

**ЦЕНТРАЛЬНЫЙ БАНК РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
(БАНК РОССИИ)**



МИНИСТЕРСТВО ЮСТИЦИИ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ

« 29 » мая 2017 г.

ЗАРЕГИСТРИРОВАНО № 4392-У

г. Москва Регистрационный № 47131

от "23" июня 2017.

УКАЗАНИЕ

**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. На основании части 4 статьи 3 Федерального закона от 13 июля 2015 года № 222-ФЗ «О деятельности кредитных рейтинговых агентств в Российской Федерации, о внесении изменения в статью 76¹ Федерального закона «О Центральном банке Российской Федерации (Банке России)» и признании утратившими силу отдельных положений законодательных актов Российской Федерации» (Собрание законодательства Российской Федерации, 2015, № 29, ст. 4348) 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, 15 февраля 2016 года № 41093, следующие изменения.

1.1. Абзац двадцать пятый примечаний к заполнению таблицы 2 подпункта 3.1.1 пункта 3.1 изложить в следующей редакции:

«При оценке данного вопроса необходимо учитывать, что при наличии в учредительном документе ЦК ограничения на размещение

выделенного капитала ЦК в рублях и (или) иностранной валюте, и (или) драгоценных металлах только в долговые ценные бумаги, включенные в котировальный список первого (высшего) уровня хотя бы одной из российских бирж, финансовые инструменты с кредитным рейтингом эмитента и (или) кредитным рейтингом выпуска ценных бумаг, и (или) кредитным рейтингом юридического лица, являющегося поручителем по соответствующему выпуску ценных бумаг (для долговых ценных бумаг, выпущенных резидентами, за исключением государственных долговых ценных бумаг Российской Федерации и долговых ценных бумаг Банка России), и (или) кредитным рейтингом контрагента – резидента (для денежных средств в рублях и драгоценных металлов), присвоенным как минимум одним из кредитных рейтинговых агентств, не ниже установленного Советом директоров Банка России уровня, информация о котором размещена на официальном сайте Банка России в информационно-телекоммуникационной сети «Интернет» (далее – установленный Советом директоров Банка России уровень), и (или) суверенным кредитным рейтингом, объектом которого является иностранное государство или блок стран, использующих иностранную валюту в качестве национальной (для денежных средств в иностранной валюте), и (или) кредитным рейтингом эмитента, и (или) кредитным рейтингом выпуска ценных бумаг, и (или) кредитным рейтингом юридического лица, являющегося поручителем по соответствующему выпуску ценных бумаг (для долговых ценных бумаг, выпущенных нерезидентами), и (или) кредитным рейтингом контрагента – нерезидента (для драгоценных металлов), присвоенным как минимум одним из иностранных кредитных рейтинговых агентств на уровне не ниже «BBB–» по классификации иностранных кредитных рейтинговых агентств «Эс-энд-Пи Глобал Рейтингс» («S&P Global Ratings») или «Фитч Рэйтингс» («Fitch Ratings») либо «Baa3» по классификации иностранного кредитного рейтингового агентства «Мудис Инвесторс Сервис» («Moody's

Investors Service»), за исключением случаев приобретения активов, осуществляемого в целях закрытия сделок с участниками клиринга и случаев приобретения активов в рамках деятельности ЦК как стороны всех договоров, обязательства из которых подлежат включению в клиринговый пул, а также осуществления операций купли-продажи иностранной валюты, и (или) ценных бумаг, и (или) драгоценных металлов, и (или) иных активов при полном предварительном обеспечении исполнения своих обязательств контрагентом ЦК, ответу на данный вопрос присваивается значение, равное 2, согласно подпункту 3.1.2 настоящей Методики.».

1.2. В пункте 3.3:

абзац третий подпункта 3.3.2 изложить в следующей редакции:

« $\max_k$ – максимум по всем активам, находящимся в коллективном клиринговом обеспечении, за исключением денежных средств в рублях и (или) свободно конвертируемых валютах, государственных долговых ценных бумаг Российской Федерации и долговых ценных бумаг Банка России, казначейских бумаг или бумаг центральных банков стран Организации экономического сотрудничества и развития с кредитным рейтингом, присвоенным как минимум одним из иностранных кредитных рейтинговых агентств на уровне не ниже «BBB+» по классификации иностранных кредитных рейтинговых агентств «Эс-энд-Пи Глобал Рейтингс» (S&P Global Ratings)» или «Фитч Рэйтингс» (Fitch Ratings)» либо «Baa1» по классификации иностранного кредитного рейтингового агентства «Мудис Инвесторс Сервис» («Moody's Investors Service»);»;

абзац первый подпункта 3.3.3 изложить в следующей редакции:

«3.3.3. Коэффициент КРЗ характеризует распределение инвестиционных активов по их кредитному качеству. Коэффициент КРЗ рассчитывается как доля инвестиционных активов, состоящих из долговых ценных бумаг, включенных в котировальный список первого (высшего)

уровня хотя бы одной из российских бирж, и иных инвестиционных активов с кредитным рейтингом эмитента (для долговых ценных бумаг, выпущенных резидентами, за исключением государственных долговых ценных бумаг Российской Федерации и долговых ценных бумаг Банка России), кредитным рейтингом контрагента – резидента (для денежных средств в рублях и драгоценных металлов), присвоенным как минимум одним из кредитных рейтинговых агентств, не ниже установленного Советом директоров Банка России уровня и (или) суверенным кредитным рейтингом, объектом которого является иностранное государство или блок стран, использующих иностранную валюту в качестве национальной (для денежных средств в иностранной валюте), и (или) кредитным рейтингом эмитента (для долговых ценных бумаг, выпущенных нерезидентами), кредитным рейтингом контрагента – нерезидента (для драгоценных металлов), присвоенным как минимум одним из иностранных кредитных рейтинговых агентств на уровне не ниже «BBB–» по классификации иностранных кредитных рейтинговых агентств «Эс-энд-Пи Глобал Рейтингс» («S&P Global Ratings») или «Фитч Рэйтингс» («Fitch Ratings») либо «Баа3» по классификации иностранного кредитного рейтингового агентства «Мудис Инвесторс Сервис» («Moody's Investors Service»), в общем объеме инвестиционных активов ЦК, умноженная на 100%.»;

в подпункте 3.3.6:

в примечаниях к заполнению таблицы 4:

абзац четвертый изложить в следующей редакции:

«При оценке данного вопроса необходимо учитывать, что при наличии в учредительном документе ЦК ограничения на открытие корреспондентских счетов в рублях, иностранной валюте и драгоценных металлах только в Банке России, расчетных небанковских кредитных организациях и (или) банках – резидентах, определенных иностранными национальными банками или иностранными регуляторами финансовых рынков в качестве уполномоченного банка – резидента для осуществления

переводов денежных средств в национальной валюте таких иностранных национальных банков или иностранных регуляторов финансовых рынков с кредитными организациями, созданными в соответствии с законодательством Российской Федерации, и (или) банках – резидентах, имеющих кредитный рейтинг, присвоенный как минимум одним из кредитных рейтинговых агентств, не ниже установленного Советом директоров Банка России уровня, а также на открытие иных счетов в рублях, иностранной валюте и драгоценных металлах для исполнения обязательств в банках – нерезидентах, имеющих кредитный рейтинг, присвоенный как минимум одним из иностранных кредитных рейтинговых агентств на уровне не ниже «BB–» по классификации иностранных кредитных рейтинговых агентств «Эс-энд-Пи Глобал Рейтингс» («S&P Global Ratings») или «Фитч Рэйтингс» («Fitch Ratings») либо «Ba3» по классификации иностранного кредитного рейтингового агентства «Мудис Инвесторс Сервис» («Moody's Investors Service»), и банках – резидентах стран – участников Содружества Независимых Государств, в том числе национальных (центральных) банках указанных стран, ответу на данный вопрос присваивается значение, равное 2, согласно подпункту 3.3.7 настоящей Методики.»;

абзац шестой изложить в следующей редакции:

«При оценке данного вопроса необходимо учитывать, что при открытии торговых банковских счетов в расчетных небанковских кредитных организациях, клиринговых банковских счетов в Банке России и (или) расчетных небанковских кредитных организациях, а также счетов в банках – резидентах, определенных иностранными национальными банками или иностранными регуляторами финансовых рынков в качестве уполномоченного банка – резидента для осуществления переводов денежных средств в национальной валюте таких иностранных национальных банков или иностранных регуляторов финансовых рынков с кредитными организациями, созданными в соответствии с

законодательством Российской Федерации, и (или) банках – резидентах, имеющих кредитный рейтинг, присвоенный как минимум одним из кредитных рейтинговых агентств, не ниже установленного Советом директоров Банка России уровня, а также при открытии иных счетов для исполнения обязательств в банках – нерезидентах, имеющих кредитный рейтинг, присвоенный как минимум одним из иностранных кредитных рейтинговых агентств на уровне не ниже «BB–» по классификации иностранных кредитных рейтинговых агентств «Эс-энд-Пи Глобал Рейтингс» («S&P Global Ratings») или «Фитч Рэйтингс» («Fitch Ratings») либо «Ба3» по классификации иностранного кредитного рейтингового агентства «Мудис Инвесторс Сервис» («Moody's Investors Service»), и банках – резидентах стран – участников Содружества Независимых Государств, в том числе национальных (центральных) банках указанных стран, ответу на данный вопрос присваивается значение, равное 2, согласно подпункту 3.3.7 настоящей Методики.»;

абзац восьмой изложить в следующей редакции:

«При оценке данного вопроса необходимо учитывать, что при открытии вкладов в рублях, иностранной валюте и драгоценных металлах в банках – резидентах, имеющих кредитный рейтинг, присвоенный как минимум одним из кредитных рейтинговых агентств, не ниже установленного Советом директоров Банка России уровня, и (или) банках – резидентах, определенных иностранными национальными банками или иностранными регуляторами финансовых рынков в качестве уполномоченного банка – резидента для осуществления переводов денежных средств в национальной валюте таких иностранных национальных банков или иностранных регуляторов финансовых рынков с кредитными организациями, созданными в соответствии с законодательством Российской Федерации, и в банках – нерезидентах, имеющих рейтинг долгосрочной кредитоспособности в иностранной валюте, присвоенный как минимум одним из иностранных кредитных

рейтинговых агентств на уровне не ниже «BBB–» по классификации иностранных кредитных рейтинговых агентств «Эс-энд-Пи Глобал Рейтингс» («S&P Global Ratings») или «Фитч Рэйтингс» («Fitch Ratings») либо «Баа3» по классификации иностранного кредитного рейтингового агентства «Мудис Инвесторс Сервис» («Moody's Investors Service»), а также при наличии в договоре возможности изъятия такого вклада в случае необходимости, ответу на данный вопрос присваивается значение, равное 2, согласно подпункту 3.3.7 настоящей Методики.»;

абзац одиннадцатый изложить в следующей редакции:

«При оценке данного вопроса необходимо учитывать, что при наличии в учредительном документе ЦК ограничения на размещение временно свободных денежных средств в рублях и (или) иностранной валюте, и (или) драгоценных металлов только во вклады в банках – резидентах, имеющих кредитный рейтинг, присвоенный как минимум одним из кредитных рейтинговых агентств, не ниже установленного Советом директоров Банка России уровня и (или) банках – резидентах, определенных иностранными национальными банками или иностранными регуляторами финансовых рынков в качестве уполномоченного банка – резидента для осуществления переводов денежных средств в национальной валюте таких иностранных национальных банков или иностранных регуляторов финансовых рынков с кредитными организациями, созданными в соответствии с законодательством Российской Федерации, и в банках – нерезидентах, имеющих кредитный рейтинг, присвоенный как минимум одним из иностранных кредитных рейтинговых агентств на уровне не ниже «BBB–» по классификации иностранных кредитных рейтинговых агентств «Эс-энд-Пи Глобал Рейтингс» («S&P Global Ratings») или «Фитч Рэйтингс» («Fitch Ratings») либо «Баа3» по классификации иностранного кредитного рейтингового агентства «Мудис Инвесторс Сервис» («Moody's Investors

Service»)), ответу на данный вопрос присваивается значение, равное 2, согласно подпункту 3.3.7 настоящей Методики.»;

абзац тринадцатый изложить в следующей редакции:

«При оценке данного вопроса необходимо учитывать, что при наличии в учредительном документе ЦК ограничения на размещение временно свободных денежных средств в рублях и (или) иностранной валюте, и (или) драгоценных металлов только в долговые ценные бумаги, включенные в котировальный список первого (высшего) уровня хотя бы одной из российских бирж, финансовые инструменты, за исключением государственных долговых ценных бумаг Российской Федерации и долговых ценных бумаг Банка России, с кредитным рейтингом эмитента и (или) кредитным рейтингом выпуска ценных бумаг, и (или) кредитным рейтингом юридического лица, являющегося поручителем по соответствующему выпуску ценных бумаг (для долговых ценных бумаг, выпущенных резидентами), и (или) кредитным рейтингом контрагента – резидента (для денежных средств в рублях и драгоценных металлов), присвоенным как минимум одним из кредитных рейтинговых агентств, не ниже установленного Советом директоров Банка России уровня, и (или) суверенным кредитным рейтингом, объектом которого является иностранное государство или блок стран, использующих иностранную валюту в качестве национальной (для денежных средств в иностранной валюте), и (или) кредитным рейтингом эмитента, и (или) кредитным рейтингом выпуска ценных бумаг, и (или) кредитным рейтингом юридического лица, являющегося поручителем по соответствующему выпуску ценных бумаг (для долговых ценных бумаг, выпущенных нерезидентами), и (или) кредитным рейтингом контрагента – нерезидента (для драгоценных металлов), присвоенным как минимум одним из иностранных кредитных рейтинговых агентств на уровне не ниже «BB–» по классификации иностранных кредитных рейтинговых агентств «Эс-энд-Пи Глобал Рейтингс» («S&P Global

Ratings») или «Фитч Рэйтингс» (Fitch Rating's) либо «Ба3» по классификации иностранного кредитного рейтингового агентства «Мудис Инвесторс Сервис» («Moody's Investors Service»), за исключением случаев приобретения активов, осуществляемых в целях закрытия сделок с участниками клиринга и случаев приобретения активов в рамках деятельности ЦК как стороны всех договоров, обязательства из которых подлежат включению в клиринговый пул, а также осуществления операций купли-продажи иностранной валюты и (или) ценных бумаг, и (или) драгоценных металлов, и (или) иных активов при полном предварительном обеспечении исполнения своих обязательств контрагентом ЦК, ответу на данный вопрос присваивается значение, равное 2 согласно подпункту 3.3.7 настоящей Методики.»;

абзац пятнадцатый изложить в следующей редакции:

«При оценке данного вопроса необходимо учитывать, что при размещении ЦК клирингового обеспечения в долговые ценные бумаги, включенные в котировальный список первого (высшего) уровня хотя бы одной из российских бирж, финансовые инструменты, за исключением государственных долговых ценных бумаг Российской Федерации и долговых ценных бумаг Банка России, с кредитным рейтингом эмитента и (или) кредитным рейтингом выпуска ценных бумаг, и (или) кредитным рейтингом юридического лица, являющегося поручителем по соответствующему выпуску ценных бумаг (для долговых ценных бумаг, выпущенных резидентами), и (или) кредитным рейтингом контрагента – резидента (для денежных средств в рублях и драгоценных металлов), присвоенным как минимум одним из кредитных рейтинговых агентств, не ниже установленного Советом директоров Банка России уровня, и (или) суверенным кредитным рейтингом, объектом которого является иностранное государство или блок стран, использующих иностранную валюту в качестве национальной (для денежных средств в иностранной валюте), и (или) кредитным рейтингом эмитента и (или)

кредитным рейтингом выпуска ценных бумаг, и (или) кредитным рейтингом юридического лица, являющегося поручителем по соответствующему выпуску ценных бумаг (для долговых ценных бумаг, выпущенных нерезидентами), и (или) кредитным рейтингом контрагента – нерезидента (для драгоценных металлов), присвоенным как минимум одним из иностранных кредитных рейтинговых агентств на уровне не ниже «BB–» по классификации иностранных кредитных рейтинговых агентств «Эс-энд-Пи Глобал Рейтингс» («S&P Global Ratings») или «Фитч Рэйтингс» (Fitch Rating's) либо «Ba3» по классификации иностранного кредитного рейтингового агентства «Мудис Инвесторс Сервис» («Moody's Investors Service»), за исключением случаев приобретения активов, которое осуществляется в целях закрытия сделок с участниками клиринга и случаев приобретения активов в рамках деятельности ЦК как стороны всех договоров, обязательства из которых подлежат включению в клиринговый пул, а также осуществления операций с иностранной валютой и (или) ценными бумагами, и (или) драгоценными металлами, и (или) иными активами при полном предварительном обеспечении исполнения своих обязательств контрагентом ЦК, ответу на данный вопрос присваивается значение, равное 2, согласно подпункту 3.3.7 настоящей Методики.».

1.3. В подпункте 3.5.7 пункта 3.5:

строку 1 таблицы 6 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, КСУ, а также долевые ценные бумаги, включенные в список для расчета Индекса ММВБ 50 и Индекса РТС 50?	»;
---	--	----

в абзаце пятом примечаний к заполнению таблицы 6 первое предложение исключить.

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

Председатель
Центрального банка
Российской Федерации



Э.С. Набиуллина

