



ЦЕНТРАЛЬНЫЙ БАНК РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
(БАНК РОССИИ)

« 15 » марта 2018 г.

№ 4740-У



О внесении изменений в Положение Банка России от 30 декабря 2016 года № 575-П «О требованиях к управлению рисками, правилам организации системы управления рисками, клиринговому обеспечению, размещению имущества, формированию активов центрального контрагента, а также к кругу лиц, в которых центральный контрагент имеет право открывать торговые и клиринговые счета, и методике определения выделенного капитала центрального контрагента»

1. В соответствии с частью 2 статьи 6¹, пунктами 11¹ и 12 части 1 статьи 25 Федерального закона от 7 февраля 2011 года № 7-ФЗ «О клиринге, клиринговой деятельности и центральном контрагенте» (Собрание законодательства Российской Федерации, 2011, № 7, ст. 904; № 48, ст. 6728; № 49, ст. 7040, ст. 7061; 2012, № 53, ст. 7607; 2013, № 30, ст. 4084; 2014, № 11, ст. 1098; 2015, № 27, ст. 4001; № 29, ст. 4357; 2016, № 1, ст. 23, ст. 47; 2017, № 30, ст. 4456) внести в Положение Банка России от 30 декабря 2016 года № 575-П «О требованиях к управлению рисками, правилам организации системы управления рисками, клиринговому обеспечению, размещению имущества, формированию

активов центрального контрагента, а также к кругу лиц, в которых центральный контрагент имеет право открывать торговые и клиринговые счета, и методике определения выделенного капитала центрального контрагента», зарегистрированное Министерством юстиции Российской Федерации 20 марта 2017 года № 46034, следующие изменения.

1.1. В пункте 1.2 слова «, Положением Банка России от 12 марта 2015 года № 463-П «О требованиях, направленных на снижение рисков осуществления клиринговой деятельности, и требованиях к документу (документам), определяющему (определяющим) меры, направленные на снижение кредитных, операционных и иных рисков, в том числе рисков, связанных с совмещением клиринговой деятельности с иными видами деятельности», зарегистрированным Министерством юстиции Российской Федерации 30 апреля 2015 года № 37079» исключить.

1.2. Абзац третий подпункта 2.1.1 пункта 2.1 изложить в следующей редакции:

«финансового положения контрагентов, в том числе инфраструктурных организаций финансового рынка, с которыми у центрального контрагента установлены договорные отношения и в отношении которых у центрального контрагента возникает кредитный риск, а также эмитентов ценных бумаг, принимаемых центральным контрагентом в качестве индивидуального клирингового обеспечения;».

1.3. В абзаце втором пункта 2.2 слова «драгоценные металлы, вклады (депозиты), межбанковские кредиты, товары, допущенные к организованным торгам» заменить словами «вклады (депозиты), межбанковские кредиты, а также драгоценные металлы и иные товары, допущенные к организованным торгам».

1.4. Главу 5 изложить в следующей редакции:

«Глава 5. Требования к клиринговому обеспечению, размещению имущества, формированию активов центрального контрагента, а также к кругу лиц, в которых центральный контрагент имеет право открывать торговые и клиринговые счета

5.1. В качестве индивидуального клирингового обеспечения центральным контрагентом принимаются:

денежные средства в рублях и (или) иностранной валюте;

государственные долговые ценные бумаги Российской Федерации;

государственные долговые ценные бумаги субъектов Российской Федерации;

долговые ценные бумаги Банка России;

долговые ценные бумаги иностранных государств или центральных банков стран, имеющих страновые оценки по классификации экспортных кредитных агентств, участвующих в Соглашении стран – членов Организации экономического сотрудничества и развития (далее – ОЭСР) «Об основных принципах предоставления и использования экспортных кредитов, имеющих официальную поддержку», «0», «1», или стран с высоким уровнем доходов, являющихся членами ОЭСР и (или) Европейского союза, перешедших на единую денежную единицу Европейского союза (далее – Еврозона) (информация о страновых оценках и странах с высоким уровнем доходов, являющихся членами ОЭСР и (или) Еврозоны, размещается на сайте ОЭСР в информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»), организаций, которым в соответствии с законодательством стран их местонахождения предоставлено право осуществлять заимствования от имени государства;

долговые и долевыe ценные бумаги, эмитированные юридическими лицами – резидентами Российской Федерации, финансовое положение

которых оценивается центральным контрагентом как хорошее в соответствии с требованиями, установленными абзацем вторым пункта 3.3 и подпунктом 3.4.1 пункта 3.4 Положения Банка России от 28 июня 2017 года № 590-П «О порядке формирования кредитными организациями резервов на возможные потери по ссудам, ссудной и приравненной к ней задолженности», зарегистрированного Министерством юстиции Российской Федерации 12 июля 2017 года № 47384 (далее – Положение Банка России № 590-П);

долговые и долевыe ценные бумаги, эмитированные юридическими лицами – нерезидентами Российской Федерации, финансовое положение которых оценивается центральным контрагентом как хорошее в соответствии с требованиями, установленными абзацем вторым пункта 3.3, подпунктом 3.4.1 пункта 3.4 и абзацем пятым подпункта 3.1.5 пункта 3.1 Положения Банка России № 590-П;

драгоценные металлы;

банковские гарантии, удовлетворяющие критериям приложения к настоящему Положению, по сделкам, заключаемым на товарных рынках;

товары (за исключением драгоценных металлов), обращающиеся на организованном рынке и допущенные к организованным торгам, по итогам которых центральным контрагентом осуществляется клиринг обязательств, обеспечиваемых таким индивидуальным клиринговым обеспечением;

клиринговые сертификаты участия, выданные центральным контрагентом, сформировавшим имущественный пул из денежных средств в рублях и (или) иностранной валюте, а также имущества, указанного в абзацах втором – девятом настоящего пункта;

иные ценные бумаги, банковские гарантии и товары, помимо указанных в абзацах третьем – восьмом и десятом настоящего пункта, при условии, что по оценке центрального контрагента указанное имущество полностью покрывает потенциальные потери центрального контрагента, вызванные неисполнением или ненадлежащим исполнением участниками клиринга своих обязательств перед центральным контрагентом.

5.2. В качестве коллективного клирингового обеспечения центральным контрагентом принимаются:

- денежные средства в рублях и (или) иностранной валюте;
- государственные долговые ценные бумаги Российской Федерации;
- долговые ценные бумаги Банка России;
- драгоценные металлы.

5.3. Центральный контрагент по своему решению размещает от своего имени и за свой счет временно свободные денежные средства в рублях и (или) иностранной валюте:

на корреспондентских счетах, открытых в Банке России, расчетных небанковских кредитных организациях и (или) банках – резидентах Российской Федерации, финансовое положение которых соответствует требованиям к финансовому положению лиц – резидентов Российской Федерации, предусмотренным абзацем седьмым пункта 5.1 настоящего Положения;

на открытых для исполнения обязательств иных счетах в банках – нерезидентах Российской Федерации, финансовое положение которых соответствует требованиям к финансовому положению лиц – нерезидентов Российской Федерации, предусмотренным абзацем восьмым пункта 5.1 настоящего Положения;

во вклады в банках – резидентах Российской Федерации, финансовое положение которых соответствует требованиям к финансовому положению лиц – резидентов Российской Федерации, предусмотренным абзацем седьмым пункта 5.1 настоящего Положения;

во вклады в банках – нерезидентах Российской Федерации, финансовое положение которых соответствует требованиям к финансовому положению лиц – нерезидентов Российской Федерации, предусмотренным абзацем восьмым пункта 5.1 настоящего Положения;

в государственные долговые ценные бумаги Российской Федерации, долговые ценные бумаги Банка России;

иные инструменты (за исключением товаров (кроме драгоценных металлов) и вкладов (депозитов), финансовое положение эмитентов которых и (или) контрагентов по которым соответствует требованиям к финансовому положению лиц – резидентов Российской Федерации, предусмотренным абзацем седьмым пункта 5.1 настоящего Положения.

5.4. Центральный контрагент по своему решению размещает от своего имени и за свой счет драгоценные металлы:

на корреспондентских счетах, открытых в расчетных небанковских кредитных организациях и (или) банках – резидентах Российской Федерации, финансовое положение которых соответствует требованиям к финансовому положению лиц – резидентов Российской Федерации, предусмотренным абзацем седьмым пункта 5.1 настоящего Положения;

на открытых для исполнения обязательств иных счетах в банках – нерезидентах Российской Федерации, финансовое положение которых соответствует требованиям к финансовому положению лиц – нерезидентов Российской Федерации, предусмотренным абзацем восьмым пункта 5.1 настоящего Положения;

во вклады в банках – резидентах Российской Федерации, финансовое положение которых соответствует требованиям к финансовому положению лиц – резидентов Российской Федерации, предусмотренным абзацем седьмым пункта 5.1 настоящего Положения;

во вклады в банках – нерезидентах Российской Федерации, финансовое положение которых соответствует требованиям к

финансовому положению лиц – нерезидентов Российской Федерации, предусмотренным абзацем восьмым пункта 5.1 настоящего Положения.

5.5. В случаях, предусмотренных правилами клиринга центрального контрагента, центральный контрагент по своему решению размещает временно свободные средства в рублях и (или) иностранной валюте, а также драгоценные металлы в инструменты, за исключением товаров, допущенных к организованным торгам, и вкладов (депозитов), в случае если участниками клиринга (клиентами участников клиринга) центрального контрагента предоставлено имущество, указанное в абзацах втором – тринадцатом пункта 5.1 настоящего Положения.

5.6. В случае если центральный контрагент по своему решению размещает временно свободные денежные средства в рублях и (или) иностранной валюте исключительно в долговые ценные бумаги, портфель ценных бумаг центрального контрагента должен иметь дюрацию Маколея не более двух лет. При расчете дюрации Маколея портфеля ценных бумаг центрального контрагента не учитываются государственные долговые ценные бумаги Российской Федерации и долговые ценные бумаги Банка России.

5.7. Требования пунктов 5.3–5.6 настоящего Положения не распространяются на случаи приобретения активов в целях исполнения центральным контрагентом обязательств перед участниками клиринга.

5.8. Центральный контрагент по своему решению размещает ценные бумаги на счетах депо для исполнения обязательств в депозитариях, удовлетворяющих одному из критериев, предусмотренных пунктом 1.2 Указания Банка России от 17 ноября 2011 года № 2732-У «Об особенностях формирования кредитными организациями резерва на возможные потери по операциям с ценными бумагами, права на которые удостоверяются депозитариями», зарегистрированного Министерством юстиции Российской Федерации 12 декабря 2011 года № 22544, 1 августа

2012 года № 25070, 11 декабря 2014 года № 35134, 18 декабря 2015 года № 40170, 16 октября 2017 года № 48551 (далее – Указание Банка России № 2732-У).

5.9. Центральный контрагент имеет право открывать:

торговые банковские счета и (или) клиринговые банковские счета в рублях, и (или) иностранной валюте, и (или) драгоценных металлах только в Банке России, расчетных небанковских кредитных организациях и (или) банках – резидентах Российской Федерации, финансовое положение которых соответствует требованиям к финансовому положению лиц – резидентов Российской Федерации, предусмотренным абзацем седьмым пункта 5.1 настоящего Положения;

торговые и (или) клиринговые счета депо в депозитариях, удовлетворяющих одному из критериев, предусмотренных пунктом 1.2 Указания Банка России № 2732-У.».

1.5. В абзаце девятом пункта 6.1 слова «указанных в абзаце девятом настоящего пункта» заменить словами «указанных в абзаце восьмом настоящего пункта».

1.6. Абзац четвертый приложения изложить в следующей редакции:

«банком – резидентом Российской Федерации, финансовое положение которого соответствует требованиям к финансовому положению лиц – резидентов Российской Федерации, предусмотренным абзацем седьмым пункта 5.1 настоящего Положения, и (или) банком – нерезидентом Российской Федерации, финансовое положение которого соответствует требованиям к финансовому положению лиц – нерезидентов Российской Федерации, предусмотренным абзацем восьмым пункта 5.1 настоящего Положения, в пределах 50 процентов от подтвержденной аудиторской проверкой за последний отчетный год величины собственных средств (капитала) гаранта;».

2. Настоящее Указание подлежит официальному опубликованию и в соответствии с решением Совета директоров Банка России (протокол заседания Совета директоров Банка России от 2 марта 2018 года № 4) вступает в силу с 1 сентября 2018 года.

Председатель
Центрального банка
Российской Федерации

Э.С. Набиуллина