

СВЕДЕНИЯ О РЕЗУЛЬТАТАХ СТРЕСС-ТЕСТИРОВАНИЯ ЦЕНТРАЛЬНОГО КОНТРАГЕНТА

по состоянию на «__» _____ г.

Сокращенное наименование кредитной организации _____

Почтовый адрес: _____

Код формы по ОКУД 0409 ____

Месячная

Номер строки	Сведения об участнике клиринга		Нетто-позиция участника клиринга	Переоценка нетто-позиций участника клиринга	Объем использованного индивидуального и иного клирингового обеспечения	Объем использованного коллективного клирингового обеспечения	Объем использованного выделенного капитала центрального контрагента	Объем использованных взносов добросовестных участников клиринга в коллективное клиринговое обеспечение
	Наименование участника клиринга	ИНН (TIN) участника клиринга						
1	2	3	4	5	6	7	8	9

Объем иных средств, при наличии	Потенциальные потери ЦК	Сценарное значение Н1.0 _{ЦК}	Используемый сценарий
10	11	12	13

Порядок составления и представления отчетности по форме 0409____
«Сведения о результатах стресс-тестирования центрального контрагента»

1. Отчетность по форме 0409____ «Сведения о результатах стресс-тестирования центрального контрагента» (далее – Отчет) составляется центральным контрагентом (далее – ЦК), в соответствии с Положением Банка России, устанавливающим требования к методикам стресс-тестирования рисков и оценки точности модели центрального контрагента, а также порядку и срокам предоставления информации о результатах стресс-тестирования и оценки точности модели центрального контрагента и Инструкцией Банка России о банковских операциях небанковских кредитных организаций – центральных контрагентов, обязательных нормативах небанковских кредитных организаций – центральных контрагентов и особенностях осуществления Банком России надзора за их соблюдением (далее – Инструкция об обязательных нормативах), по состоянию на 1-е число месяца, следующего за отчетным, и представляется в территориальное учреждение Банка России не позднее 5-го рабочего дня месяца, следующего за отчетным.

2. В графе 2 Отчета указывается полное наименование юридического лица – участника клиринга, неисполнение обязательств которого моделируется в стресс-сценарии.

3. В графе 3 Отчета указывается идентификационный номер налогоплательщика для юридических лиц-резидентов; «Tax Identification Number» или регистрационный номер в стране регистрации – для юридических лиц-нерезидентов.

4. В графе 4 Отчета указывается совокупная величина нетто-позиций соответствующего участника клиринга.

5. В графе 5 Отчета указывается совокупная величина нетто-позиций участника клиринга с учетом заданного стресс-сценария.

6. В графе 6 Отчета указывается величина использованного индивидуального и иного клирингового обеспечения соответствующего участника клиринга.

7. В графе 7 Отчета указывается величина использованного коллективного клирингового обеспечения соответствующего участника клиринга.

8. В графе 8 Отчета указывается величина использованного выделенного капитала ЦК, определенного ЦК в соответствии с методикой определения выделенного капитала ЦК.

9. В графе 9 Отчета указывается величина использованных средств из взносов в коллективное клиринговое обеспечение добросовестных участников клиринга.

10. В графе 10 Отчета указывается величина иных средств, использование которых предусмотрено правилами клиринга ЦК в случае неисполнения обязательств участником клиринга.

11. В графе 11 Отчета указывается смоделированный по итогам применения стресс-сценария объем потенциальных потерь ЦК за вычетом величин, указанных в графах 6-10 Отчета.

12. В графах 4-11 Отчета значения показателей указываются в рублевом эквиваленте (тыс. руб.).

13. В графе 12 Отчета указывается норматив достаточности собственных средств ЦК Н1.0_{ЦК} по итогам стресс-тестирования, определенный в соответствии с главой 3 Инструкции об обязательных нормативах. Величина указывается в процентах.

14. В графе 13 Отчета указывается используемый сценарий при стресс-тестировании ЦК (наименование сценария).

СВЕДЕНИЯ О КОНТРОЛЬНЫХ ПОКАЗАТЕЛЯХ ЦЕНТРАЛЬНОГО КОНТРАГЕНТА

по состоянию на «__» _____ г.

Сокращенное наименование кредитной организации _____

Почтовый адрес: _____

Код формы по ОКУД 0409 _____

Месячная

Номер строки	Наименование показателя	Значение показателя
1	2	3
1.1	Кредитный риск	
1.2	Рыночный риск	
1.3	Риск ликвидности	
1.4	Операционный риск	
1.5	Кастодиальный риск	
1.6	Правовой риск	
1.7	Общий деловой риск	
1.8	Иные риски	
1.9	Итого	
2.1	КР	
2.2	КР _ф	

Руководитель (Ф.И.О.)

Главный бухгалтер (Ф.И.О.)

М.П.

Исполнитель (Ф.И.О.)

Телефон:

"__" _____ г.

Порядок составления и представления отчетности по форме 0409____

«Сведения о контрольных показателях центрального контрагента»

1. Отчетность по форме 0409____ «Сведения о контрольных показателях центрального контрагента» (далее – Отчет) составляется центральным контрагентом (далее – ЦК), в соответствии с Положением Банка России, устанавливающим требования к методикам стресс-тестирования рисков и оценки точности модели центрального контрагента, а также порядку и срокам предоставления информации о результатах стресс-тестирования и оценки точности модели центрального контрагента (далее – Положение о методике стресс-тестирования) и Положением о требованиях к управлению рисками, правилам организации системы управления рисками и методике определения выделенного капитала центрального контрагента, по состоянию на 1-е число месяца, следующего за отчетным, и представляется в территориальное учреждение Банка России не позднее 5-го рабочего дня месяца, следующего за отчетным.

2. В строках 1.1 – 1.9 Отчета значения показателей указываются в рублевом эквиваленте (тыс. руб.).

3. В строках 2.1 – 2.2 Отчета указываются показатели кредитного риска КР и КРф, определенные в соответствии с Приложением 1 к Положению о методике стресс-тестирования.

4. В строках 2.1 – 2.2 Отчета значения показателей указываются в процентах.

СВЕДЕНИЯ О РЕЗУЛЬТАТАХ ОЦЕНКИ ТОЧНОСТИ МОДЕЛИ ЦЕНТРАЛЬНОГО КОНТРАГЕНТА

по состоянию на «__» _____ г.

Сокращенное наименование кредитной организации _____

Почтовый адрес: _____

Код формы по ОКУД 0409 ____

Квартальная

Наименование модели	Односторонний доверительный интервал	Количество дней калибровки модели	Частота пересмотра параметров модели	Показатель 1	Показатель 2
1	2	3	4	5	6

Руководитель (Ф.И.О.)

Главный бухгалтер (Ф.И.О.)

М.П.

Исполнитель (Ф.И.О.)

Телефон:

"__" _____ г.

Порядок составления и представления отчетности по форме 0409____

«Сведения о результатах оценки точности модели центрального контрагента»

1. Отчетность по форме 0409____ «Сведения о результатах оценки точности модели центрального контрагента» (далее – Отчет) составляется центральным контрагентом (далее – ЦК), в соответствии с Положением Банка России, устанавливающим требования к методикам стресс-тестирования рисков и оценки точности модели центрального контрагента, а также порядку и срокам предоставления информации о результатах стресс-тестирования и оценки точности модели центрального контрагента (далее – Положение о методике стресс-тестирования), по состоянию на 1-е число квартала, следующего за отчетным, и представляется в территориальное учреждение Банка России не позднее 5-го рабочего дня квартала, следующего за отчетным.

2. В графе 1 Отчета указывается наименование модели, которая используется для оценки точности модели ЦК.

3. В графе 2 Отчета указывается размер одностороннего доверительного интервала, используемого в модели ЦК для оценки точности модели ЦК в соответствии с главой 6 Положения о методике стресс-тестирования. Величина указывается в процентах.

4. В графе 3 Отчета указывается количество дней, которые ЦК использовал для калибровки параметров модели в соответствии с пунктом 7.3 Положения о методике стресс-тестирования.

5. В графе 4 Отчета указывается частота, с которой пересматриваются параметры модели, используемой для оценки точности модели ЦК в соответствии с пунктом 2.5 Положения о методике стресс-тестирования. Величина указывается в штуках.

6. В графе 5 Отчета указывается количество случаев в течение последнего квартала, когда прогнозное значение индивидуального клирингового и иного обеспечения любого участника клиринга было ниже фактического. Величина указывается в штуках.

7. В графе 6 Отчета указывается количество случаев в течение последнего квартала, когда прогнозное значение коллективного клирингового обеспечения любого участника клиринга было ниже фактического. Величина указывается в штуках.

СВЕДЕНИЯ ОБ ОБЯЗАТЕЛЬНЫХ НОРМАТИВАХ И О ВЫДЕЛЕННОМ КАПИТАЛЕ
ЦЕНТРАЛЬНОГО КОНТРАГЕНТА

по состоянию на «__» _____ г.

Сокращенное наименование кредитной организации _____

Почтовый адрес: _____

Код формы по ОКУД 0409 _____

Ежедневная

Раздел I. Отдельные показатели деятельности центрального контрагента, используемы для расчета обязательных нормативов, тыс. руб.

СС=

МЛикв=

МДР=

МБР=

ЗН1.0=

ВК=

П=

Ф=

ПМ=

СЛ=

ВЛР=

ПЛ=

$\max_i A_i =$

A=

$\max_i (\text{OpenInterest}_i - \text{Об}_i, 0) =$

$\sum_i^N \max_i (\text{OpenInterest}_i - \text{Об}_i, 0) =$

Раздел II. Значения обязательных нормативов центрального контрагента

Номер строки	Краткое наименование показателя	Фактическое значение, процент
1	2	3
1	Н1цк	
2	Н2цк	
3	Н3цк	
4	Н4цк	
5	Н5цк	
6	Н6цк	

Руководитель (Ф.И.О.)

Главный бухгалтер (Ф.И.О.)

М.П.

Исполнитель (Ф.И.О.)

Телефон:

"__" _____ г.

Порядок составления и представления отчетности по форме 0409___

«Сведения об обязательных нормативах и о выделенном капитале центрального контрагента»

1. Отчетность по форме 0409___ «Сведения об обязательных нормативах и о выделенном капитале центрального контрагента» (далее – Отчет) составляется центральным контрагентом (далее – ЦК), в соответствии с Инструкцией Банка России о банковских операциях небанковских кредитных организаций – центральных контрагентов, обязательных нормативах небанковских кредитных организаций – центральных контрагентов и особенностях осуществления Банком России надзора за их соблюдением (далее – Инструкция об обязательных нормативах), ежедневно и представляется в территориальное учреждение Банка России не позднее 3-го рабочего дня, следующего за отчетным.

2. В разделе I Отчета показатели: величина собственных средств (капитала) ЦК (СС); минимальная величина средств, необходимая для обеспечения прекращения или реструктуризации деятельности ЦК (МЛикв); минимальная величина средств, необходимая для покрытия возможных потерь в результате ухудшения финансового положения ЦК вследствие уменьшения его доходов или увеличения расходов, не связанных с неисполнением обязательств участниками клиринга (МДР); минимальная величина капитала (МБР); величина знаменателя норматива достаточности собственных средств (капитала) Н1.0 (ЗН1.0); минимальная величина выделенного капитала (ВК) определяются в соответствии с главой 3 Инструкции об обязательных нормативах.

Показатели: величина возможных потерь ЦК при неисполнении обязательств двумя крупнейшими по потерям участниками клиринга (П), величина коллективного клирингового обеспечения (Ф) определяются в соответствии с главой 4 Инструкции об обязательных нормативах.

Показатели: количество случаев превышения фактических изменений цен инструментов, по итогам проведения клиринга и (или) торгов на организованных рынках, на которые приходится наибольший объем сделок по данным инструментам, над ставками индивидуального клирингового обеспечения (ПМ); общее количество фактических изменений цен инструментов по итогам проведения клиринга и (или) торгов на организованных рынках, на которые приходится наибольший объем сделок по данным инструментам (СЛ) определяются в соответствии с главой 5 Инструкции об обязательных нормативах.

Показатели: максимальная величина высоколиквидных ресурсов ЦК, использование которой предусмотрено правилами клиринга для покрытия обязательств, возникающих при неисполнении двумя крупнейшими по размеру нетто-обязательств участниками клиринга своих обязательств и не покрытых за счет обеспечения, предоставленного такими участниками клиринга

(ВЛР); совокупная величина нетто-обязательств, возникающих на дату расчета норматива Н4цк, на всех рынках двух крупнейших по величине нетто-обязательств участников клиринга, за исключением сделок при полном предварительном обеспечении (ПЛ) определяются в соответствии с главой 6 Инструкции об обязательных нормативах.

Показатели: максимальная величина актива в обеспечении ЦК по всем I ($\max_i A_i$); совокупная величина обеспечения, принятого ЦК (A); величина числителя ($\max_i(\text{OpenInterest}_i - \text{Об}_i, 0)$) и знаменателя ($\sum_i^N \max_i(\text{OpenInterest}_i - \text{Об}_i, 0)$) норматива Нбцк определяются в соответствии с главой 7 Инструкции об обязательных нормативах.

3. В графе 3 раздела II Отчета указываются значения показателей, определенные в соответствии с Инструкцией об обязательных нормативах.

**СВЕДЕНИЯ ОБ ОЦЕНКЕ НЕПРЕРЫВНОСТИ ДЕЯТЕЛЬНОСТИ ЦЕНТРАЛЬНОГО
КОНТРАГЕНТА**

по состоянию на «__» _____ г.

Сокращенное наименование кредитной организации _____

Почтовый адрес: _____

Код формы по ОКУД 0409 ____

Квартальная

Номер строки	Наименование показателя	Значение показателя
1	2	3
1	Д0	
2	t	
3	e	
4	T _{max}	
5	T _{cp}	

Руководитель (Ф.И.О.)

Главный бухгалтер (Ф.И.О.)

М.П.

Исполнитель (Ф.И.О.)

Телефон:

"__" _____ г.

Порядок составления и представления отчетности по форме 0409___

«Сведения об оценке непрерывности деятельности центрального контрагента»

1. Отчетность по форме 0409___ «Сведения об оценке непрерывности деятельности центрального контрагента» (далее – Отчет) составляется центральным контрагентом, в соответствии с Указанием Банка России, устанавливающим требования к плану обеспечения непрерывности деятельности, к программно-техническим средствам, сетевым коммуникациям, а также порядке создания, ведения и хранения электронных баз данных центрального контрагента, по состоянию на 1-е число квартала, следующего за отчетным, и представляется в территориальное учреждение Банка России не позднее 5-го рабочего дня квартала, следующего за отчетным.

2. Показатели оценки непрерывности деятельности центрального контрагента D_0 и T_{cp} рассчитываются в соответствии с Указанием Банка России о порядке оценки и требованиях к плану обеспечения непрерывности деятельности, к программно-техническим средствам, сетевым коммуникациям, а также порядке создания, ведения и хранения электронных баз данных центрального контрагента.

3. В строке 1 Отчета значения показателя указывается в процентах.

4. В строке 2 Отчета указывается суммарная продолжительность рабочего времени программно-технических средств, предусмотренная в соответствии с временным регламентом его функционирования за последние четыре квартала, рассчитанная в часах.

5. В строке 3 Отчета указывается суммарная продолжительность простоя при нарушениях в работе программно-технических средств за последние четыре квартала, рассчитанная в часах.

6. В строке 5 Отчета значение показателя указывается в часах.