



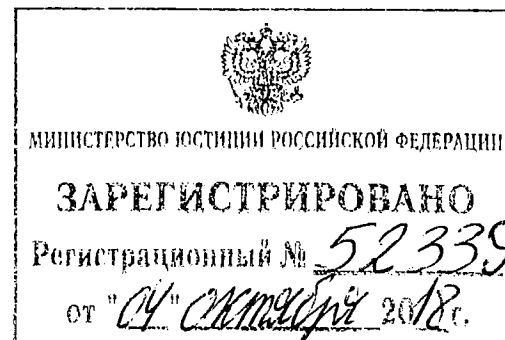
ЦЕНТРАЛЬНЫЙ БАНК РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ  
(БАНК РОССИИ)

« 2 » ИЮЛЯ 2018 г.

№ 643-П

г. Москва

**ПОЛОЖЕНИЕ**



**О требованиях к содержанию, порядку и сроках представления в Банк России плана восстановления финансовой устойчивости центрального контрагента, изменений, вносимых в него, о порядке оценки Банком России плана восстановления финансовой устойчивости центрального контрагента, о требованиях к виду и характеру событий, о наступлении которых центральный контрагент обязан информировать Банк России, а также о порядке информирования Банка России о наступлении в деятельности центрального контрагента событий, предусмотренных планом восстановления финансовой устойчивости центрального контрагента, и принятии решения о начале реализации плана восстановления финансовой устойчивости центрального контрагента**

Настоящее Положение в соответствии с частями 2, 3, 4 статьи 11<sup>1</sup>, статьей 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; № 24, ст. 3399) (далее – Федеральный закон «О клиринге, клиринговой деятельности и центральном контрагенте») устанавливает требования к содержанию, порядок и сроки представления в Банк России плана восстановления финансовой устойчивости центрального контрагента (далее – ПФУ), изменений, вносимых в него, порядок оценки Банком России ПФУ, требования к виду и характеру событий, о наступлении которых центральный контрагент обязан информировать Банк России, а также порядок информирования Банка России о наступлении в деятельности центрального контрагента событий, предусмотренных ПФУ, и принятии решения о начале реализации ПФУ.

## **Глава 1. Требования к содержанию ПФУ**

### **1.1. ПФУ должен содержать:**

мероприятия по восстановлению финансовой устойчивости центрального контрагента и мероприятия по предупреждению ухудшения финансового положения центрального контрагента (далее при совместном упоминании – мероприятия ПФУ), учитывающие возможные риски деятельности центрального контрагента как небанковской кредитной организации, как клиринговой организации и центрального контрагента;

информацию о планируемых источниках финансирования мероприятий ПФУ, включая способы экстренного поддержания ликвидности, определяемых центральным контрагентом исходя из прогнозируемой потребности центрального контрагента в дополнительных источниках собственных средств (капитала), ликвидности, совокупных финансовых ресурсов в рамках реализации предусмотренных ПФУ сценариев;

информацию о договорных обязательствах со связанными с центральным контрагентом лицами (группой связанных с центральным

контрагентом лиц), и (или) участниками клиринга, и (или) третьими лицами по предоставлению центральному контрагенту ликвидных активов в рамках реализации мероприятий по восстановлению финансовой устойчивости центрального контрагента (в случае наличия таких договорных обязательств);

перечень сценариев, которым соответствуют исключительные, но вероятные события, имеющие системный и (или) уникальный для деятельности центрального контрагента характер, наступление которых влечет применение мероприятий ПФУ;

программу (программы), а также порядок проводимого центральным контрагентом не реже одного раза в год тестирования мероприятий ПФУ в рамках каждого из заданных в ПФУ сценариев;

порядок подготовки и представления совету директоров (наблюдательному совету) центрального контрагента для рассмотрения и утверждения отчетов о результатах тестирования мероприятий ПФУ, содержащих описание примененных в рамках тестирования мероприятий ПФУ сценариев, выявленных недостатков ПФУ, а также предложения по их устранению и совершенствованию ПФУ (далее – отчеты о результатах тестирования ПФУ);

порядок принятия решений советом директоров (наблюдательным советом) центрального контрагента о внесении изменений в ПФУ, в том числе по результатам рассмотрения отчетов о результатах тестирования ПФУ;

сведения, предусмотренные приложением к настоящему Положению.

1.2. ПФУ должен содержать мероприятия по восстановлению финансовой устойчивости центрального контрагента, направленные на:

восстановление финансовой устойчивости центрального контрагента и минимизацию возможного негативного влияния ухудшения финансового положения центрального контрагента на непрерывность оказания центральным контрагентом услуг, приостановление или

прекращение оказания которых по оценке центрального контрагента может повлиять на его финансовое положение и (или) финансовое положение участников клиринга и (или) связанных с центральным контрагентом лиц (группы связанных с центральным контрагентом лиц) (далее – значимые услуги);

исключение необходимости привлечения средств бюджетов бюджетной системы Российской Федерации, а также Банка России при реализации ПФУ.

1.3. В случае если правила клиринга центрального контрагента предполагают распределение убытков центрального контрагента, связанных с осуществлением им своих функций, между участниками клиринга, ПФУ должен содержать мероприятия по восстановлению финансовой устойчивости центрального контрагента, предполагающие участие добросовестных участников клиринга (участников клиринга, которые исполнили свои обязательства), с указанием ссылок на соответствующие положения правил клиринга.

1.4. ПФУ должен содержать мероприятия по восстановлению финансовой устойчивости центрального контрагента при возникновении событий, находящихся в зависимости от профиля рисков и инвестиционной стратегии центрального контрагента, которые финансируются исключительно за счет собственных средств центрального контрагента и (или) за счет привлечения средств третьих лиц.

1.5. В отношении каждого из сценариев, предусмотренных абзацем пятым пункта 1.1 настоящего Положения, в ПФУ должны быть предусмотрены:

количественные и качественные показатели, содержащие значения (границы) характеристик деятельности центрального контрагента, достижение которых является основанием для начала осуществления мероприятий по восстановлению финансовой устойчивости центрального

контрагента (далее – показатели необходимости осуществления мероприятий по восстановлению финансовой устойчивости);

показатели, позволяющие прогнозировать потенциальные угрозы для финансовой устойчивости центрального контрагента, достижение которых является основанием для осуществления мероприятий по предупреждению ухудшения финансового положения центрального контрагента (далее – показатели необходимости осуществления мероприятий по предупреждению ухудшения финансового положения).

1.6. Содержание ПФФУ должно поддерживаться центральным контрагентом в актуальном состоянии с учетом:

- изменения финансового положения центрального контрагента;
- изменения перечня значимых услуг центрального контрагента;
- изменения конъюнктуры финансового рынка и (или) экономической ситуации в целом;

наступления значимых событий в деятельности центрального контрагента, способных повлиять на возможность реализации ПФФУ, связанных с изменениями в законодательстве Российской Федерации, влияющими на условия функционирования центрального контрагента, с изменением состава собственников, организационной структуры, с внедрением новых направлений деятельности центрального контрагента, а также с иными событиями, не позволяющими реализовать предусмотренные в ПФФУ мероприятия по восстановлению финансовой устойчивости центрального контрагента.

1.7. Для целей настоящего Положения связанность лица (группы лиц) с центральным контрагентом определяется в соответствии с частями второй – четвертой статьи 64<sup>1</sup> Федерального закона от 10 июля 2002 года № 86-ФЗ «О Центральном банке Российской Федерации (Банке России)» (Собрание законодательства Российской Федерации, 2002, № 28, ст. 2790; 2003, № 2, ст. 157; № 52, ст. 5032; 2004, № 27, ст. 2711; № 31, ст. 3233; 2005, № 25, ст. 2426; № 30, ст. 3101; 2006, № 19, ст. 2061; № 25, ст. 2648;

2007, № 1, ст. 9, ст. 10; № 10, ст. 1151; № 18, ст. 2117; 2008, № 42, ст. 4696, ст. 4699; № 44, ст. 4982; № 52, ст. 6229, ст. 6231; 2009, № 1, ст. 25; № 29, ст. 3629; № 48, ст. 5731; 2010, № 45, ст. 5756; 2011, № 7, ст. 907; № 27, ст. 3873; № 43, ст. 5973; № 48, ст. 6728; 2012, № 50, ст. 6954; № 53, ст. 7591, ст. 7607; 2013, № 11, ст. 1076; № 14, ст. 1649; № 19, ст. 2329; № 27, ст. 3438, ст. 3476, ст. 3477; № 30, ст. 4084; № 49, ст. 6336; № 51, ст. 6695, ст. 6699; № 52, ст. 6975; 2014, № 19, ст. 2311, ст. 2317; № 27, ст. 3634; № 30, ст. 4219; № 40, ст. 5318; № 45, ст. 6154; № 52, ст. 7543; 2015, № 1, ст. 4, ст. 37; № 27, ст. 3958, ст. 4001; № 29, ст. 4348, ст. 4357; № 41, ст. 5639; № 48, ст. 6699; 2016, № 1, ст. 23, ст. 46, ст. 50; № 26, ст. 3891; № 27, ст. 4225, ст. 4273, ст. 4295; 2017, № 1, ст. 46; № 14, ст. 1997; № 18, ст. 2661, ст. 2669; № 27, ст. 3950; № 30, ст. 4456; № 31, ст. 4830; № 50, ст. 7562; 2018, № 1, ст. 66; № 9, ст. 1286; № 11, ст. 1584, ст. 1588; № 18, ст. 2557).

## **Глава 2. Порядок и сроки представления центральным контрагентом в Банк России ПВФУ и вносимых в него изменений**

2.1. ПВФУ представляется центральным контрагентом для оценки в Банк России (Департамент финансовой стабильности Банка России) (далее – уполномоченное структурное подразделение Банка России) в течение 6 месяцев с даты присвоения статуса центрального контрагента и ежегодно не позднее 1 марта.

Изменения в ПВФУ представляются центральным контрагентом для оценки в Банк России в виде новой редакции ПВФУ в течение 5 рабочих дней с даты утверждения изменений.

При наличии в ПВФУ ссылок на иные внутренние документы центрального контрагента к ПВФУ прилагаются копии таких документов, утвержденных уполномоченными органами управления центрального контрагента.

К ПВФУ прилагается аналитическая записка, содержащая:

информацию о последнем проведенном центральным контрагентом на момент представления ПВФУ тестировании мероприятий ПВФУ в рамках каждого из заданных в ПВФУ сценариев;

прогнозную оценку вероятных существенных изменений в деятельности центрального контрагента в период действия ПВФУ, способных повлиять на возможность его реализации.

В случае внесения изменений в ПВФУ в аналитической записке отражается информация о причинах внесения изменений.

2.2. В случае внесения изменений не более чем в 30 процентов текста ПВФУ к нему прилагается перечень изменений в ПВФУ (далее – перечень изменений).

Перечень изменений представляется в виде таблицы, в которой содержатся редакции структурных единиц ПВФУ до и после изменений с указанием номеров измененных (новых) структурных единиц (например, главы, статьи, раздела, пункта, подпункта), а также причин внесения изменений.

2.3. ПВФУ и прилагаемые к нему документы представляются центральным контрагентом в Банк России (уполномоченное структурное подразделение Банка России) через личный кабинет в соответствии с Указанием Банка России от 3 ноября 2017 года № 4600-У «О порядке взаимодействия Банка России с кредитными организациями, некредитными финансовыми организациями и другими участниками информационного обмена при использовании ими информационных ресурсов Банка России, в том числе личного кабинета», зарегистрированным Министерством юстиции Российской Федерации 11 января 2018 года № 49605 (далее – Указание Банка России № 4600-У), в виде файла, имеющего формат, обеспечивающий возможность его сохранения на технических средствах и допускающий после сохранения

возможность поиска и копирования произвольного фрагмента текста средствами для просмотра (doc, docx, rtf, pdf).

2.4. В случае несоблюдения требований к оформлению и (или) комплектности, предусмотренных пунктами 2.1–2.3 настоящего Положения, Банк России (уполномоченное структурное подразделение Банка России) не позднее 5 рабочих дней со дня представления ПФУ в Банк России информирует об этом центрального контрагента через личный кабинет с указанием несоблюденных требований к оформлению и (или) комплектности и (или) перечня недостающих документов.

В случае непредставления центральным контрагентом документов в Банк России в течение 5 рабочих дней со дня информирования центрального контрагента о несоблюдении требований к оформлению и (или) комплектности Банк России (уполномоченное структурное подразделение Банка России) направляет центральному контрагенту через личный кабинет в соответствии с Указанием Банка России № 4600-У предписание об устранении нарушения порядка представления ПФУ, содержащее основания его направления и срок его исполнения.

### **Глава 3. Порядок оценки Банком России ПФУ**

3.1. Банк России осуществляет оценку ПФУ, представленного центральным контрагентом в соответствии с настоящим Положением, в срок, не превышающий 60 календарных дней со дня его представления.

В случае, предусмотренном пунктом 2.4 настоящего Положения, срок, установленный абзацем первым настоящего пункта для проведения Банком России оценки ПФУ, исчисляется со дня представления центральным контрагентом в Банк России документов с соблюдением требований к оформлению и комплектности, предусмотренных пунктами 2.1–2.3 настоящего Положения.

3.2. Оценка Банком России ПФУ осуществляется на основании:



результатов анализа отчетности, представляемой центральным контрагентом в Банк России;

результатов стресс-тестирования рисков центрального контрагента;

результатов тестирования, проводимого по программе, предусмотренной в ПВФУ в соответствии с абзацем шестым пункта 1.1 настоящего Положения;

результатов проверок деятельности центрального контрагента;

результатов оценки планов восстановления финансовой устойчивости крупнейших участников клиринга центрального контрагента, являющихся кредитными организациями, в случае ее проведения структурными подразделениями Банка России, осуществляющими надзор за кредитными организациями.

3.3. В случае отсутствия в Банке России информации, необходимой для оценки ПВФУ, Банк России (уполномоченное структурное подразделение Банка России) запрашивает у центрального контрагента дополнительную информацию, касающуюся ПВФУ, установив срок ее представления.

3.4. Банк России (уполномоченное структурное подразделение Банка России) осуществляет оценку:

соответствия ПВФУ требованиям законодательства Российской Федерации;

достаточности и реализуемости мероприятий ПВФУ.

3.5. В случае если по результатам оценки ПВФУ выявлены несоответствие ПВФУ требованиям законодательства Российской Федерации и (или) недостаточность и нереализуемость мероприятий ПВФУ, Банк России (уполномоченное структурное подразделение Банка России) направляет центральному контрагенту через личный кабинет в соответствии с Указанием Банка России № 4600-У предписание об устранении нарушения требований законодательства Российской Федерации.

Федерации (с указанием перечня выявленных несоответствий и (или) недостатков и срока для доработки ПВФУ).

3.6. В случае если по результатам оценки ПВФУ не выявлены несоответствие ПВФУ требованиям законодательства Российской Федерации и (или) недостаточность и нереализуемость мероприятий ПВФУ, Банк России (уполномоченное структурное подразделение Банка России) направляет ПВФУ на рассмотрение Комитета финансового надзора Банка России.

3.7. В случае принятия Комитетом финансового надзора Банка России решения о принятии к сведению ПВФУ уполномоченное структурное подразделение Банка России в срок, не превышающий 5 рабочих дней со дня принятия Комитетом финансового надзора Банка России указанного решения, направляет центральному контрагенту через личный кабинет в соответствии с Указанием Банка России № 4600-У уведомление, содержащее информацию об указанном решении.

В случае принятия Комитетом финансового надзора Банка России решения о направлении ПВФУ на доработку в связи с выявлением несоответствия ПВФУ требованиям законодательства Российской Федерации и (или) недостаточности и нереализуемости мероприятий ПВФУ уполномоченное структурное подразделение Банка России в срок, не превышающий 5 рабочих дней со дня принятия Комитетом финансового надзора Банка России указанного решения, направляет центральному контрагенту через личный кабинет в соответствии с Указанием Банка России № 4600-У предписание об устранении нарушения требований законодательства Российской Федерации (с указанием перечня выявленных несоответствий и (или) недостатков и срока для доработки ПВФУ).

Центральный контрагент представляет для оценки в Банк России доработанную редакцию ПВФУ в соответствии с требованием Банка России в порядке, установленном главой 2 настоящего Положения.

#### **Глава 4. Порядок информирования Банка России о наступлении в деятельности центрального контрагента событий, предусмотренных ПВФУ, а также о принятии решения о начале реализации ПВФУ**

4.1. Центральный контрагент должен направлять сообщения в Банк России (уполномоченное структурное подразделение Банка России) о наступлении в деятельности центрального контрагента событий, которые влекут применение мероприятий по восстановлению финансовой устойчивости центрального контрагента и принятие решения о начале реализации ПВФУ, не позднее одного рабочего дня, следующего за днем наступления указанных событий (принятия указанного решения).

В сообщениях указываются перечень мероприятий по восстановлению финансовой устойчивости центрального контрагента и сроки их реализации.

4.2. Сообщения, предусмотренные пунктом 4.1 настоящего Положения, направляются центральным контрагентом в уполномоченное структурное подразделение Банка России через личный кабинет в соответствии с Указанием Банка России № 4600-У.

4.3. Центральный контрагент должен осуществлять мероприятия по восстановлению финансовой устойчивости в сроки и объемах, которые предусмотрены ПВФУ.

#### **Глава 5. Заключительные положения**

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

5.2. Настоящее Положение применяется в отношении юридических лиц, которым Банком России на дату вступления в силу настоящего Положения присвоен статус центрального контрагента в соответствии со статьей 27<sup>1</sup> Федерального закона «О клиринге, клиринговой деятельности и центральном контрагенте».

5.3. Центральный контрагент разрабатывает и представляет ПВФУ в соответствии с требованиями настоящего Положения в течение 6 месяцев со дня вступления его в силу.

Председатель  
Центрального банка  
Российской Федерации

Э.С. Набиуллина

Приложение  
к Положению Банка России  
от «2» июля 2018 года №643-П  
«О требованиях к содержанию, порядке  
и сроках представления в Банк России  
плана восстановления финансовой  
устойчивости центрального контрагента,  
изменений, вносимых в него, о порядке  
оценки Банком России плана  
восстановления финансовой  
устойчивости центрального контрагента,  
о требованиях к виду и характеру  
событий, о наступлении которых  
центральный контрагент обязан  
информировать Банк России, а также о  
порядке информирования Банка России  
о наступлении в деятельности  
центрального контрагента событий,  
предусмотренных планом  
восстановления финансовой  
устойчивости центрального контрагента,  
и принятии решения о начале  
реализации плана восстановления  
финансовой устойчивости центрального  
контрагента»

### Сведения, включаемые в ПВФУ

№ п/п	Наименование раздела	Содержание раздела
1	Общие положения	
1.1	Информация о центрального контрагенте	<p>1. Полное фирменное наименование центрального контрагента на русском и на английском (при наличии) языках.</p> <p>2. Сокращенное фирменное наименование (при наличии) центрального контрагента на русском и на английском (при наличии) языках.</p> <p>3. Информация о дате учреждения юридического лица и получения статуса центрального контрагента.</p>

		<p>4. Место нахождения, почтовый адрес центрального контрагента.</p> <p>5. Размер уставного капитала центрального контрагента.</p> <p>6. Сведения об аудиторской организации (аудиторе) центрального контрагента.</p> <p>7. Актуальная контактная информация о лицах, ответственных за подготовку и (или) реализацию ПФУ центрального контрагента, с которыми Банку России следует осуществлять взаимодействие в процессе оценки ПФУ центрального контрагента</p>
1.2	<p>Сведения об организационной структуре, направлениях деятельности, функциях и бизнес-модели центрального контрагента</p>	<p>1. Состав органов управления центрального контрагента и внутренние структурные подразделения центрального контрагента.</p> <p>2. Основные направления деятельности центрального контрагента, в том числе значимые услуги центрального контрагента.</p> <p>3. Описание схемы связей основных направлений деятельности центрального контрагента, относящихся к ним активов и обязательств.</p> <p>4. Особенности финансирования и размещения активов центрального контрагента.</p>

		<p>5. Описание программно-технических средств и сетевых коммуникаций центрального контрагента, которые могут быть задействованы центральным контрагентом при реализации ПФУ.</p> <p>6. Информация о связанных с центральным контрагентом лицах (группе связанных с центральным контрагентом лиц).</p> <p>7. Перечень значимых с точки зрения реализации ПФУ услуг, которые предоставляются центральному контрагенту участниками финансового рынка</p>
1.3	Оценка положения центрального контрагента на финансовом рынке	Анализ последствий для финансового рынка Российской Федерации или его отдельных сегментов возможного прекращения деятельности центрального контрагента, его реорганизации или ликвидации отдельных направлений деятельности, не связанных с предоставлением значимых услуг центральным контрагентом
1.4	Описание финансового положения центрального контрагента	Анализ финансового положения центрального контрагента в соответствии с данными финансовой отчетности центрального контрагента, представляемой в Банк России, на ближайшую отчетную дату, предшествующую дате утверждения ПФУ

2	Планирование восстановления финансовой устойчивости центрального контрагента	
2.1	Общие сведения о ПВФУ	<p>1. Информация о целях и задачах ПВФУ.</p> <p>2. Информация о значимых изменениях в деятельности центрального контрагента, способных повлиять на возможность реализации ПВФУ, произошедших с момента последнего утверждения ПВФУ</p>
2.2	Разработка, утверждение и реализация ПВФУ	<p>1. Роль и функции структурных подразделений центрального контрагента, ответственных за подготовку, актуализацию и своевременную реализацию ПВФУ.</p> <p>2. Ссылки на внутренние документы центрального контрагента, содержащие описание возможных мероприятий по поддержанию функционирования структурных подразделений центрального контрагента при возникновении нестандартных и чрезвычайных ситуаций (при наличии).</p> <p>3. Ссылки на внутренние документы центрального контрагента, содержащие описание взаимодействия структурных подразделений центрального контрагента при управлении рисками в рамках оказания значимых услуг (при наличии).</p>



		<p>4. Описание интеграции ПВФУ в существующую систему управления рисками центрального контрагента.</p> <p>5. Описание мероприятий, предусматривающих взаимодействие между центральным контрагентом и связанными с центральным контрагентом лицами (группой связанных с центральным контрагентом лиц), и (или) участниками клиринга, являющимися кредитными организациями, в рамках разработанных ими планов восстановления финансовой устойчивости, и (или) третьими лицами (при наличии), направленных на координацию работы и обеспечение последовательной и своевременной реализации мероприятий ПВФУ, включая информацию об имеющихся договорных обязательствах указанных лиц по предоставлению центральному контрагенту ликвидных активов в рамках реализации предусмотренных ПВФУ сценариев.</p> <p>6. Описание процедуры принятия решения о начале реализации ПВФУ (с указанием ответственных лиц), включая порядок выбора оптимальных мероприятий ПВФУ.</p> <p>7. Внутренний порядок информирования Банка России о</p>
--	--	--

		<p>наступлении в деятельности центрального контрагента событий, которые влекут применение мероприятий по восстановлению финансовой устойчивости центрального контрагента и принятие решения о начале реализации ПФФУ.</p> <p>8. Инструменты мониторинга эффективности реализации ПФФУ и порядок информирования органов управления центрального контрагента о результатах такого мониторинга</p>
3	<p>Показатели необходимости осуществления мероприятий по восстановлению финансовой устойчивости и показатели необходимости осуществления мероприятий по предупреждению ухудшения финансового положения</p>	<p>1. Детальное описание показателей необходимости осуществления мероприятий по восстановлению финансовой устойчивости, таких как:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>показатели капитала;</li> <li>показатели ликвидности;</li> <li>показатели прибыльности;</li> <li>показатели качества клирингового обеспечения;</li> <li>показатели достаточности ставок индивидуального клирингового обеспечения;</li> <li>показатели концентрации отдельных видов активов в коллективном клиринговом обеспечении;</li> <li>доля высококачественных инвестиционных активов;</li> <li>показатели стресс-тестирования рисков;</li> </ul>

		<p>показатели финансового рынка; макроэкономические показатели.</p> <p>2. Определение значений или границ значений или иных характеристик (для качественных показателей) показателей, свидетельствующих о переходе к сценарию, предусматривающему применение мероприятий по восстановлению финансовой устойчивости центрального контрагента.</p> <p>3. Детальное описание разработанных по каждому из приведенных показателей необходимости осуществления мероприятий по восстановлению финансовой устойчивости показателей необходимости осуществления мероприятий по предупреждению ухудшения финансового положения.</p> <p>4. Определение значений или границ значений или иных характеристик (для качественных показателей) показателей, достижение которых является основанием для применения мероприятий по предупреждению ухудшения финансового положения центрального контрагента</p>
4	Сценарии для выбора мероприятий по восстановлению финансовой устойчивости центрального контрагента	
4.1	Определение сценариев	1. Определение и описание исключительных, но вероятных событий,

		<p>имеющих системный и (или) уникальный для деятельности центрального контрагента характер, с указанием конкретных показателей необходимости осуществления мероприятий по предупреждению ухудшения финансового положения и показателей необходимости осуществления мероприятий по восстановлению финансовой устойчивости.</p> <p>2. Определение и описание перечня основных сценариев, связанных с дефолтом участника клиринга, и специфических сценариев по отдельным событиям, не связанным с дефолтом участника клиринга.</p> <p>3. Разрабатываемые центральным контрагентом специальные сценарии, предназначенные для урегулирования уникальных событий, предусматривающие обязательное формирование группы антикризисного управления (руководители ключевых структурных подразделений центрального контрагента), специальные мероприятия по восстановлению финансовой устойчивости центрального контрагента, взаимодействие с Банком России</p>
--	--	--

4.2	Оценка результатов сценариев	<p>Оценка потенциального влияния реализации предусмотренных в ПФУ сценариев на:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>величину собственных средств центрального контрагента;</li> <li>уровень ликвидности центрального контрагента;</li> <li>уровень рисков, присущих деятельности центрального контрагента;</li> <li>рентабельность (доходность) центрального контрагента;</li> <li>основные направления деятельности центрального контрагента;</li> <li>деловую репутацию центрального контрагента;</li> <li>иные показатели центрального контрагента</li> </ul>
5	Мероприятия по восстановлению финансовой устойчивости центрального контрагента	
5.1	Описание мероприятий по восстановлению финансовой устойчивости центрального контрагента	<p>1. Определение и описание мероприятий по восстановлению финансовой устойчивости центрального контрагента в отношении каждого из предусмотренных в ПФУ сценариев с указанием сроков реализации указанных мероприятий, оценкой прогнозируемых результатов их применения.</p> <p>2. Группы инструментов восстановления финансовой устойчивости,</p>

		<p>не связанных с принудительным распределением убытков центрального контрагента между добросовестными участниками клиринга (участниками клиринга, которые исполнили свои обязательства), а также с использованием средств добросовестных участников клиринга, полученных путем выставления первоначального маржинального требования:</p> <p>инструменты распределения потерь, обусловленных дефолтом участника клиринга;</p> <p>инструменты покрытия дефицита ликвидности (в том числе краткосрочного дефицита финансовых ресурсов);</p> <p>инструменты восполнения собственных средств, в том числе выделенного капитала;</p> <p>инструменты восстановления сбалансированного по срокам портфеля активов и пассивов после дефолта участника клиринга;</p> <p>инструменты, не связанные с дефолтом участника клиринга.</p> <p>3. Перечень мероприятий по предупреждению ухудшения финансового положения центрального контрагента при срабатывании показателей необходимости осуществления мероприятий по</p>
--	--	---

		предупреждению ухудшения финансового положения в отношении каждого из предусмотренных ПФУ сценариев
5.2	Финансирование реализации ПФУ	<p>1. Определение потребности центрального контрагента в дополнительных источниках собственных средств (капитала), ликвидности, совокупных финансовых ресурсов в рамках различных сценариев в процессе планирования восстановления финансовой устойчивости.</p> <p>2. Чрезвычайные источники финансирования мероприятий по восстановлению финансовой устойчивости: предоставление акционерами, участниками клиринга, связанными с центральным контрагентом лицами (группой связанных с центральным контрагентом лиц) и кредиторами центрального контрагента средств в целях докапитализации и (или) поддержания ликвидности центрального контрагента; активы, ориентировочная оценка их стоимости в случае ликвидации (если таковая предусмотрена ПФУ) отдельных направлений деятельности центрального контрагента, не являющихся основными, а также их потенциальные покупатели при осуществлении мероприятий по</p>

		восстановлению финансовой устойчивости центрального контрагента
5.3	Оценка мероприятий по восстановлению финансовой устойчивости центрального контрагента	Оценка эффективности, своевременности, реализуемости и потенциальных рисков мероприятий по восстановлению финансовой устойчивости центрального контрагента, включая потенциальное влияние на участников клиринга, акционеров и связанных с центральным контрагентом лиц (группу связанных с центральным контрагентом лиц)
6	Дополнительная информация	Дополнительная информация, необходимая для включения в ПВФУ по мнению центрального контрагента