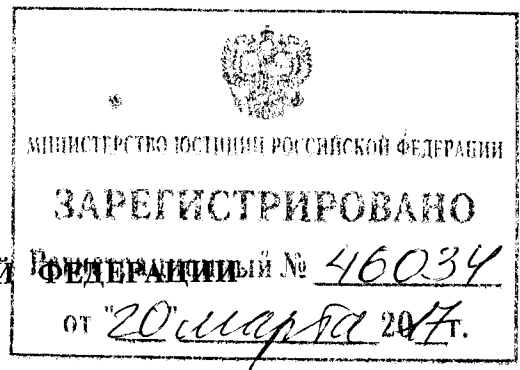




ЦЕНТРАЛЬНЫЙ БАНК РОССИЙСКОЙ
(БАНК РОССИИ)



« 30 » декабря 2016г.

№ 575-П

г. Москва

ПОЛОЖЕНИЕ

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

Настоящее Положение в соответствии с частью 2 статьи 6¹, пунктами 11¹, 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) (далее – Федеральный закон «О клиринге, клиринговой деятельности и центральном контрагенте») устанавливает требования к управлению рисками центрального контрагента, правилам организации системы управления рисками, индивидуальному и коллективному клиринговому обеспечению, размещению имущества и 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.

Глава 1. Общие положения

1.1. Настоящее Положение применяется в отношении юридического лица, которому Банком России присвоен статус центрального контрагента в соответствии со статьей 27¹ Федерального закона «О клиринге, клиринговой деятельности и центральном контрагенте».

1.2. Центральный контрагент в рамках управления рисками должен руководствоваться законодательством Российской Федерации, настоящим Положением и в части, не противоречащей требованиям настоящего Положения, Указанием Банка России от 15 апреля 2015 года № 3624-У «О требованиях к системе управления рисками и капиталом кредитной организации и банковской группы», зарегистрированным Министерством юстиции Российской Федерации 26 мая 2015 года № 37388, 28 декабря 2015 года № 40325, приложением 1 к Положению Банка России от 3 декабря 2015 года № 510-П «О порядке расчета норматива краткосрочной ликвидности («Базель III») системно значимыми кредитными организациями», зарегистрированным Министерством юстиции Российской Федерации 28 декабря 2015 года № 40319, Положением Банка России от 16 декабря 2003 года № 242-П «Об организации внутреннего контроля в кредитных организациях и банковских группах», зарегистрированным Министерством юстиции Российской Федерации 27 января 2004 года № 5489, 22 декабря 2004 года № 6222, 20 марта 2009 года № 13547, 30 июня 2014 года № 32913, 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.

1.3. Центральный контрагент должен обеспечить выявление, мониторинг, оценку и управление рисками, предусмотренными главами 2–4 настоящего Положения, а также иными рисками, реализация которых может привести к потере финансовой устойчивости центрального контрагента и (или) привести к нарушению непрерывности деятельности центрального контрагента.

1.4. Центральный контрагент в рамках организации системы управления рисками должен назначить должностное лицо или сформировать отдельное структурное подразделение, ответственное за управление рисками центрального контрагента, за исключением регуляторного риска, выявление, мониторинг и оценка которого, а также управление которым должны осуществляться службой внутреннего контроля (руководителем службы внутреннего контроля (контролером)).

Для должностного лица (руководителя структурного подразделения), ответственного за управление рисками центрального контрагента (далее – должностное лицо), занимаемая должность должна являться основным местом работы.

Должностное лицо должно соответствовать квалификационным требованиям, установленным Указанием Банка России от 1 апреля 2014 года № 3223-У «О требованиях к руководителям службы управления рисками, службы внутреннего контроля, службы внутреннего аудита кредитной организации», зарегистрированным Министерством юстиции Российской Федерации 23 апреля 2014 года № 32086, 8 августа 2016 года № 43152, и требованиям к деловой репутации, установленным пунктом первым части первой статьи 16 Федерального закона «О банках и банковской деятельности» (в редакции Федерального закона от 3 февраля 1996 года

17-ФЗ) (Ведомости Съезда народных депутатов РСФСР и Верховного Совета РСФСР, 1990, 27, ст. 357; Собрание законодательства Российской Федерации, 1996, № 6, ст. 492; 1998, № 31, ст. 3829; 1999, № 28, ст. 3459, ст. 3469; 2001, № 26, ст. 2586; № 33, ст. 3424; 2002, № 12, ст. 1093; 2003, № 27, ст. 2700; № 50, ст. 4855; № 52, ст. 5033, ст. 5037; 2004, № 27, ст. 2711; № 31, ст. 3233; 2005, № 1, ст. 18, ст. 45; № 30, ст. 3117; 2006, № 6, ст. 636; № 19, ст. 2061; № 31, ст. 3439; № 52, ст. 5497; 2007, № 1, ст. 9; № 22, ст. 2563; № 31, ст. 4011; № 41, ст. 4845; № 45, ст. 5425; № 50, ст. 6238; 2008, № 10, ст. 895; 2009, № 1, ст. 23; № 9, ст. 1043; № 18, ст. 2153; № 23, ст. 2776; № 30, ст. 3739; № 48, ст. 5731; № 52, ст. 6428; 2010, № 8, ст. 775; № 27, ст. 3432; № 30, ст. 4012; № 31, ст. 4193; № 47, ст. 6028; 2011, № 7, ст. 905; № 27, ст. 3873, ст. 3880; № 29, ст. 4291; № 48, ст. 6730; № 49, ст. 7069; № 50, ст. 7351; 2012, № 27, ст. 3588; № 31, ст. 4333; № 50, ст. 6954; № 53, ст. 7605, ст. 7607; 2013, № 11, ст. 1076; № 19, ст. 2317, ст. 2329; № 26, ст. 3207; № 27, ст. 3438, ст. 3477; № 30, ст. 4048; № 40, ст. 5036; № 49, ст. 6336; № 51, ст. 6683, ст. 6699; 2014, № 6, ст. 563; № 19, ст. 2311; № 26, ст. 3379, ст. 3395; № 30, ст. 4219; № 40, ст. 5317, ст. 5320; № 45, ст. 6144, ст. 6154; № 49, ст. 6912; № 52, ст. 7543; 2015, № 1, ст. 37; № 17, ст. 2473; № 27, ст. 3947, ст. 3950; № 29, ст. 4355, ст. 4357, ст. 4385; № 51, ст. 7243; 2016, № 1, ст. 23; № 15, ст. 2050; № 26, ст. 3860; № 27, ст. 4294, ст. 4295).

Должностное лицо не может осуществлять функции, не связанные с управлением рисками. Должностное лицо должно быть подотчетно совету директоров (наблюдательному совету) центрального контрагента.

Должностное лицо может входить в состав создаваемых центральным контрагентом комитетов и комиссий, не являющихся структурными подразделениями центрального контрагента.

Должностное лицо в рамках управления рисками должно регулярно, но не реже одного раза в шесть месяцев представлять совету директоров

(наблюдательному совету), единоличному и коллегиальному исполнительным органам центрального контрагента отчеты об управлении рисками, а также результаты стресс-тестирования рисков и оценки точности модели центрального контрагента в соответствии с Положением Банка России от 30 декабря 2016 года № 576-П «О требованиях к методикам стресс-тестирования рисков и оценки точности модели центрального контрагента, к стресс-тестированию рисков и оценке точности модели центрального контрагента, порядке и сроках представления информации о результатах стресс-тестирования рисков центрального контрагента участникам клиринга», зарегистрированным Министерством юстиции Российской Федерации 25 января 2017 года № 45403.

1.5. Центральный контрагент должен обеспечить проведение оценки эффективности функционирования системы управления рисками, в том числе для целей принятия решений по вопросам развития (совершенствования) системы управления рисками, не реже одного раза в год.

Глава 2. Требования к управлению кредитным риском, рыночным риском и риском ликвидности

2.1. Центральный контрагент при управлении риском возникновения расходов (убытков) вследствие невыполнения договорных обязательств контрагентом перед центральным контрагентом своевременно и (или) в полном объеме (далее – кредитный риск) должен:

2.1.1. проводить мониторинг контрагентов, включающий оценку и контроль:

соответствия участников клиринга критериям допуска к осуществлению операций с центральным контрагентом;

финансовой устойчивости 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;

величины риска дефолта контрагента до завершения расчетов по сделкам центрального контрагента в рамках инвестиционной деятельности с учетом риска концентрации, присущего операциям с производными финансовыми инструментами (далее – ПФИ), в том числе в отношении групп связанных контрагентов, эмитентов, видов экономической деятельности;

механизмов, обеспечивающих закрытие позиций участников клиринга, не исполнивших обязательства в срок, не превышающий установленный в правилах клиринга;

2.1.2. организовать систему финансового покрытия рисков, а также потенциально возможных убытков центрального контрагента, включающую:

параметры, используемые для оценки достаточности индивидуального клирингового обеспечения, а также иного обеспечения (кроме коллективного клирингового обеспечения), предназначенного для обеспечения исполнения обязательств участника клиринга (далее – обеспечение) и коллективного клирингового обеспечения;

определение величины выделенного капитала центрального контрагента для покрытия рисков, а также потенциально возможных убытков центрального контрагента (не покрытых обеспечением);

организацию в случае принятия решения советом директоров (наблюдательным советом) центрального контрагента дополнительного финансового покрытия, предназначенного для покрытия убытков, не обеспеченных участниками клиринга, включающего привлеченные средства участников клиринга, кредитные ресурсы, гарантии, средства акционеров и собственные средства (капитал) центрального контрагента;

2.1.3. обеспечить покрытие потенциальных потерь, возникающих в результате неисполнения обязательств участниками клиринга перед центральным контрагентом;

2.1.4. оценивать величины текущего и потенциального кредитного риска по сделкам центрального контрагента в рамках инвестиционной деятельности;

2.1.5. ограничивать концентрацию активов, принадлежащих центральному контрагенту и (или) переданных участниками клиринга центральному контрагенту в качестве обеспечения исполнения обязательств;

2.1.6. использовать исключительно для заключения сделок РЕПО с участниками клиринга привлекаемые средства от юридических лиц, являющихся участниками клиринга, в рамках проведения банковской операции, указанной в абзаце четвертом пункта 1.1 Инструкции Банка России от 14 ноября 2016 года № 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», зарегистрированной Министерством юстиции Российской Федерации 6 декабря 2016 года № 44577.

2.2. Центральный контрагент при управлении риском возникновения расходов (убытков) вследствие неблагоприятного изменения рыночной (справедливой) стоимости инструментов или иных активов, принадлежащих центральному контрагенту и (или) переданных участниками клиринга центральному контрагенту в качестве обеспечения исполнения обязательств (далее – рыночный риск), должен:

оценивать стоимость активов центрального контрагента с учетом факторов активности и ликвидности рынка инструментов, клиринг по сделкам с которыми осуществляется центральным контрагентом, а также по инструментам, в которые центральный контрагент размещает временно

свободные средства (в целях настоящего Положения к инструментам относятся ценные бумаги, ПФИ, иностранная валюта, драгоценные металлы, вклады (депозиты), межбанковские кредиты, товары, допущенные к организованным торгам, сделки РЕПО);

проводить рыночную переоценку обязательств центрального контрагента и обеспечения (с учетом возможности выставления маржинального требования (требования по довнесению обеспечения) и коллективного клирингового обеспечения;

устанавливать дисконты по сделкам центрального контрагента в рамках инвестиционной деятельности с целью покрытия возможных изменений их стоимости в период между последней переоценкой и временем, необходимым для их реализации.

2.3. Центральный контрагент при управлении риском неспособности центрального контрагента исполнять в полном объеме свои обязательства по мере наступления сроков их исполнения без понесения убытков (риск ликвидности) должен:

использовать автоматизированную систему, обеспечивающую контроль способности центрального контрагента своевременно и в полном объеме исполнять свои обязательства и осуществлять деятельность центрального контрагента;

осуществлять дифференциацию активов центрального контрагента, обеспечения и коллективного клирингового обеспечения по степени ликвидности.

Глава 3. Требования к управлению операционным риском

3.1. Центральный контрагент в рамках управления риском возникновения расходов (убытков) в результате недостатков, нарушений,

сбоев в работе информационных систем и комплексов программно-технических средств центрального контрагента и (или) во внутренних бизнес-процессах, ошибок персонала и (или) внешних событий, оказывающих негативное воздействие на деятельность центрального контрагента (далее – операционный риск), должен проводить мероприятия, предусмотренные пунктами 3.2–3.5 настоящего Положения.

3.2. Центральный контрагент должен определить целевые показатели операционной надежности центрального контрагента, обеспечивающие бесперебойность деятельности центрального контрагента, а также конфиденциальность, целостность и сохранность данных, доступ к данным на постоянной основе.

При определении целевых показателей операционной надежности центральный контрагент должен учитывать как количественные, так и качественные критерии операционной надежности.

Центральный контрагент должен анализировать целевые показатели операционной надежности не реже одного раза в год и при необходимости актуализировать их, в том числе с учетом развития новых технологий и совершенствования бизнес-процессов.

3.3. Центральный контрагент должен использовать комплексы программно-технических средств для осуществления деятельности центрального контрагента, удовлетворяющие требованиям Указания Банка России от 30 декабря 2016 года № 4258-У «О требованиях к содержанию, порядку и сроках представления в Банк России плана обеспечения непрерывности деятельности центрального контрагента, изменений, вносимых в него, о порядке оценки плана обеспечения непрерывности деятельности центрального контрагента, о требованиях к программно-техническим средствам и сетевым коммуникациям центрального контрагента, а также о порядке создания, ведения и хранения баз данных, содержащих информацию об имуществе, обязательствах центрального контрагента и их движении», зарегистрированного Министерством юстиции

Российской Федерации 15 февраля 2017 года № 45648, и обеспечивающие бесперебойную деятельность и возможность оперативно обрабатывать и управлять объемом информации, получаемой в рамках деятельности центрального контрагента. Центральный контрагент должен проводить тестирование (в том числе нагрузочное тестирование) комплексов программно-технических средств с периодичностью, установленной правилами организации системы управления рисками центрального контрагента, но не реже одного раза в год, а также в случаях изменений бизнес-процессов, связанных с деятельностью центрального контрагента, и после событий операционного риска, наступление которых негативно влияет на качество осуществления деятельности центрального контрагента.

Центральный контрагент должен составлять прогнозную оценку (с учетом результатов нагрузочного тестирования комплексов программно-технических средств) возможного изменения объемов проводимых операций и разрабатывать планы мер, обеспечивающих бесперебойную деятельность центрального контрагента в условиях возможного увеличения объемов операций и (или) при необходимости изменения технических параметров комплексов программно-технических средств.

3.4. Центральный контрагент должен организовать функционирование комплекса программно-технических средств, обеспечивающего надлежащее и бесперебойное осуществление деятельности центрального контрагента в случае невозможности осуществления деятельности центрального контрагента основным комплексом программно-технических средств в условиях возникновения нестандартных и чрезвычайных ситуаций (далее – резервный комплекс).

Центральный контрагент должен обеспечить переход на использование резервного комплекса в случае возникновения нестандартных и чрезвычайных ситуаций и невозможности обеспечения непрерывности

деятельности центрального контрагента основным комплексом программно-технических средств.

В рамках обеспечения функционирования резервного комплекса центральный контрагент должен:

обеспечить возможность работникам основного комплекса программно-технических средств осуществлять деятельность центрального контрагента в резервном комплексе в течение срока, определенного планом обеспечения непрерывности деятельности центрального контрагента;

обеспечить нахождение в резервном комплексе работников в течение рабочего времени, определенного внутренними документами центрального контрагента, для обеспечения начала функционирования резервного комплекса и возобновления в нем осуществления деятельности центрального контрагента в случае возникновения нестандартной или чрезвычайной ситуации;

использовать услуги как минимум двух независимых поставщиков телекоммуникационных услуг для основного комплекса программно-технических средств и резервного комплекса;

поддерживать техническое состояние резервного комплекса, в том числе необходимое количество рабочих мест для обеспечения возможности осуществления деятельности центрального контрагента в резервном комплексе в течение как минимум пятнадцати рабочих дней со дня возникновения нестандартной или чрезвычайной ситуации.

3.5. Центральный контрагент должен определить меры по выявлению дополнительного операционного риска, обусловленного взаимодействием с инфраструктурными и иными организациями финансового рынка, в том числе клиентами и поставщиками услуг, а также меры, направленные на снижение или устранение возможного негативного влияния дополнительного операционного риска при осуществлении деятельности центрального контрагента.

Глава 4. Требования к управлению кастодиальным риском

4.1. Центральный контрагент в рамках управления риском утраты активов, принадлежащих центральному контрагенту и (или) переданных участниками клиринга центральному контрагенту в качестве обеспечения исполнения обязательств, вследствие действий или бездействия юридических лиц, осуществляющих учет и хранение вышеуказанных активов (далее – кастодиальный риск), должен:

проводить анализ деятельности юридических лиц, осуществляющих учет и хранение активов, принадлежащих центральному контрагенту и (или) переданных участниками клиринга центральному контрагенту в качестве обеспечения исполнения обязательств (а также оценивать надежность и финансовую устойчивость таких юридических лиц);

проводить контроль фактического местонахождения активов (за исключением ценных бумаг), принадлежащих центральному контрагенту и (или) переданных участниками клиринга центральному контрагенту в качестве обеспечения исполнения обязательств;

оценивать возможность своевременного востребования активов (за исключением ценных бумаг), принадлежащих центральному контрагенту и (или) переданных участниками клиринга центральному контрагенту в качестве обеспечения исполнения обязательств.

4.2. Центральный контрагент в рамках управления кастодиальным риском должен обеспечить возможность создания резервов и (или) страхования активов (за исключением ценных бумаг), принадлежащих центральному контрагенту и (или) переданных участниками клиринга центральному контрагенту в качестве обеспечения исполнения обязательств, для покрытия потенциальных убытков, возникающих в случае несостоятельности юридических лиц, осуществляющих учет и хранение активов, принадлежащих центральному контрагенту и (или) переданных

участниками клиринга центральному контрагенту в качестве обеспечения исполнения обязательств.

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. 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, имеющих рейтинг долгосрочной кредитоспособности в иностранной валюте, присвоенный как минимум одним из рейтинговых агентств, включенных в установленный Советом директоров Банка России перечень рейтинговых агентств (далее – рейтинг), на уровне не ниже установленного Советом директоров Банка России, информация о котором размещена на официальном сайте Банка России в информационно-телекоммуникационной сети «Интернет» (далее – уровень, установленный Банком России);

торговые и (или) клиринговые счета депо, удовлетворяющие 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.

5.2. Центральный контрагент размещает от своего имени и за свой счет временно свободные денежные средства в рублях и (или) иностранной валюте, и (или) драгоценных металлах на корреспондентских счетах, открытых в Банке России, расчетных небанковских кредитных организациях и (или) банках-резидентах, имеющих рейтинг не ниже уровня, установленного Банком России, на открытых для исполнения обязательств иных счетах в банках-нерезидентах, имеющих аналогичный банкам-резидентам рейтинг в соответствующих национальной и (или) иностранных валютах, а также в национальной валюте в национальных (центральных) банках иностранных государств.

Центральный контрагент размещает от своего имени и за свой счет временно свободные денежные средства в рублях и (или) иностранной валюте, и (или) драгоценных металлах во вклады в банках-резидентах, банках-нерезидентах, имеющих рейтинг не ниже уровня, установленного Банком России.

Центральный контрагент размещает от своего имени и за свой счет временно свободные денежные средства в рублях и (или) иностранной валюте, и (или) драгоценных металлах в государственные долговые ценные бумаги Российской Федерации, долговые ценные бумаги Банка России и инструменты, за исключением товаров и вкладов (депозитов), с долгосрочным рейтингом в иностранной и (или) национальной валюте выпуска ценных бумаг (при отсутствии рейтинга выпуска – рейтингом эмитента или юридического лица, являющегося поручителем (гарантом) по соответствующему выпуску ценных бумаг) (для сделок с ценными бумагами), и (или) рейтингом контрагента (для сделок в рублях и с драгоценными металлами), и (или) суверенным рейтингом страны, являющейся эмитентом иностранной валюты, выступающей в качестве обеспечения по сделке и (или) объекта купли – продажи, и (или) базисного актива ПФИ (для сделок в иностранной валюте), присвоенным как минимум одним из рейтинговых агентств, включенных в установленный Советом директоров Банка России перечень рейтинговых агентств (далее – рейтинг

инструмента), не ниже уровня, установленного Банком России. При этом портфель ценных бумаг центрального контрагента может состоять исключительно из долговых ценных бумаг и 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.

5.3. Центральный контрагент размещает:

ценные бумаги на счетах депо для исполнения обязательств в депозитариях, требования к которым приведены в абзаце третьем пункта 5.1 настоящего Положения;

коллективное клиринговое обеспечение в рублях и (или) иностранной валюте, и (или) драгоценных металлах исключительно во вклады в банках-резидентах, банках-нерезидентах, имеющих рейтинг не ниже уровня, установленного Банком России.

5.4. Центральный контрагент принимает в качестве индивидуального клирингового обеспечения:

денежные средства в рублях и (или) иностранной валюте, и (или) драгоценные металлы, и (или) государственные долговые ценные бумаги Российской Федерации, и (или) долговые ценные бумаги Банка России, и (или) клиринговые сертификаты участия, и (или) ценные бумаги эмитентов, долговые ценные бумаги которых включены в Ломбардный список Банка России, с долгосрочным рейтингом в иностранной и (или) национальной валюте выпуска ценных бумаг (при отсутствии рейтинга выпуска – рейтингом эмитента или юридического лица, являющегося поручителем (гарантом) по соответствующему выпуску ценных бумаг), присвоенным как минимум одним из рейтинговых агентств, включенных в установленный Советом директоров Банка России перечень рейтинговых агентств, не ниже уровня, установленного Банком России, а также долевые ценные бумаги организаций – эмитентов, включенных в список для расчета Индекса ММВБ и Индекса РТС;

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

5.5. Центральный контрагент принимает в качестве коллективного клирингового обеспечения денежные средства в рублях и (или) иностранной валюте, и (или) драгоценные металлы, и (или) государственные долговые ценные бумаги Российской Федерации, и (или) долговые ценные бумаги Банка России.

5.6. Требования пункта 5.2 настоящего Положения не распространяются на случаи приобретения активов в целях исполнения центральным контрагентом обязательств перед участниками клиринга.

5.7. В случае наличия у банков-резидентов, банков-нерезидентов различных значений рейтинга выбирается наихудшее его значение в соответствующей валюте.

5.8. В случае наличия у инструмента нескольких значений рейтинга инструмента выбирается наихудшее его значение.

5.9. В случае если иностранная валюта является национальной валютой нескольких стран, выбирается наихудшее значение суверенного рейтинга блока стран, использующего данную иностранную валюту в качестве национальной.

Глава 6. Требования к правилам организации системы управления рисками

6.1. Правила организации системы управления рисками центрального контрагента должны включать:

общие положения, определяющие цели организации системы управления рисками;

перечень рисков центрального контрагента, реализация которых может привести к потере финансовой устойчивости центрального контрагента и (или) нарушению деятельности центрального контрагента, и (или) иным

неблагоприятным последствиям, которые могут привести к невозможности осуществления деятельности центрального контрагента;

порядок выявления, мониторинга и оценки рисков центрального контрагента (по каждому виду рисков, за исключением регуляторного риска);

порядок управления рисками центрального контрагента, в том числе процедуры принятия решений в рамках управления рисками центрального контрагента (по каждому виду рисков, за исключением регуляторного риска);

порядок взаимодействия совета директоров (наблюдательного совета), единоличного и коллегиальных исполнительных органов центрального контрагента и структурных подразделений центрального контрагента, в том числе установление случаев и порядка обязательного информирования совета директоров (наблюдательного совета) центрального контрагента о рисках, за исключением регуляторного риска, представления отчетов об управлении рисками, за исключением отчетов об управлении регуляторным риском;

порядок использования активов, принадлежащих центральному контрагенту и (или) переданных участниками клиринга центральному контрагенту в качестве обеспечения исполнения обязательств, на различных рынках в случае неисполнения обязательств участниками клиринга;

перечень обстоятельств, наступление которых может привести к приостановлению или прекращению осуществления деятельности центрального контрагента;

перечень мер, порядок и сроки их принятия центральным контрагентом в случае наступления обстоятельств, указанных в абзаце девятом настоящего пункта;

перечень целевых показателей операционной надежности центрального контрагента;

порядок формирования базы данных о событиях операционного риска;

порядок и периодичность проведения тестирования, в том числе нагрузочного тестирования, комплексов программно-технических средств, используемых для осуществления деятельности центрального контрагента;

порядок обеспечения защиты информационных систем и комплексов программно-технических средств, используемых для осуществления деятельности центрального контрагента;

требования к организации функционирования резервного комплекса программно-технических средств;

порядок, содержание, сроки и периодичность представления отчетов об управлении рисками совету директоров (наблюдательному совету) центрального контрагента, за исключением отчетов об управлении регуляторным риском;

порядок оценки эффективности функционирования системы управления рисками центрального контрагента и принятия решений по вопросам развития (совершенствования) системы управления рисками.

6.2. Перечень мер, указанный в абзаце девятом пункта 6.1 настоящего Положения, должен содержать:

порядок действий центрального контрагента в случае неисполнения обязательств участником клиринга, в том числе порядок покрытия возникающих в этой связи расходов (убытков);

порядок действий центрального контрагента в случае недостаточности обеспечения;

порядок действий центрального контрагента при наступлении обстоятельств, повлекших возникновение убытков, не предусмотренных абзацами вторым и третьим настоящего пункта;

порядок действий центрального контрагента, направленных на восстановление величины выделенного капитала центрального контрагента, обеспечения, коллективного клирингового обеспечения и иных фондов, использованных для покрытия убытков.

6.3. Правила организации системы управления рисками центрального контрагента пересматриваются по мере необходимости, но не реже одного раза в год в целях актуализации содержащихся в них сведений и (или) повышения эффективности функционирования системы управления рисками.

6.4. Правила организации системы управления рисками центрального контрагента могут состоять из одного или нескольких документов.

Глава 7. Требования к методике определения выделенного капитала центрального контрагента

7.1. Методика определения выделенного капитала центрального контрагента должна содержать положения по расчету величины собственных средств центрального контрагента, предназначенной для покрытия возможных потерь, вызванных неисполнением участниками клиринга своих обязательств, до использования средств, внесенных добросовестными участниками клиринга в коллективное клиринговое обеспечение на соответствующем рынке, обслуживаемом центральным контрагентом (далее – выделенный капитал центрального контрагента).

7.2. Методика определения выделенного капитала центрального контрагента должна содержать:

источники информации, используемой для расчета выделенного капитала центрального контрагента;

порядок расчета минимальной величины выделенного капитала центрального контрагента;

порядок распределения выделенного капитала центрального контрагента по рынкам, обслуживаемым центральным контрагентом;

порядок восполнения выделенного капитала центрального контрагента в случае его использования.

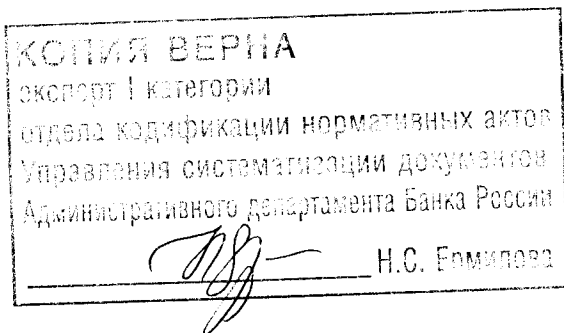
Глава 8. Заключительные положения

8.1. Настоящее Положение вступает в силу по истечении 10 дней после дня его официального опубликования.

И.о. Председателя
Центрального банка
Российской Федерации



Д.В. Тулин



Приложение

к Положению 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»

Банковская гарантия, принимаемая центральным контрагентом в качестве индивидуального клирингового обеспечения в соответствии с абзацем третьим пункта 5.4 настоящего Положения (далее – банковская гарантия), должна одновременно соответствовать следующим критериям.

Банковская гарантия должна быть выдана:

участнику клиринга, являющемуся нефинансовой организацией;

банком-резидентом, банком-нерезидентом, имеющим рейтинг не ниже уровня, установленного Банком России;

банком, не являющимся членом того же банковского холдинга и (или) той же банковской группы, что и участник клиринга, предоставивший банковскую гарантию в качестве обеспечения;

банком, не аффилированным с центральным контрагентом.

Банковская гарантия должна являться безотзывной безусловной.

Срок выплаты денежных средств по банковской гарантии не должен превышать период, за который в соответствии с правилами клиринга центральный контрагент осуществляет урегулирование убытков, возникших в результате неисполнения своих обязательств участниками клиринга.

Банковская гарантия должна иметь период действия, превышающий срок, за который должны быть урегулированы все обязательства участника клиринга перед центральным контрагентом.