

## **ПОЯСНИТЕЛЬНАЯ ЗАПИСКА**

### **к проекту указания Банка России «О внесении изменений в Положение Банка России от 1 ноября 2018 года № 658-П»**

Банк России разработал проект указания «О внесении изменений в Положение Банка России от 1 ноября 2018 года № 658-П» (далее – проект указания).

Подготовка проекта указания осуществляется в целях уточнения процедуры надзорного реагирования при выявлении Банком России фактов несоблюдения квалифицированным центральным контрагентом (далее – КЦК) требований Положения Банка России № 658-П<sup>1</sup>, а также совершенствования требований, установленных Положением № 658-П, в том числе с учетом инициатив КЦК.

Действие проекта указания распространяется на КЦК и Банк России.

Проект указания предусматривает следующие основные изменения:

1. Уточнение процедуры надзорного реагирования.

Действующая редакция Положения № 658-П предусматривает подготовку и направление уполномоченным структурным подразделением Банка России на рассмотрение Комитета финансового надзора Банка России (далее – КФН) мотивированного заключения в случае выявления любого факта невыполнения КЦК требований, установленных данным нормативным актом, в целях дальнейшего принятия КФН решения о сохранении центральному контрагенту статуса «квалифицированный» или его отзыва.

Проектом указания предусматривается, в случае выявления Банком России факта невыполнения КЦК требований Положения Банка России

---

<sup>1</sup> Положение Банка России от 1 ноября 2018 года № 658-П «О требованиях к квалифицированному центральному контрагенту, порядке признания качества управления центрального контрагента удовлетворительным, об основаниях и порядке принятия решения о признании качества управления центрального контрагента неудовлетворительным, порядке доведения информации о принятом решении до центрального контрагента» (далее – Положение Банка России № 658-П).

№ 658-П, который не несет негативного влияния на риск защищенность КЦК и стабильность финансового рынка, направление уполномоченным структурным подразделением Банка России предписания об осуществлении мер, направленных на устранение или недопущение в будущем выявленного невыполнения требований. При этом сохраняется порядок вынесения на КФН вопроса признания качества управления КЦК удовлетворительным (неудовлетворительным) в случаях невыполнения КЦК указанного предписания или наличия угроз реализации системного риска.

2. Совершенствование установленных Положением Банка России № 658-П требований к КЦК:

- расширение перечня организаций, в которых КЦК должен открывать торговые банковские счета, по аналогии с перечнем, установленным для клиринговых банковских счетов;

- исключение разграничения присвоенных национальными и иностранными рейтинговыми агентствами рейтингов по признаку резидентства для размещения КЦК временно свободных денежных средств в долговые ценные бумаги, драгоценные металлы, производные финансовые инструменты или межбанковские кредиты;

- ограничение видов базового (базисного) актива договоров, являющихся производными финансовыми инструментами, в которые КЦК может размещать временно свободные денежные средства и (или) драгоценные металлы;

- изменение периодичности расчета коэффициентов, применяемых КЦК при управлении кредитным и рыночным рисками;

- расширение возможности КЦК по выстраиванию торгово-клиринговых линков с иностранными юридическими лицами, в частности, осуществляющими функции, аналогичные функциям центрального контрагента, организатора торговли и (или) клиринговой организации;

- закрепление возможности КЦК не учитывать в расчете коэффициента

рыночного риска нереалистичные события при предоставлении в Банк России соответствующего обоснования;

- закрепление обязанности по доведению руководителем внутреннего контроля (лица, его замещающего) до сведения единоличного исполнительного органа КЦК информации о вероятности реализации и (или) реализации факта невыполнения требований Положения Банка России № 658-П;

- исключение норм, дублирующих положения Федерального закона от 7 февраля 2011 года № 7-ФЗ «О клиринге, клиринговой деятельности и центральном контрагенте».

Иные изменения, предусмотренные проектом указания, носят технический характер и направлены на недопущение их неоднозначного толкования.

Указание вступает в силу по истечении 10 дней после дня его официального опубликования.

В целях обеспечения возможности проведения оценки регулирующего воздействия замечания и предложения по проекту указания принимаются с 25 июля 2022 года по 8 августа 2022 года включительно по адресу электронной почты: [Gorinakov@cbr.ru](mailto:Gorinakov@cbr.ru).

Ответственным структурным подразделением Банка России за проведение оценки регулирующего воздействия является Департамент инфраструктуры финансового рынка.