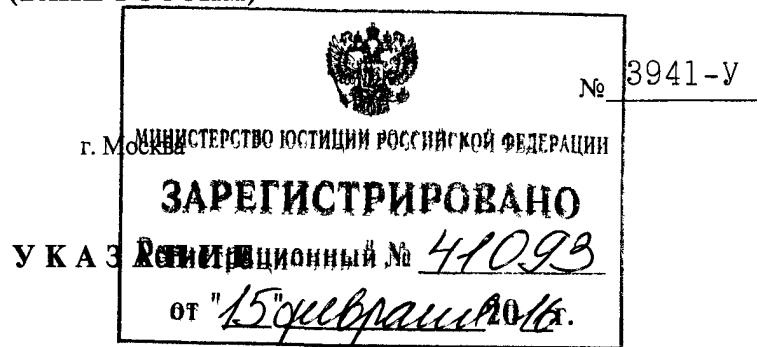




ЦЕНТРАЛЬНЫЙ БАНК РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
(БАНК РОССИИ)

« 19 » января 2016 г.



О внесении изменений в приложение 1 к Указанию Банка России от 3 декабря 2012 года № 2919-У «Об оценке качества управления кредитной организации, осуществляющей функции центрального контрагента»

1. Внести в приложение 1 к Указанию Банка России от 3 декабря 2012 года № 2919-У «Об оценке качества управления кредитной организации, осуществляющей функции центрального контрагента», зарегистрированному Министерством юстиции Российской Федерации 21 декабря 2012 года № 26273, 18 сентября 2014 года № 34094, 10 декабря 2014 года № 35118, 30 апреля 2015 года № 37087, 5 октября 2015 года № 39153 («Вестник Банка России» от 28 декабря 2012 года № 77, от 1 октября 2014 года № 87, от 22 декабря 2014 года № 112, от 14 мая 2015 года № 42, от 12 октября 2015 года № 86), следующие изменения.

1.1. Строки 15 и 16 таблицы 2 подпункта 3.1.1 пункта 3.1 изложить в следующей редакции:

« 15.	Проводит ли ЦК для определения размера клирингового обеспечения оценку точности используемых ЦК моделей оценки рисков путем сравнения спрогнозированных моделью оценки рисков значений показателя с величиной фактически наблюдаемых значений такого показателя (далее – оценка точности	
-------	--	--

	модели) не реже одного раза в шесть месяцев или в случае изменения параметров таких моделей?	
16.	Имеются ли у ЦК меры, принимаемые в случаях, когда результаты оценки точности моделей свидетельствуют о низкой эффективности указанных моделей?	».

1.2. В пункте 3.3:

в подпункте 3.3.1:

абзац пятый изложить в следующей редакции:

$$\ll \Pi_2 = \sum_2 \sum_k \max\left(\sum_i \text{CVaR}_{k,i}^T - \text{Об}_k; 0\right) \gg;$$

в абзаце восьмом слово « $\text{CVAR}_{k,i}^T$ » заменить словом « $\text{CVaR}_{k,i}^T$ », слово « CVAR_k^T » заменить словом « CVaR_k^T »;

абзац четырнадцатый изложить в следующей редакции:

« $\text{CVaR}_{k,i}^T$ и Об_k по нетто-наборам по сделкам с клиринговыми сертификатами участия (далее – КСУ) рассчитываются пропорционально доле стоимости имущества, переданного участником пула в соответствующий имущественный пул.»;

дополнить абзацем следующего содержания:

«Глубина выборки для расчета $\text{CVaR}_{k,i}^T$ должна быть не менее 12 месяцев и включать в себя период с наибольшим месячным отрицательным изменением Индекса ММВБ 50 и (или) Индекса РТС 50 за последние 10 лет. При отсутствии данных за рассматриваемый период расчет $\text{CVaR}_{k,i}^T$ следует проводить с использованием данных по финансовым инструментам со схожими параметрами, по которым имеются данные за указанный период.»;

в абзаце первом подпункта 3.3.3 слова «(для ценных бумаг» заменить словами «(для долговых ценных бумаг, выпущенных резидентами и нерезидентами»;

в подпункте 3.3.6:

графу 2 строк 23 и 24 таблицы 4 после слов «только долговых ценных бумаг» дополнить словами «, выпущенных резидентами и нерезидентами,»;

в примечаниях к заполнению таблицы 4:

в абзацах тринадцатом и пятнадцатом слова «(для ценных бумаг)» заменить словами «(для долговых ценных бумаг, выпущенных резидентами и нерезидентами)»;

абзацы восемнадцатый и двадцатый после слов «только долговых ценных бумаг» дополнить словами «, выпущенных резидентами и нерезидентами,».

1.3. В пункте 3.4:

в подпункте 3.4.1:

абзац восьмой изложить в следующей редакции:

«Расчет для финансовых инструментов, входящих в имущественный пул, производится по каждому финансовому инструменту, входящему в соответствующий имущественный пул.»;

дополнить абзацем следующего содержания:

«Значение $PP1$ принимается равным наибольшему из всех значений, рассчитанных по каждому финансовому инструменту, торгуемому на рынке с ЦК, и каждому финансовому инструменту, входящему в соответствующий имущественный пул.»;

в подпункте 3.4.2:

абзац двенадцатый изложить в следующей редакции:

«Расчет для финансовых инструментов, входящих в имущественный пул, производится по каждому финансовому инструменту, входящему в соответствующий имущественный пул.»;

дополнить абзацем следующего содержания:

«Значение $PP2$ принимается равным наибольшему из всех значений, рассчитанных по каждому финансовому инструменту, торгуемому на рынке с ЦК, и каждому финансовому инструменту, входящему в соответствующий имущественный пул.».

1.4. Строку 1 таблицы 6 подпункта 3.5.7 пункта 3.5 изложить в следующей редакции:

« 1.	Принимаются ли в качестве обеспечения, а также в состав имущественных пулов, только долговые ценные бумаги из Ломбардного списка Банка России с долгосрочным рейтингом эмитента и (или) рейтингом выпуска ценных бумаг, за исключением государственных долговых ценных бумаг Российской Федерации и долговых ценных бумаг Банка России, и (или) рейтингом юридического лица, являющегося поручителем по соответствующему выпуску ценных бумаг (для ценных бумаг), присвоенными как минимум одним из рейтинговых агентств на уровне не ниже «BB-» по классификации рейтинговых агентств «Standard&Poor's» или «Fitch Ratings» либо «Ba3» по классификации рейтингового агентства «Moody's Investors Service», КСУ, а также долевые ценные бумаги, включенные в список для расчета Индекса ММВБ 50 и Индекса РТС 50?	».
------	--	----

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

Председатель
Центрального банка
Российской Федерации



Э.С. Набиуллина

