

ЦЕНТРАЛЬНЫЙ БАНК РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
(БАНК РОССИИ)

«__» _____ 201__ г.

№ ____-П

ПОЛОЖЕНИЕ

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, 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 со статьей 11.1 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) (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 – План устойчивости), изменений вносимых в него, порядок оценки Банком России Плана устойчивости, а также порядок информирования Банка России о наступлении в деятельности центрального контрагента событий, предусмотренных Планом устойчивости, и принятия решения о начале реализации Плана устойчивости.

Глава 1. Общие положения

1.1. План устойчивости разрабатывается центральным контрагентом с целью определения мер по восстановлению его финансовой устойчивости и поддержанию непрерывности оказания значимых услуг, приостановление или прекращение оказания которых может существенно повлиять на финансовое положение центрального контрагента и (или) финансовое положение его участников клиринга, контрагентов и связанных с ними участников финансового рынка (далее – значимые услуги), а также мер по предупреждению и предотвращению ухудшения финансового положения центрального контрагента и нарушения непрерывности оказания значимых услуг доступными центральному контрагенту инструментами и методами за счет возможностей, не связанных с привлечением средств бюджетов бюджетной системы Российской Федерации, а также Банка России.

В случае необходимости внесения изменений в План устойчивости центральный контрагент осуществляет подготовку изменений, вносимых в План устойчивости в форме новой редакции Плана устойчивости.

Информация, содержащаяся в Плате устойчивости, относится к информации ограниченного доступа Банка России.

1.2. Меры по восстановлению финансовой устойчивости и поддержанию непрерывности оказания значимых услуг, предусмотренные Планом устойчивости применяются центральным контрагентом до возникновения в его деятельности оснований для решения о прекращении статуса центрального контрагента, предусмотренных статьей 27.3 Федерального закона «О клиринге, клиринговой деятельности и центральном контрагенте», оснований для осуществления мер по предупреждению банкротства кредитных организаций, предусмотренных статьей 189.10 Федерального закона от 26 октября 2002 года № 127-ФЗ «О несостоятельности (банкротстве)» (Собрание законодательства Российской Федерации, 2004, № 35, ст. 3607; 2005, № 1, ст. 18;

2005, № 1, ст. 46; 2005, № 44, ст. 4471; 2006, № 30, ст. 3292; 2006, № 52, ст. 5497; 2007, № 7, ст. 834; 2007, № 18, ст. 2117; 2007, № 30, ст. 3754; 2007, № 41, ст. 4845; 2007, № 49, ст. 6079; 2008, № 30, ст. 3616; 2008, № 49, ст. 5748; 2009, № 1, ст. 4; 2009, № 1, ст. 14; 2009, № 18, ст. 2153; 2009, № 29, ст. 3632; 2009, № 51, ст. 6160; 2009, № 52, ст. 6450; 2010, № 17, ст. 1988; 2010, № 31, ст. 4188; 2010, № 31, ст. 4196; 2011, № 1, ст. 41; 2011, № 7, ст. 905; 2011, № 19, ст. 2708; 2011, № 27, ст. 3880; 2011, № 29, ст. 4301; 2011, № 30, ст. 4576; 2011, № 48, ст. 6728; 2011, № 49, ст. 7015; 2011, № 49, ст. 7024; 2011, № 49, ст. 7040; 2011, № 49, ст. 7061; 2011, № 49, ст. 7068; 2011, № 50, ст. 7351; 2011, № 50, ст. 7357; 2012, № 31, ст. 4333; 2012, № 53, ст. 7607; 2012, № 53, ст. 7619; 2013, № 23, ст. 2871; 2013, № 26, ст. 3207; 2013, № 27, ст. 3477; 2013, № 27, ст. 3481; 2013, № 30, ст. 4084; 2013, № 51, ст. 6699; 2013, № 52, ст. 6975; 2013, № 52, ст. 6979; 2013, № 52, ст. 6984; 2014, № 11, ст. 1095; 2014, № 11, ст. 1098; 2014, № 30, ст. 4217; 2014, № 49, ст. 6914; 2014, № 52, ст. 7543; 2015, № 1, ст. 10; 2015, № 1, ст. 11; 2015, № 1, ст. 29; 2015, № 1, ст. 35; 2015, № 27, ст. 3945; 2015, № 27, ст. 3958; 2015, № 27, ст. 3967; 2015, № 27, ст. 3977; 2015, № 29, ст. 4350; 2015, № 29, ст. 4355; 2015, № 29, ст. 4362; 2016, № 1, ст. 11; 2016, № 1, ст. 27; 2016, № 1, ст. 29; 2016, № 23, ст. 3296; 2016, № 26, ст. 3891; 2016, № 27, ст. 4225; 2016, № 27, ст. 4237; 2016, № 27, ст. 4293; 2016, № 27, ст. 4305; 2017, № 1, ст. 29; 2017, № 18, ст. 2661; 2017, № 25, ст. 3596; 2017, № 31, ст. 4761; 2017, № 31, ст. 4767; 2017, № 31, ст. 4815) (далее – Федеральный закон «О несостоятельности (банкротстве)»).

1.3. При разработке Плана устойчивости (изменений, вносимых в План устойчивости) центральный контрагент должен применять комплексный подход к оценке взаимосвязанных групп рисков его деятельности как

небанковской кредитной организации, как клиринговой организации и центрального контрагента.

1.4. Требования к содержанию Плана устойчивости приведены в Приложении 1 к настоящему Положению.

Центральный контрагент должен разработать 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 и поддержанию непрерывности оказания значимых услуг, предусмотренных Планом устойчивости (далее – индикаторы) и показатели, позволяющие прогнозировать потенциальные угрозы для финансовой устойчивости центрального контрагента и поддержания непрерывности оказания значимых услуг, достижение которых является основанием для осуществления мероприятий по предупреждению ухудшения финансового положения центрального контрагента и поддержанию непрерывности оказания значимых услуг (далее – сигналы раннего предупреждения), с учетом примерного перечня индикаторов и сигналов раннего предупреждения, указанных в Приложении 2 к настоящему Положению.

План устойчивости должен содержать перечень стресс-сценариев, которым соответствуют исключительные, но вероятные стрессовые события, имеющие системный и (или) уникальный характер, и условия, при наступлении которых осуществляются мероприятия по его реализации, в том числе условия участия акционеров и кредиторов в возмещении потерь и (или) финансовых ресурсов центрального контрагента в случае реализации мероприятий по восстановлению его финансовой устойчивости и поддержанию непрерывности оказания значимых услуг.

1.5. Центральный контрагент должен обеспечить наличие набора инструментов восстановления финансовой устойчивости, отвечающих критериям эффективности, правомерности и прозрачности и позволяющих

минимизировать возможное негативное влияние ухудшения финансового положения центрального контрагента на непрерывность оказания значимых услуг центрального контрагента и (или) финансовое положение его участников клиринга, контрагентов и связанных с ними участников финансового рынка.

1.6. План устойчивости должен являться частью процессов управления и стратегического планирования деятельности центрального контрагента, системы управления рисками центрального контрагента.

План устойчивости подлежит утверждению советом директоров (наблюдательным советом) центрального контрагента и подписанию единоличным исполнительным органом (лицом его замещающим).

1.7. Порядок разработки, утверждения и самостоятельной оценки Плана устойчивости должен быть строго регламентирован внутренними документами центрального контрагента с указанием лиц ответственных за разработку Плана устойчивости, контроль его содержания и актуализацию, своевременность принятия решений по его реализации.

1.8 Содержание Плана устойчивости должно пересматриваться не реже одного раза в год и поддерживаться центральным контрагентом в актуальном состоянии с учетом изменения финансового положения центрального контрагента, перечня значимых услуг центрального контрагента, ситуации на финансовом рынке и (или) экономической ситуации в целом.

При разработке Плана устойчивости центральный контрагент определяет перечень ситуаций, при которых План устойчивости подлежит изменению, связанных со следующими обстоятельствами:

изменения финансово-экономических условий функционирования центрального контрагента;

значимые события в деятельности центрального контрагента, способные повлиять на возможность реализации Плана устойчивости, связанные 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 и поддержанию непрерывности оказания значимых услуг;

недостатки в Плане устойчивости, выявленные по итогам оценки Плана устойчивости Банком России в соответствии с пунктом 3.6 настоящего Положения.

1.9. При разработке Плана устойчивости центральный контрагент должен привлечь заинтересованные стороны (акционеров, крупнейших участников клиринга, связанные инфраструктурные организации финансового рынка и других заинтересованных лиц), которые могут обеспечить возмещение потерь и (или) финансовых ресурсов центрального контрагента в случае реализации Плана устойчивости.

1.10. В случае, если в отношении центрального контрагента осуществляются меры по предупреждению банкротства кредитных организаций в соответствии со статьей 189.9 Федерального закона «О несостоятельности (банкротстве)» на основании плана мер по финансовому оздоровлению кредитной организации, признанного реальным Банком России, то обязанность такого центрального контрагента по разработке и представлению в Банк России Плана устойчивости наступает при завершении осуществления мер по предупреждению банкротства кредитных организаций.

Глава 2. Порядок представления центральным контрагентом Плана устойчивости в Банк России

2.1. План устойчивости ежегодно представляется центральным контрагентом для его оценки в Банк России (Департамент финансовой стабильности Банка России) (далее - уполномоченное структурное

подразделение) не позднее 1 марта, учитывая плановые показатели развития бизнеса, текущую и плановую структуру рисков, плановые показатели финансового результата на текущий год.

План устойчивости вновь создаваемого путем учреждения центрального контрагента представляется центральным контрагентом для его оценки в уполномоченное структурное подразделение в течение трех месяцев с даты такого учреждения.

При наличии в Плане устойчивости ссылок на иные внутренние документы центрального контрагента, к Плану устойчивости прилагаются копии таких документов, утвержденные уполномоченными органами центрального контрагента.

В случае представления для оценки Плана устойчивости, содержащего изменения в положения последнего оцененного Плана устойчивости, к Плану устойчивости прилагается также полный перечень таких изменений в План устойчивости (далее - перечень изменений), представленный в табличном виде, с указанием номера структурной единицы (например, главы, статьи, раздела, пункта, подпункта) последнего оцененного Плана устойчивости, в который вносятся изменения (номера добавленной структурной единицы - в случае дополнения Плана устойчивости новой структурной единицей), ее действующей редакции (в случае, если вносятся изменения в структурную единицу последнего оцененного Плана устойчивости), новой редакции соответствующей структурной единицы (редакции новой структурной единицы - в случае дополнения Плана устойчивости новой структурной единицей) и причин внесения изменений.

2.2. План устойчивости вместе с приложениями в предусмотренных пунктом 2.1 настоящего Положения случаях направляется в Банк России в форме электронного документа, подписанного усиленной квалифицированной электронной подписью в соответствии с требованиями Федерального закона от 6 апреля 2011 года № 63-ФЗ «Об электронной подписи» (Собрание законодательства Российской Федерации,

2011, № 15, ст. 2036; № 27, ст. 3880; 2012, № 29, ст. 3988; 2013, № 14, ст. 1668; № 27, ст. 3463, ст. 3477; 2014, № 11, ст. 1098; № 26, ст. 3390; 2016, № 1, ст. 65; № 26, ст. 3889), путем его размещения в личном кабинете участника информационного обмена с Банком России (далее – личный кабинет) с соблюдением требований, установленных Указанием Банка России от 03.11.2017 № 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).

2.3. План устойчивости в форме электронного документа представляется посредством личного кабинета 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).

2.4. План устойчивости должен быть направлен в форме электронного документа в Банк России посредством личного кабинета в течение 5 рабочих дней со дня его утверждения советом директоров (наблюдательным советом) центрального контрагента. Днем получения Плана устойчивости является день его регистрации в Банке России в порядке установленном Указанием Банка России № 4600-У.

2.5. В случае выявления нарушения центральным контрагентом требований к оформлению и (или) к комплектности документов, установленных пунктами 2.1 - 2.3 настоящего Положения, уполномоченное структурное подразделение не позднее 7 календарных дней со дня представления Плана устойчивости (изменений, вносимых в План устойчивости) в Банк России направляет центральному контрагенту уведомление с указанием выявленных нарушений требований к оформлению

документов и (или) к комплектности документов, а также перечня недостающих документов (далее - уведомление о представлении документов). Уведомление о представлении документов направляется в форме электронного документа путем его размещения в личном кабинете.

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

В случае непредставления центральным контрагентом документов в Банк России в соответствии с уведомлением о представлении документов в течение 7 календарных дней со дня его получения, Банк России в срок, предусмотренный пунктом 3.1 настоящего Положения для проведения Банком России оценки Плана устойчивости, в рамках оценки Плана устойчивости принимает решение о его несоответствии требованиям настоящего Положения.

2.6. В случае, если по итогам оценки Банком России Плана устойчивости центральному контрагенту предъявлено требование о приведении содержания Плана устойчивости в соответствие с требованиями федеральных законов и нормативных актов Банка России центральный контрагент в срок, указанный в требовании, направляет доработанный План устойчивости в уполномоченное структурное подразделение.

Глава 3. Порядок оценки Банком России Плана устойчивости, изменений, вносимых в План устойчивости

3.1. Уполномоченное структурное подразделение осуществляет оценку Плана устойчивости центрального контрагента разработанного и представленного им в Банк России в соответствии с настоящим Положением в срок, не превышающий 60 рабочих дней со дня его представления.

3.2. Оценка плана устойчивости центрального контрагента осуществляется в целях определения способности центрального контрагента обеспечить свою финансовую устойчивость и непрерывность оказания значимых услуг в случае развития событий по нескольким стресс-сценариям, включая наиболее критические, и (или) непрерывность оказания значимых услуг в случае ухудшения его финансового состояния и нарушения непрерывности оказания значимых услуг.

3.3. Оценка Планов устойчивости осуществляется с учетом результатов анализа отчетности, представляемой центральным контрагентом в Банк России, результатов стресс-тестирования рисков центрального контрагента, результатов проверок деятельности центрального контрагента и иных документально оформленных сведений, а также результатов анализа Планов устойчивости крупнейших участников клиринга центрального контрагента, являющихся профессиональными участниками рынка ценных бумаг.

3.4. Уполномоченное структурное подразделение в ходе проведения оценки Плана устойчивости вправе запросить у центрального контрагента дополнительную информацию, пояснения касающиеся Плана устойчивости, установив срок ее представления, соблюдая срок оценки Плана устойчивости, указанный в пункте 3.1 настоящего Положения.

3.5. Уполномоченное структурное подразделение на основе мотивированного суждения осуществляет оценку:

соответствия Плана устойчивости требованиям федеральных законов и нормативных актов Банка России;

достаточности и реализуемости заявленных в Плане устойчивости мероприятий для поддержания непрерывности оказания значимых услуг центрального контрагента в случае ухудшения его финансового положения и нарушения непрерывности оказания значимых услуг за счет возможностей, не связанных с привлечением средств государства и Банка России, без угрозы для стабильности финансовой системы Российской Федерации и инфраструктурных организаций финансового рынка.

3.6. По результатам оценки Плана устойчивости уполномоченное структурное подразделение в срок, установленный пунктом 3.1 настоящего Положения:

разрабатывает и направляет в адрес центрального контрагента рекомендации по изменению его деятельности и (или) доработке Плана устойчивости с указанием срока для их реализации и (или) доработки Плана устойчивости в случае выявления в ходе оценки недостатков в Плане устойчивости, которые могут повлиять на возможность своевременного и эффективного применения центральным контрагентом предусмотренных Планом устойчивости мероприятий;

направляет в адрес центрального контрагента требование о приведении центральным контрагентом Плана устойчивости в соответствие требованиям федеральных законов и нормативных актов Банка России в случае выявления несоответствия Плана устойчивости требованиям законодательства Российской Федерации, нормативных актов Банка России с указанием срока для доработки Плана устойчивости;

направляет докладную записку, содержащую мотивированное суждение, а также иную информацию, 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 Плана устойчивости в случае установления соответствия Плана устойчивости требованиям законодательства Российской Федерации, нормативных актов Банка России.

3.7. В случае принятия Комитетом финансового надзора Банка России решения о принятии к сведению Плана устойчивости уполномоченное структурное подразделение в срок, не превышающий пять рабочих дней со дня принятия Комитетом финансового надзора Банка России решения о принятии к сведению Плана устойчивости, письменно информирует об указанном решении центрального контрагента.

В случае принятия Комитетом финансового надзора Банка России решения о направлении Плана устойчивости на доработку уполномоченное структурное подразделение в срок, не превышающий пять рабочих дней со дня принятия Комитетом финансового надзора Банка России указанного решения, направляет в адрес центрального контрагента требование о приведении центральным контрагентом Плана устойчивости в соответствие с требованиями федеральных законов и нормативных актов Банка России с указанием срока для доработки Плана устойчивости.

Глава 4. Порядок информирования Банка России о наступлении в деятельности центрального контрагента событий для начала реализации Плана устойчивости, а также надзора за соблюдением мероприятий по восстановлению финансовой устойчивости

4.1. Сообщение о наступлении в деятельности центрального контрагента событий, предусмотренных Планом устойчивости, принятии решения советом директоров (наблюдательным советом) центрального контрагента о начале реализации Плана устойчивости с перечнем мероприятий по восстановлению финансовой устойчивости и поддержанию непрерывности оказания значимых услуг и сроками их реализации, а также о завершении реализации Плана устойчивости направляется центральным контрагентом в уполномоченное структурное подразделение Банка России не позднее рабочего дня, следующего за днем наступления указанных событий.

4.2. Центральный контрагент еженедельно в первый рабочий день недели, следующей за отчетной, или в срок, определенный в запросе Банка России, направляет информацию о ходе выполнения Плана устойчивости в уполномоченное структурное подразделение Банка России.

Информация должна содержать сведения о текущем финансовом положении центрального контрагента, показателях совокупных финансовых ресурсов центрального контрагента, предназначенных для покрытия возможных потерь по позициям участников клиринга и фактическом

выполнении мероприятий по восстановлению финансовой устойчивости и поддержанию непрерывности оказания значимых услуг в предусмотренные Планом устойчивости сроки с приложением подтверждающих документов.

4.3. Центральный контрагент должен осуществлять мероприятия по восстановлению финансовой устойчивости и поддержанию непрерывности оказания значимых услуг в сроки и объемах, предусмотренных Планом устойчивости, принятым к сведению Банком России.

4.4. В случае несоблюдения центральным контрагентом мероприятий по восстановлению финансовой устойчивости и поддержанию непрерывности оказания значимых услуг в сроки и объемах, предусмотренных Планом устойчивости, принятым к сведению Банком России, уполномоченное структурное подразделение Банка России направляет центральному контрагенту предписание об устранении нарушения.

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. 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__-П
«О требованиях к содержанию,
порядке и сроках представления
в Банк России, порядке оценки
Банком России планов
восстановления финансовой
устойчивости, изменений,
вносимых в планы
восстановления финансовой
устойчивости центральных
контрагентов»

**Требования к содержанию
Плана устойчивости 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 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 создании 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 Плана устойчивости центрального контрагента, с которыми Банку России следует осуществлять взаимодействие в процессе</p>

		оценки Плана устойчивости центрального контрагента.
1.2.	Сведения об организационной структуре, направлениях деятельности, функциях и бизнес-модели центрального контрагента	<p>1. Состав органов управления и организационная структура центрального контрагента.</p> <p>2. Бизнес-модель центрального контрагента и стратегические задачи его деятельности.</p> <p>3. Основные направления деятельности центрального контрагента, в том числе значимые услуги центрального контрагента, бесперебойное функционирование которых должен обеспечивать План устойчивости.</p> <p>4. Описание схемы операционных и финансовых взаимосвязей и взаимозависимостей основных направлений деятельности центрального контрагента.</p> <p>5. Функциональная структура центрального контрагента, обеспечивающая выполнение его бизнес-функций по осуществлению клиринговой деятельности, функций центрального контрагента и управлению рисками.</p> <p>6. Особенности структуры финансирования и размещения активов центрального контрагента.</p> <p>7. Описание информационных и операционных систем центрального контрагента, которые могут быть задействованы при реализации Плана устойчивости, включая каналы информационного обмена со связанными инфраструктурными организациями финансового рынка.</p> <p>8. Информация о лицах, под контролем или значительным влиянием которых находится центральный контрагент, аффилированных лиц и связанных инфраструктурных организациях финансового рынка.</p> <p>9. Перечень значимых и иных услуг, которые предоставляются</p>

		центральному контрагенту внешними участниками финансового рынка.
1.3.	Оценка положения центрального контрагента на финансовом рынке	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.
1.4.	Описание финансового положения центрального контрагента	Описание показателей совокупных финансовых ресурсов по каждому направлению деятельности центрального контрагента в соответствии с данными финансовой отчетности центрального контрагента, представляемой в Банк России, на ближайшую отчетную дату, предшествующую дате утверждения Плана устойчивости.
2.	Планирование восстановления финансовой устойчивости центрального контрагента	
2.1.	Общие сведения о Плане устойчивости	<ol style="list-style-type: none"> 1. Информация о целях и задачах Плана устойчивости. 2. Указание периода, на который разрабатывается План устойчивости. 3. Информация о существенных изменениях в деятельности центрального контрагента, произошедших с момента последнего утверждения Плана устойчивости, включая причины таких изменений. 4. Результаты оценки и тестирования Плана устойчивости в рамках каждого из заданных стресс-сценариев, проводимых центральным контрагентом с момента последнего утверждения Плана устойчивости. 5. Прогнозная оценка вероятных существенных изменений в деятельности центрального контрагента в период действия Плана устойчивости, способных повлиять на возможности его реализации в кризисной ситуации.

2.2.	Разработка, утверждение и реализация Плана устойчивости	<p>1. Роль и функции структурных подразделений центрального контрагента, ответственных за подготовку, актуализацию и своевременную реализацию Плана устойчивости.</p> <p>2. Описание возможных мероприятий по поддержанию функционирования структурных подразделений центрального контрагента в кризисных ситуациях.</p> <p>3. Описание взаимодействия структурных подразделений центрального контрагента при управлении рисками в рамках оказания значимых услуг.</p> <p>4. Описание того, как у центрального контрагента План устойчивости 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, связанными с ним инфраструктурными организациями финансового рынка и его крупнейшими участниками клиринга в рамках разработанных ими Планов устойчивости, направленных на координацию работы и обеспечение последовательного и своевременного применения мер по восстановлению финансовой устойчивости и поддержанию непрерывности оказания значимых услуг, включая информацию о договорных обязательствах связанных инфраструктурных организаций финансового рынка, и (или) участников клиринга, и (или) третьих лиц по предоставлению центральному контрагенту ликвидных активов в случае возникновения дефицита ликвидности в рамках одного из заданных стресс-сценариев.</p> <p>6. Описание процедуры принятия решения о начале реализации Плана устойчивости (с указанием ответственных</p>
------	---	---

		<p>лиц), включая порядок выбора оптимальных стратегии и мероприятий по восстановлению финансовой устойчивости и поддержанию непрерывности оказания значимых услуг.</p> <p>7. Порядок информирования Банка России о наступлении в деятельности центрального контрагента событий, предусмотренных Планом устойчивости и принятии решения о начале реализации Плана устойчивости.</p> <p>8. Описание, предпринятых центральным контрагентом действий, обеспечивающих правовую основу для реализации мер восстановления финансовой устойчивости и поддержания непрерывности оказания значимых услуг.</p> <p>9. Инструменты мониторинга эффективности реализации Плана устойчивости и порядок информирования органов управления центрального контрагента о результатах такого мониторинга с целью предупреждения задержки своевременной реализации мероприятий Плана устойчивости.</p>
3.	Сигналы раннего предупреждения и индикаторы реализации Плана устойчивости	<p>1. Детальное описание количественных и качественных показателей, направленных на определение момента, события или иного признака, свидетельствующих о реализации того или иного стресс-сценария, предусмотренного Планом устойчивости - индикаторы реализации Плана устойчивости:</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

		<p>обеспечении;</p> <ul style="list-style-type: none"> – 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 стресс-сценарию, предусматривающему применение мер по восстановлению финансовой устойчивости и поддержанию непрерывности оказания значимых услуг.</p> <p>3. Прогнозные значения количественных индикаторов.</p> <p>4. Детальное описание разработанных по каждому из приведенных индикаторов сигналов раннего предупреждения, свидетельствующих об ухудшении финансового положения центрального контрагента и целесообразности применения соответствующих превентивных мер.</p>
4.	Стресс-сценарии для формирования стратегии восстановления финансовой устойчивости центрального контрагента	
4.1.	Определение стресс-сценариев	<p>1. Определение и описание значимых для деятельности центрального контрагента стрессовых событий, имеющих системный и (или) уникальный для деятельности центрального контрагента характер с указанием конкретных сигналов раннего предупреждения и индикаторов.</p> <p>При определении значимых стрессовых событий центральный контрагент должен учитывать результаты стресс-тестирования системы управления рисками, проводимого в целях оценки основных рисков, присущих деятельности центрального контрагента.</p> <p>2. Определение и описание перечня основных стресс-сценариев, учитывающих не менее трех стресс-сценариев следующих</p>

		<p>типов:</p> <ul style="list-style-type: none"> – базовый основной сценарий; – сценарий, предусматривающий применение превентивных (мер раннего реагирования) на основании сигналов раннего предупреждения; – сценарий, предусматривающий введение в действие и исполнение процедур восстановления финансовой устойчивости и поддержания непрерывности оказания значимых услуг, в том числе реорганизационных процедур по собственным операциям центрального контрагента. <p>3. Разрабатываемые центральным контрагентом специальные стресс-сценарии, предназначенные для урегулирования уникальных стрессовых событий, предусматривающие осуществление нестандартных процедур управления, обязательное формирование группы антикризисного управления (руководители ключевых структурных подразделений центрального контрагента), специальные меры, взаимодействие с Банком России.</p>
4.2.	Оценка результатов стресс-сценариев	<p>1. Оценка потенциального влияния реализации заданных стресс-сценариев (стресс-тестирование) 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. <p>2. Описание результатов</p>

		<p>обратного стресс-тестирования для определения стресс-сценариев, реализация которых может привести к серьезному ухудшению финансового положения центрального контрагента и нарушению непрерывности оказания значимых услуг.</p> <p>3. Представление скорректированных в соответствии с результатами стресс-тестирования финансовых показателей деятельности центрального контрагента, включая показатели совокупных финансовых ресурсов центрального контрагента.</p> <p>4. Порядок использования результатов стресс-тестирования при принятии управленческих решений, включая стратегическое планирование и планирование размера собственных средств центрального контрагента.</p>
5.	Стратегии восстановления финансовой устойчивости	
5.1.	Описание стратегий восстановления финансовой устойчивости	<p>1. Определение и описание стратегий восстановления финансовой устойчивости и поддержания непрерывности оказания значимых услуг (далее – стратегии восстановления) в отношении каждого из указанных в пункте 4.1 настоящего Положения стресс-сценариев, направленных на восстановление финансового положения и поддержание непрерывности оказания значимых услуг центрального контрагента и восполнение финансовых ресурсов центрального контрагента, предназначенных для покрытия возможных потерь по обязательствам участников клиринга.</p> <p>2. Перечень конкретных действий центрального контрагента при срабатывании сигналов раннего предупреждения, направленных на предупреждение ухудшения финансового положения и нарушения непрерывности оказания значимых услуг центрального</p>

		<p>контрагента, в отношении каждого из указанных в пункте 4.1 настоящего Положения стресс-сценариев.</p> <p>3. Перечень конкретных мероприятий по восстановлению финансовой устойчивости и поддержанию непрерывности оказания значимых услуг центрального контрагента в отношении каждой из выбранных стратегий восстановления с указанием сроков реализации указанных мероприятий оценкой прогнозируемых результатов от их применения.</p> <p>При разработке мероприятий по восстановлению финансовой устойчивости и поддержанию непрерывности оказания значимых услуг центрального контрагента должны быть предусмотрены следующие группы инструментов восстановления финансовой устойчивости и поддержания непрерывности оказания значимых услуг:</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); инструменты восполнения собственных средств, в том числе выделенного капитала; инструменты восстановления сбалансированного по срокам портфеля активов и пассивов после дефолта участника клиринга; инструменты, не связанные с дефолтом участника клиринга. <p>Не допускается использование в качестве инструмента восстановления финансовой устойчивости и поддержания непрерывности оказания значимых услуг принудительное распределение убытков центрального контрагента между добросовестными участниками клиринга, а</p>
--	--	---

		<p>также использование средств добросовестных участников клиринга, полученных путем выставления дополнительного маржинального требования.</p>
5.2.	<p>Финансирование реализации Плана устойчивости</p>	<p>В процессе планирования восстановления финансовой устойчивости и поддержания непрерывности оказания значимых услуг необходимо определить потребность центрального контрагента в дополнительных источниках собственных средств (капитала), ликвидности, совокупных финансовых ресурсов в рамках различных стресс-сценариев, включая наиболее критические.</p> <p>С целью определения чрезвычайных источников финансирования мероприятий по восстановлению финансовой устойчивости и поддержанию непрерывности оказания значимых услуг в Плате устойчивости необходимо предусмотреть следующее:</p> <p>условия предоставления акционерами, участниками клиринга, связанными инфраструктурными организациями и кредиторами центрального контрагента средств в целях докапитализации и (или) поддержания ликвидности центрального контрагента;</p> <p>информацию об активах, структурных подразделениях и частях бизнеса, а также ориентировочной оценке их стоимости в случае ликвидации отдельных направлений деятельности центрального контрагента, не являющихся критическими, а также их потенциальных покупателей при осуществлении мероприятий по восстановлению его финансовой устойчивости и поддержанию непрерывности оказания значимых услуг;</p> <p>описание возможных направлений реорганизации центрального контрагента и ориентировочные оценки его финансового положения после реализации данных</p>

		<p>мероприятий по восстановлению финансовой устойчивости и поддержанию непрерывности оказания значимых услуг.</p> <p>Исходя из прогнозируемой потребности центрального контрагента в дополнительных источниках собственных средств (капитала), ликвидности, совокупных финансовых ресурсов в рамках реализации одного из заданных стресс-сценариев, включая наиболее критические, центральный контрагент должен обеспечить наличие соответствующих договорных обязательств со связанными инфраструктурными организациями, и (или) участниками клиринга, и (или) третьими лицами по предоставлению центральному контрагенту ликвидных активов в рамках реализации процедур восстановления финансовой устойчивости и поддержания непрерывности оказания значимых услуг.</p> <p>Центральный контрагент должен обеспечить наличие соглашений об оказании центральному контрагенту внутригрупповой финансовой поддержки, предполагающих как оказание финансовой поддержки со стороны юридического лица, под контролем или значительным влиянием которого находится центральный контрагент, в отношении такого центрального контрагента, входящего в группу организаций, подконтрольных такому юридическому лицу, в случае реализации стрессовых сценариев, а также между центральным контрагентом и иными организациями, входящими в группу и являющимися сторонами такого соглашения.</p> <p>В случае добровольного участия добросовестных участников клиринга в мероприятиях по восстановлению финансовой устойчивости и поддержанию непрерывности оказания значимых услуг предельный размер такого участия должен</p>
--	--	---

		<p>быть строго регламентирован внутренними документами центрального контрагента для обеспечения прозрачности и предсказуемости мероприятий по восстановлению финансовой устойчивости и поддержанию непрерывности оказания значимых услуг.</p> <p>Убытки, не связанные с дефолтом участника клиринга, находящиеся в прямой зависимости от профиля рисков и инвестиционной стратегии центрального контрагента, должны покрываться исключительно за счет собственных средств центрального контрагента.</p>
5.3.	Оценка стратегий восстановления	<p>Оценка эффективности, своевременности, реализуемости и потенциальных рисков каждого существенного аспекта мероприятий по восстановлению финансовой устойчивости и поддержанию непрерывности оказания значимых услуг, включая потенциальное влияние на участников клиринга, акционеров и связанные инфраструктурные организации финансового рынка.</p>
6.	Дополнительная информация	<p>Дополнительная информация, необходимая для включения в План устойчивости, по мнению центрального контрагента</p>

Приложение 2
к Положению Банка России
от __ 20__-П
«О требованиях к
содержанию, порядку и
сроках представления в Банк
России, порядке оценки
Банком России планов
восстановления финансовой
устойчивости, изменений,
вносимых в планы
восстановления финансовой
устойчивости центральных
контрагентов»

Примеры сигналов раннего предупреждения и индикаторов реализации различных вариантов мероприятий Плана устойчивости и изменений, вносимых в План устойчивости центрального контрагента

1. Сигналы раннего предупреждения и индикаторы реализации различных вариантов мероприятий Плана устойчивости относительно рисков центрального контрагента:

1.1. Ухудшение финансового положения крупнейших участников клиринга или группы участников клиринга.

1.2. Снижение кредитного качества или ликвидности ценных бумаг, предоставленных участниками клиринга центрального контрагента в качестве клирингового обеспечения.

1.3. Рост концентрации отдельного вида активов, предоставленного участниками клиринга центрального контрагента в качестве клирингового обеспечения.

1.4. 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.

1.5. Выявление факта снижения величины выделенного капитала центрального контрагента и сокращения размера коллективного клирингового обеспечения.

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

1.7. Размер норматива достаточности собственных средств (капитала) центрального контрагента приближается к уровню, который на десять процентов превышает уровень, определенный нормативным актом Банка России.

1.8. Снижение размера норматива достаточности совокупных ресурсов центрального контрагента до уровня, установленного во внутренних документах центрального контрагента.

1.9. Увеличение размера норматива достаточности индивидуального клирингового обеспечения центрального контрагента до уровня, установленного во внутренних документах центрального контрагента.

2. Сигналы раннего предупреждения и индикаторы риска ликвидности центрального контрагента:

2.1. Снижение значения обязательного норматива ликвидности центрального контрагента до уровня, установленного во внутренних документах центрального контрагента.

2.2. Невозможность привлечения центральным контрагентом ликвидных активов в срок, не превышающий установленный в правилах клиринга.

2.3. Одновременный рост абсолютных величин коэффициентов дефицита ликвидности с различными сроками до погашения.

3. Сигналы раннего предупреждения и индикаторы операционного риска центрального контрагента:

3.1. 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.

3.2. 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.

3.3. 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.

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

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

4. Индикаторы риска потери деловой репутации центрального контрагента и иные индикаторы:

4.1. Снижение количества клиентов (участников клиринга) центрального контрагента, которое не было вызвано наличием проблем в деятельности самих клиентов (участников клиринга) центрального контрагента, 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.

4.2. Снижение показателя соотношения размера прибыли от операционной деятельности центрального контрагента и размера затрат по операционной деятельности, понесенных центральным контрагентом, не вызванное проводимой центральным контрагентом политикой.

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

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

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

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