



Правління Національного банку України
ПОСТАНОВА

08 квітня 2020 року

м. Київ

№ 47

Про затвердження Положення про Контактну групу
грошового та валютного ринків

*(зі змінами, унесеними постановами Правління
Національного банку України
від 13 квітня 2020 року № 48,
від 14 травня 2020 року № 63,
від 19 червня 2020 року № 78 – набрання чинності з 23 червня 2020 року,
від 26 лютого 2021 року № 21,
від 22 липня 2022 року № 156,
від 09 березня 2023 року № 19,
від 22 серпня 2023 року № 103)*

Відповідно до статей 6, 7, 15, 56 Закону України “Про Національний банк України”, з метою розвитку грошового, валютного ринків та ринків процентних і валютних деривативів Правління Національного банку України **постановляє:**

1. Затвердити Положення про Контактну групу грошового та валютного ринків, що додається.
2. Департаменту відкритих ринків (Сергій Пономаренко) довести до відома банків України інформацію про прийняття цієї постанови.
3. Постанова набирає чинності з дня, наступного за днем її офіційного опублікування.

Голова

Яків СМОЛІЙ

ЗАТВЕРДЖЕНО
Постанова Правління
Національного банку України
08 квітня 2020 року № 47

Положення про Контактну групу грошового та валютного ринків

I. Загальні положення

1. Контактна група грошового та валютного ринків (далі – Контактна група) є консультативним органом, який створений з метою обміну інформацією та поглядами між Національним банком України (далі – Національний банк) та учасниками ринку щодо актуального стану і шляхів розвитку грошового та валютного ринків, а також ринків процентних та валютних деривативів (далі – ринки ГВД).

2. Контактна група у своїй діяльності керується цим Положенням.

3. Основними завданнями Контактної групи є опрацювання та обговорення питань про:

- 1) поточний стан, структуру та засади функціонування ринків ГВД;
- 2) проблеми, загрози та перешкоди для розвитку ринків ГВД;
- 3) визначення шляхів розвитку ринків ГВД та активізації здійснення операцій на них;
- 4) вплив ринків ГВД на інші сегменти фінансових ринків та вплив інших сегментів фінансових ринків, а також глобальних ринків на ринки ГВД;
- 5) індикатори (бенчмарки) грошового і валютного ринків та їх використання під час здійснення операцій на фінансових ринках;
- 6) кращі практики роботи на ринках ГВД;
- 7) розвиток регуляторного середовища та його вплив на операції на ринках ГВД;
- 8) коди професійної поведінки/найкращих практик учасників ринків ГВД;

8¹) надання рекомендацій Національному банку щодо кандидатур, які можуть бути включені до складу Ради оверсайту індикаторів грошового та валютного ринків України як зовнішні члени;

(пункт 3 розділу I доповнено підпунктом 8¹ згідно з постановою Правління Національного банку України від 14.05.2020 № 63, підпункт 8¹ пункту 3 розділу I зі змінами, унесеними постановами Правління Національного банку України від 19.06.2020 № 78, від 26.02.2021 № 21, від 22.08.2023 № 103)

9) інші питання, які становлять інтерес у контексті розвитку ринків ГВД.

4. Контактна група інформує про свою діяльність шляхом розміщення матеріалів, узагальнених підсумків дискусії, іншої інформації щодо її діяльності на сторінці “Контактної групи грошового та валютного ринків” розділу “Фінансові ринки” офіційного Інтернет-представництва Національного банку (далі – Сторінка Контактної групи).

5. Результати опрацювання та обговорення відповідних питань на засіданнях Контактної групи можуть братися до уваги Національним банком та банками під час виконання покладених на них законодавством функцій, а також можуть надсилатися до відома державним органам та іншим організаціям.

II. Склад Контактної групи

6. До складу Контактної групи входять представники Національного банку, визначені у пункті 8 розділу II цього Положення, а також експерти, рекомендовані банками України.

7. Склад Контактної групи з числа експертів, що делегуються банками, підлягає щорічному перегляду.

Персональний склад Контактної групи затверджується наказом Національного банку.

8. Головою Контактної групи є заступник Голови Національного банку за вертикаллю підпорядкування “Ринкові операції”. Заступником голови Контактної групи є директор Департаменту відкритих ринків Національного банку.

9. Організаційне супроводження роботи Контактної групи здійснює управління оперативного регулювання грошово-кредитного ринку

Департаменту відкритих ринків Національного банку України (далі – Секретаріат).

(абзац перший пункту 9 розділу II зі змінами, унесеними постановою Правління Національного банку України від 26.02.2021 № 21)

Секретарем Контактної групи є начальник управління оперативного регулювання грошово-кредитного ринку Департаменту відкритих ринків.

(абзац другий пункту 9 розділу II зі змінами, унесеними постановою Правління Національного банку України від 26.02.2021 № 21)

10. Засідання Контактної групи веде голова Контактної групи, а за його відсутності – заступник голови Контактної групи.

11. Право пропонувати експертів до Контактної групи отримують банки, що входять до переліку 25 банків, які мають найкращий загальний рейтинг за підсумками IV кварталу попереднього року. Загальний рейтинг банку визначається відповідно до розрахунку загального рейтингу банку, зазначеного в додатку до цього Положення (додається).

Банки, визначені в абзаці першому пункту 11 розділу II цього Положення, у яких власниками істотної участі є фізичні та/або юридичні особи Російської Федерації та/або Республіки Білорусь, не мають права пропонувати експертів до складу Контактної групи.

(пункт 11 розділу II доповнено новим абзацом другим згідно з постановою Правління Національного банку України від 09.03.2023 № 19, у зв'язку з цим абзац другий вважати абзацом третім)

Інформація про перелік банків, які мають право пропонувати експертів до складу Контактної групи, публікується на Сторінці Контактної групи не пізніше 25 січня поточного року.

(абзац третій пункту 11 розділу II зі змінами, унесеними постановою Правління Національного банку України від 09.03.2023 № 19)

12. Банки, які увійшли до переліку, визначеного відповідно до пункту 11 розділу II цього Положення, у терміни, визначені головою Контактної групи, надають до Секретаріату свої пропозиції щодо експертів для включення до складу Контактної групи. Кандидатури, подані до Секретаріату після визначеного Національним банком терміну, не розглядаються.

Кожен банк має право надати кандидатуру не більше одного експерта, який може бути або не бути штатним співробітником цього банку. Експерти, кандидатури яких подаються для включення до складу Контактної групи, повинні мати досвід роботи з питань, визначених у пункті 3 розділу I цього Положення, та не бути громадянами Російської Федерації або Республіки Білорусь.

(абзац другий пункту 12 розділу II зі змінами, унесеними постановою Правління Національного банку України від 09.03.2023 № 19)

Національний банк за потреби має право запитати в банків інформацію про кандидатуру (коротке резюме експерта, яке відображає його громадянство, освіту, посаду, досвід роботи та іншу інформацію, що підтверджує належний рівень фаховості експерта).

(абзац третій пункту 12 розділу II зі змінами, унесеними постановою Правління Національного банку України від 09.03.2023 № 19)

13. Голова Контактної групи має право відхилити ту або іншу кандидатуру експерта, подану для включення до складу Контактної групи, якщо така кандидатура не відповідає вимогам абзацу другого пункту 12 розділу II цього Положення. Про таке рішення Секретаріат повідомляє банк, який запропонував відповідну кандидатуру. У такому разі банк має право надати іншу кандидатуру у визначений Секретаріатом термін.

(пункт 13 розділу II зі змінами, унесеними постановою Правління Національного банку України від 09.03.2023 № 19)

14. Склад Контактної групи публікується на Сторінці Контактної групи. Підставами для виключення експерта зі складу Контактної групи можуть бути:

1) віднесення банку, що надавав кандидатуру експерта для включення до складу Контактної групи, до категорії неплатоспроможних або щодо якого прийнято рішення про відкликання банківської ліцензії та ліквідацію банку;

2) зміна посади, яку на момент формування Контактної групи обіймав відповідний експерт. Банк, що надавав цю кандидатуру, у такому разі має право запропонувати іншу кандидатуру, якщо до кінця поточного року залишилося не менше чотирьох місяців. Банк не надає кандидатуру, якщо до кінця поточного року залишилося менше чотирьох місяців.

(пункт 14 розділу II у редакції постанови Правління Національного банку України від 22.07.2022 № 156)

III. Організаційні засади діяльності Контактної групи

15. Робота Контактної групи організовується у формі проведення засідань, які відбуваються, як правило, щоквартально, але не рідше двох разів на рік. Графік засідань публікується на Сторінці Контактної групи.

Засідання Контактної групи проводяться в приміщенні Національного банку України.

Голова Контактної групи має право прийняти рішення про проведення засідання Контактної групи в дистанційному режимі за допомогою засобів аудіо-, візуального зв'язку.

Засідання Контактної групи правомочне за умови участі в ньому більше половини її членів.

16. Голова Контактної групи визначає порядок денний засідань на підставі пропозицій учасників Контактної групи та структурних підрозділів Національного банку, які подаються до Секретаріату в терміни, погоджені на засіданні Контактної групи.

Секретаріат публікує на Сторінці Контактної групи порядок денний засідання та матеріали, які розглядатимуться (за наявності).

Регламент розгляду питань визначає Голова Контактної групи безпосередньо на засіданні.

17. Представники структурних підрозділів Національного банку, представники інших фінансових регуляторів, банківських асоціацій, інші запрошені особи мають право брати участь у засіданнях Контактної групи як спостерігачі та/або запрошені особи.

Члени Контактної групи мають право надавати до Секретаріату пропозиції щодо запрошення осіб, участь яких може бути доцільною під час розгляду питань порядку денного.

Рішення щодо запрошення осіб або дозволу на участь у засіданні Контактної групи як спостерігача приймає Голова Контактної групи.

18. Доповідачами з питань порядку денного на засіданнях Контактної групи можуть бути як члени Контактної групи, так і запрошені особи.

19. За підсумками кожного засідання Контактної групи на Сторінці Контактної групи публікуються: порядок денний засідання, матеріали, які розглядалися (за їх наявності), а також узагальнені підсумки дискусії членів Контактної групи з відповідних питань.

20. Результати засідання Контактної групи оформляються у вигляді узагальнених підсумків дискусії членів Контактної групи (далі – Узагальнені підсумки дискусії). У документі коротко викладаються зміст доповідей членів Контактної групи і запрошених осіб, а також коментарі та зауваження, висловлені під час обговорення.

Узгодження Узагальнених підсумків дискусії відбувається за принципом мовчазної згоди – вони є погодженими, якщо до визначеного Національним банком терміну зауваження та пропозиції не надійшли.

Узагальнені підсумки дискусії після погодження їх тексту із членами Контактної групи публікуються на Сторінці Контактної групи.

Директор Департаменту
відкритих ринків

Сергій ПОНОМАРЕНКО

ПОГОДЖЕНО
Заступник Голови
Національного банку України

_____ О. ЧУРІЙ

_____ 2020 року

Додаток
до Положення про Контактну
групу грошового та
валютного ринків
(пункт 11 розділу II)

Розрахунок загального рейтингу банку

1. Формула, за якою розраховується загальний рейтинг банку:

$$R = \sum_{i=1}^3 w_i * x_i; \quad \sum_{i=1}^3 w_i = 1,$$

де R – загальний рейтинг банку (найменше значення є найкращим);

x_1 – місце банку в рейтингу банків, визначене за обсягами операцій із купівлі і продажу іноземної валюти з іншими банками та Національним банком, за винятком обсягу валютних операцій на умовах “своп”, за даними статистичної звітності банків (місця в рейтингу банків визначаються від найбільшого до найменшого обсягу операцій, найбільшому обсягу операцій відповідає перше місце);

x_2 – місце банку в рейтингу банків, визначене за обсягами його операцій на міжбанківському грошовому ринку, до яких для цілей цього Положення включаються операції з іншими банками з надання/отримання кредитів та розміщення/залучення депозитів, а також із купівлі та продажу іноземної валюти на умовах “своп” за даними форм статистичної звітності банків (місця в рейтингу банків визначаються від найбільшого до найменшого обсягу операцій, найбільшому обсягу операцій відповідає перше місце);

x_3 – місце банку в рейтингу банків, визначене за обсягом активів банку станом на перший робочий день поточного року (місця в рейтингу банків визначаються від найбільшого до найменшого обсягу активів, найбільшому обсягу активів відповідає перше місце);

w_1, w_2, w_3 – питома вага відповідного рейтингу банків, w_1 та w_2 дорівнює 0,4, w_3 дорівнює 0,2.

*(абзац п'ятий пункту 1 у редакції постанови Правління
Національного банку України
від 13.04.2020 № 48)*

2. Під час визначення місць банків у рейтингах, за якими визначаються складові x_1, x_2 або x_3 , банкам, що мають однакове значення відповідного показника (обсяг операцій із купівлі та продажу іноземної валюти з іншими

банками та Національним банком або обсяг операцій на міжбанківському грошовому ринку, або обсяг активів), присвоюється однакове місце у відповідному рейтингу, яке дорівнює найменшому можливому для цих банків місцю в рейтингу. Місце в рейтингу наступного за ними банку зменшенню не підлягає.

3. Якщо 25 місце у загальному рейтингу банків мають кілька банків, то до переліку банків, що мають право пропонувати експертів до складу Контактної групи, включається той із цих банків, який має найбільший обсяг операцій із купівлі та продажу іноземної валюти з іншими банками та Національним банком.

Директор Департаменту
відкритих ринків

Сергій ПОНОМАРЕНКО

*(додаток зі змінами згідно з постановою Правління
Національного банку України
від 13.04.2020 № 48)*