

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

« ____ » _____ 2016 г.

№ _____

г. Москва

ПОЛОЖЕНИЕ

**О порядке осуществления наблюдения
за центральными контрагентами**

Настоящее Положение на основании статей 25, 27.1 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) устанавливает порядок осуществления наблюдения за центральными контрагентами (далее – ЦК), включающего в себя следующие виды деятельности Банка России: мониторинг ЦК, оценка деятельности ЦК и подготовка по результатам оценки деятельности ЦК рекомендаций по изменению деятельности ЦК.

Глава 1. Мониторинг ЦК

1.1. В рамках мониторинга ЦК Банк России осуществляет сбор, анализ информации о деятельности ЦК, включающий проведение стресс-тестирования рисков и оценки точности модели ЦК, и разрабатывает

рекомендации по совершенствованию ЦК своей деятельности и развитию ЦК.

1.2. При проведении мониторинга Банк России использует информацию, полученную в рамках:

отчетности и информации, предоставляемой ЦК в Банк России;

взаимодействия с ЦК посредством запросов Банка России, направляемых в адрес ЦК с указанием сроков их исполнения, рабочих встреч с представителями ЦК, а также иных форм взаимодействия с ЦК;

взаимодействия с федеральными органами исполнительной власти Российской Федерации, центральными банками и иными органами надзора и (или) наблюдения иностранных государств.

1.3. Анализ информации о деятельности ЦК, полученной в рамках мониторинга ЦК, осуществляется Банком России по следующим направлениям:

выявление тенденций в динамике показателей, характеризующих риски ЦК, сформированных Банком России для целей мониторинга ЦК (далее – показатели мониторинга), а также выявление факторов, оказывающих влияние на их изменение;

проведение стресс-тестирования рисков ЦК и оценка точности модели ЦК;

оценка документов ЦК, в том числе характеризующих систему управления рисками ЦК;

оценка планируемых к внедрению новых услуг и (или) иных инноваций в деятельности ЦК;

выявление отечественной практики функционирования ЦК, ее сопоставление с лучшей мировой практикой и международными аналогами.

1.4. Результаты мониторинга могут использоваться Банком России для:

информирования ЦК о результатах проведенного Банком России мониторинга его деятельности в случае выявления признаков возможной реализации рисков ЦК;

разработки и направления ЦК рекомендаций Банка России, направленных на предупреждение реализации рисков ЦК, а также совершенствование деятельности и развитие ЦК;

совершенствования показателей мониторинга, включая определение критических (максимальных и (или) минимальных) значений данных показателей и допустимых интервалов их изменения;

формирования информационно-аналитических материалов Банка России;

формирования предложений по совершенствованию регулирования деятельности ЦК.

1.5. Банк России вправе при необходимости запрашивать у ЦК, в отношении которого были разработаны и направлены рекомендации Банка России по предупреждению реализации рисков ЦК, развитию и совершенствованию деятельности ЦК, о ходе реализации указанных рекомендаций.

Глава 2. Оценка деятельности ЦК и подготовка по ее результатам рекомендаций по изменению деятельности ЦК

2.1. При проведении оценки деятельности ЦК Банк России определяет степень соответствия деятельности ЦК методическим рекомендациям Банка России, в том числе подготовленным на основе международных стандартов деятельности ЦК (далее – оценка на соответствие рекомендациям).

2.2. Банк России уведомляет ЦК о проведении оценки на соответствие рекомендациям.

2.3. При проведении оценки на соответствие рекомендациям Банк России использует информацию, получаемую в рамках мониторинга, посредством взаимодействия с ЦК в формах, аналогичных указанным в пункте 1.2 настоящего Положения, и иных источников.

2.4. По результатам оценки на соответствие рекомендациям Банк России формирует отчет, который в том числе включает в себя результаты оценки и

рекомендации, в случае их наличия, по изменению деятельности ЦК, направленные на совершенствование и развитие его деятельности.

2.5. Банк России направляет в адрес ЦК отчет по результатам оценки на соответствие рекомендациям.

2.6. Банк России может запросить у ЦК информацию о ходе реализации рекомендаций по изменению деятельности ЦК.

Глава 3. Заключительные положения

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

Председатель
Центрального банка
Российской Федерации

Э.С. Набиуллина