

ЦЕНТРАЛЬНЫЙ БАНК РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
(БАНК РОССИИ)

«__» _____ 201__г.

№ ____-П

г. Москва

П О Л О Ж Е Н И Е

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 11.1, 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) (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 – ПВФУ), изменений вносимых в него, порядок оценки Банком России ПВФУ, требования к виду и характеру событий, предусмотренных ПВФУ, о наступлении которых центральный контрагент обязан информировать Банк России, а также порядок информирования Банка России о наступлении в деятельности центрального контрагента событий, предусмотренных ПВФУ, и принятии решения о начале реализации ПВФУ.

Глава 1. Общие положения

1.1. ПВФУ должен содержать мероприятия по восстановлению финансовой устойчивости центрального контрагента, а также мероприятия по предупреждению ухудшения финансового положения центрального контрагента доступными центральному контрагенту инструментами и методами за счет возможностей, не связанных с привлечением средств бюджетов бюджетной системы Российской Федерации, а также Банка России.

1.2. ПВФУ должен включать мероприятия по восстановлению финансовой устойчивости центрального контрагента и по предупреждению ухудшения финансового положения центрального контрагента, которые учитывают возможные риски его деятельности как небанковской кредитной организации, как клиринговой организации и центрального контрагента.

1.3. Содержание ПВФУ должно соответствовать требованиям, установленным Приложением 1 к настоящему Положению.

ПВФУ должен включать перечень сценариев, которым соответствуют исключительные, но вероятные события, имеющие системный и (или) уникальный характер.

В отношении каждого сценария в ПВФУ 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 – индикаторы) и 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 – сигналы раннего предупреждения). Примерный перечень индикаторов и сигналов раннего предупреждения приведен в Приложении 2 к настоящему Положению.

1.4. ПВФУ должен включать перечень инструментов восстановления финансовой устойчивости, позволяющих минимизировать возможное негативное влияние ухудшения финансового положения центрального контрагента на непрерывность оказания услуг центрального контрагента, приостановление или прекращение оказания которых по оценке центрального контрагента может существенно повлиять на его финансовое положение и (или) финансовое положение участников клиринга и (или) связанных с ним участников финансового рынка (далее – значимые услуги) и позволяющие восстановить финансовую устойчивость центрального контрагента.

1.5. ПВФУ должен содержать:

программу (программы) тестирования мероприятий по восстановлению финансовой устойчивости и мероприятий по предупреждению ухудшения финансового положения центрального контрагента в рамках каждого из заданных в ПВФУ сценариев, проводимого центральным контрагентом не реже 1 раза в год;

порядок тестирования ПВФУ, проводимого по программе (программам) тестирования ПВФУ;

порядок подготовки и представления совету директоров (наблюдательному совету) центрального контрагента для рассмотрения и утверждения отчетов о результатах тестирования ПФФУ, содержащих описание примененных в рамках тестирования ПФФУ сценариев, выявленных недостатков ПФФУ, а также предложения по их устранению и совершенствованию ПФФУ (далее – отчеты о результатах тестирования ПФФУ), в срок не позднее 30 календарных дней с даты окончания проведения тестирования ПФФУ;

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

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

изменения финансового положения центрального контрагента;

изменения перечня значимых услуг центрального контрагента;

изменения ситуации на финансовом рынке 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, изменением состава собственников, организационной структуры, внедрением новых направлений деятельности центрального контрагента, а также наступлением иных событий, не позволяющих реализовать значительную часть ранее запланированных мероприятий по восстановлению финансовой устойчивости.

1.7. ПФФУ должен содержать информацию о планируемых источниках финансирования мероприятий по восстановлению финансовой устойчивости и по предупреждению ухудшения финансового положения

центрального контрагента, определяемых центральным контрагентом исходя из прогнозируемой потребности центрального контрагента в дополнительных источниках собственных средств (капитала), ликвидности, совокупных финансовых ресурсов в рамках реализации предусмотренных ПВФУ сценариев.

При наличии у центрального контрагента договорных обязательств с организациями финансового рынка, с которыми у центрального контрагента установлены операционные и финансовые связи, и (или) участниками клиринга, и (или) третьими лицами по предоставлению центральному контрагенту ликвидных активов в рамках реализации мероприятий по восстановлению финансовой устойчивости центрального контрагента, ПВФУ должен содержать информацию о таких договорных обязательствах и их условиях.

При наличии у центрального контрагента соглашений об оказании центральному контрагенту финансовой поддержки в случае реализации одного из предусмотренных ПВФУ сценариев со стороны юридического лица, под контролем или значительным влиянием которого находится центральный контрагент, лиц, входящих в группу организаций, подконтрольных такому юридическому лицу, иных организаций, входящих в такую группу, ПВФУ должен содержать информацию о таких соглашениях и их условиях.

Для целей настоящего Положения контроль и значительное влияние определяется в соответствии с Международными стандартами финансовой отчетности, признанными на территории Российской Федерации.

1.8. В случае если правила клиринга центрального контрагента предполагают распределение убытков центрального контрагента, связанных с осуществлением центральным контрагентом своих функций, между участниками клиринга, ПВФУ должен содержать мероприятия по восстановлению финансовой устойчивости и по предупреждению ухудшения финансового положения центрального контрагента,

предполагающие участие добросовестных участников клиринга, с указанием ссылок на соответствующие положения правил клиринга.

1.9. ПФУ должен содержать только те мероприятия по восстановлению финансовой устойчивости центрального контрагента при возникновении событий, не связанных с дефолтом участника клиринга, находящихся в прямой 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.

1.10. Обмен информацией между центральным контрагентом и Банком России, предусмотренный главами 2, 3 и 4 настоящего Положения, осуществляется в порядке, предусмотренном 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).

Глава 2. Порядок и сроки представления центральным контрагентом ПФУ в Банк России

2.1. ПФУ представляется центральным контрагентом для оценки в Банк России (Департамент финансовой стабильности Банка России) (далее – уполномоченное структурное подразделение Банка России) в течение шести месяцев с даты присвоения статуса центрального контрагента и ежегодно не позднее 1 марта следующего за отчетным периодом года.

Изменения в ПФУ представляются центральным контрагентом для оценки в Банк России в виде новой редакции ПФУ в течение пяти рабочих дней с даты утверждения соответствующих 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 результаты тестирования мероприятий по восстановлению финансовой устойчивости и мероприятий по предупреждению ухудшения финансового положения центрального контрагента в рамках каждого из заданных в ПВФУ сценариев, проводимых центральным контрагентом с момента последнего утверждения ПВФУ, в случае внесения изменений в ПВФУ в аналитической записке отражается информация о причинах внесения соответствующих изменений.

2.2. В случае внесения изменений не более чем в 30 процентов текста ПВФУ, к ПВФУ прилагается перечень таких 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 (дополненных) структурных единиц (например, главы, статьи, разделы, пункты, подпункты), а также причин внесения изменений.

2.3. ПВФУ и прилагаемые к нему документы, направляются в Банк России (уполномоченное структурное подразделение Банка России) в форме электронного документа путем его размещения в личном кабинете участника информационного обмена с Банком России (далее – личный кабинет) с соблюдением требований, установленных Указанием 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 выявления нарушения центральным контрагентом требований к оформлению и (или) к комплектности документов, установленных пунктами 2.1 – 2.3 настоящего Положения, Банк России (уполномоченное структурное подразделение Банка России) не позднее пяти рабочих дней со дня представления ПФУ в Банк России направляет центральному контрагенту уведомление с указанием выявленных нарушений, и (или) перечня недостающих документов (далее – уведомление). Уведомление направляется в форме электронного документа путем его размещения в личном кабинете в порядке установленном Указанием Банка России № 4600-У.

В случае направления центральному контрагенту уведомления срок, предусмотренный пунктом 3.1 настоящего Положения для проведения Банком России оценки ПФУ, исчисляется со дня представления центральным контрагентом в Банк России документов в соответствии с уведомлением.

В случае непредставления центральным контрагентом документов в Банк России в соответствии с уведомлением в течение пяти рабочих дней со дня его представления центральному контрагенту Банк России (уполномоченное структурное подразделение Банка России) направляет центральному контрагенту предписание о представлении ПФУ в порядке, установленном настоящим Положением, содержащее основания его направления и срок его исполнения, путем его размещения в личном кабинете в порядке, установленном Указанием Банка России № 4600-У.

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.

3.2. Оценка ПВФУ осуществляется с учетом результатов анализа отчетности, представляемой центральным контрагентом в Банк России, результатов стресс-тестирования рисков центрального контрагента, тестирования, проводимого в соответствии с пунктом 1.7 настоящего Положения, результатов проверок деятельности центрального контрагента, а также представляемых по запросу уполномоченного структурного подразделения Банка России результатов оценки планов восстановления финансовой устойчивости крупнейших участников клиринга центрального контрагента, являющихся кредитными организациями, в случае его проведения структурными подразделениями Банка России, осуществляющими надзор за кредитными организациями.

3.3. Банк России (уполномоченное структурное подразделение Банка России) в ходе проведения оценки ПВФУ вправе запросить у центрального контрагента дополнительную информацию, пояснения, касающиеся ПВФУ, установив срок ее представления.

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

соответствия ПВФУ требованиям законодательства Российской Федерации и нормативных актов Банка России;

достаточности и реализуемости заявленных в ПВФУ мероприятий по восстановлению финансовой устойчивости центрального контрагента.

3.5. По результатам оценки ПВФУ Банк России (уполномоченное структурное подразделение Банка России):

в случае выявления несоответствия ПВФУ требованиям законодательства Российской Федерации, нормативных актов Банка России, и (или) недостаточности и нереализуемости заявленных в ПВФУ мероприятий по восстановлению финансовой устойчивости центрального контрагента уполномоченное структурное подразделение Банка России направляет в адрес центрального контрагента требование о приведении центральным контрагентом ПВФУ в соответствие с требованиями

законодательства Российской Федерации и нормативных актов Банка России и (или) об устранении выявленных недостатков (с указанием перечня выявленных несоответствий и (или) недостатков и срока для доработки ПВФУ) путем размещения соответствующего электронного документа в личном кабинете в порядке, установленном Указанием Банка России № 4600-У;

в случае установления соответствия ПВФУ требованиям законодательства Российской Федерации, нормативных актов Банка России, а также достаточности и реализуемости заявленных в ПВФУ мероприятий по восстановлению финансовой устойчивости центрального контрагента уполномоченное структурное подразделение Банка России направляет докладную записку, содержащую заключение о соответствии ПВФУ требованиям законодательства Российской Федерации, нормативных актов Банка России, достаточности и реализуемости заявленных в ПВФУ мероприятий по восстановлению финансовой устойчивости центрального контрагента председателю Комитета финансового надзора Банка России либо лицу, его замещающему, а также предложение о вынесении на рассмотрение Комитета финансового надзора Банка России вопроса о принятии к сведению ПВФУ.

3.6. В случае принятия Комитетом финансового надзора Банка России решения о принятии к сведению ПВФУ уполномоченное структурное подразделение Банка России в срок, не превышающий пяти рабочих дней со дня принятия Комитетом финансового надзора Банка России соответствующего решения, направляет в адрес центрального контрагента уведомление, содержащее информацию об указанном решении, путем его размещения в личном кабинете в порядке установленном Указанием Банка России № 4600-У.

В случае принятия Комитетом финансового надзора Банка России решения о направлении ПВФУ на доработку в связи с выявлением недостаточности и нереализуемости заявленных в ПВФУ мероприятий по

восстановлению финансовой устойчивости центрального контрагента уполномоченное структурное подразделение Банка России в срок, не превышающий пять рабочих дней со дня принятия Комитетом финансового надзора Банка России указанного решения, направляет в адрес центрального контрагента требование об устранении выявленных недостатков (с указанием перечня выявленных недостатков и срока для доработки ПВФУ) путем размещения соответствующего электронного документа в личном кабинете в порядке, установленном Указанием Банка России № 4600-У.

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 направляет сообщения в Банк России (уполномоченное структурное подразделение Банка России) о наступлении в деятельности центрального контрагента событий, предусмотренных ПВФУ в соответствии с частью 1 пункта 4.1 Приложения 1 к настоящему Положению и принятии решения о начале реализации ПВФУ не позднее 1 рабочего дня, следующего за днем наступления соответствующих событий (принятия указанного решения).

В сообщениях указывается перечень мероприятий по восстановлению финансовой устойчивости и сроки их реализации.

4.2. Сообщения, предусмотренные пунктом 4.1 настоящего Положения, направляются в уполномоченное структурное подразделение Банка России в форме электронного документа путем его размещения в

личном кабинете с соблюдением требований, установленных Указанием Банка России № 4600-У.

4.3. Центральный контрагент должен осуществлять мероприятия по восстановлению финансовой устойчивости в сроки и объемах, предусмотренных ПФУ.

Глава 5. Заключительные положения

5.1. Настоящее Положение применяется в отношении юридических лиц, которым Банком России присвоен статус центрального контрагента в соответствии со статьей 27.1 Федерального закона «О клиринге, клиринговой деятельности и центральном контрагенте».

5.2. Центральный контрагент представляет ПФУ, соответствующий требованиям настоящего Положения, в порядке, предусмотренным настоящим Положением, в течение шести месяцев со дня вступления в силу настоящего Положения.

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

Председатель Центрального банка
Российской Федерации

Э.С. Набиуллина

Приложение 1
к Положению Банка России от
«___» _____ 20__ года №___-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»

**Требования к содержанию
ПВФУ центрального контрагента**

№ 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 (при наличии) на английском языках.</p> <p>2. Сокращенное фирменное наименование центрального контрагента (при его наличии) на русском и на английском языках.</p> <p>3. Информация о дате учреждения юридического лица и получении статуса</p>

		<p>центрального контрагента.</p> <p>4. Местонахождение, 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 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 и организационная структура центрального контрагента.</p> <p>2. Основные направления деятельности центрального контрагента, в том числе значимые услуги центрального контрагента, бесперебойное функционирование которых должен обеспечивать ПФУ.</p> <p>3. Ссылки на внутренние документы центрального контрагента, содержащие описание схем операционных и финансовых взаимосвязей и взаимозависимостей основных направлений деятельности центрального контрагента.</p> <p>4. Особенности структуры финансирования и размещения активов центрального контрагента.</p> <p>5. Ссылки на внутренние документы центрального контрагента, содержащие описание информационных и операционных систем центрального</p>

		<p>контрагента, которые могут быть задействованы при реализации ПВФУ, включая каналы информационного обмена с организациями финансового рынка, с которыми у центрального контрагента установлены операционные и финансовые связи.</p> <p>6. Информация о лицах, под контролем или значительным влиянием которых находится центральный контрагент, аффилированных лицах и организациях финансового рынка, с которыми у центрального контрагента установлены операционные и финансовые связи.</p> <p>7. Перечень значимых и иных услуг, которые предоставляются центральному контрагенту участниками финансового рынка.</p>
1.3.	Оценка положения центрального контрагента на финансовом рынке	<p>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 центрального контрагента.</p>
1.4.	Описание финансового положения центрального контрагента	<p>Описание общих показателей финансового положения центрального контрагента и показателей совокупных финансовых ресурсов центрального контрагента в соответствии с данными финансовой отчетности центрального контрагента, представляемой в Банк России, на ближайшую отчетную дату, предшествующую дате утверждения ПВФУ.</p>

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 существенных изменениях в деятельности центрального контрагента, произошедших с момента последнего утверждения ПВФУ.</p> <p>3. Прогнозная оценка вероятных существенных изменений в деятельности центрального контрагента в период действия ПВФУ, способных повлиять на возможности его реализации в кризисной ситуации.</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 в кризисных ситуациях.</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 того, как у центрального контрагента ПВФУ интегрирован в существующую систему управления рисками, в том числе в информационно-управленческую систему и (или) систему управления в кризисных ситуациях.</p>

		<p>5. Описание мероприятий между центральным контрагентом, организациями финансового рынка, с которыми у центрального контрагента установлены операционные и финансовые связи и (или) его крупнейшими участниками клиринга, являющимися кредитными организациями, в рамках разработанных ими Планов устойчивости, направленных на координацию работы и обеспечение последовательной и своевременной реализации мероприятий по восстановлению финансовой устойчивости центрального контрагента, включая информацию о договорных обязательствах (при наличии) организаций финансового рынка, с которыми у центрального контрагента установлены операционные и финансовые связи, и (или) участников клиринга, и (или) третьих лиц по предоставлению центральному контрагенту ликвидных активов в случае возникновения дефицита ликвидности в рамках одного из заданных сценариев.</p> <p>6. Описание процедуры принятия решения о начале реализации ПВФУ (с указанием ответственных лиц), включая порядок выбора оптимальных мероприятий по восстановлению финансовой устойчивости.</p> <p>7. Внутренний порядок информирования Банка России о наступлении в деятельности центрального контрагента событий, предусмотренных Планом устойчивости и принятии решения о начале реализации ПВФУ.</p> <p>8. Инструменты мониторинга эффективности реализации ПВФУ и</p>
--	--	---

		<p>порядок информирования органов управления центрального контрагента о результатах такого мониторинга.</p>
3.	<p>Сигналы раннего предупреждения и индикаторы реализации ПФУ</p>	<p>1. Детальное описание количественных и качественных показателей, направленных на определение момента, события или иного признака, свидетельствующих о реализации того или иного сценария, предусмотренного Планом устойчивости – индикаторы реализации ПФУ, такие как:</p> <ul style="list-style-type: none"> показатели капитала; показатели ликвидности; показатели прибыльности; показатели качества клирингового обеспечения; показатели достаточности ставок индивидуального клирингового обеспечения; показатели концентрации отдельных видов активов в коллективном клиринговом обеспечении; доля высококачественных инвестиционных активов; показатели стресс-тестирования финансовой устойчивости; показатели финансового рынка; макроэкономические показатели. <p>2. Определение значений или границ значений или иных характеристик (для качественных индикаторов), свидетельствующих о переходе к сценарию, предусматривающему применение мероприятий по восстановлению финансовой устойчивости.</p> <p>3. Детальное описание разработанных по каждому из приведенных индикаторов сигналов раннего предупреждения,</p>

		свидетельствующих об угрозе ухудшения финансового положения центрального контрагента и целесообразности применения соответствующих мероприятий по предупреждению ухудшения финансового положения центрального контрагента.
4.	Сценарии для выбора мероприятий по восстановлению финансовой устойчивости центрального контрагента	
4.1.	Определение сценариев	<p>1. Определение и описание значимых для деятельности центрального контрагента событий, имеющих системный и (или) уникальный для деятельности центрального контрагента характер с указанием конкретных сигналов раннего предупреждения и индикаторов.</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, взаимодействие с Банком России.</p>

4.2.	Оценка результатов сценариев	<p>Оценка потенциального влияния реализации заданных сценариев на:</p> <ul style="list-style-type: none"> собственные средства центрального контрагента; уровень ликвидности центрального контрагента; риски, присущие деятельности центрального контрагента; рентабельность (доходность) центрального контрагента; ключевые направления деятельности центрального контрагента; деловую репутацию центрального контрагента; и другие.
5. Мероприятия по восстановлению финансовой устойчивости		
5.1.	Описание мероприятий по восстановлению финансовой устойчивости	<p>1. Определение и описание мероприятий по восстановлению финансовой устойчивости центрального контрагента в отношении каждого из рассматриваемых в рамках ПФУ сценариев с указанием сроков реализации указанных мероприятий, оценкой прогнозируемых результатов от их применения.</p> <p>При разработке мероприятий по восстановлению финансовой устойчивости центрального контрагента должны быть предусмотрены следующие группы инструментов восстановления финансовой устойчивости:</p> <ul style="list-style-type: none"> инструменты распределения потерь, обусловленных дефолтом участника клиринга; инструменты покрытия дефицита ликвидности (в том числе краткосрочного дефицита финансовых ресурсов);

		<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>Не допускается использование в качестве инструмента восстановления финансовой устойчивости принудительное распределение убытков центрального контрагента между добросовестными участниками клиринга, а также использование средств добросовестных участников клиринга, полученных путем выставления первоначального маржинального требования.</p> <p>2. Перечень мероприятий по предупреждению ухудшения финансового положения центрального контрагента при срабатывании сигналов раннего предупреждения, направленных на предупреждение ухудшения финансового положения центрального контрагента, в отношении каждого из предусмотренных ПВФУ сценариев.</p>
5.2.	Финансирование реализации ПВФУ	<p>В процессе планирования восстановления финансовой устойчивости необходимо определить потребность центрального контрагента в дополнительных источниках собственных средств (капитала), ликвидности, совокупных финансовых ресурсов в рамках различных сценариев.</p> <p>С целью определения чрезвычайных источников финансирования мероприятий по восстановлению финансовой</p>

		<p>устойчивости в ПФУ необходимо предусмотреть следующее:</p> <p>случаи предоставления акционерами, участниками клиринга, организациями финансового рынка, с которыми у центрального контрагента установлены операционные и финансовые связи и кредиторами центрального контрагента средств в целях докапитализации и (или) поддержания ликвидности центрального контрагента;</p> <p>информацию об активах, а также ориентировочной оценке их стоимости в случае ликвидации (если таковая предусмотрена ПФУ) отдельных направлений деятельности центрального контрагента, не являющихся критическими, а также их потенциальных покупателей при осуществлении мероприятий по восстановлению его финансовой устойчивости.</p>
5.3.	Оценка мероприятий восстановления финансовой устойчивости	<p>Оценка эффективности, своевременности, реализуемости и потенциальных рисков мероприятий по восстановлению финансовой устойчивости, включая потенциальное влияние на участников клиринга, акционеров и организации финансового рынка, с которыми у центрального контрагента установлены операционные и финансовые связи.</p>
6.	Дополнительная информация	<p>Дополнительная информация, необходимая для включения в ПФУ, по мнению центрального контрагента</p>

Приложение 2
к Положению Банка России от
«__» _____ 20__ года №__-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»

**Примерный перечень сигналов раннего предупреждения и
индикаторов реализации различных вариантов мероприятий ПВФУ**

1. Ухудшение финансового положения крупнейших участников клиринга или группы участников клиринга.
2. Снижение кредитного качества или ликвидности ценных бумаг, предоставленных участниками клиринга центрального контрагента в качестве клирингового обеспечения.
3. Рост концентрации отдельного вида активов, предоставленного участниками клиринга центрального контрагента в качестве клирингового обеспечения.
4. Снижение доли высококачественных ликвидных активов (денежных средств в валюте Российской Федерации, свободно

конвертируемых валют, государственных ценных бумаг Российской Федерации), в которые осуществлены инвестиции за счет собственных средств (капитала) центрального контрагента, в общей величине инвестиционных активов.

5. Снижение величины выделенного капитала центрального контрагента и сокращения размера коллективного клирингового обеспечения.

6. Снижение размера ликвидности, которую центральный контрагент в состоянии дополнительно привлечь, для исполнения обязательств по сделкам, в случае неисполнения обязательств участниками клиринга перед центральным контрагентом.

7. Размер норматива достаточности собственных средств (капитала) центрального контрагента (норматив $N1_{\text{ЦК}}$) снижается до уровня, который на десять процентов превышает уровень, определенный нормативным актом Банка России.

8. Снижение размера норматива достаточности совокупных ресурсов центрального контрагента (норматив $N2_{\text{ЦК}}$) до уровня, установленного во внутренних документах центрального контрагента.

9. Увеличение размера норматива достаточности индивидуального клирингового обеспечения центрального контрагента (норматив $N3_{\text{ЦК}}$) до уровня, установленного во внутренних документах центрального контрагента.

10. Снижение значения обязательного норматива ликвидности центрального контрагента (норматив $N4_{\text{ЦК}}$) до уровня, установленного во внутренних документах центрального контрагента.

11. Одновременный рост абсолютных показателей дефицита ликвидности по обязательствам с различными сроками до погашения.

12. Рост показателя соотношения величины понесенных потерь центральным контрагентом в результате реализации операционного риска к сумме собственных средств (капитала) центрального контрагента и

страхового покрытия по заключенным им договорам страхования деятельности.

13. Недостатки операционной деятельности центрального контрагента, выявленные в результате проведения внутреннего и (или) внешнего аудита его операционной деятельности, которые могут привести к снижению финансовой устойчивости и (или) невозможности оказания значимых услуг центрального контрагента.

14. Увеличение количества нарушений работы структурных подразделений центрального контрагента, случаев нарушений сотрудниками центрального контрагента правил и требований, регламентирующих осуществление операций центрального контрагента и (или) суммы расходов (убытков) центрального контрагента вследствие таких нарушений.

15. Увеличение количества нарушений бесперебойной работы программно-технических средств центрального контрагента.

16. Рост количества операций, осуществление которых может потребовать максимальной или приближенной к максимальной нагрузке на программно-технические средства центрального контрагента.

17. Снижение количества клиентов (участников клиринга) центрального контрагента, которое было вызвано не наличием проблем в деятельности самих клиентов (участников клиринга) центрального контрагента, а фактическим ухудшением финансового состояния центрального контрагента или приостановлением обслуживания или прекращением обслуживания по инициативе центрального контрагента, что в дальнейшем могло бы привести к невозможности оказания им значимых услуг.

18. Отключение каналов межбанковского взаимодействия, иных каналов связи вследствие применения ограничительных мер со стороны иностранного государства (иностранных государств).

19. Снижение доли, занимаемой центральным контрагентом на финансовом рынке Российской Федерации.

20. Убыточная деятельность центрального контрагента, наблюдаемая более одного квартала подряд, не вызванная неисполнением обязательств участниками клиринга центрального контрагента.

21. Рост количества случаев обращений (запросов) правоохранительных и (или) судебных органов, а также предписаний Банка России по операциям (сделкам) центрального контрагента.