, восьмой пункта 2.23 признать утратившими силу.

1.25. В пункте 2.24 слова ", обеспечить своевременность" заменить словами "в целях обеспечения своевременности".

1.26. В пункте 2.27 слова "проводить на ежедневной основе" заменить словами "каждый торговый день проводить".

1.27. Пункт 2.30 изложить в следующей редакции:

"2.30. Квалифицированный центральный контрагент должен проводить в рамках внутреннего контроля мероприятия по контролю за соблюдением требований, установленных главой 2 настоящего Положения, и предоставлять лицу, осуществляющему функции единоличного исполнительного органа квалифицированного центрального контрагента, отчет о соблюдении указанных требований не реже одного раза в квартал. Руководитель службы внутреннего контроля (лицо, его замещающее) должен в течение рабочего дня со дня определения вероятности возникновения и (или) реализации факта невыполнения требований, установленных главой 2 настоящего Положения, довести до лица, осуществляющего функции единоличного исполнительного органа квалифицированного центрального контрагента, указанную информацию.".

1.28. Абзац второй пункта 2.32 признать утратившим силу.

1.29. Пункт 2.34 изложить в следующей редакции:

"2.34. Квалифицированный центральный контрагент должен предусмотреть в правилах клиринга порядок и конкретные сроки проведения процедуры закрытия позиций участников клиринга, не исполнивших или исполнивших ненадлежащим образом свои обязательства перед квалифицированным центральным контрагентом, не являющиеся обязательствами, которые исполнены в соответствии с частью 8 статьи 18 Федерального закона "О клиринге, клиринговой деятельности и центральном контрагенте" (Собрание законодательства Российской Федерации, 2011, N 7, ст. 904; 2018, N 24, ст. 3399), в зависимости от вида, ликвидности и (или) рыночной стоимости инструмента, по которому открыта позиция

указанных участников клиринга.".

1.30. Пункт 2.37 изложить в следующей редакции:

"2.37. Квалифицированный центральный контрагент должен проводить оценку финансовой устойчивости организаций, предоставляющих ликвидность квалифицированному центральному контрагенту в целях финансирования мероприятий, предусмотренных планом восстановления финансовой устойчивости, разрабатываемым на основании части 1 статьи 11.1 Федерального закона "О клиринге, клиринговой деятельности и центральном контрагенте" (Собрание законодательства Российской Федерации, 2011 N 7, ст. 904; 2016, N 1, ст. 23), с которыми заключены договоры (соглашения), не реже одного раза в квартал.".

1.31. Пункт 2.39 изложить в следующей редакции:

"2.39. Квалифицированный центральный контрагент должен проводить анализ потенциальных рисков, в том числе участников клиринга, а также анализ доходов и расходов при планировании допуска к клирингу обязательств, возникающих из договоров, в том числе производных финансовых инструментов, предметом которых являются ценные бумаги, иностранная валюта и (или) иное имущество, в отношении которых квалифицированным центральным контрагентом клиринг ранее не осуществлялся, в соответствии с порядком, установленным во внутренних документах квалифицированного центрального контрагента.".

1.32. В пункте 2.40 слова "в рамках внутреннего контроля" исключить.

1.33. В абзацах втором - четвертом пункта 2.43 цифры "2.1 - 2.5, 2.7 - 2.42" заменить цифрами "2.1 - 2.42".

1.34. Приложение 1 изложить в редакции приложения к настоящему Указанию.

1.35. Абзацы пятый и седьмой пункта 2 приложения 3 после слов "Банка России" дополнить словами ", Министерства финансов Российской Федерации".

1.36. В абзаце четвертом пункта 1 приложения 4 слова ", казначейских бумаг или бумаг центральных банков государств - членов Организации экономического сотрудничества и развития" исключить.

1.37. В приложении 5:

абзац четвертый пункта 1 изложить в следующей редакции:

"Ак - инвестиционные активы, состоящие из долговых ценных бумаг, включенных в котировальный список первого (высшего) уровня хотя бы одной из российских бирж, и иных инвестиционных активов с кредитным рейтингом юридического лица, являющегося поручителем (гарантом) по соответствующему выпуску ценных бумаг, кредитным рейтингом выпуска ценных бумаг, кредитным рейтингом эмитента указанных ценных бумаг (для долговых ценных бумаг, за исключением государственных долговых ценных бумаг

Российской Федерации и долговых ценных бумаг Банка России), кредитным рейтингом контрагента (для денежных средств в рублях и драгоценных металлов), присвоенными кредитным рейтинговым агентством не ниже уровня, установленного Советом директоров Банка России в соответствии с пунктом 175 части первой статьи 18 Федерального закона от 10 июля 2002 года N 86-ФЗ "О Центральном банке Российской Федерации (Банке России)", или иностранным кредитным рейтинговым агентством на уровне не ниже "BBB-" по классификации иностранных кредитных рейтинговых агентств "Эс-энд-Пи Глобал Рейтингс" ("S&P Global Ratings") и (или) "Фитч Рэйтингс" ("Fitch Ratings") и (или) "Baa3" по классификации иностранного кредитного рейтингового агентства "Мудис Инвесторс Сервис" ("Moody's Investors Service"), и (или) суверенным кредитным рейтингом, объектом которого является иностранное государство, в том числе иностранное государство, суверенный кредитный рейтинг которого используется для определения кредитоспособности стран, входящих в международное объединение и использующих иностранную валюту в качестве национальной, присвоенным кредитным рейтинговым агентством не ниже уровня, установленного Советом директоров Банка России в соответствии с пунктом 17.5 части первой статьи 18 Федерального закона от 10 июля 2002 года N 86-ФЗ "О Центральном банке Российской Федерации (Банке России)" (для денежных средств в иностранной валюте);";

пункт 2 изложить в следующей редакции:

"2. Инвестиционные активы в целях настоящего Положения включают в себя все активы квалифицированного центрального контрагента, в том числе денежные средства, находящиеся на корреспондентских счетах, открытых в Банке России и кредитных организациях, корреспондентских и иных счетах, открытых в национальных (центральных) банках государств, являющихся участниками Содружества Независимых Государств, а также в банках-нерезидентах и иностранных юридических лицах, осуществляющих в соответствии со своим личным законом функции, аналогичные функциям центрального контрагента, клиринговой организации, организатора торговли и (или) расчетного депозитария, а также портфели активов, сформированные из инструментов, в которые квалифицированный центральный контрагент размещает временно свободные средства. Для целей настоящего Положения к инвестиционным активам не относятся активы квалифицированного центрального контрагента, связанные с общехозяйственной деятельностью.";

дополнить пунктом 3 следующего содержания:

"3. В случае одновременного наличия кредитного рейтинга эмитента и (или) кредитного рейтинга юридического лица, являющегося поручителем (гарантом) по соответствующему выпуску ценных бумаг, и кредитного рейтинга выпуска ценных бумаг применяется кредитный рейтинг выпуска ценных бумаг, а в случае одновременного наличия кредитного рейтинга эмитента и кредитного рейтинга юридического лица, являющегося поручителем (гарантом) по соответствующему выпуску ценных бумаг, принимается наивысший из кредитных рейтингов, присвоенных кредитным рейтинговым агентством или иностранным кредитным рейтинговым агентством.

В случае одновременного наличия кредитного рейтинга, присвоенного кредитным рейтинговым агентством, и кредитного рейтинга, присвоенного иностранным кредитным рейтинговым агентством, применяется кредитный рейтинг, присвоенный кредитным рейтинговым агентством.".

2. Настоящее Указание вступает в силу по истечении 10 дней после дня его официального опубликования.

Председатель Центрального банка
Российской Федерации
Э.С.НАБИУЛЛИНА

Приложение
к Указанию Банка России
от 19 октября 2022 года N 6294-У
"О внесении изменений
в Положение Банка России
от 1 ноября 2018 года N 658-П"

"Приложение 1
к Положению Банка России
от 1 ноября 2018 года N 658-П
"О требованиях к квалифицированному
центральному контрагенту, порядке
признания качества управления
центрального контрагента
удовлетворительным, об основаниях
и порядке принятия решения
о признании качества управления
центрального контрагента
неудовлетворительным, порядке

доведения информации о принятом
решении до центрального контрагента"

РАСЧЕТ
ВЕЛИЧИНЫ КОЭФФИЦИЕНТА РЫНОЧНОГО РИСКА В РАМКАХ УПРАВЛЕНИЯ
РЫНОЧНЫМ РИСКОМ

1. Величина коэффициента рыночного риска PP1, характеризующего чувствительность собственного портфеля инструментов и открытых позиций, определенных в абзацах втором - шестом пункта 1.1 Положения Банка России от 3 декабря 2015 года N 511-П "О порядке расчета кредитными организациями величины рыночного риска" (зарегистрировано Минюстом России 28 декабря 2015 года, регистрационный N 40328, с изменениями, внесенными Указаниями Банка России от 15 ноября 2018 года N 4969-У (зарегистрировано Минюстом 7 марта 2019 года, регистрационный N 53986), от 27 февраля 2020 года N 5404-У (зарегистрировано Минюстом 31 марта 2020 года, регистрационный N 57915), от 30 сентября 2019 года N 5272-У (зарегистрировано Минюстом 6 ноября 2019 года, регистрационный N 56430), от 28 февраля 2022 года N 6075-У (зарегистрировано Минюстом 4 апреля 2022 года, регистрационный N 68056) <3> (далее - собственный портфель инструментов и открытых позиций), к рыночному риску, рассчитывается как отношение средних ожидаемых потерь, которые может понести квалифицированный центральный контрагент по собственному портфелю инструментов и открытых позиций при условии, что потери превысят значение стоимостной меры риска (value-at-risk), к величине собственных средств (капитала) квалифицированного центрального контрагента, рассчитанное на горизонте 10 дней с вероятностью 99 процентов по формуле:

<3> Зарегистрировано Минюстом России 28 декабря 2015 года, регистрационный N 40328, с изменениями, внесенными Указаниями Банка России от 12 апреля 2018 года N 4773-У (зарегистрировано Минюстом 8 мая 2018 года, регистрационный N 51015), от 30 сентября 2019 года N 5272-У (зарегистрировано Минюстом 6 ноября 2019 года, регистрационный N 56430), от 27 февраля 2020 года N 5404-У (зарегистрировано Минюстом 31 марта 2020 года, регистрационный N 57915).

$$PP1 = \frac{CVaR^{10\ дней}}{CC} \times 100\%;$$

где:

СС - величина собственных средств (капитала) квалифицированного центрального контрагента, определенная в соответствии с пунктом 2.2 Инструкции Банка России N 175-И;

CVaR10 дней - условная стоимость под риском - величина, характеризующая среднее значение по однопроцентной выборке наихудших негативных для квалифицированного центрального контрагента изменений стоимости собственного портфеля инструментов и открытых позиций на дату расчета.

2. Глубина выборки величины CVaR10 дней для расчета должна быть не менее 12 месяцев и включать в себя периоды с наихудшим месячным изменением совокупной стоимости собственного портфеля инструментов и открытых позиций, состав которого зафиксирован по состоянию на дату расчета, за последние 10 лет. При отсутствии данных за рассматриваемый период расчет величины CVaR10 дней осуществляется с использованием данных по схожим инструментам, входящим в портфель квалифицированного центрального контрагента, по которым имеются данные за указанный период, с учетом критериев соотнесения инструментов, входящих в портфель квалифицированного центрального контрагента, со схожими инструментами, установленными в методике стресс-тестирования рисков квалифицированного центрального контрагента в соответствии с пунктом 3.14 Положения Банка России N 576-П.

3. При определении выборки в соответствии с пунктом 2 настоящего приложения квалифицированный центральный контрагент вправе не учитывать отдельные периоды, в которых произошедшие события по решению квалифицированного центрального контрагента являются нереалистичными для их повторения в будущем с учетом экономической ситуации на момент проведения расчета рыночного риска.

Информация о принятом квалифицированным центральным контрагентом решении, предусмотренном в абзаце первом настоящего пункта, информация о его влиянии на величину рыночного риска и обоснование данного решения направляются квалифицированным центральным контрагентом в Банк России одновременно с отчетностью по форме 0409703 "Сведения о деятельности квалифицированного центрального контрагента и сведения о концентрации кредитного риска центрального контрагента", предусмотренной Указанием Банка России N 4927-У.

4. Квалифицированный центральный контрагент должен проводить процедуру оценки точности используемой методики расчета величины CVaR10 дней (далее - процедура оценки). Процедура оценки должна проводиться на исторических данных, путем сравнения величины CVaR10 дней за каждый торговый день с величиной фактического обесценения по собственному портфелю инструментов и открытых позиций. Глубина исторических данных должна составлять не менее 12 месяцев. Целью проведения процедуры является оценка соответствия расчетной величины CVaR10 дней величине CVaR10 дней, получаемой с вероятностью 99 процентов. Критерии и порядок проведения процедуры оценки, а также случаи внесения изменений в порядок расчета величины CVaR10 дней определяются квалифицированным центральным контрагентом во внутренних документах. Проведение процедуры оценки должно осуществляться не реже одного раза в квартал.".

Версия #1
Журнал АО создал 19 октября 2022 19:33:00
Журнал АО обновил 26 февраля 2024 15:26:19