Документ предоставлен [КонсультантПлюс](https://www.consultant.ru)

**СРАВНЕНИЕ**

|  |  |
| --- | --- |
| Указание Банка России от 08.10.2018 N 4927-У | Указание Банка России от 10.04.2023 N 6406-У |
| Сведения о результатах оценки точности модели центрального контрагента (Код формы по ОКУД 0409721 (квартальная)) | Сведения о результатах оценки точности модели центрального контрагента (Форма (квартальная), код формы по ОКУД 0409721) |
|  | Форма |
|

|  |
| --- |
| Банковская отчетность |
|  | Код территории по ОКАТО | Код кредитной организации (филиала) |
| по ОКПО | регистрационный номер (/порядковый номер) |
|  |  |  |  |

 СВЕДЕНИЯ О РЕЗУЛЬТАТАХ ОЦЕНКИ ТОЧНОСТИ МОДЕЛИ ЦЕНТРАЛЬНОГО КОНТРАГЕНТА по состоянию на "\_\_" \_\_\_\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_ г. |

|  |
| --- |
| Банковская отчетность |
|  | Код территории по ОКАТО <1> | Код кредитной организации (филиала) |
| по ОКПО <2> | регистрационный номер (/порядковый номер) |
|  |  |  |  |

|  |
| --- |
| СВЕДЕНИЯО РЕЗУЛЬТАТАХ ОЦЕНКИ ТОЧНОСТИ МОДЕЛИ ЦЕНТРАЛЬНОГО КОНТРАГЕНТА |
| по состоянию на "\_\_" \_\_\_\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_ г. |

 |
| Полное ~~или сокращенное~~ фирменное наименование кредитной организации \_\_\_\_\_\_\_Адрес ~~(место~~ нахождения~~)~~ кредитной организации \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ |

|  |  |
| --- | --- |
| Полное фирменное наименование кредитной организации |  |
| Адрес кредитной организации в пределах места нахождения кредитной организации \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ |

 |
|  Код формы по ОКУД 0409721 Квартальная |

|  |
| --- |
| Код формы по ОКУД <3> 0409721 |
| Квартальная |

 |
|

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Номер строки | Доверительная вероятность, ~~процент~~ | Количество дней оценки точности параметров модели, дней | Количество пересмотров параметров модели, единиц | Дата проведения оценки точности модели центрального контрагента | Показатель 1, единиц | Показатель 2, ~~процент~~ | Показатель 3, ~~процент~~ | Показатель 4, ~~процент~~ |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |

~~Руководитель~~ (~~Ф.И.О.~~)Исполнитель (~~Ф.И.О.~~)Телефон:"\_\_" \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_ г. |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Номер строки | Доверительная вероятность, в процентах | Количество дней оценки точности параметров модели, дней | Количество пересмотров параметров модели, единиц | Дата проведения оценки точности модели центрального контрагента | Показатель 1, единиц | Показатель 2, в процентах | Показатель 3, в процентах | Показатель 4, в процентах |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Должностное лицо,уполномоченное подписывать Отчет |  |  |  |  |
| (должность) |  | (подпись) |  | (фамилия, имя, отчество (последнее - при наличии) |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| Исполнитель: |  |  |
|  |  | (фамилия, имя, отчество (последнее - при наличии) |
| Телефон:"\_\_" \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_ г. |

 |
|  | --------------------------------<1> Общероссийский классификатор объектов административно-территориального деления.<2> Общероссийский классификатор предприятий и организаций.<3> Общероссийский классификатор управленческой документации. |
| Порядоксоставления и представления отчетности по форме 0409721"Сведения о результатах оценки точности моделицентрального контрагента"1. Отчетность по форме 0409721 "Сведения о результатах оценки точности модели центрального контрагента" (далее - Отчет) составляется небанковской кредитной организацией - центральным контрагентом (далее - центральный контрагент) в соответствии с Положением Банка России от 30 декабря 2016 года N 576-П "О требованиях к методикам стресс-тестирования рисков и оценки точности модели центрального контрагента, к стресс-тестированию рисков и оценке точности модели центрального контрагента, порядке и сроках представления информации о результатах стресс-тестирования рисков центрального контрагента участникам клиринга"~~, зарегистрированным Министерством юстиции Российской Федерации~~ 25 января 2017 года N 45403 (далее - Положение Банка России N 576-П)~~,~~ по состоянию на ~~1-е~~ число квартала, следующего за отчетным, и представляется в Банк России не позднее ~~5-го~~ рабочего дня месяца, следующего за отчетным кварталом. | Порядоксоставления и представления отчетности по форме 0409721"Сведения о результатах оценки точности моделицентрального контрагента"1. Отчетность по форме 0409721 "Сведения о результатах оценки точности модели центрального контрагента" (далее - Отчет) составляется небанковской кредитной организацией - центральным контрагентом (далее - центральный контрагент) в соответствии с Положением Банка России от 30 декабря 2016 года N 576-П "О требованиях к методикам стресс-тестирования рисков и оценки точности модели центрального контрагента, к стресс-тестированию рисков и оценке точности модели центрального контрагента, порядке и сроках представления информации о результатах стресс-тестирования рисков центрального контрагента участникам клиринга" <1> (далее - Положение Банка России N 576-П) по состоянию на первое число квартала, следующего за отчетным кварталом, и представляется в Банк России не позднее пятого рабочего дня месяца, следующего за отчетным кварталом.--------------------------------<1> Зарегистрировано Минюстом России 25 января 2017 года, регистрационный N 45403. |
| 2. В графе 2 Отчета указывается величина доверительной вероятности, используемая в модели центрального контрагента для оценки точности модели центрального контрагента в соответствии с главой 4 Положения Банка России N 576-П. Величина доверительной вероятности указывается для каждого показателя оценки точности модели центрального контрагента по отдельной строке~~,~~ в процентах с ~~точностью~~ до двух знаков после запятой. | 2. В графе 2 Отчета указывается величина доверительной вероятности, используемая в модели центрального контрагента для оценки точности модели центрального контрагента в соответствии с главой 4 Положения Банка России N 576-П. Величина доверительной вероятности указывается для каждого показателя оценки точности модели центрального контрагента по отдельной строке в процентах с округлением до двух знаков после запятой по правилам математического округления. |
| 3. В графе 3 Отчета указывается глубина выборки, используемая центральным контрагентом для оценки точности параметров модели в соответствии с пунктом 4.2 Положения Банка России N 576-П. | 3. В графе 3 Отчета указывается глубина выборки, используемая центральным контрагентом для оценки точности параметров модели центрального контрагента в соответствии с пунктом 4.2 Положения Банка России N 576-П. |
| 4. В графе 4 Отчета указывается количество пересмотров параметров методики оценки точности модели центрального контрагента в соответствии с пунктом 4.4 Положения Банка России N 576-П. Значение показателя указывается в единицах.5. В графе 5 Отчета указывается дата~~, соответствующая проведению~~ оценки точности модели центрального контрагента~~,~~ в формате "дд.мм.гггг", где "дд" - день, "мм" - месяц, "гг" - год. В случае если оценка точности модели центрального контрагента проводилась в течение нескольких дней, указывается дата ~~последнего дня~~ оценки точности модели центрального контрагента. | 4. В графе 4 Отчета указывается количество пересмотров параметров методики оценки точности модели центрального контрагента в соответствии с пунктом 4.4 Положения Банка России N 576-П. Значение показателя указывается в единицах.5. В графе 5 Отчета указывается дата проведения оценки точности модели центрального контрагента в формате "дд.мм.гггг", где "дд" - день, "мм" - месяц, "гг" - год. В случае если оценка точности модели центрального контрагента проводилась в течение нескольких дней, указывается дата последней оценки точности модели центрального контрагента. |
| 6. В графе 6 Отчета указывается количество случаев в течение отчетного квартала, когда прогнозное значение обеспечения (индивидуального клирингового обеспечения и иного обеспечения~~)~~ за исключением коллективного клирингового обеспечения любого участника клиринга превышало значение фактического обеспечения. Значение показателя указывается в единицах.7. В графе 7 Отчета указывается величина, характеризующая достаточность размера ставок индивидуального клирингового обеспечения, рассчитанных в соответствии с моделью, используемой центральным контрагентом для оценки достаточности ставок индивидуального клирингового обеспечения, применяемая центральным контрагентом на ~~момент~~ проведения оценки точности модели центрального контрагента для покрытия потенциальных потерь, вызванных неблагоприятным изменением цен инструментов, с доверительной вероятностью не менее 99 процентов. Значение показателя указывается в процентах с ~~точностью~~ до одного знака после запятой.8. В графе 8 Отчета указывается величина, характеризующая достаточность обеспечения (индивидуального клирингового обеспечения и иного обеспечения~~)~~ за исключением коллективного клирингового обеспечения каждого участника клиринга, рассчитанного в соответствии с моделью, используемой центральным контрагентом для оценки достаточности обеспечения (индивидуального клирингового обеспечения и иного обеспечения~~)~~, за исключением коллективного клирингового обеспечения, применяемая центральным контрагентом на ~~момент~~ проведения оценки точности модели центрального контрагента для покрытия потенциальных потерь, вызванных неисполнением или ненадлежащим исполнением обязательств данным участником клиринга, с доверительной вероятностью не менее 99 процентов. Значение показателя указывается в процентах с ~~точностью~~ до одного знака после запятой.9. В графе 9 Отчета указывается величина, характеризующая достаточность коллективного клирингового обеспечения, рассчитанного в соответствии с моделью, используемой центральным контрагентом для оценки достаточности коллективного клирингового обеспечения, применяемая центральным контрагентом на ~~момент~~ проведения оценки точности модели центрального контрагента для покрытия потенциальных потерь, вызванных неисполнением или ненадлежащим исполнением обязательств двумя крупнейшими по потерям участниками клиринга, с учетом их обеспечения, выделенного капитала центрального контрагента~~,~~ с доверительной вероятностью не менее 99,5 процента. Значение показателя указывается в процентах с ~~точностью~~ до одного знака после запятой. | 6. В графе 6 Отчета указывается количество случаев в течение отчетного квартала, когда прогнозное значение обеспечения (индивидуального клирингового обеспечения и иного обеспечения, за исключением коллективного клирингового обеспечения) любого участника клиринга превышало значение фактического обеспечения. Значение показателя указывается в единицах.7. В графе 7 Отчета указывается величина, характеризующая достаточность размера ставок индивидуального клирингового обеспечения, рассчитанных в соответствии с моделью, используемой центральным контрагентом для оценки достаточности ставок индивидуального клирингового обеспечения, применяемая центральным контрагентом на дату проведения оценки точности модели центрального контрагента для покрытия потенциальных потерь, вызванных неблагоприятным изменением цен инструментов, с доверительной вероятностью не менее 99 процентов. Значение показателя указывается в процентах с округлением до одного знака после запятой по правилам математического округления.8. В графе 8 Отчета указывается величина, характеризующая достаточность обеспечения (индивидуального клирингового обеспечения и иного обеспечения, за исключением коллективного клирингового обеспечения) каждого участника клиринга, рассчитанного в соответствии с моделью, используемой центральным контрагентом для оценки достаточности обеспечения (индивидуального клирингового обеспечения и иного обеспечения, за исключением коллективного клирингового обеспечения), применяемая центральным контрагентом на дату проведения оценки точности модели центрального контрагента для покрытия потенциальных потерь, вызванных неисполнением или ненадлежащим исполнением обязательств данным участником клиринга, с доверительной вероятностью не менее 99 процентов. Значение показателя указывается в процентах с округлением до одного знака после запятой по правилам математического округления.9. В графе 9 Отчета указывается величина, характеризующая достаточность коллективного клирингового обеспечения, рассчитанного в соответствии с моделью, используемой центральным контрагентом для оценки достаточности коллективного клирингового обеспечения, применяемая центральным контрагентом на дату проведения оценки точности модели центрального контрагента для покрытия потенциальных потерь, вызванных неисполнением или ненадлежащим исполнением обязательств двумя крупнейшими по потерям участниками клиринга, с учетом их обеспечения, выделенного капитала центрального контрагента с доверительной вероятностью не менее 99,5 процента. Значение показателя указывается в процентах с округлением до одного знака после запятой по правилам математического округления. |