

Посттрейдинговые услуги

КЛИРИНГОВАЯ ДЕЯТЕЛЬНОСТЬ

Функции клиринговой организации и ЦК на российском финансовом рынке с 2007 года выполняет НКЦ, входящий в Группу. Основная задача НКЦ – оказание клиринговых услуг участникам рынка и поддержание стабильности на обслуживаемых сегментах финансового рынка за счет реализации современной, отвечающей международным стандартам системы управления рисками. НКЦ имеет статус квалифицированного ЦК и признан Банком России системно значимой инфраструктурной организацией финансового рынка. Он является членом Всемирной ассоциации центральных контрагентов (Global Association of Central Counterparties, CCP12) и Европейской ассоциации клиринговых домов – центральных контрагентов (European Association of Central Counterparty Clearing Houses, EACH).

Рейтинги

Международное рейтинговое агентство Fitch Ratings в 2018 году подтвердило рейтинги НКЦ: долгосрочный рейтинг дефолта эмитента (РДЭ) в национальной валюте на уровне «BBB», прогноз «Стабильный» – на одну ступень выше суверенного рейтинга Российской Федерации; в иностранной валюте на уровне «BBB», прогноз «Позитивный» – на уровне суверенного рейтинга Российской Федерации.

Аналитическое кредитное рейтинговое агентство (АКРА) подтвердило кредитный рейтинг НКЦ по национальной шкале на уровне AAA(RU), прогноз «Стабильный». По мнению экспертов АКРА, присвоенные НКЦ кредитный рейтинг и прогноз обусловлены сильным и устойчивым бизнес-профилем, исключительной позицией по ликвидности и запасу достаточности капитала, а также тем, что дополнительную поддержку рейтингу оказывает системная значимость НКЦ на российском финансовом рынке.

Уровни защиты центрального контрагента

В 2018 году усовершенствована структура уровней защиты ЦК за счет унификации размера взноса участников клиринга в гарантийный фонд на всех рынках. В частности, размер взноса участников клиринга на рынке СПФИ увеличен до 10 млн рублей.

Структура уровней защиты ЦК, унифицированная для всех рынков Биржи, нацелена на обеспечение надежности и устойчивости ЦК, а также на гарантированное восстановление финансовой устойчивости НКЦ в любой рыночной ситуации. Разработанная и внедренная структура защиты соответствует международным стандартам деятельности ЦК и требованиям Банка России.

СТРУКТУРА УРОВНЕЙ ЗАЩИТЫ ЦЕНТРАЛЬНОГО КОНТРАГЕНТА



Отчетность и аудит

Проект «Отчетность НКЦ» стал победителем ежегодного конкурса «Проект года. Выбор ИТ-директоров России» в номинации «Лучшее решение в предметной области». Проект был направлен на разработку более эффективного решения комплексной задачи формирования обязательной банковской и налоговой отчетности в НКЦ. Реализация проекта предусматривала системную перестройку процессов формирования обязательной банковской и налоговой отчетности, а также отчетности, направляемой в Росфинмониторинг. В результате процесс подготовки отчетности сократился не менее чем в три раза. После реализации проекта быстрое действие системы составляет порядка 120 минут для расчета сложных взаимосвязанных форм на объемах около 60 млн проводок в день. Формирование ежедневного пакета отчетов выполняется за 10–15 минут вместо одного часа.

В 2018 году НКЦ успешно прошел операционный аудит, проведенный АО «Делойт и Туш СНГ» в соответствии с требованиями Положения Банка России «О порядке проведения центральным контрагентом операционного аудита», который охватывал такие элементы деятельности ЦК, как управление рисками, оценка точности модели, стресс-тестирование рисков, определение выделенного капитала и восстановление финансовой устойчивости.

Международное сертификационное общество Det Norske Veritas and Germanischer Lloyd подтвердило соответствие системы менеджмента качества, внедренной в НКЦ, международному стандарту Системы менеджмента качества. Сертификат о подтверждении соответствия для услуг по осуществлению клиринговой деятельности, включая функцию ЦК, действителен до 10 декабря 2021 года.