

**УТВЕРЖДЕНА**

Советом директоров РДК (АО)

Протокол № СД-10/2020 от «06» октября 2020 года

**МЕТОДИКА**

**ОПРЕДЕЛЕНИЯ ВЫДЕЛЕННОГО КАПИТАЛА  
ЦЕНТРАЛЬНОГО КОНТРАГЕНТА  
НЕБАНКОВСКОЙ КРЕДИТНОЙ ОРГАНИЗАЦИИ –  
ЦЕНТРАЛЬНОГО КОНТРАГЕНТА «РДК»  
(АКЦИОНЕРНОЕ ОБЩЕСТВО)**

**г. Москва  
2020 год**

## **СОДЕРЖАНИЕ**

<b>1. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ</b>	<b>3</b>
<b>2. ИСТОЧНИКИ ИНФОРМАЦИИ ДЛЯ РАСЧЕТА ВЫДЕЛЕННОГО КАПИТАЛА ЦЕНТРАЛЬНОГО КОНТРАГЕНТА</b>	<b>4</b>
<b>3. ПОРЯДОК РАСЧЕТА МИНИМАЛЬНОЙ ВЕЛИЧИНЫ ВЫДЕЛЕННОГО КАПИТАЛА ЦЕНТРАЛЬНОГО КОНТРАГЕНТА</b>	<b>4</b>
<b>4. УТВЕРЖДЕНИЕ ЗНАЧЕНИЙ ВЫДЕЛЕННОГО КАПИТАЛА ЦЕНТРАЛЬНОГО КОНТРАГЕНТА</b>	<b>5</b>
<b>5. РАСПРЕДЕЛЕНИЕ ВЫДЕЛЕННОГО КАПИТАЛА ПО ОБСЛУЖИВАЕМЫМ РЫНКАМ</b>	<b>5</b>
<b>6. ПОРЯДОК ВОСПОЛНЕНИЯ ВЫДЕЛЕННОГО КАПИТАЛА В СЛУЧАЕ ЕГО ИСПОЛЬЗОВАНИЯ</b>	<b>5</b>
<b>7. ЗАКЛЮЧИТЕЛЬНЫЕ ПОЛОЖЕНИЯ</b>	<b>6</b>

## 1. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ

1.1. Настоящая Методика определения выделенного капитала центрального контрагента Небанковской кредитной организации – центрального контрагента «РДК» (Акционерное общество) (далее – Методика) разработана в соответствии с Федеральным законом от 07.02.2011 г. № 7-ФЗ «О клиринге, клиринговой деятельности и центральном контрагенте» и Положением Банка России от 30.12.2016 г. № 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».

1.2. Методика, а также изменения и дополнения в нее утверждаются Советом директоров и вступают в силу в дату, определяемую Советом директоров после регистрации Методики в Банке России.

1.3. Термины и определения, используемые в Методике:

<b><i>Инструкция № 175-И</i></b>	Инструкция Банка России от 14.11.2016 № 175-И «О банковских операциях небанковских кредитных организаций - центральных контрагентов, об обязательных нормативах небанковских кредитных организаций - центральных контрагентов и особенностях осуществления Банком России надзора за их соблюдением»
<b><i>Правила клиринга срочного рынка</i></b>	Правила осуществления клиринговой деятельности Небанковской кредитной организации – центрального контрагента «РДК» (Акционерное общество) на срочном рынке АО «СПбМТСБ»
<b><i>Выделенный капитал центрального контрагента</i></b>	Собственные средства центрального контрагента, которые в соответствии с Правилами клиринга срочного рынка предназначены для покрытия возможных потерь, вызванных неисполнением или ненадлежащим исполнением участником клиринга своих обязательств, до использования средств, внесенных добросовестными участниками клиринга в Коллективный гарантийный фонд
<b><i>Минимальная величина выделенного капитала центрального контрагента</i></b>	Величина выделенного капитала центрального контрагента, определяемая в соответствии с требованиями Инструкции № 175-И
<b><i>Публикуемая годовая отчетность</i></b>	Отчетность НКО ЦК РДК (АО), составляемая в соответствии с Указанием Банка России от 27.11.2018 № 4983-У «О формах, порядке и сроках раскрытия кредитными организациями информации о своей деятельности»
<b><i>НКО, центральный контрагент</i></b>	Небанковская кредитная организация – центральный контрагент «РДК» (Акционерное общество), НКО ЦК РДК (АО)

1.4. Термины, специально не определенные в настоящей Методике, используются в значениях, установленных законодательством Российской Федерации, нормативными актами Банка России, Правилами организации системы управления рисками НКО ЦК РДК (АО), Правилами клиринга срочного рынка, внутренними нормативными документами НКО.

1.5. Настоящая Методика определяет:

- источники информации, используемой для расчета Выделенного капитала центрального контрагента;
- порядок расчета Минимальной величины выделенного капитала центрального контрагента;
- порядок распределения Выделенного капитала центрального контрагента по рынкам, обслуживаемым НКО;
- порядок восполнения Выделенного центрального контрагента в случае его использования.

1.6. Настоящая Методика подлежит размещению на сайте НКО не позднее пяти рабочих дней со дня ее вступления в силу.

## **2. ИСТОЧНИКИ ИНФОРМАЦИИ ДЛЯ РАСЧЕТА ВЫДЕЛЕННОГО КАПИТАЛА ЦЕНТРАЛЬНОГО КОНТРАГЕНТА**

2.1. Для определения значений Выделенного капитала центрального контрагента используются следующие источники информации, данные и факторы:

2.1.1. Публикуемая годовая отчетность;

2.1.2. Показатели достаточности собственных средств (капитала) НКО, включая следующие данные:

- текущий и прогнозный размер собственных средств (капитала) НКО;
- значение лицензионного требования к минимальному размеру собственных средств (капитала) центрального контрагента, установленного Статьей 8 Федерального закона от 07.02.2011 № 7-ФЗ «О клиринге, клиринговой деятельности и центральном контрагенте»;
- минимально допустимые и фактические значения обязательных нормативов центрального контрагента;
- текущие и прогнозные объемы обслуживаемого рынка.

2.1.3. Округление полученных величин.

2.2. Помимо информации, предусмотренной в пункте 2.1 настоящей Методики, центральный контрагент имеет право использовать любую иную доступную ему информацию, способную повлиять на оценку значения Выделенного капитала центрального контрагента.

## **3. ПОРЯДОК РАСЧЕТА МИНИМАЛЬНОЙ ВЕЛИЧИНЫ ВЫДЕЛЕННОГО КАПИТАЛА ЦЕНТРАЛЬНОГО КОНТРАГЕНТА**

3.1. Расчет Минимальной величины выделенного капитала центрального контрагента осуществляется в соответствии с Инструкцией № 175-И.

3.2. Расчет величины Минимального выделенного капитала центрального контрагента осуществляется ежегодно по состоянию на первое января года, следующего за отчетным, не позднее дня раскрытия Публикуемой годовой отчетности НКО.

3.3. Минимальная величина выделенного капитала центрального контрагента (далее - ВК) определяется на основе следующих данных:

- значения минимального капитала центрального контрагента (далее - МБР);

- минимальной величины средств, необходимой для обеспечения прекращения или реструктуризации деятельности центрального контрагента (далее - МЛикв);
- минимальной величины средств центрального контрагента, необходимой для покрытия потенциальных потерь в результате ухудшения его финансового положения вследствие уменьшения доходов или увеличения расходов, не связанных с неисполнением или ненадлежащим исполнением обязательств участниками клиринга (далее - МДР),  
и рассчитывается по формуле:  $ВК = (МЛикв + МДР + МБР) * 25\%$ .

3.4. Значения МЛикв, МДР и МБР определяются в соответствии с «Методикой расчета обязательных нормативов НКО ЦК РДК (АО)».

3.5. Значение Минимальной величины выделенного капитала центрального контрагента, рассчитанного в соответствии с пунктом 3.3. настоящей Методики не меняется до следующего ежегодного пересчета.

3.6. Значение Минимальной величины выделенного капитала центрального контрагента используется при ежедневном расчете норматива достаточности собственных средств (капитала) центрального контрагента.

#### **4. УТВЕРЖДЕНИЕ ЗНАЧЕНИЙ ВЫДЕЛЕННОГО КАПИТАЛА ЦЕНТРАЛЬНОГО КОНТРАГЕНТА**

4.1. Значение Выделенного капитала центрального контрагента утверждается в размере, равном или превышающем Минимальную величину выделенного капитала центрального контрагента, рассчитанного в соответствии с разделом 3 настоящей Методики.

4.2. Рассчитанные значения Минимальной величины выделенного капитала центрального контрагента и Выделенного капитала центрального контрагента утверждаются Председателем Правления НКО.

4.3. Значение Минимальной величины выделенного капитала центрального контрагента определяется, утверждается и вступает в силу ежегодно, не позднее пяти рабочих дней, после дня раскрытия Публикуемой годовой отчетности НКО.

4.4. Значение Выделенного капитала центрального контрагента, установленное в соответствии с настоящей Методикой, указывается в Правилах клиринга срочного рынка, утверждаемых Советом директоров НКО, и вступает в силу с момента введения в действие Правил клиринга срочного рынка.

4.5. Значения Минимальной величины выделенного капитала центрального контрагента и Выделенного капитала центрального контрагента публикуются на сайте НКО не позднее дня вступления их в силу.

#### **5. РАСПРЕДЕЛЕНИЕ ВЫДЕЛЕННОГО КАПИТАЛА ПО ОБСЛУЖИВАЕМЫМ РЫНКАМ**

5.1. В связи с тем, что клиринг с участием центрального контрагента осуществляется НКО только на срочном рынке АО «СПбМТСБ», весь Выделенный капитал центрального контрагента, рассчитанный в соответствии с настоящей Методикой, распределяется только на срочный рынок АО «СПбМТСБ».

#### **6. ПОРЯДОК ВОСПОЛНЕНИЯ ВЫДЕЛЕННОГО КАПИТАЛА В СЛУЧАЕ ЕГО ИСПОЛЬЗОВАНИЯ**

6.1. Восполнение Выделенного капитала центрального контрагента в случае его использования осуществляется в соответствии с Правилами клиринга срочного рынка.

6.2. Решение о восполнении Выделенного капитала центрального контрагента принимается Советом директоров НКО.

6.3. Решение Совета директоров НКО о восполнении Выделенного капитала центрального контрагента также устанавливает сроки и порядок его восполнения.

## **7. ЗАКЛЮЧИТЕЛЬНЫЕ ПОЛОЖЕНИЯ**

7.1. В случае изменения законодательства Российской Федерации, внесения изменений в нормативные акты Банка России и иных органов, а также во внутренние нормативные документы НКО, до приведения настоящей Методики в соответствие с такими изменениями, настоящая Методика действует в части, не противоречащей законодательству Российской Федерации и внутренним нормативным документам НКО.

7.2. При изменении организационной структуры НКО и/или наименования структурных подразделений до внесения соответствующих изменений в настоящую Методику выполнение функций в рамках регламентируемого процесса осуществляется тем структурным подразделением, к компетенции которого по результатам вышеуказанного изменения будет относиться соответствующая функция.