



**Правління Національного банку України**  
**ПОСТАНОВА**

02 липня 2021 року

м. Київ

№ 69

Про затвердження Положення про підтримання  
ліквідності центрального контрагента

Відповідно до статей 15, 42, 56 Закону України “Про Національний банк України”, статті 60 Закону України “Про ринки капіталу та організовані товарні ринки”, з метою визначення умов і порядку підтримання Національним банком України ліквідності центрального контрагента Правління Національного банку України **постановляє:**

1. Затвердити Положення про підтримання ліквідності центрального контрагента, що додається.

2. Визнати такими, що втратили чинність:

1) постанову Правління Національного банку України від 12 квітня 2013 року № 137 “Про затвердження Положення про порядок реєстрації Правил ПАТ “Розрахунковий центр з обслуговування договорів на фінансових ринках”, зареєстровану в Міністерстві юстиції України 29 квітня 2013 року за № 697/23229;

2) постанову Правління Національного банку України від 15 липня 2013 року № 277 “Про затвердження Порядку створення та використання гарантійного фонду у вигляді коштів для забезпечення виконання зобов’язань за правочинами щодо цінних паперів та інших фінансових інструментів”, зареєстровану в Міністерстві юстиції України 02 серпня 2013 року за № 1315/23847;

3) постанову Правління Національного банку України від 21 серпня 2013 року № 332 “Про затвердження Положення про підтримку ліквідності Розрахункового центру з обслуговування договорів на фінансових ринках”, зареєстровану в Міністерстві юстиції України 12 вересня 2013 року за № 1578/24110;

4) пункт 19 постанови Правління Національного банку України від 10 жовтня 2017 року № 102 “Про внесення змін до деяких нормативно-правових актів Національного банку України”;

5) постанову Правління Національного банку України від 25 травня 2018 року № 56 “Про внесення змін до деяких нормативно-правових актів Національного банку України”.

3. Контроль за виконанням цієї постанови покласти на заступника Голови Національного банку України Юрія Гелетія.

4. Постанова набирає чинності з дня її офіційного опублікування.

Голова

Кирило ШЕВЧЕНКО

Інд. 40

ЗАТВЕРДЖЕНО  
Постанова Правління  
Національного банку України  
02 липня 2021 року № 69

Положення про підтримання ліквідності центрального контрагента

I. Загальні положення

1. Це Положення розроблено відповідно до статей 15, 42, 56 Закону України “Про Національний банк України”, статті 60 Закону України “Про ринки капіталу та організовані товарні ринки” та визначає умови й порядок підтримання Національним банком України (далі – Національний банк) ліквідності центрального контрагента.

2. Термін “центральный контрагент” у цьому Положенні вживається в значенні, наведеному в Законі України “Про ринки капіталу та організовані товарні ринки”.

Інші терміни в цьому Положенні вживаються в значеннях, визначених законодавством України.

3. Центральний контрагент у разі виникнення в нього тимчасового дефіциту ліквідних коштів у національній валюті України для виконання покладених на нього функцій та вичерпання ним інших можливостей отримання коштів має право звернутися до Національного банку за підтриманням ліквідності.

4. Національний банк здійснює підтримання ліквідності центрального контрагента, якщо це не суперечить пріоритетам діяльності Національного банку, визначеним Законом України “Про Національний банк України”, шляхом проведення з ним операцій прямого репо з облігаціями внутрішньої державної позики України (далі – операція репо), які є у власності центрального контрагента та не обтяжені будь-якими зобов’язаннями.

Операція репо здійснюється Національним банком з переходом права власності на цінні папери.

5. Національний банк здійснює з центральним контрагентом операції репо з облігаціями внутрішньої державної позики України. Операція репо здійснюється за умови, що строки виплати купонного доходу та/або погашення за цими цінними паперами мають наставати не раніше ніж через два робочих дні після дати їх зворотної купівлі.

6. Національний банк здійснює з центральним контрагентом операції репо на термін до наступного робочого дня.

7. Національний банк за операцією репо враховує ризики можливої зміни справедливої вартості цінних паперів, які є предметом операції репо та застосовує коригуючі коефіцієнти.

8. Процентний дохід за операцією репо є наперед обумовленим та фіксованим на час проведення операції.

Процентна ставка, що використовується для визначення ціни зворотного продажу облігацій внутрішньої державної позики України, встановлюється на рівні процентної ставки Національного банку за операціями за кредитами овернайт на дату укладення договору репо з центральним контрагентом, наданими Національним банком.

Базовою кількістю днів для визначення процентного доходу є фактична кількість днів у місяці/році.

9. Національний банк розпорядчими актами має право встановлювати:

1) порядок проведення операцій з підтримання ліквідності центрального контрагента, що передбачає послідовність дій підрозділів Національного банку та центрального контрагента під час здійснення операцій із підтримання ліквідності центрального контрагента;

2) розмір коригуючих коефіцієнтів.

## II. Порядок проведення Національним банком операцій із підтримання ліквідності центрального контрагента

10. Центральний контрагент для здійснення операцій репо подає засобами системи електронного документообігу АСКОД (далі – СЕД АСКОД) до Національного банку клопотання щодо проведення операції репо з обґрунтуванням необхідності проведення такої операції із зазначенням її обсягу, кількості та коду (міжнародного ідентифікаційного номера) облігацій внутрішньої державної позики України, що пропонуються, строку проведення операції та цінових параметрів (процентної ставки, що використовується для визначення ціни зворотного продажу облігацій внутрішньої державної позики України).

11. Документи, що подаються центральним контрагентом до Національного банку відповідно до цього Положення, підписуються керівником центрального контрагента та/або уповноваженою особою центрального контрагента.

Документи, що подаються до Національного банку в електронній формі засобами СЕД АСКОД, підписуються кваліфікованими електронними підписами осіб, уповноважених на підписання цих документів від імені центрального контрагента.

Документи, що подаються до Національного банку в електронній формі за допомогою програмно-технологічного забезпечення, підписуються електронними підписами Національного банку осіб, які уповноважені на підписання цих документів від імені центрального контрагента. Центральний контрагент під час обміну повідомленнями з використанням електронних торговельних систем є відповідальним за те, що надсилання таких повідомлень здійснюється виключно уповноваженими особами центрального контрагента.

12. Національний банк протягом п'яти робочих днів із дня отримання клопотання центрального контрагента розглядає клопотання та після прийняття рішення керівництвом Національного банку надсилає лист-повідомлення центральному контрагенту (у разі позитивного вирішення – із зазначенням умов проведення операцій, у разі відмови – з обґрунтуванням причин відмови) та забезпечує здійснення організаційних заходів щодо укладення з центральним контрагентом договору прямого репо.

13. Істотними умовами в договорі репо, укладеному з центральним контрагентом, зазначаються ціна купівлі, обсяг операції, код (міжнародний ідентифікаційний номер) та кількість облігацій внутрішньої державної позики України, строк проведення операції, дата погашення, розмір процентного доходу, ціна зворотного викупу.

14. Ціною купівлі Національним банком облігацій внутрішньої державної позики України за операцією репо є їх справедлива вартість, з урахуванням коригуючих коефіцієнтів.

Ціна зворотної купівлі (викупу) центральним контрагентом цінних паперів встановлюється в такий спосіб, щоб дохід за строк операції репо дорівнював процентному доходу, нарахованому на ціну купівлі за ставкою, визначеною як процентна ставка Національного банку за операціями за кредитами овернайт на дату укладення договору репо з центральним контрагентом, наданими Національним банком.

15. Зобов'язання щодо виконання другої частини договору репо виникає у сторін договору тільки за умови повного виконання ними зобов'язань за першою частиною договору репо.

16. Операції репо здійснюються Національним банком із дотриманням під час розрахунків принципу “поставка цінних паперів проти оплати” в порядку,

установленому законодавством України та розпорядчими актами Національного банку з питань депозитарної та клірингової діяльності.

17. Наявність у центрального контрагента простроченої заборгованості за раніше проведеною операцією репо унеможлиблює проведення Національним банком наступної операції репо.

### III. Контроль і відповідальність

18. Національний банк здійснює контроль за своєчасним виконанням центральним контрагентом усіх умов укладених договорів репо.

19. Відповідальність центрального контрагента за своєчасне повернення коштів за другою частиною операції репо та за виконання усіх умов укладених договорів репо визначається цими договорами.

20. Національний банк після двох робочих днів із дня невиконання центральним контрагентом зобов'язань договору репо щодо зворотного викупу цінних паперів відмовляється від проведення другої частини операції репо.

21. Взаємовідносини між Національним банком та центральним контрагентом у разі невиконання центральним контрагентом своїх зобов'язань за другою частиною операції репо врегульовуються положеннями договору репо.