

Пояснительная записка

к проекту указания Банка России

«О внесении изменений в приложение 1 к Указанию Банка России от 23 декабря 2021 года № 6032-У «О случаях, когда при заключении не на организованных торгах договоров, являющихся производными финансовыми инструментами, одной из сторон по которым не является лицо, осуществляющее функции центрального контрагента, исполнение обязательств, возникающих из таких договоров, должно быть обеспечено, а также требованиях к указанному обеспечению»

Банк России подготовил проект указания «О внесении изменений в приложение 1 к Указанию Банка России от 23 декабря 2021 года № 6032-У «О случаях, когда при заключении не на организованных торгах договоров, являющихся производными финансовыми инструментами, одной из сторон по которым не является лицо, осуществляющее функции центрального контрагента, исполнение обязательств, возникающих из таких договоров, должно быть обеспечено, а также требованиях к указанному обеспечению» (далее – проект указания, Указание Банка России № 6032-У) на основании компетенции, предусмотренной пунктом 1 статьи 51⁴ Федерального закона от 22.04.1996 № 39-ФЗ «О рынке ценных бумаг».

В соответствии с абзацем восьмым пункта 2.1 Указания Банка России № 6032-У предметом обеспечения исполнения обязательств, возникающих из своп-договоров¹, могут выступать в том числе долевыми ценные бумаги, включенные в списки для расчета индексов акций, указанных в приложении 1 к Указанию Банка России № 6032-У. Проект указания

¹ Заключаемые не на организованных торгах своп-договоры, одной из сторон по которым не является лицо, осуществляющее функции центрального контрагента, предусматривающие обязанность стороны или сторон договора периодически и (или) одновременно уплачивать денежные суммы в рублях в зависимости от изменения величины процентных ставок и обязательства из которых должны быть обеспечены в соответствии с требованиями Указания Банка России № 6032-У.

направлен на расширение указанного перечня индексов акций с целью возможного снижения инфраструктурных рисков в условиях санкций недружественных государств и предусматривает его дополнение следующими индексами: SPB100 (Россия), FTSE China 50 Index (Китай), CSI 300 Index (Китай), Shanghai Se Composite (Китай), Shenzhen Composite (Китай), Hang Seng (Гонконг), Hang Seng Composite (Гонконг), Bovespa Index (Бразилия), NIFTY 50 (Индия), FTSE/JSE Top 40 (ЮАР), KASE (Казахстан).

Это предоставит более широкие возможности по обеспечению исполнения обязательств, возникающих из своп-договоров, в соответствии с требованиями Указания Банка России № 6032-У.

Предполагаемый срок вступления в силу проекта указания – по истечении 10 дней после дня его официального опубликования.

Проект указания разработан Департаментом стратегического развития финансового рынка Банка России.

Предложения и замечания по проекту указания, направляемые в рамках публичного обсуждения, принимаются с 18 апреля 2023 года до 2 мая 2023 года.