

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

ПОЛОЖЕНИЕ

« ___ » _____ 20___ г.

№ _____-П

г. Москва

**О требованиях к соглашению об операционном взаимодействии
центральных контрагентов**

Настоящее Положение на основании пункта 9.2 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; 2016, № 1, ст. 23) (далее – Федеральный закон «О клиринге, клиринговой деятельности и центральном контрагенте») устанавливает требования к соглашению об операционном взаимодействии центральных контрагентов (далее – соглашение об операционном взаимодействии).

Глава 1. Общие положения

1.1. Соглашение об операционном взаимодействии заключается центральными контрагентами в целях определения порядка взаимодействия между центральными контрагентами при осуществлении ими своей деятельности по предоставлению клиринговых услуг участникам клиринга центрального контрагента, являющегося стороной соглашения, в том числе по переводу долга и уступке требований участника клиринга, требований, возникших из договоров, заключенных участником клиринга за счет клиента (клиентов) участника клиринга, а также передачи имущества, являющегося предметом обеспечения, другому центральному контрагенту, являющимся

одной из сторон данного соглашения (далее – перевод долга и уступка требований).

1.2. Центральный контрагент должен обеспечить выявление и оценку рисков, которые могут возникнуть вследствие заключения соглашения об операционном взаимодействии и привести к потере финансовой устойчивости центрального контрагента и (или) к нарушению непрерывности деятельности центрального контрагента.

1.3. Центральный контрагент обязан информировать участников клиринга о намерении заключить соглашение об операционном взаимодействии и о потенциальных рисках, которые могут возникнуть при его применении.

1.4. В рамках управления рисками, возникающими в результате заключения соглашения об операционном взаимодействии, центральный контрагент должен руководствоваться законодательством Российской Федерации, Положением 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», зарегистрированным Министерством юстиции Российской Федерации 20 марта 2017 года № 46034, 5 июня 2018 года № 51286.

Глава 2. Требования к соглашению об операционном взаимодействии

2. Соглашение об операционном взаимодействии должно содержать:

2.1. Информацию о центральных контрагентах, заключивших соглашение об операционном взаимодействии, включая следующие сведения:

полное фирменное наименование центральных контрагентов на русском и английском (при наличии) языках;

сокращенное фирменное наименование (при наличии) центральных контрагентов на русском и английском (при наличии) языках;

информация о дате учреждения юридического лица и получения статуса центрального контрагента;

место нахождения, почтовый адрес центральных контрагентов;

актуальная контактная информация о лицах, ответственных за подготовку и (или) реализацию соглашения об операционном взаимодействии.

2.2. Перечень финансовых инструментов для целей реализации положений соглашения об операционном взаимодействии.

2.3. Условия сделок, заключаемых центральными контрагентами для целей реализации соглашения об операционном взаимодействии, в том числе порядок установления лимитов по позициям участников клиринга, сроки исполнения сделок, ограничение суммы сделок.

2.4. Ссылки на внутренние документы центрального контрагента, содержащие перечень и описание мероприятий, направленных на выявление, мониторинг, оценку и управление рисками, которые могут реализоваться в результате заключенного соглашения об операционном взаимодействии, для своевременного выполнения центральными контрагентами обязательств перед участниками клиринга.

2.5. Перечень финансовых ресурсов, используемых центральными контрагентами для управления рисками, возникающими при реализации соглашения об операционном взаимодействии, а также порядок их использования.

2.6. Определение и описание инструментов по управлению рисками при осуществлении перевода долга и уступки требований, дефолте участника клиринга или центрального контрагента, являющегося стороной соглашения об операционном взаимодействии, а также условия и порядок их использования.

2.7. Порядок и сроки раскрытия центральными контрагентами друг другу данных о сделках, заключенных в рамках соглашения об операционном

взаимодействии, или условия обеспечения доступа к данным по таким сделкам на постоянной основе.

2.8. Требования к участникам клиринга, не являющимся участниками клиринга центрального контрагента, которому переводится долг и уступаются требования, или указание на то, что к участникам клиринга, по сделкам которых осуществляется перевод долга и уступаются требования, не применяются требования, установленные к участникам клиринга правилами клиринга центральных контрагентов.

2.9. Информация об используемых независимых поставщиках телекоммуникационных услуг для основного комплекса программно-технических средств.

2.10. Порядок принятия решений советом директоров (наблюдательным советом) центральных контрагентов о внесении изменений в действующее соглашение об операционном взаимодействии.

2.11. Условия по переводу долга и уступке требований.

2.12. Порядок согласования с Банком России перевода долга и уступки требований в соответствии с частью 4.1 статьи 22 Федерального закона «О клиринге, клиринговой деятельности и центральном контрагенте».

2.13. Порядок информирования участников клиринга центральных контрагентов о рисках, возникающих при распределении непокрытых убытков и дефиците непокрытой ликвидности в рамках реализации соглашения об операционном взаимодействии.

2.14. Условия, при наступлении которых каждая из сторон соглашения об операционном взаимодействии вправе отказаться от заключения новых сделок и (или) приостановить выполнение своих обязательств по ним.

2.15. Порядок приостановления или прекращения центральными контрагентами выполнения своих обязательств по проведению клиринга по сделкам, которые не соответствуют условиям соглашения об операционном взаимодействии.

2.16. Ограничение ответственности центральных контрагентов при реализации соглашения об операционном соглашении.

2.17. Порядок и сроки уведомления центральными контрагентами друг друга о фактах (событиях, действиях), затрагивающих финансово-хозяйственную деятельность центральных контрагентов, заключении соглашения об операционном взаимодействии с другим центральным контрагентом, невозможности исполнения своих обязательств в рамках соглашения об операционном взаимодействии, внесении изменений в правила клиринга и (или) план восстановления финансовой устойчивости центрального контрагента и (или) план обеспечения непрерывности деятельности центрального контрагента.

2.18. Дополнительная информация и (или) условия, необходимые для включения в соглашение об операционном взаимодействии (состав определяется центральными контрагентами самостоятельно).

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