

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

У К А З А Н И Е

«_____» _____ 20__ г.

№ _____

г. Москва

О внесении изменений в Положение Банка России от 30 декабря 2016 года № 575-П «О требованиях к управлению рисками, правилам организации системы управления рисками, клиринговому обеспечению, размещению имущества, формированию активов центрального контрагента, а также к кругу лиц, в которых центральный контрагент имеет право открывать торговые и клиринговые счета, и методике определения выделенного капитала центрального контрагента»

1. В соответствии с частью 2 статьи 6.1, пунктами 11¹ и 12 части 1 статьи 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, «Официальный интернет-портал правовой информации» (www.pravo.gov.ru) 19 июля 2017 года) и в соответствии с решением Совета директоров Банка

России (протокол заседания Совета директоров Банка России от __ _____ 2018 года № ____) внести в Положение Банка России от 30 декабря 2016 года № 575-П «О требованиях к управлению рисками, правилам организации системы управления рисками, клиринговому обеспечению, размещению имущества, формированию активов центрального контрагента, а также к кругу лиц, в которых центральный контрагент имеет право открывать торговые и клиринговые счета, и методике определения выделенного капитала центрального контрагента», зарегистрированное Министерством юстиции Российской Федерации 20 марта 2017 года № 46034, следующие изменения:

1.1. В пункте 1.2 слова «Положением Банка России от 12 марта 2015 года № 463-П «О требованиях, направленных на снижение рисков осуществления клиринговой деятельности, и требованиях к документу (документам), определяющему (определяющим) меры, направленные на снижение кредитных, операционных и иных рисков, в том числе рисков, связанных с совмещением клиринговой деятельности с иными видами деятельности», зарегистрированным Министерством юстиции Российской Федерации 30 апреля 2015 года № 37079» исключить;

1.2. Абзац второй пункта 2.2 после слова «товары» дополнить словами «(за исключением драгоценных металлов)»;

1.3. Главу 5 изложить в следующей редакции:

«Глава 5. Требования к клиринговому обеспечению, размещению имущества, формированию активов центрального контрагента, а также к кругу лиц, в которых центральный контрагент имеет право открывать торговые и клиринговые счета

5.1. Центральный контрагент с учетом положений части 6 статьи 23 Федерального закона «О клиринге, клиринговой деятельности и центральном контрагенте» принимает в качестве индивидуального клирингового обеспечения имущество, удовлетворяющее следующим требованиям:

государственные долговые ценные бумаги Российской Федерации;
государственные долговые ценные бумаги субъектов Российской Федерации;

долговые ценные бумаги Банка России;

долговые ценные бумаги иностранных государств или центральных банков стран, имеющих страновую оценку «0», «1», или стран с высоким уровнем доходов, являющихся членами ОЭСР и (или) Еврозоны;

долговые и (или) долевые ценные бумаги, эмитированные юридическими лицами - резидентами Российской Федерации, финансовое положение которых оценивается как хорошее в соответствии с абзацем вторым пункта 3.3 и с учетом подпункта 3.4.1 пункта 3.4 Положения Банка России от 28 июня 2017 года № 590-П «О порядке формирования кредитными организациями резервов на возможные потери по ссудам, ссудной и приравненной к ней задолженности», зарегистрированного Министерством юстиции Российской Федерации 12 июля 2017 года № 47384 (далее – Положение Банка России № 590-П);

долговые и (или) долевые ценные бумаги, эмитированные юридическими лицами - нерезидентами Российской Федерации, имеющими оценку финансового положения, определенную с учетом абзаца пятого подпункта 3.1.5 пункта 3.1 Положения Банка России № 590-П, и аналогичную оценке финансового положения юридических лиц - резидентов Российской Федерации, предусмотренную абзацем восьмым настоящего пункта;

драгоценные металлы;

банковские гарантии, удовлетворяющие критериям приложения к настоящему Положению, по сделкам, заключаемым на товарных рынках;

товары (за исключением драгоценных металлов), обращающиеся на организованном рынке, допущенные к организованным торгам, по итогам

которых центральным контрагентом осуществляется клиринг обязательств, обеспечиваемых таким индивидуальным клиринговым обеспечением;

клиринговые сертификаты участия, выданные центральным контрагентом и сформированные за счет денежных средств в рублях и (или) иностранной валюте, а также активов, перечисленных в абзацах втором-седьмом настоящего пункта.

Центральный контрагент может принимать в качестве индивидуального клирингового обеспечения, иные ценные бумаги и (или) иные банковские гарантии и (или) иные товары, в случае если имущество, перечисленное в настоящем пункте, полностью обеспечивает исполнение участниками клиринга своих обязательств перед центральным контрагентом.

Финансовое положение эмитента оценивается в соответствии с методикой (методиками), утвержденной (утвержденными) внутренними документами, соответствующими требованиям настоящего Положения.

5.2. Центральный контрагент принимает в качестве коллективного клирингового обеспечения:

денежные средства в рублях и (или) иностранной валюте;
государственные долговые ценные бумаги Российской Федерации;
долговые ценные бумаги Банка России.

5.3. Центральный контрагент размещает от своего имени и за свой счет временно свободные денежные средства в рублях и (или) иностранной валюте, а также драгоценные металлы:

на корреспондентских счетах, открытых в Банке России, расчетных небанковских кредитных организациях и (или) банках-резидентах Российской Федерации, требования к финансовому положению которых определены абзацем шестым пункта 5.1 настоящего Положения;

на открытых для исполнения обязательств иных счетах в банках-нерезидентах Российской Федерации, требования к финансовому положению которых определены абзацем седьмым пункта 5.1 настоящего Положения;

во вклады в банках-резидентах Российской Федерации, требования к финансовому положению которых определены абзацем шестым пункта 5.1 настоящего Положения;

во вклады в банках-нерезидентах Российской Федерации, требования к финансовому положению которых определены абзацем седьмым пункта 5.1 настоящего Положения;

в государственные долговые ценные бумаги Российской Федерации, долговые ценные бумаги Банка России и инструменты, за исключением товаров (кроме драгоценных металлов) и вкладов (депозитов), требования к финансовому положению эмитентов которых и (или) контрагентов по которым определены абзацем шестым пункта 5.1 настоящего Положения.

Центральный контрагент при осуществлении сделок в соответствии с правилами клиринга может размещать временно свободные средства в рублях и (или) иностранной валюте, а также драгоценные металлы, в том числе в инструменты, за исключением товаров и вкладов (депозитов), в случае если клиентом (клиентами) предоставлено имущество, удовлетворяющее требованиям абзацев второго-одиннадцатого пункта 5.1 настоящего положения, полностью обеспечивающее исполнение им (ими) своих обязательств перед центральным контрагентом.

Портфель ценных бумаг центрального контрагента может состоять исключительно из долговых ценных бумаг и должен иметь дюрацию Маколея не более двух лет. При расчете дюрации Маколея портфеля ценных бумаг центрального контрагента не учитываются государственные долговые ценные бумаги Российской Федерации и долговые ценные бумаги Банка России.

5.4. Центральный контрагент размещает ценные бумаги на счетах депо для исполнения обязательств в депозитариях, удовлетворяющих одному из критериев, предусмотренных пунктом 1.2 Указания Банка России от

17 ноября 2011 года № 2732-У «Об особенностях формирования кредитными организациями резерва на возможные потери по операциям с ценными бумагами, права на которые удостоверяются депозитариями», зарегистрированного Министерством юстиции Российской Федерации 12 декабря 2011 года № 22544, 1 августа 2012 года № 25070, 11 декабря 2014 года № 35134, 18 декабря 2015 года № 40170.

5.5. Центральный контрагент имеет право открывать:

торговые банковские счета и (или) клиринговые банковские счета в рублях и (или) иностранной валюте, и (или) драгоценных металлах только в Банке России, расчетных небанковских кредитных организациях и (или) банках-резидентах, требования к финансовому положению которых определены абзацем шестым пункта 5.1 настоящего Положения;

торговые и (или) клиринговые счета депо в депозитариях, требования к которым определены пунктом 5.4 настоящего Положения.

5.6. Требования пункта 5.3 настоящего Положения не распространяются на случаи приобретения активов в целях исполнения центральным контрагентом обязательств перед участниками клиринга.».

1.4. В абзаце девятом пункта 6.1 слова «указанных в абзаце девятом настоящего пункта» заменить словами «указанных в абзаце восьмом настоящего пункта».

1.5. Абзац четвертый приложения изложить в следующей редакции:

«банком - резидентом Российской Федерации, банком - нерезидентом Российской Федерации в пределах 50 процентов от подтвержденной аудиторской проверкой за последний отчетный год величины собственных средств (капитала) гаранта. Требования к финансовому положению указанных банков определены абзацами шестым и седьмым пункта 5.1 настоящего Положения;».

2. Настоящее Указание подлежит официальному опубликованию и вступает в силу с 1 сентября 2018 года.

Председатель
Центрального банка
Российской Федерации

Э.С. Набиуллина