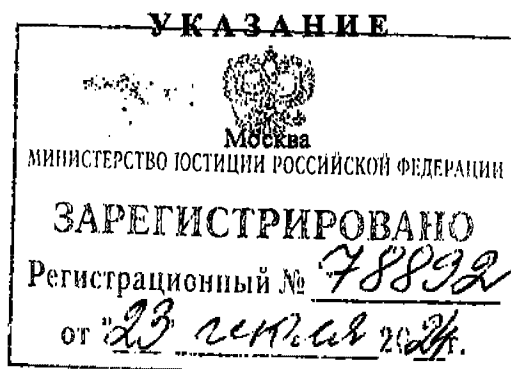




ЦЕНТРАЛЬНЫЙ БАНК РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
(БАНК РОССИИ)

« 17 » июня 2024 г.

№ 6752-У



в Положение Банка России от 1 ноября 2018 года № 658-П

На основании пункта 1¹ статьи 2, пункта 9¹ части 1 статьи 25 Федерального закона от 7 февраля 2011 года № 7-ФЗ «О клиринге, клиринговой деятельности и центральном контрагенте»:

1. Внести в Положение Банка России от 1 ноября 2018 года № 658-П «О требованиях к квалифицированному центральному контрагенту, порядке признания качества управления центрального контрагента удовлетворительным, об основаниях и порядке принятия решения о признании качества управления центрального контрагента неудовлетворительным, порядке доведения информации о принятом решении до центрального контрагента»¹ следующие изменения:

1.1. В пункте 2.5:

абзац второй изложить в следующей редакции:

¹ Зарегистрировано Минюстом России 6 февраля 2019 года, регистрационный № 53703, с изменениями, внесенными Указаниями Банка России от 30 сентября 2019 года № 5271-У (зарегистрировано Минюстом России 6 ноября 2019 года, регистрационный № 56422), от 27 февраля 2020 года № 5405-У (зарегистрировано Минюстом России 31 марта 2020 года, регистрационный № 57917), от 28 сентября 2020 года № 5568-У (зарегистрировано Минюстом России 3 ноября 2020 года, регистрационный № 60731), от 12 января 2021 года № 5706-У (зарегистрировано Минюстом России 18 февраля 2021 года, регистрационный № 62559), от 30 июня 2021 года № 5844-У (зарегистрировано Минюстом России 6 августа 2021 года, регистрационный № 64566), от 19 октября 2022 года № 6294-У (зарегистрировано Минюстом России 9 февраля 2023 года, регистрационный № 72292), от 6 октября 2023 года № 6569-У (зарегистрировано Минюстом России 25 декабря 2023 года, регистрационный № 76594).

«корреспондентские счета, и (или) торговые банковские счета, и (или) клиринговые банковские счета в рублях, и (или) иностранной валюте, и (или) драгоценных металлах – исключительно в Банке России, банках-резидентах, определенных иностранными национальными банками или иностранными регуляторами финансовых рынков в качестве уполномоченных банков для осуществления переводов денежных средств в национальной валюте таких иностранных национальных банков или иностранных регуляторов финансовых рынков, а также в государственной корпорации развития «ВЭБ.РФ», определенной в соответствии с частью 1 статьи 2 Федерального закона от 17 мая 2007 года № 82-ФЗ «О государственной корпорации развития «ВЭБ.РФ» (далее – ВЭБ.РФ), расчетных небанковских кредитных организациях и банках-резидентах, имеющих кредитные рейтинги, присвоенные не менее чем двумя кредитными рейтинговыми агентствами, не ниже уровня, установленного Советом директоров Банка России в соответствии с пунктом 17⁵ части первой статьи 18 Федерального закона от 10 июля 2002 года № 86-ФЗ «О Центральном банке Российской Федерации (Банке России)»;»;

в абзаце третьем слова «в банках-нерезидентах и иностранных юридических лицах, осуществляющих соответствии» заменить словами «в международных финансовых организациях и международных банках развития (далее при совместном упоминании – международные организации), банках-нерезидентах и иностранных юридических лицах, осуществляющих в соответствии».

1.2. В пункте 2.6:

в подпункте 2.6.1:

абзац второй изложить в следующей редакции:

«банках-резидентах и ВЭБ.РФ, имеющих кредитные рейтинги, присвоенные не менее чем двумя кредитными рейтинговыми агентствами, не ниже уровня, установленного Советом директоров Банка России в соответствии с пунктом 17⁵ части первой статьи 18 Федерального закона

от 10 июля 2002 года № 86-ФЗ «О Центральном банке Российской Федерации (Банке России)»;»;

в абзаце четвертом слова «банках-нерезидентах» заменить словами «международных организациях, банках-нерезидентах»;

в подпункте 2.6.2:

абзац первый изложить в следующей редакции:

«2.6.2. в государственные долговые ценные бумаги Российской Федерации и долговые ценные бумаги Банка России, а также в долговые ценные бумаги с кредитными рейтингами эмитента, или выпуска ценных бумаг, или юридического лица, являющегося поручителем (гарантом) по соответствующему выпуску ценных бумаг, присвоенными не менее чем двумя кредитными рейтинговыми агентствами, не ниже уровня, установленного Советом директоров Банка России в соответствии с пунктом 17⁵ части первой статьи 18 Федерального закона от 10 июля 2002 года № 86-ФЗ «О Центральном банке Российской Федерации (Банке России)», или иностранным кредитным рейтинговым агентством на уровне не ниже «BB-» по классификации иностранных кредитных рейтинговых агентств «Эс-энд-Пи Глобал Рейтингс» («S&P Global Ratings»), и (или) «Фитч Рейтингс» («Fitch Ratings»), и (или) «Ва3» по классификации иностранного кредитного рейтингового агентства «Мудис Инвесторс Сервис» («Moody's Investors Service»).»;

абзац третий изложить в следующей редакции:

«В случае одновременного наличия кредитного рейтинга эмитента и (или) кредитного рейтинга юридического лица, являющегося поручителем (гарантом) по соответствующему выпуску ценных бумаг, и кредитного рейтинга выпуска ценных бумаг, присвоенных кредитным рейтинговым агентством или иностранным кредитным рейтинговым агентством, применяется кредитный рейтинг выпуска ценных бумаг, а в случае одновременного наличия кредитного рейтинга эмитента и кредитного

рейтинга юридического лица, являющегося поручителем (гарантом) по соответствующему выпуску ценных бумаг, присвоенных кредитным рейтинговым агентством или иностранным кредитным рейтинговым агентством, применяется наивысший из указанных кредитных рейтингов.»;

подпункт 2.6.3 изложить в следующей редакции:

«2.6.3. в иностранную валюту;».

1.3. В абзаце первом пункта 2.7 слова «в банках-нерезидентах, не удовлетворяющих требованиям, установленным абзацем пятым пункта 2.5» заменить словами «в международных организациях, банках-нерезидентах, не удовлетворяющих требованиям, установленным абзацем третьим пункта 2.5».

1.4. В пункте 2.8:

абзац четвертый изложить в следующей редакции:

«в международных организациях, банках-нерезидентах, имеющих кредитный рейтинг, присвоенный кредитным рейтинговым агентством, не ниже уровня, установленного Советом директоров Банка России в соответствии с пунктом 17⁵ части первой статьи 18 Федерального закона от 10 июля 2002 года № 86-ФЗ «О Центральном банке Российской Федерации (Банке России)», или иностранным кредитным рейтинговым агентством на уровне не ниже «BBB-» по классификации иностранных кредитных рейтинговых агентств «Эс-энд-Пи Глобал Рейтингс» («S&P Global Ratings»), и (или) «Фитч Рейтингс» («Fitch Ratings»), и (или) «Баа3» по классификации иностранного кредитного рейтингового агентства «Мудис Инвесторс Сервис» («Moody's Investors Service»);»;

дополнить абзацем следующего содержания:

«В случае одновременного наличия кредитного рейтинга, присвоенного кредитным рейтинговым агентством, и кредитного рейтинга, присвоенного иностранным кредитным рейтинговым агентством, применяется кредитный рейтинг, присвоенный кредитным рейтинговым

агентством.».

1.5. Пункт 2.11 признать утратившим силу.

1.6. В пункте 2.33 слова «, за исключением участников клиринга с полным предварительным обеспечением исполнения обязательств» исключить.

1.7. Абзац первый пункта 1 приложения 1 изложить в следующей редакции:

«1. Величина коэффициента рыночного риска $PP1$, характеризующего чувствительность собственного портфеля инструментов и открытых позиций, в отношении которых осуществляется расчет рыночного риска в соответствии с Положением Банка России от 3 декабря 2015 года № 511-П «О порядке расчета кредитными организациями величины рыночного риска» (зарегистрировано Минюстом России 28 декабря 2015 года, регистрационный № 40328, с изменениями, внесенными Указаниями Банка России от 15 ноября 2018 года № 4969-У (зарегистрировано Минюстом России 7 марта 2019 года, регистрационный № 53986), от 27 февраля 2020 года № 5404-У (зарегистрировано Минюстом России 31 марта 2020 года, регистрационный № 57915), от 28 февраля 2022 года № 6075-У (зарегистрировано Минюстом России 4 апреля 2022 года, регистрационный № 68056), от 1 февраля 2024 года № 6676-У (зарегистрировано Минюстом России 29 мая 2024 года, регистрационный № 78330) (далее – собственный портфель инструментов и открытых позиций), к рыночному риску, рассчитывается как отношение средних ожидаемых потерь, которые может понести квалифицированный центральный контрагент по собственному портфелю инструментов и открытых позиций при условии, что потери превысят значение стоимостной меры риска (value-at-risk), к величине собственных средств (капитала) квалифицированного центрального контрагента, рассчитанное на горизонте 10 дней с вероятностью 99 процентов по формуле:»;

сноску 3 исключить.

1.8. Абзац четвертый пункта 1 приложения 4 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;».

1.9. В приложении 5:

абзац четвертый пункта 1 изложить в следующей редакции:

«Ак – инвестиционные активы, состоящие из иностранной валюты, размещенной на счетах, которые квалифицированный центральный контрагент должен открывать в соответствии с пунктом 2.5 настоящего Положения, инвестиционных активов с кредитными рейтингами эмитента ценных бумаг, или выпуска ценных бумаг, или юридического лица, являющегося поручителем (гарантом) по соответствующему выпуску ценных бумаг (для долговых ценных бумаг, за исключением государственных долговых ценных бумаг Российской Федерации и долговых ценных бумаг Банка России), присвоенными не менее чем двумя кредитными рейтинговыми агентствами, не ниже уровня, установленного Советом директоров Банка России в соответствии с пунктом 17⁵ части первой статьи 18 Федерального закона от 10 июля 2002 года № 86-ФЗ «О Центральном банке Российской Федерации (Банке России)», или иностранным кредитным рейтинговым агентством на уровне не ниже «BBB-» по классификации иностранных кредитных рейтинговых агентств «Эс-энд-Пи Глобал Рейтингс» («S&P Global Ratings»), и (или) «Фитч Рэйтингс» («Fitch Ratings»), и (или) «Баа3» по классификации иностранного кредитного рейтингового агентства «Мудис Инвесторс Сервис» («Moody's Investors Service»), кредитным рейтингом контрагента (для денежных средств в рублях и драгоценных металлов), присвоенным кредитным

рейтинговым агентством, не ниже уровня, установленного Советом директоров Банка России в соответствии с пунктом 17⁵ части первой статьи 18 Федерального закона от 10 июля 2002 года № 86-ФЗ «О Центральном банке Российской Федерации (Банке России)», или иностранным кредитным рейтинговым агентством на уровне не ниже «BBB-» по классификации иностранных кредитных рейтинговых агентств «Эс-энд-Пи Глобал Рейтингс» («S&P Global Ratings»), и (или) «Фитч Рэйтингс» («Fitch Ratings»), и (или) «Баа3» по классификации иностранного кредитного рейтингового агентства «Мудис Инвесторс Сервис» («Moody's Investors Service»);»;

пункт 2 после слов «а также в» дополнить словами «международных организациях,»;

абзац первый пункта 3 изложить в следующей редакции:

«3. В случае одновременного наличия кредитного рейтинга эмитента и (или) кредитного рейтинга юридического лица, являющегося поручителем (гарантом) по соответствующему выпуску ценных бумаг, и кредитного рейтинга выпуска ценных бумаг, присвоенных кредитным рейтинговым агентством или иностранным кредитным рейтинговым агентством, применяется кредитный рейтинг выпуска ценных бумаг, а в случае одновременного наличия кредитного рейтинга эмитента и кредитного рейтинга юридического лица, являющегося поручителем (гарантом) по соответствующему выпуску ценных бумаг, присвоенных кредитным рейтинговым агентством или иностранным кредитным рейтинговым агентством, применяется наивысший из указанных кредитных рейтингов.».

2. Настоящее Указание подлежит официальному опубликованию и в соответствии с решением Совета директоров Банка России (протокол заседания Совета директоров Банка России от 7 июня 2024 года № ПСД-15) вступает в силу с 1 апреля 2025 года, за исключением положений, для которых настоящим пунктом установлен иной срок вступления их в силу.

Абзацы шестой – десятый подпункта 1.2 и абзацы второй, третий, пятый, шестой подпункта 1.9 пункта 1 настоящего Указания вступают в силу с 1 июля 2026 года.

Председатель
Центрального банка
Российской Федерации

Э.С. Набиуллина