

Статья 22. Система управления рисками клиринговой организации и центрального контрагента

(Наименование в редакции Федерального закона от 29.12.2015 № 403-ФЗ)

1. Клиринговая организация и центральный контрагент обязаны организовать систему управления рисками, связанными с осуществлением клиринговой деятельности или функций центрального контрагента и операций с собственным имуществом, которая должна соответствовать объему и характеру операций, совершаемых клиринговой организацией и центральным контрагентом. Для организации системы управления рисками клиринговая организация и центральный контрагент обязаны назначить должностное лицо или сформировать отдельное структурное подразделение.
2. В случае осуществления клиринга с участием центрального контрагента, а также в иных случаях, предусмотренных нормативными актами Банка России и (или) правилами клиринга, исполнение обязательств, допущенных к клирингу, должно обеспечиваться индивидуальным и коллективным клиринговым обеспечением. В указанных случаях условия соглашения об индивидуальном и (или) о коллективном клиринговом обеспечении должны содержаться в правилах клиринга.
3. Центральный контрагент обязан оценивать каждый рабочий день, если более частая оценка не установлена Банком России или центральным контрагентом, размер собственных обязательств и размер обязательств участников клиринга перед ним, а также размер индивидуального клирингового обеспечения участника клиринга с учетом рыночной цены имущества, являющегося предметом обязательств или составляющего индивидуальное клиринговое обеспечение, и рыночной цены, по которой заключаются договоры, являющиеся производным финансовым инструментом.
4. Центральный контрагент вправе осуществить перевод долга и уступку требований одного участника клиринга по допущенным к клирингу обязательствам, возникшим из договоров, заключенных за счет клиента, а также передачу имущества, являющегося предметом обеспечения исполнения обязательств, другому участнику клиринга в случаях и в порядке, которые предусмотрены правилами клиринга, при условии получения центральным контрагентом согласия на это участника клиринга, которому переводится долг, уступаются требования и передается имущество, и лица, за счет которого исполняются такие обязательства и (или) обеспечивается исполнение обязательств. Указанная передача имущества, являющегося предметом обеспечения исполнения обязательств, осуществляется в случае, если это имущество по требованию участника клиринга учитывается во внутреннем учете центрального контрагента отдельно.
- 4¹. Центральный контрагент вправе осуществить перевод долга и уступку требований участника клиринга, требований, возникших из договоров, заключенных участником клиринга за счет клиента (клиентов), а также передачу имущества, являющегося предметом обеспечения, другому центральному контрагенту в соответствии с условиями, определенными соглашением об операционном взаимодействии центральных контрагентов, по согласованию с Банком России. Случаи и порядок перевода долга и уступки требований участника клиринга одного центрального контрагента другому центральному контрагенту устанавливаются правилами клиринга. (Дополнение частью - Федеральный закон от 29.12.2015 № 403-ФЗ)
5. Клиринговая организация обязана утвердить документ (документы), определяющий (определяющие) правила организации системы управления кредитными, операционными и иными рисками, в том числе рисками, связанными с совмещением клиринговой деятельности с иными видами деятельности, меры по обеспечению бесперебойного функционирования программно-технических средств, предназначенных для осуществления клиринговой деятельности, меры, направленные на предотвращение и урегулирование конфликта интересов при осуществлении клиринга и совмещении клиринговой деятельности с иными видами деятельности. Требования к указанному документу (указанным документам) устанавливаются нормативными актами Банка

России.

5¹. Центральный контрагент обязан утвердить правила организации системы управления рисками центрального контрагента, которые должны определять меры, направленные на снижение рисков центрального контрагента и рисков, связанных с совмещением деятельности центрального контрагента с иными видами деятельности, меры, принимаемые центральным контрагентом в случаях возникновения нестандартных и чрезвычайных ситуаций, которые могут препятствовать нормальному осуществлению деятельности центрального контрагента, и направленные на обеспечение непрерывности осуществления такой деятельности. Требования к правилам организации системы управления рисками центрального контрагента устанавливаются нормативными актами Банка России. (Дополнение частью - Федеральный закон от 29.12.2015 № 403-ФЗ)

6. Клиринговая организация обязана иметь комитет по рискам. Не менее половины состава указанного комитета должны составлять представители участников клиринга.

6¹. В случае осуществления клиринга с участием центрального контрагента не менее двух третей комитета по рискам должны составлять представители участников клиринга. В состав комитета по рискам должны входить представители участников клиринга, независимые члены совета директоров (наблюдательного совета) и представители клиентов участников клиринга. (Дополнение частью - Федеральный закон от 29.12.2015 № 403-ФЗ)

7. Центральный контрагент обязан осуществлять мониторинг финансовой устойчивости участников клиринга в случаях, установленных нормативными актами Банка России.

8. Центральный контрагент обязан проводить оценку потенциального влияния на его финансовое состояние ряда заданных изменений в факторах риска (стресс-сценариев), которые соответствуют исключительным, но вероятным сценариям (стресс-тестирование рисков), и оценку точности используемых центральным контрагентом моделей оценки рисков путем сравнения спрогнозированных моделью оценки рисков значений показателя с величиной фактически наблюдаемых значений такого показателя (оценка точности модели центрального контрагента), представлять информацию о результатах стресс-тестирования рисков участникам клиринга и в Банк России в порядке и сроки, которые установлены нормативными актами Банка России. Одновременно с указанной информацией центральный контрагент представляет в Банк России результаты оценки точности модели центрального контрагента.

8¹. Центральный контрагент обязан утвердить методику стресс-тестирования рисков центрального контрагента и методику оценки точности модели центрального контрагента, требования к которым устанавливаются нормативными актами Банка России. (Дополнение частью - Федеральный закон от 29.12.2015 № 403-ФЗ)

8². Банк России вправе определять стресс-сценарии для центрального контрагента и направлять рекомендации об изменении системы управления рисками центрального контрагента в случае неудовлетворительных результатов стресс-тестирования рисков и (или) оценки точности модели центрального контрагента. (Дополнение частью - Федеральный закон от 29.12.2015 № 403-ФЗ)

9. Клиринговая организация обязана утвердить документ, определяющий меры, принимаемые ею в случаях возникновения чрезвычайных обстоятельств, которые могут препятствовать нормальному осуществлению клиринговой деятельности, и направленные на обеспечение непрерывности осуществления такой деятельности.