



**ЦЕНТРАЛЬНЫЙ БАНК
РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
(Банк России)**

ПЕРВЫЙ ЗАМЕСТИТЕЛЬ ПРЕДСЕДАТЕЛЯ

107016, Москва, ул. Неглинная, 12
www.cbr.ru
тел.: (495) 771-91-00

Организациям, выполняющим
функции ценовых центров

от 29.03.2016 № ИН-06-51/15

на № _____ от _____

Информационное письмо «Об
оценке качества функционирования
ценовых центров»

Банк России в рамках выполнения возложенных на него задач в целях развития финансового рынка осуществляет оценку качества функционирования организаций, осуществляющих деятельность по определению стоимости финансовых инструментов, информация о которой может использоваться заинтересованными лицами наряду с другими существующими источниками информации о стоимости финансовых инструментов, способами и методами оценки стоимости финансовых инструментов, за исключением организаций, обязанность которых по определению стоимости финансовых инструментов, а также предоставлению заинтересованным лицам информации о стоимости финансовых инструментов установлена законодательством Российской Федерации, в том числе нормативными актами Банка России (далее – ценовые центры).

Ценовым центрам, желающим на добровольной основе пройти оценку качества функционирования, рекомендуется направлять в Банк России (Департамент развития финансовых рынков Банка России) ходатайства с указанием полного фирменного наименования, адреса (места нахождения), ИНН, ОГРН, № телефона, адреса электронной почты ценового центра,

а также наименования финансового инструмента (группы финансовых инструментов), в отношении которого ценовым центром осуществляется определение стоимости. К ходатайству прилагаются следующие документы:

для ценового центра, не являющегося организатором торговли – копии учредительных документов, свидетельства о постановке на учет в налоговом органе, свидетельства о присвоении ОГРН, выписка из единого государственного реестра юридических лиц. В случае если указанные документы ранее представлялись в Банк России, то для целей оценки качества функционирования ценового центра повторное представление указанных документов требуется только в случае внесения в них изменений;

методика определения стоимости финансовых инструментов (далее – методика) (по каждому финансовому инструменту или группе финансовых инструментов);

заключение о соответствии расчета стоимости финансовых инструментов методике, подготовленное независимой от ценового центра организацией;

документы, содержащие перечень источников информации, используемой для определения стоимости финансовых инструментов;

копии договоров, заключенных между ценовым центром и лицами, выполняющими по поручению ценового центра отдельные функции, связанные с определением стоимости финансовых инструментов, включая представление информации, используемой для определения стоимости финансовых инструментов (при наличии);

копии документов ценового центра, регламентирующих условия оказания ценовым центром услуг; процедуру мониторинга качества методики; порядок утверждения и введения в действие методики; организацию работы ценового центра в отношении сбора, обработки, хранения и раскрытия информации, включая критерии отбора источников информации, используемой для определения стоимости финансовых

инструментов; организацию работы ценового центра в отношении обеспечения непрерывности деятельности ценового центра; организацию работы с претензиями и предложениями, поступающими от заинтересованных лиц; организацию деятельности функционирующего при ценовом центре независимого коллегиального органа, состоящего из представителей профессионального сообщества, осуществляющего, в том числе, функции по подготовке рекомендаций о внесении изменений в методику, осуществлению контроля за проводимой ценовым центром работой с претензиями и предложениями, поступающими от заинтересованных лиц (далее – экспертный совет); процедуры, направленные на предотвращение злоупотреблений; процедуры по выявлению и управлению рисками возникновения конфликтов интересов в процессе сбора и обработки информации о финансовом инструменте, разработки методики и в процессе определения стоимости финансовых инструментов.

Ходатайства и иные документы рекомендуется представлять за подписью лица, осуществляющего функции единоличного исполнительного органа ценового центра, на бумажном носителе или в форме электронных документов, подписанных усиленной квалифицированной электронной подписью.

Предполагается, что оценка качества функционирования ценового центра будет осуществляться в разумный срок, но не более двух месяцев со дня получения ходатайства на предмет соответствия ценового центра следующим критериям:

наличие в открытом доступе информации о составе, об изменениях в составе экспертного совета;

наличие в открытом доступе методики, информации о порядке утверждения и введения в действие методики, об изменениях в методике, а также документов ценового центра, регламентирующих процедуры обеспечения непрерывности деятельности ценового центра, организацию

деятельности экспертного совета, процедуру раскрытия ценовым центром информации, относящейся к определению стоимости финансовых инструментов, организацию в ценовом центре работы с претензиями и предложениями, поступающими от заинтересованных лиц, а также процедуру мониторинга качества методики, предусматривающую, в том числе, регулярное тестирование результатов определения стоимости финансовых инструментов на основе исторических данных и размещение в открытом доступе результатов такого тестирования;

наличие в открытом доступе перечня финансовых инструментов, стоимость которых определяется ценовым центром, а также информации о каждом финансовом инструменте, входящем в указанный перечень, включая сведения об источниках информации, используемой для определения стоимости финансовых инструментов;

наличие в открытом доступе заключения, подготовленного независимой от ценового центра организацией, содержащего вывод о соответствии расчета стоимости финансовых инструментов методике (в том числе в части соответствия методике алгоритмов программного комплекса, источников данных, отсутствия в программном комплексе алгоритмов, не указанных в методике);

наличие в открытом доступе информации об условиях оказания ценовым центром услуг, предусматривающих, в том числе, порядок, в соответствии с которым предоставление ценовым центром информации о стоимости финансовых инструментов, по которым по итогам предыдущего торгового дня организатором торговли была рассчитана рыночная цена или признаваемая котировка, осуществляется одновременно с предоставлением информации о значениях таких рыночных цен и признаваемых котировок (включая сроки предоставления информации и используемые для этого форматы и каналы связи, тарифы на оказываемые услуги), о перечне лиц, с которыми у ценового центра заключены договоры в связи с выполнением

такими лицами по поручению ценового центра отдельных функций, связанных с определением стоимости финансовых инструментов, включая представление информации, используемой для определения стоимости финансовых инструментов в случае, если ценовой центр использует информацию таких лиц в целях определения стоимости финансовых инструментов, а также информацию об изменениях в перечне таких лиц;

доступность для Банка России, заинтересованных лиц архивов ценового центра, содержащих информацию, относящуюся к определению стоимости финансовых инструментов.

Информация о признании качества функционирования ценового центра удовлетворительным (с указанием финансового инструмента, группы финансовых инструментов, стоимость которых определяется ценовым центром) в срок не позднее пяти рабочих дней с даты принятия решения будет размещаться на официальном сайте Банка России в сети «Интернет» с указанием даты принятия решения.

В случае если на официальном сайте Банка России в сети «Интернет» будет содержаться информация о признании качества функционирования ценового центра удовлетворительным, ценовому центру рекомендуется при последующем внесении изменений в документы, ранее представленные в Банк России в качестве приложения к ходатайству, также представлять в Банк России документы, содержащие указанные изменения.

Планируется, что принятое Банком России решение о признании качества функционирования ценового центра удовлетворительным будет пересматриваться Банком России на ежегодной основе (далее – пересмотр результатов оценки).

Если по итогам пересмотра результатов оценки Банком России будет принято решение о признании качества функционирования ценового центра неудовлетворительным, соответствующая информация не позднее первого рабочего дня, следующего за днем принятия решения, будет размещена на

официальном сайте Банка России в сети «Интернет», а также направлена ценовому центру с указанием оснований принятия решения.

Настоящее письмо подлежит опубликованию на официальном сайте Банка России в сети «Интернет».

С.А. Швецов