



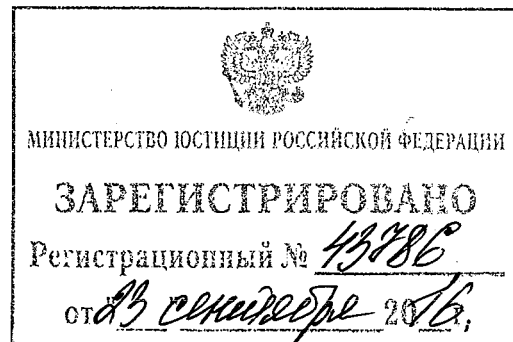
**ЦЕНТРАЛЬНЫЙ БАНК РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
(БАНК РОССИИ)**

« 16 » августа 2016 г.

№ 4104-У

г. Москва

У К А З А Н И Е



О видах договоров, заключенных не на организованных торгах, информация о которых предоставляется в репозиторий, лицах, предоставляющих в репозиторий информацию о таких договорах, порядке, составе, форме и сроках предоставления ими информации в репозиторий, дополнительных требованиях к порядку ведения репозитарием реестра договоров, порядке и сроках предоставления информации репозитарием, а также порядке, составе, форме и сроках предоставления репозитарием в Банк России реестра договоров

Настоящее Указание на основании пункта 1 статьи 15⁵, пункта 1 статьи 15⁷, пунктов 1, 5, 7, 8 и 10 статьи 15⁸ Федерального закона от 22 апреля 1996 года № 39-ФЗ «О рынке ценных бумаг» (Собрание законодательства Российской Федерации, 1996, № 17, ст. 1918; 2001, № 33, ст. 3424; 2002, № 52, ст. 5141; 2004, № 27, ст. 2711; № 31, ст. 3225; 2005, № 11, ст. 900; № 25, ст. 2426; 2006, № 1, ст. 5; № 2, ст. 172; № 17, ст. 1780; № 31, ст. 3437; № 43, ст. 4412; 2007, № 1, ст. 45; № 18, ст. 2117; № 22, ст. 2563; № 41, ст. 4845; № 50, ст. 6247; 2008, № 52, ст. 6221; 2009, № 1, ст. 28; № 18, ст. 2154; № 23, ст. 2770; № 29, ст. 3642; № 48, ст. 5731; № 52, ст. 6428; 2010, № 17, ст. 1988; № 31, ст. 4193; № 41, ст. 5193; 2011, № 7,

ст. 905; № 23, ст. 3262; № 29, ст. 4291; № 48, ст. 6728; № 49, ст. 7040; № 50, ст. 7357; 2012, № 25, ст. 3269; № 31, ст. 4334; № 53, ст. 7607; 2013, № 26, ст. 3207; № 30, ст. 4043, ст. 4082, ст. 4084; № 51, ст. 6699; № 52, ст. 6985; 2014, № 30, ст. 4219; 2015, № 1, ст. 13; № 14, ст. 2022; № 27, ст. 4001; № 29, ст. 4348, ст. 4357; 2016, № 1, ст. 50, ст. 81; № 27, ст. 4225) (далее – Федеральный закон «О рынке ценных бумаг») определяет:

виды договоров, заключенных не на организованных торгах, информация о которых предоставляется в репозитарий;

лиц, предоставляющих в репозитарий информацию о таких договорах, и порядок, состав, форму и сроки предоставления ими информации в репозитарий;

дополнительные требования к порядку ведения репозитарием реестра договоров;

порядок и сроки предоставления информации репозитарием;

порядок, состав, форму и сроки предоставления репозитарием в Банк России реестра договоров.

1. В соответствии с пунктом 1 статьи 15⁵ и пунктом 1 статьи 15⁸ Федерального закона «О рынке ценных бумаг» предоставлению в репозитарий подлежит информация о следующих видах договоров, заключенных не на организованных торгах:

о договоре репо;

о договоре, являющемся производным финансовым инструментом;

о договоре, предусматривающем обязанность одной стороны передать валюту в собственность другой стороне и обязанность другой стороны принять и оплатить валюту, а также обязанность другой стороны передать валюту в собственность первой стороне и обязанность первой стороны принять и оплатить валюту. При этом такой договор не предусматривает иных обязанностей сторон по уплате или передаче валюты (денежных средств).

Если договоры, указанные в настоящем пункте, заключены на условиях генерального соглашения (единого договора) (далее – генеральное соглашение), то в соответствии с пунктом 2 статьи 15⁸ Федерального закона «О рынке ценных бумаг» одновременно с предоставлением информации о таких договорах в репозиторий предоставляется информация о генеральном соглашении.

2. Предоставлять информацию в репозиторий обязаны следующие юридические лица, созданные в соответствии с законодательством Российской Федерации, являющиеся стороной договора, указанного в пункте 1 настоящего Указания:

- кредитные организации;
- брокеры;
- дилеры;
- управляющие;
- депозитарии;
- регистраторы;
- негосударственные пенсионные фонды;
- управляющие компании инвестиционных фондов, паевых инвестиционных фондов и негосударственных пенсионных фондов;
- акционерные инвестиционные фонды;
- организаторы торговли;
- клиринговые организации;
- страховые организации.

3. Юридические лица, не указанные в пункте 2 настоящего Указания, созданные в соответствии с законодательством Российской Федерации, являющиеся сторонами договоров, указанных в пункте 1 настоящего Указания, заключенных с 1 ноября 2016 года, обязаны предоставлять информацию в репозиторий о каждом из таких договоров, если второй стороной такого договора является юридическое лицо, не указанное

в пункте 2 настоящего Указания, при выполнении любого из следующих условий:

если сумма обязательств из такого договора на дату заключения в рублях или эквиваленте в иностранной валюте, рассчитанном по официальному курсу иностранной валюты по отношению к рублю, установленному Банком России, превышает 1 миллиард рублей;

если сумма обязательств из совокупности таких договоров на конец каждого из трех месяцев подряд (далее – расчетный период) составляет не менее 10 миллиардов рублей или эквивалента в иностранной валюте, рассчитанного по официальному курсу иностранной валюты по отношению к рублю, установленному Банком России на дату расчета (далее – пороговое значение);

если такие договоры заключены с первого числа месяца, следующего за расчетным периодом, в рамках которого были достигнуты пороговые значения.

4. Информация о договоре, указанном в пункте 1 настоящего Указания, предоставляется в репозитарий лицами, указанными в пунктах 2 и 3 настоящего Указания, не позднее трех рабочих дней с даты заключения, изменения или прекращения такого договора, за исключением случаев предоставления в репозитарий информации по основанию, предусмотренному абзацем третьим пункта 3 настоящего Указания.

В случае предоставления в репозитарий информации по основанию, предусмотренному абзацем третьим пункта 3 настоящего Указания, информация предоставляется в репозитарий в течение месяца, следующего за расчетным периодом. При этом в случае изменения или прекращения такого договора после истечения расчетного периода информация о его изменении или прекращении предоставляется в репозитарий в сроки, указанные в абзаце первом настоящего пункта, с одновременным предоставлением информации о заключении такого договора, в случае если информация о заключении

такого договора не была предоставлена ранее.

5. Сторона договора, указанного в пункте 1 настоящего Указания, вправе привлечь для исполнения своей обязанности по предоставлению информации в репозитарий другую сторону такого договора или третье лицо, именуемое для целей настоящего Указания информирующим лицом.

6. Информация об одном договоре, указанном в пункте 1 настоящего Указания, а также совокупности таких договоров, заключенных на условиях одного генерального соглашения, предоставляется в один репозитарий.

7. Информация о договоре, указанном в пункте 1 настоящего Указания, предоставляется в репозитарий в электронной форме в форматах, предусмотренных договором об оказании репозитарных услуг, а в случаях, предусмотренных договором об оказании репозитарных услуг, – на бумажном носителе.

8. Информация о договоре, указанном в пункте 1 настоящего Указания, предоставляется в репозитарий в составе, предусмотренном приложениями 1–7 к настоящему Указанию, в соответствии с порядком предоставления отдельных сведений в репозитарий, приведенном в приложении 8 к настоящему Указанию.

9. Реестр договоров, ведение которого осуществляется репозитарием, состоит из трех разделов и ведется в электронной форме при условии обеспечения возможности предоставления содержащейся в нем информации на бумажных носителях.

10. В раздел 1 реестра договоров вносится запись о полученном репозитарием сообщении, содержащем информацию о договоре, указанном в пункте 1 настоящего Указания, и (или) генеральном соглашении (далее – сообщение).

Запись в раздел 1 реестра договоров вносится репозитарием не позднее рабочего дня, следующего за днем получения сообщения.

11. Запись в разделе 1 реестра договоров должна содержать:

наименование сообщения и порядковый номер, присваиваемый ему последовательно по времени регистрации (входящий номер);

дату и время внесения в раздел 1 реестра договоров записи о сообщении; порядковый номер (исходящий номер) и дату отправления сообщения (при наличии);

исходящий номер ответа (при наличии) на полученное сообщение и дату его предоставления.

12. В раздел 2 реестра договоров вносится запись, содержащая информацию согласно таблицам 1 и 2 приложения 1 к настоящему Указанию, а также запись, содержащая информацию, относящуюся к соответствующему виду договора согласно таблицам 3–8 приложения 1 и приложениям 2–7 к настоящему Указанию.

Внесение записи в раздел 2 реестра договоров осуществляется репозитарием не позднее рабочего дня, следующего за днем получения сообщения.

Для целей настоящего пункта днем получения сообщения является:

в случае если по соглашению сторон договора, указанного в пункте 1 настоящего Указания, сообщение предоставляется одной стороной, – день получения сообщения от такой стороны;

в случае если по соглашению сторон договора, указанного в пункте 1 настоящего Указания, сообщения предоставляются каждой стороной, – день получения сообщения от второй стороны при условии совпадения информации, предоставленной в сообщениях, полученных от каждой из сторон такого договора;

при внесении записи о генеральном соглашении – день получения сообщения от стороны генерального соглашения независимо от факта

получения репозитарием сообщения от второй стороны.

Информация, указанная в настоящем пункте, может предоставляться в репозитарий на иностранном языке, если договор, о котором предоставляется информация, составлен на иностранном языке.

13. Репозитарий отказывает во внесении записи, содержащей информацию о договоре, указанном в пункте 1 настоящего Указания, при нарушении следующих требований:

предоставление в репозитарий сообщения, содержащего информацию о договоре, заключенном на условиях генерального соглашения, должно осуществляться с одновременным предоставлением в репозитарий информации о соответствующем генеральном соглашении;

сообщение должно быть получено репозитарием от лица, являющегося стороной договора или информирующим лицом;

в сообщении должен содержаться международный код идентификации юридического лица – стороны договора, указанного в пункте 1 настоящего Указания, обязанной предоставлять информацию в репозитарий, а также информирующего лица (в случае его привлечения);

сообщение не может предоставляться для изменения уникального кода идентификации договора;

в сообщении должен содержаться уникальный код идентификации договора;

сообщение не должно содержать уникальный код идентификации договора, содержащийся в записи, ранее внесенной в раздел 2 реестра договоров, за исключением случаев, когда сообщение, содержащее уникальный код идентификации договора, предоставлено с целью изменения информации о договоре, указанном в пункте 1 настоящего Указания, запись о котором была внесена в раздел 2 реестра договоров ранее;

сообщение должно быть составлено в соответствии с требованиями, предусмотренными правилами осуществления репозитарной деятельности.

14. Репозитарий фиксирует информацию о внесении записи в раздел 2 реестра договоров, а также об отказе во внесении записи в реестр договоров в разделе 3 реестра договоров.

Фиксация информации о внесении записи в раздел 2 реестра договоров или отказа во внесении записи в реестр договоров осуществляется одновременно с внесением записи в раздел 2 реестра договоров или отказом во внесении записи в реестр договоров соответственно.

15. Запись в разделе 3 реестра договоров должна содержать:

международный код идентификации юридического лица – стороны договора, указанного в пункте 1 настоящего Указания, обязанной предоставлять информацию в репозитарий, а также информирующего лица;

дату, время и номер записи, внесенной в раздел 2 реестра договоров, или дату уведомления об отказе во внесении записи в реестр договоров;

вид записи в разделе 2 реестра договоров (внесение записи или изменение ранее внесенной записи);

информацию о факте внесения записи в раздел 2 реестра договоров или основание для отказа во внесении записи в реестр договоров;

уникальный код идентификации договора.

16. Репозитарий не позднее рабочего дня, следующего за днем внесения записи в раздел 2 реестра договоров (отказа во внесении записи в реестр договоров), предоставляет сообщение, содержащее информацию, внесенную в раздел 2 реестра договоров (об отказе во внесении записи в реестр договоров), в порядке, предусмотренном договором об оказании репозитарных услуг.

17. В случае отказа репозитария во внесении записи в реестр договоров в репозитарий может быть предоставлено новое сообщение не позднее трех рабочих дней со дня получения сообщения, содержащего информацию об отказе во внесении записи в реестр договоров, за исключением отказа при нарушении требований, предусмотренных абзацами пятым и шестым

пункта 13 настоящего Указания. При этом установленные пунктом 4 настоящего Указания сроки предоставления информации в репозиторий считаются соблюденными, за исключением случая повторного отказа репозитария во внесении записи в реестр договоров.

18. Возражения по внесенной в раздел 2 реестра договоров информации могут быть предоставлены в репозиторий не позднее трех рабочих дней, следующих за днем получения сообщения, содержащего информацию, внесенную в раздел 2 реестра договоров.

19. Репозиторий рассматривает возражения по внесенной в раздел 2 реестра договоров записи не позднее одного рабочего дня со дня их получения и вносит соответствующие изменения или предоставляет мотивированный отказ.

20. При ведении реестра договоров репозиторий обязан обеспечить хранение и защиту информации, внесенной в реестр договоров, в том числе путем обязательного создания резервной копии реестра договоров и определения процедур, направленных на предотвращение технических сбоев и ошибок, а также предотвращение доступа к реестру договоров неуполномоченных лиц.

21. Для ведения реестра договоров репозиторий обеспечивает использование программно-технических средств, которые должны позволять предоставлять информацию о внесении записи на любой момент времени, а также формировать документы, содержащие внесенные записи обо всех или отдельных договорах, на любой момент или за любой период времени.

22. Репозиторий обязан предоставлять в Банк России реестр договоров в составе, предусмотренном настоящим Указанием, каждый рабочий день месяца по состоянию на конец операционного дня, предшествующего дню предоставления реестра договоров, в электронной форме в формате XML (eXtensible Markup Language), FpML (Financial products Markup Language) либо путем организации бесперебойного защищенного доступа Банка России

к таблицам базы данных репозитария.

23. Репозитарий обязан предоставлять информацию о внесении записи в реестр договоров по письменному запросу лиц, указанных в пункте 8 статьи 15⁸ Федерального закона «О рынке ценных бумаг», в электронном виде и (или) на бумажных носителях в срок, не превышающий пяти рабочих дней со дня поступления в репозитарий соответствующего запроса.

24. Настоящее Указание вступает в силу по истечении 10 дней после дня его официального опубликования.

25. Со дня вступления в силу настоящего Указания признать утратившими силу:

Указание Банка России от 30 апреля 2014 года № 3253-У «О порядке ведения реестра договоров, заключенных на условиях генерального соглашения (единого договора), сроках предоставления информации, необходимой для ведения указанного реестра, и информации из указанного реестра, а также предоставления реестра договоров, заключенных на условиях генерального соглашения (единого договора), в Центральный банк Российской Федерации (Банк России)», зарегистрированное Министерством юстиции Российской Федерации 26 мая 2014 года № 32434 («Вестник Банка России» от 4 июня 2014 года № 52);

Указание Банка России от 17 сентября 2014 года № 3382-У «О внесении изменений в Указание Банка России от 30 апреля 2014 года № 3253-У «О порядке ведения реестра договоров, заключенных на условиях генерального соглашения (единого договора), сроках предоставления информации, необходимой для ведения указанного реестра, и информации из указанного реестра, а также предоставления реестра договоров, заключенных на условиях генерального соглашения (единого договора), в Центральный банк Российской Федерации (Банк России)», зарегистрированное Министерством юстиции Российской Федерации 24 сентября 2014 года № 34120 («Вестник Банка России» от 1 октября 2014 года № 87);

Указание Банка России от 16 февраля 2015 года № 3567-У «О внесении изменений в Указание Банка России от 30 апреля 2014 года № 3253-У «О порядке ведения реестра договоров, заключенных на условиях генерального соглашения (единого договора), сроках предоставления информации, необходимой для ведения указанного реестра, и информации из указанного реестра, а также предоставления реестра договоров, заключенных на условиях генерального соглашения (единого договора), в Центральный банк Российской Федерации (Банк России)», зарегистрированное Министерством юстиции Российской Федерации 27 марта 2015 года № 36574 («Вестник Банка России» от 31 марта 2015 года № 28);

Указание Банка России от 7 сентября 2015 года № 3776-У «О внесении изменений в Указание Банка России от 30 апреля 2014 года № 3253-У «О порядке ведения реестра договоров, заключенных на условиях генерального соглашения (единого договора), сроках предоставления информации, необходимой для ведения указанного реестра, и информации из указанного реестра, а также предоставления реестра договоров, заключенных на условиях генерального соглашения (единого договора), в Центральный банк Российской Федерации (Банк России)», зарегистрированное Министерством юстиции Российской Федерации 25 сентября 2015 года № 39001 («Вестник Банка России» от 30 сентября 2015 года № 82);

Указание Банка России от 18 апреля 2016 года № 4001-У «О внесении изменений в Указание Банка России от 30 апреля 2014 года № 3253-У «О порядке ведения реестра договоров, заключенных на условиях генерального соглашения (единого договора), сроках предоставления информации, необходимой для ведения указанного реестра, и информации из указанного реестра, а также предоставления реестра договоров, заключенных на условиях генерального соглашения (единого договора), в Центральный банк Российской Федерации (Банк России)», зарегистрированное Министерством юстиции Российской Федерации

Федерации 18 мая 2016 года № 42138 («Вестник Банка России» от 25 мая 2016 года № 48).

И.о. Председателя
Центрального банка
Российской Федерации

Д.В. Тулин

Приложение 1

к Указанию Банка России

от «16» августа 2016 года № 4104 -У

«О видах договоров, заключенных не на организованных торгах, информация о которых предоставляется в репозитарий, лицах, предоставляющих в репозитарий информацию о таких договорах, порядке, составе, форме и сроках предоставления ими информации в репозитарий, дополнительных требованиях к порядку ведения репозитарием реестра договоров, порядке и сроках предоставления информации репозитарием, а также порядке, составе, форме и сроках предоставления репозитарием в Банк России реестра договоров»

Информация о договоре, подлежащая предоставлению в репозитарий

Таблица 1. Информация о генеральном соглашении

Номер строки	Вид информации	Описание
1	2	3
1	Идентификационный код генерального соглашения	Указывается уникальный код идентификации договора
2	Дата и время внесения информации о генеральном соглашении в раздел 2 реестра договоров	Указываются дата и время внесения записи о генеральном соглашении в раздел 2 реестра договоров в формате ГТТГ-ММ-ДДТЧ:ММ:СС
3	Примерные условия договора (форма генерального соглашения)	Указываются наименование организации, разработавшей и опубликовавшей примерные условия договора или форму генерального соглашения, индивидуальное обозначение указанных документов либо указывается, что форма генерального соглашения разработана сторонами самостоятельно
4	Тип кода стороны 1	Указывается тип кода стороны генерального

		соглашения в соответствии с приоритетом использования кодов для идентификации сторон договора (генерального соглашения) согласно приложению 8 к настоящему Указанию
5	Код стороны 1	Указывается значение кода идентификации стороны генерального соглашения
6	Наименование стороны 1	Указывается полное фирменное наименование юридического лица или фамилия, имя и отчество (при наличии последнего) физического лица
7	Код страны стороны 1	Указывается код страны
8	Вид экономической деятельности стороны 1	ССР – центральный контрагент; СІ – кредитная организация; В – брокер; D – дилер; Т – управляющие; МС – управляющие компании инвестиционного фонда, паевого инвестиционного фонда и негосударственного пенсионного фонда; Dep – депозитарии; R – регистраторы; PF – негосударственные пенсионные фонды; IF – акционерные инвестиционные фонды; ТА – организаторы торговли; СС – клиринговые организации; I – страховые организации; Other – прочие виды экономической деятельности
9	Тип кода стороны 2	Указывается тип кода стороны генерального соглашения в соответствии с приоритетом использования кодов для идентификации сторон договора (генерального соглашения) согласно приложению 8 к настоящему Указанию
10	Код стороны 2	Указывается значение кода идентификации стороны генерального соглашения

11	Наименование стороны 2	Указывается полное фирменное наименование юридического лица или фамилия, имя и отчество (при наличии последнего) физического лица
12	Код страны стороны 2	Указывается код страны
13	Вид экономической деятельности стороны 2	ССР – центральный контрагент; СІ – кредитная организация; В – брокер; D – дилер; Т – управляющие; МС – управляющие компании инвестиционного фонда, паевого инвестиционного фонда и негосударственного пенсионного фонда; Dep – депозитарии; R – регистраторы; PF – негосударственные пенсионные фонды; IF – акционерные инвестиционные фонды; ТА – организаторы торговли; СС – клиринговые организации; I – страховые организации; Other – прочие виды экономической деятельности
14	Код информирующего лица стороны 1	Указывается международный код идентификации юридического лица
15	Наименование информирующего лица стороны 1	Указывается полное фирменное наименование юридического лица
16	Код информирующего лица стороны 2	Указывается международный код идентификации юридического лица
17	Наименование информирующего лица стороны 2	Указывается полное фирменное наименование юридического лица
18	Аффилированность стороны 1 и стороны 2	Y – стороны являются аффилированными; N – стороны не являются аффилированными

Таблица 2. Общая информация о договоре

Номер строки	Виды информации	Описание
1	2	3
1	Идентификационный код договора	Указывается уникальный код идентификации договора
2	Идентификационный код генерального соглашения	Указывается уникальный код идентификации генерального соглашения. Если договор заключен не на условиях генерального соглашения, поле остается пустым
3	Дата и время поступления информации о договоре в репозитарий	Указываются дата и время регистрации сообщения в разделе 1 реестра договоров в формате ГГГГ-ММ-ДДТЧЧ:ММ:СС
4	Дата и время внесения записи о договоре в раздел 2 реестра договоров	Указываются дата и время внесения записи о договоре в раздел 2 реестра договоров в формате ГГГГ-ММ-ДДТЧЧ:ММ:СС
5	Код состояния обязательств по договору	R – исключение записи о заключении договора ввиду ошибочного внесения в раздел 2 реестра договоров или признания договора недействительным; N – прекращение обязательств новацией (новация отражается регистрацией нового договора); SO – прекращение обязательств зачетом (неттингом), а также по основаниям, предусмотренным статьей 4 ¹ Федерального закона от 26 октября 2002 года № 127-ФЗ «О несостоятельности (банкротстве)» (Собрание законодательства Российской Федерации, 2002, № 43, ст. 4190; 2004, № 35, ст. 3607; 2005, № 1, ст. 18, ст. 46; № 44, ст. 4471; 2006, № 30, ст. 3292; № 52, ст. 5497;

		<p>2007, № 7, ст. 834; № 18, ст. 2117; № 30, ст. 3754; № 41, ст. 4845; № 49, ст. 6079; 2008, № 30, ст. 3616; № 49, ст. 5748; 2009, № 1, ст. 4, ст. 14; № 18, ст. 2153; № 29, ст. 3632; № 51, ст. 6160; № 52, ст. 6450; 2010, № 17, ст. 1988; № 31, ст. 4188, ст. 4196; 2011, № 1, ст. 41; № 7, ст. 905; № 19, ст. 2708; № 27, ст. 3880; № 29, ст. 4301; № 30, ст. 4576; № 48, ст. 6728; № 49, ст. 7015, ст. 7024, ст. 7040, ст. 7061, ст. 7068; № 50, ст. 7351, ст. 7357; 2012, № 31, ст. 4333; № 53, ст. 7607, ст. 7619; 2013, № 23, ст. 2871; № 26, ст. 3207; № 27, ст. 3477, ст. 3481; № 30, ст. 4084; № 51, ст. 6699; № 52, ст. 6975, ст. 6984; 2014, № 11, ст. 1095, ст. 1098; № 30, ст. 4217; № 49, ст. 6914; № 52, ст. 7543; 2015, № 1, ст. 10, ст. 11, ст. 29, ст. 35; № 27, ст. 3945, ст. 3958, ст. 3967, ст. 3977; № 29, ст. 4350, ст. 4355, ст. 4362; 2016, № 1, ст. 27; № 23, ст. 3296; № 27, ст. 4225, ст. 4293);</p> <p>ССР – прекращение обязательств заменой новым обязательством между каждой из сторон первоначального обязательства и центральным контрагентом;</p> <p>T – прекращение обязательств надлежащим исполнением в срок;</p> <p>TD – прекращение обязательств надлежащим исполнением досрочно;</p> <p>D – прекращение обязательств по иным основаниям;</p> <p>W – прекращение регистрации договора в репозитории ввиду перехода клиента в другой репозиторий;</p> <p>C – исполнение обязательств просрочено;</p> <p>P – исполнение обязательств приостановлено по предусмотренным в договоре основаниям;</p> <p>E – продление срока действия договора по предусмотренным договором основаниям</p>
6	Дата заключения договора	Указывается дата заключения договора в формате ГГГГ-ММ-ДД

7	Дата вступления в силу договора	Указывается дата, определенная сторонами как дата вступления в силу договора, в формате ГГГГ-ММ-ДД, если указанная дата не совпадает с датой заключения договора. Если не применимо, поле остается пустым
8	Дата окончания срока действия договора	Указывается дата окончания срока действия договора в формате ГГГГ-ММ-ДД. В случае если договором предусмотрено продление срока его действия в результате наступления соответствующего обстоятельства или события, этот срок не учитывается при указании даты окончания срока действия договора
9	Тип кода продавца по договору	Указывается тип кода продавца по договору в соответствии с приоритетом использования кодов для идентификации сторон договора (генерального соглашения) согласно приложению 8 к настоящему Указанию
10	Код продавца по договору	Указывается код, позволяющий идентифицировать лицо, определенное сторонами как продавец по договору. Если не применимо, поле остается пустым
11	Наименование продавца по договору	Полное фирменное наименование юридического лица или фамилия, имя и отчество (при наличии последнего) физического лица
12	Тип кода покупателя по договору	Указывается тип кода покупателя по договору в соответствии с приоритетом использования кодов для идентификации сторон договора (генерального соглашения) согласно приложению 8 к настоящему Указанию
13	Код покупателя по договору	Указывается код, позволяющий идентифицировать лицо, определенное сторонами как покупатель по договору. Если не применимо, поле остается пустым
14	Наименование покупателя по договору	Полное фирменное наименование юридического лица или фамилия, имя и отчество (при наличии последнего)

		физического лица
15	Тип клиента стороны 1	<p>F – клиент является профессиональным участником рынка ценных бумаг, кредитной организацией, страховой организацией, управляющей компанией, негосударственным пенсионным фондом или иной организацией, основным видом деятельности которой является деятельность по предоставлению финансовых услуг, а также вспомогательная деятельность в сфере финансовых услуг;</p> <p>L – клиент является иным юридическим лицом;</p> <p>P – клиент является физическим лицом;</p> <p>N – договор заключен не в интересах клиента</p>
16	Тип кода клиента стороны 1	<p>Указывается тип кода клиента в соответствии с приоритетом использования кодов для идентификации сторон договора (генерального соглашения) согласно приложению 8 к настоящему Указанию.</p> <p>Если договор заключен не в интересах клиента, поле остается пустым</p>
17	Код клиента стороны 1	<p>Указывается код клиента стороны по договору, позволяющий идентифицировать клиента.</p> <p>Если договор заключен не в интересах клиента, поле остается пустым</p>
18	Наименование клиента стороны 1	<p>Полное фирменное наименование юридического лица или фамилия, имя и отчество (при наличии последнего) физического лица.</p> <p>Если договор заключен не в интересах клиента, поле остается пустым</p>
19	Код страны клиента 1	<p>Указывается код страны.</p> <p>Если договор заключен не в интересах клиента, поле остается пустым</p>
20	Тип клиента стороны 2	<p>F – клиент является профессиональным участником рынка ценных бумаг, кредитной организацией, страховой организацией, управляющей компанией, негосударственным</p>

		<p>пенсионным фондом или иной организацией, основным видом деятельности которой является деятельность по предоставлению финансовых услуг, а также вспомогательная деятельность в сфере финансовых услуг;</p> <p>L – клиент является иным юридическим лицом;</p> <p>P – клиент является физическим лицом;</p> <p>N – договор заключен не в интересах клиента</p>
21	Тип кода клиента стороны 2	<p>Указывается тип кода клиента в соответствии с приоритетом использования кодов для идентификации сторон договора (генерального соглашения) согласно приложению 8 к настоящему Указанию.</p> <p>Если договор заключен не в интересах клиента, поле остается пустым</p>
22	Код клиента стороны 2	<p>Указывается код клиента стороны по договору, позволяющий идентифицировать клиента.</p> <p>Если договор заключен не в интересах клиента, поле остается пустым</p>
23	Наименование клиента стороны 2	<p>Полное фирменное наименование юридического лица или фамилия, имя и отчество (при наличии последнего) физического лица.</p> <p>Если договор заключен не в интересах клиента, поле остается пустым</p>
24	Код страны клиента 2	<p>Указывается код страны.</p> <p>Если договор заключен не в интересах клиента, поле остается пустым</p>
25	Код брокера	<p>Если сделка заключена при посредничестве брокера, и брокер не является стороной сделки, указывается международный код идентификации юридического лица – брокера.</p> <p>Если не применимо, поле остается пустым</p>
26	Код участника клиринга	<p>Указывается международный код идентификации юридического лица – участника клиринга.</p>

		Если не применимо, поле остается пустым
27	Код типа расчетов	ОТС – внеклиринговый расчет; ССР – расчет по результатам клиринга с участием центрального контрагента; CS – расчет по результатам клиринга без участия центрального контрагента
28	Код метода расчетов	Р – поставочный; С – расчетный; Е – расчетно-поставочный, предполагающий выбор какой-либо стороной договора метода расчетов: поставочный или расчетный
29	Код клиринговой организации	Указывается международный код идентификации юридического лица – клиринговой организации. Если не применимо, поле остается пустым
30	Код центрального контрагента	Указывается международный код идентификации юридического лица – центрального контрагента. Если не применимо, поле остается пустым
31	Дата включения обязательств из договора в клиринговый пул	Указывается дата включения обязательств из договора в клиринговый пул в формате ГГГГ-ММ-ДД. Если не применимо, поле остается пустым
32	Обязанность централизованного клиринга	Y – договор подлежит обязательному клирингу с участием центрального контрагента; N – договор не подлежит обязательному клирингу с участием центрального контрагента
33	Дата и время клиринга	Указываются дата и время клиринга обязательств из договора формате ГГГГ-ММ-ДДТЧ:ММ:СС. Если не применимо, поле остается пустым
34	Дата включения договора в портфель договоров	Указывается дата включения договора в портфель договоров в формате ГГГГ-ММ-ДД. Если не применимо, поле остается пустым

35	Дата исключения договора из портфеля договоров	Указывается дата исключения договора из портфеля договоров в формате ГГГ-ММ-ДД. Если не применимо, поле остается пустым
36	Код информирующего лица стороны 1	Указывается международный код идентификации юридического лица. В случае если договор заключен на условиях генерального соглашения, поле остается пустым
37	Наименование информирующего лица стороны 1	Указывается полное фирменное наименование юридического лица. В случае если договор заключен на условиях генерального соглашения, поле остается пустым
38	Код информирующего лица стороны 2	Указывается международный код идентификации юридического лица. В случае если договор заключен на условиях генерального соглашения, поле остается пустым
39	Наименование информирующего лица стороны 2	Указывается полное фирменное наименование юридического лица. В случае если договор заключен на условиях генерального соглашения, поле остается пустым
40	Аффилированность стороны 1 и стороны 2	Y – стороны являются аффилированными; N – стороны не являются аффилированными. В случае если договор заключен на условиях генерального соглашения, поле остается пустым

Таблица 3. Информация об условиях опционного договора (далее – опцион)

Номер строки	Вид информации	Описание
1	2	3
1	Идентификационный код договора	Указывается уникальный код идентификации договора

2	Код классификации	Указывается код в соответствии с приложением 3 к настоящему Указанию
3	Код взаимосвязи	Указывается код в соответствии с приложением 6 к настоящему Указанию
4	Дата исполнения опциона	Указывается дата, на которую покупатель опциона вправе требовать исполнения по опциону (для европейского опциона), в формате ГГГГ-ММ-ДДТЧЧ:ММ:СС
5	Срок осуществления права на исполнение опциона	Указывается период, в который покупатель опциона вправе требовать исполнения по опциону (для американского и бермудского опциона), в формате с ГГГГ-ММ-ДДТЧЧ:ММ:СС по ГГГГ-ММ-ДДТЧЧ:ММ:СС
6	Код базисного актива	Указывается код базисного актива в соответствии с приложением 7 к настоящему Указанию
7	Единица измерения базисного актива	Указывается единица измерения базисного актива согласно опциону (например, штуки, тонны, баррели, литры), за исключением валюты
8	Количество базисного актива	Указывается числовое значение в единицах измерения базисного актива (в случае если заполнение поля невозможно, заполняется поле «Номинальная сумма базисного актива»)
9	Номинальная сумма базисного актива	Указывается числовое значение. В случае если базисным активом является валюта, указывается сумма в валюте, по отношению к единице которой устанавливается цена исполнения. Заполняется одно из полей: «Количество базисного актива» или «Номинальная сумма базисного актива»
10	Код валюты, в которой выражается номинальная сумма базисного актива	Код Общероссийского классификатора валют ОК (МК (ИСО 4217) 003-97) 014-2000, принятого Постановлением Госстандарта России от 25 декабря 2000 года № 405-ст (далее – код ОКВ)

11	Цена (премия) опциона	Указывается числовое значение в валюте, в которой выражается цена (премия) опциона
12	Код валюты, в которой выражается цена (премия) опциона	Код ОКВ (буквенный)
13	Цена исполнения опциона	Указывается числовое значение в валюте за единицу базисного актива, в которой выражается цена исполнения опциона. В случае если базисным активом является валюта, указывается количество одной валюты за единицу другой валюты
14	Период исполнения средней цены опциона	Для азиатского опциона указывается период, за который определяется средняя цена базисного актива опциона (если условиями азиатского опциона предусмотрены дискретные даты, за которые определяется средняя цена, указываются первая и последняя дата), в формате с ГГГГ-ММ-ДДТЧЧ:ММ:СС по ГГГГ-ММ-ДДТЧЧ:ММ:СС
15	Код валюты, в которой выражается цена исполнения опциона	Код ОКВ (буквенный). Если не применимо, поле остается пустым
16	Сумма платежа	Указывается сумма платежа по бинарному опциону – числовое значение в валюте, в которой выражается указанная сумма
17	Код валюты, в которой выражается сумма платежа	Код ОКВ (буквенный)
18	Тип барьерного условия	Указывается тип барьерного условия: отлагательное или отменительное. Если не применимо, поле остается пустым
19	Идентификатор барьерного условия	R – процентная ставка; EX – курс
20	Барьерная цена	Указывается барьерная цена (курс,

	(курс, процентная ставка)	процентная ставка), с достижением которой стороны связали возникновение у покупателя опциона права для отлагательного условия (утрату покупателем опциона права для отменительного условия) требовать от продавца исполнения опциона
21	Код валюты, в которой выражается барьерная цена	Код ОКВ (буквенный)

Таблица 4. Информация об условиях своп-договора (за исключением кредитного свопа) (далее – своп)

Номер строки	Вид информации	Описание
1	2	3
1	Идентификационный код договора	Указывается уникальный код идентификации договора
2	Код классификации	Указывается код в соответствии с приложением 3 к настоящему Указанию
3	Код взаимосвязи	Указывается код в соответствии с приложением 6 к настоящему Указанию
4	Тип кода стороны 1	Указывается тип кода в соответствии с приоритетом использования кодов для идентификации сторон договора (генерального соглашения) согласно приложению 8 к настоящему Указанию
5	Код стороны 1	Указывается код, позволяющий идентифицировать сторону договора
Платежи доходности по ставке		
6	Номинальная сумма стороны 1	Указывается размер номинала свопа в валюте, в которой выражен номинал
7	Код валюты, в которой выражена номинальная сумма	Код ОКВ (буквенный)

8	Код амортизации (повышения) номинальной суммы	Указывается код в соответствии с приложением 4 к настоящему Указанию
9	Код амортизации (повышения) ставки	Указывается код в соответствии с приложением 4 к настоящему Указанию
10	Фиксированная ставка, в процентах	Указывается фиксированная процентная ставка
11	Максимальная ставка, в процентах	Указывается верхний предел процентной ставки
12	Минимальная ставка, в процентах	Указывается нижний предел процентной ставки
13	Периодичность платежей	Указывается код в соответствии с приложением 5 к настоящему Указанию
Поставка базисного актива		
14	Код базисного актива	Указывается код базисного актива в соответствии с приложением 7 к настоящему Указанию
15	Единица измерения базисного актива	Указывается единица измерения базисного актива согласно договору (например, штуки, тонны, баррели, литры), за исключением валюты
16	Количество базисного актива	Указывается числовое значение в единицах измерения базисного актива (в том случае, если заполнение поля невозможно, заполняется поле «Номинальная сумма базисного актива»)
17	Код валюты, в которой выражена номинальная сумма базисного актива	Код ОКВ (буквенный)
18	Номинальная сумма базисного актива	Указывается числовое значение. В случае если базисным активом является валюта, указывается сумма в валюте, по отношению к единице которой устанавливается цена исполнения. Заполняется одно из полей: «Количество

		базисного актива» или «Номинальная сумма базисного актива»
19	Дата поставки	Указывается дата поставки в формате ГГГГ-ММ-ДД. Заполняется одно из полей: «Дата поставки» или «Период поставки»
20	Период поставки	Указывается период поставки в формате с ГГГГ-ММ-ДД по ГГГГ-ММ-ДД. Заполняется одно из полей: «Дата поставки» или «Период поставки»
Платежи плавающих индексированных сумм		
21	Код базисного актива	Указывается код базисного актива в соответствии с приложением 7 к настоящему Указанию
22	Единица измерения базисного актива	Указывается единица измерения базисного актива согласно договору (например, штуки, тонны, баррели, литры), за исключением валюты
23	Количество базисного актива	Указывается числовое значение в единицах измерения базисного актива (в том случае, если заполнение поля невозможно, заполняется поле «Номинальная сумма базисного актива»)
24	Номинальная сумма сделки на первую дату расчетов	Указывается размер номинальной суммы сделки в валюте, в которой выражена эта сумма, на первую дату расчетов
25	Код валюты, в которой выражена номинальная сумма сделки	Код ОКВ (буквенный)
26	Код амортизации (повышения) номинальной суммы	Указывается код в соответствии с приложением 4 к настоящему Указанию и (или) код «NAR», если пересчет номинальной суммы сделки осуществляется с учетом индексированной суммы
27	Первоначальная цена на дату заключения	Указывается первоначальная цена на дату заключения договора

	договора	
28	Периодичность переоценки базисного актива	Указывается код в соответствии с приложением 5 к настоящему Указанию
29	Тип кода стороны 2	Указывается тип кода в соответствии с приоритетом использования кодов для идентификации сторон договора (генерального соглашения) согласно приложению 8 к настоящему Указанию
30	Код стороны 2	Указывается код, позволяющий идентифицировать сторону договора
Платежи доходности по ставке		
31	Номинальная сумма стороны 2	Указывается размер номинала свопа в валюте, в которой выражен номинал
32	Код валюты, в которой выражена номинальная сумма	Код ОКВ (буквенный)
33	Код амортизации (повышения) номинальной суммы	Указывается код в соответствии с приложением 4 к настоящему Указанию
34	Код амортизации (повышения) ставки	Указывается код в соответствии с приложением 4 к настоящему Указанию
35	Фиксированная ставка, в процентах	Указывается фиксированная процентная ставка
36	Максимальная ставка	Указывается верхний предел процентной ставки
37	Минимальная ставка	Указывается нижний предел процентной ставки
Поставка базисного актива		
38	Код базисного актива	Указывается код базисного актива в соответствии с приложением 7 к настоящему Указанию
39	Единица измерения базисного актива	Указывается единица измерения базисного актива согласно договору (например, штуки,

		тонны, баррели, литры), за исключением валюты
40	Количество базисного актива	Указывается числовое значение в единицах измерения базисного актива (в том случае, если заполнение поля невозможно, заполняется поле «Номинальная сумма базисного актива»)
41	Код валюты, в которой выражена номинальная сумма базисного актива	Код ОКВ (буквенный)
42	Номинальная сумма базисного актива	Указывается числовое значение. В случае если базисным активом является валюта, указывается сумма в валюте, по отношению к единице которой устанавливается цена исполнения. Заполняется одно из полей: «Количество базисного актива» или «Номинальная сумма базисного актива»
43	Дата поставки	Указывается дата поставки в формате ГГГГ-ММ-ДД. Заполняется одно из полей: «Дата поставки» или «Период поставки»
44	Период поставки	Указывается период поставки в формате с ГГГГ-ММ-ДД по ГГГГ-ММ-ДД. Заполняется одно из полей: «Дата поставки» или «Период поставки»
Платежи плавающих индексированных сумм		
45	Код базисного актива	Указывается код базисного актива в соответствии с приложением 7 к настоящему Указанию
46	Единица измерения базисного актива	Указывается единица измерения базисного актива согласно договору (например, штуки, тонны, баррели, литры), за исключением валюты
47	Количество базисного актива	Указывается числовое значение в единицах измерения базисного актива (в том случае, если заполнение поля невозможно, заполняется поле «Номинальная сумма

		сделки на первую дату расчетов»)
48	Номинальная сумма сделки на первую дату расчетов	Указывается оговоренный размер номинальной суммы сделки в валюте, в которой выражена эта сумма, на первую дату расчетов
49	Код валюты, в которой выражена номинальная сумма сделки	Код ОКВ (буквенный)
50	Код амортизации (повышения) номинальной суммы	Указывается код в соответствии с приложением 4 к настоящему Указанию и (или) код «NAR», если пересчет номинальной суммы сделки осуществляется с учетом индексированной суммы
51	Первоначальная цена на дату заключения договора	Указывается первоначальная цена на дату заключения договора
52	Периодичность переоценки базисного актива	Указывается код в соответствии с приложением 5 к настоящему Указанию

Таблица 5. Информация об условиях кредитного свопа

Номер строки	Вид информации	Описание
1	2	3
1	Идентификационный код договора	Указывается уникальный код идентификации договора
2	Код взаимосвязи	Указывается код в соответствии с приложением 6 к настоящему Указанию
3	Код контрольного лица	Указывается международный код идентификации юридического лица, а в случае его отсутствия – иной код, позволяющий определить наименование и местоположение лица, на кредитный риск

		которого приобретается защита
4	Тип обязательств	Указывается тип обязательств контрольного лица (например, долговое обязательство, корзина (портфель) долговых обязательств)
5	Категория обязательств контрольного лица	Указывается категория обязательств контрольного лица (например, облигация, заем, иная долговая ценная бумага)
6	Номинальная сумма	Указывается размер номинальной суммы договора в валюте, в которой выражен номинал
7	Код валюты, в которой выражена номинальная сумма	Код ОКВ (буквенный)
8	Фиксированная ставка для расчета платежей, уплачиваемых продавцу кредитной защиты	Указывается фиксированная ставка для расчета платежей, уплачиваемых продавцу кредитной защиты
9	Периодичность платежей	Указывается код в соответствии с приложением 5 к настоящему Указанию
10	Сумма первоначального платежа	Указывается сумма первоначального платежа, уплачиваемая продавцу кредитной защиты
11	Код кредитного события	Указывается код события, с наступлением которого стороны связали возникновение у приобретателя кредитной защиты права требовать исполнения договора

Таблица 6. Информация об условиях форвардного договора
(далее – форвард)

Номер строки	Вид информации	Описание
1	2	3

1	Идентификационный код договора	Указывается уникальный код идентификации договора
2	Код классификации	Указывается код в соответствии с приложением 3 к настоящему Указанию
3	Код взаимосвязи	Указывается код в соответствии с приложением 6 к настоящему Указанию
4	Код базисного актива	Указывается код базисного актива в соответствии с приложением 7 к настоящему Указанию
5	Единица измерения базисного актива	Указывается единица измерения базисного актива согласно договору (например, штуки, тонны, баррели, литры), за исключением валюты
6	Количество базисного актива	Указывается числовое значение в единицах измерения базисного актива (в том случае, если заполнение поля невозможно, заполняется поле «Номинальная сумма базисного актива»)
7	Код валюты, в которой выражена номинальная сумма базисного актива	Код ОКВ (буквенный)
8	Номинальная сумма базисного актива	Указывается числовое значение. В случае если базисным активом является валюта, указывается сумма в валюте, по отношению к единице которой устанавливается цена исполнения. Заполняется одно из полей: «Количество базисного актива» или «Номинальная сумма базисного актива»
9	Дата поставки	Указывается дата поставки в формате ГГГГ-ММ-ДД
10	Дата расчетов	Указывается дата оплаты в формате ГГГГ-ММ-ДД
11	Форвардная цена договора	Указывается числовое значение форвардной цены договора

12	Код валюты, в которой выражается цена договора	Код ОКВ (буквенный). Если не применимо, поле остается пустым
----	--	---

Таблица 7. Информация об условиях договора репо

Номер строки	Вид информации	Описание
1	2	3
1	Идентификационный код договора	Указывается уникальный код идентификации договора
2	Код базисного актива	Указывается код базисного актива в соответствии с приложением 7 к настоящему Указанию
3	Количество ценных бумаг	Указывается числовое значение в штуках (в том случае, если заполнение поля невозможно, заполняется поле «Номинальная стоимость ценных бумаг»)
4	Номинальная стоимость ценных бумаг	Указывается числовое значение. Заполняется одно из полей: «Количество ценных бумаг» или «Номинальная стоимость ценных бумаг»
5	Код валюты, в которой выражается номинальная стоимость ценных бумаг	Код ОКВ (буквенный)
6	Сумма расчетов по первой части договора	Указывается числовое значение суммы расчетов первой части договора в валюте, в которой выражается цена сделки по первой части
7	Код валюты, в которой выражается цена	Код ОКВ (буквенный)
8	Фиксированная ставка	Указывается фиксированная ставка

9	Плавающая ставка	Указывается плавающая ставка
10	Максимальная ставка	Указывается верхний предел процентной ставки
11	Минимальная ставка	Указывается нижний предел процентной ставки
12	Дата поставки по первой части	Указывается дата поставки по первой части договора в формате ГГГГ-ММ-ДД
13	Дата поставки по второй части	Указывается дата поставки по второй части договора в формате ГГГГ-ММ-ДД
14	Дата расчетов по первой части	Указывается дата оплаты по первой части договора в формате ГГГГ-ММ-ДД
15	Дата расчетов по второй части	Указывается дата оплаты по второй части договора в формате ГГГГ-ММ-ДД

Таблица 8. Информация об условиях иного договора

Номер строки	Вид информации	Описание
1	2	3
1	Идентификационный номер договора	Указывается уникальный код идентификации договора
2	Тип кода клиента стороны 1	Указывается тип кода клиента в соответствии с приоритетом использования кодов для идентификации сторон договора (генерального соглашения) согласно приложению 8 к настоящему Указанию
3	Код стороны 1	Указывается код, позволяющий идентифицировать сторону договора
4	Код базисного актива	Указывается код базисного актива в соответствии с приложением 7 к настоящему Указанию
5	Единица измерения базисного актива	Указывается единица измерения базисного актива согласно договору (например, штуки, тонны, баррели, литры), за исключением

		валюты
6	Количество базисного актива	Указывается числовое значение в единицах измерения базисного актива (в том случае, если заполнение поля невозможно, заполняется поле «Номинальная сумма базисного актива»)
7	Код валюты, в которой выражена номинальная сумма базисного актива	Код ОКВ (буквенный)
8	Номинальная сумма базисного актива	Указывается числовое значение. В случае если базисным активом является валюта, указывается сумма в валюте, по отношению к единице которой устанавливается цена исполнения. Заполняется одно из полей: «Количество базисного актива» или «Номинальная сумма базисного актива»
9	Цена за единицу базисного актива	Указывается числовое значение цены базисного актива в валюте, в которой выражается эта цена
10	Код валюты, в которой выражается цена	Код ОКВ (буквенный)
11	Дата поставки базисного актива	Указывается дата поставки базисного актива в формате ГГГГ-ММ-ДД
12	Общая денежная сумма, подлежащая уплате стороне 2	Указывается числовое значение суммы средств, подлежащей переводу в валюте, в которой выражается эта сумма. Данное поле заполняется, если договором не предусмотрена цена
13	Код валюты, в которой выражается общая денежная сумма, подлежащая уплате стороне 2	Код ОКВ (буквенный)
14	Дата платежа	Указывается предусмотренная договором

		дата денежного перевода в формате ГГГГ-ММ-ДД
15	Тип кода клиента стороны 2	Указывается тип кода клиента в соответствии с приоритетом использования кодов для идентификации сторон договора (генерального соглашения) согласно приложению 8 к настоящему Указанию
16	Код стороны 2	Указывается код, позволяющий идентифицировать сторону договора
17	Код базисного актива	Указывается код базисного актива в соответствии с приложением 7 к настоящему Указанию
18	Код единицы измерения базисного актива	Указывается код единицы измерения базисного актива согласно договору (например, штуки, тонны, баррели, литры), за исключением валюты
19	Количество базисного актива	Указывается числовое значение в единицах измерения базисного актива (в том случае, если заполнение поля невозможно, заполняется поле «Номинальная сумма базисного актива»)
20	Код валюты, в которой выражена номинальная сумма базисного актива	Код ОКВ (буквенный)
21	Номинальная сумма базисного актива	Указывается числовое значение. В случае если базисным активом является валюта, указывается сумма в валюте, по отношению к единице которой устанавливается цена исполнения. Заполняется одно из полей: «Количество базисного актива» или «Номинальная сумма базисного актива»
22	Цена за единицу базисного актива	Указывается числовое значение цены за единицу базисного актива в валюте, в которой выражается эта цена
23	Код валюты, в	Код ОКВ (буквенный)

	которой выражается цена базисного актива	
24	Дата поставки базисного актива	Указывается дата поставки базисного актива в формате ГГГГ-ММ-ДД
25	Общая денежная сумма, подлежащая уплате стороне 1	Указывается числовое значение суммы средств, подлежащей переводу в валюте, в которой выражается эта сумма. Данное поле заполняется, если договором не предусмотрена цена
26	Код валюты, в которой выражается общая денежная сумма, подлежащая уплате стороне 1	Код ОКВ (буквенный)
27	Дата платежа	Указывается предусмотренная договором дата денежного перевода в формате ГГГГ-ММ-ДД

Приложение 2

к Указанию Банка России

от « 16 » августа 2016 года № 4104 -У

«О видах договоров, заключенных не на организованных торгах, информация о которых предоставляется в репозитарий, лицах, предоставляющих в репозитарий информацию о таких договорах, порядке, составе, форме и сроках предоставления ими информации в репозитарий, дополнительных требованиях к порядку ведения репозитарием реестра договоров, порядке и сроках предоставления информации репозитарием, а также порядке, составе, форме и сроках предоставления репозитарием в Банк России реестра договоров»

Информация о договоре, заключенном в целях обеспечения исполнения обязательств, о маржевых суммах и о справедливой (оценочной) стоимости

Таблица 1. Информация об обеспечении исполнения обязательств

Номер строки	Вид информации	Описание
1	2	3
1	Идентификационный код договора	Указывается идентификационный код договора, заключенного в целях обеспечения исполнения обязательств. Если не применимо, поле остается пустым
2	Тип обеспечения	Указывается тип обеспечения по договору (маржинальных требований): ФС – полное обеспечение (используется одновременно начальная и вариационная маржа); РС – частичное обеспечение (используется только вариационная маржа); ОС – одностороннее обеспечение (начальная и (или) вариационная маржа вносится только одной стороной); U – договор о порядке уплаты плавающих маржевых сумм не заключен

3	Форма обеспечения	Указывается форма обеспечения по договору: Т – обязательства по данному договору обеспечиваются индивидуально; G – обязательства по данному договору обеспечиваются совокупно с обязательствами по иным заключенным договорам в составе портфеля (кумулятивное обеспечение); U – договор о порядке уплаты плавающих маржевых сумм не заключен
---	-------------------	--

Таблица 2. Информация о маржевых суммах

Номер строки	Вид информации	Описание
1	2	3
1	Идентификационный код договора о порядке уплаты маржевых сумм	Указывается идентификационный код договора о порядке уплаты плавающих маржевых сумм
2	Начальная маржевая сумма	Указывается предусмотренная договором начальная маржевая сумма в валюте, в которой выражается указанная сумма
3	Тип кода получателя начальной маржевой суммы	Указывается тип кода получателя начальной маржевой суммы в соответствии с приоритетом использования кодов для идентификации сторон договора (генерального соглашения) согласно приложению 8 к настоящему Указанию
4	Код получателя начальной маржевой суммы	Указывается код, позволяющий идентифицировать получателя начальной маржевой суммы
5	Тип кода плательщика начальной маржевой суммы	Указывается тип кода плательщика начальной маржевой суммы в соответствии с приоритетом использования кодов для идентификации сторон договора (генерального соглашения) согласно приложению 8 к настоящему Указанию

6	Код плательщика начальной маржевой суммы	Указывается код, позволяющий идентифицировать плательщика начальной маржевой суммы
7	Код валюты начальной маржевой суммы	Код ОКВ (буквенный)
8	Плавающая маржевая сумма	Указывается плавающая маржевая сумма в валюте, в которой выражается плавающая маржевая сумма
9	Тип кода получателя плавающей маржевой суммы	Указывается тип кода получателя плавающей маржевой суммы в соответствии с приоритетом использования кодов для идентификации сторон договора (генерального соглашения) согласно приложению 8 к настоящему Указанию
10	Код получателя плавающей маржевой суммы	Указывается код, позволяющий идентифицировать получателя плавающей маржевой суммы
11	Тип кода плательщика плавающей маржевой суммы	Указывается тип кода плательщика плавающей маржевой суммы в соответствии с приоритетом использования кодов для идентификации сторон договора (генерального соглашения) согласно приложению 8 к настоящему Указанию
12	Код плательщика плавающей маржевой суммы	Указывается код, позволяющий идентифицировать плательщика плавающей маржевой суммы
13	Код валюты плавающей маржевой суммы	Код ОКВ (буквенный)
14	Накопленная маржевая сумма	Указывается накопленная маржевая сумма на дату оценки в валюте, в которой выражается указанная сумма
15	Тип кода получателя накопленной маржевой суммы	Указывается тип кода получателя накопленной маржевой суммы в соответствии с приоритетом использования кодов для идентификации сторон договора

		(генерального соглашения) согласно приложению 8 к настоящему Указанию
16	Код получателя накопленной маржевой суммы	Указывается код, позволяющий идентифицировать получателя накопленной маржевой суммы
17	Тип кода плательщика накопленной маржевой суммы	Указывается тип кода плательщика накопленной маржевой суммы в соответствии с приоритетом использования кодов для идентификации сторон договора (генерального соглашения) согласно приложению 8 к настоящему Указанию
18	Код плательщика накопленной маржевой суммы	Указывается код, позволяющий идентифицировать плательщика накопленной маржевой суммы
19	Код валюты накопленной маржевой суммы	Код ОКВ (буквенный)
20	Дата расчета маржевой суммы	Указывается дата, на которую приведена предоставляемая информация о маржевых суммах в формате ГГГГ-ММ-ДД
21	Дата внесения информации в раздел 2 реестра договоров	Указывается дата внесения информации о маржевой сумме в раздел 2 реестра договоров в формате ГГГГ-ММ-ДД

Таблица 3. Информация о справедливой (оценочной) стоимости

Номер строки	Вид информации	Описание
1	2	3
1	Идентификационный код договора о расчете справедливой (оценочной) стоимости	Указывается идентификационный код договора о расчете справедливой (оценочной) стоимости. Если не применимо, поле остается пустым
2	Идентификационный	Указывается уникальный код идентификации

	код договора	договора, в отношении которого рассчитывается справедливая (оценочная) стоимость
3	Справедливая (оценочная) стоимость	Указывается справедливая (оценочная) стоимость договора
4	Тип оценки стоимости	Указывается метод оценки справедливой стоимости: М – рыночная оценка; О – оценка, полученная на основе модели
5	Валюта справедливой (оценочной) стоимости	Код ОКВ (буквенный) (валюта, в которой выражена справедливая (оценочная) стоимость)
6	Дата и время оценки	Дата и время, на которые приводится информация о справедливой (оценочной) стоимости, в формате ГГГГ-ММ-ДДТЧЧ:ММ:СС

Приложение 3

к Указанию Банка России

от «16 » августа 2016 года №4104 -У

«О видах договоров, заключенных не на организованных торгах, информация о которых предоставляется в репозитарий, лицах, предоставляющих в репозитарий информацию о таких договорах, порядке, составе, форме и сроках предоставления ими информации в репозитарий, дополнительных требованиях к порядку ведения репозитарием реестра договоров, порядке и сроках предоставления информации репозитарием, а также порядке, составе, форме и сроках предоставления репозитарием в Банк России реестра договоров»

Коды классификации производных финансовых инструментов и договоров репо

1. Код классификации производных финансовых инструментов и договоров репо является последовательностью атрибутов указанного кода, присваиваемых в соответствии с настоящим приложением.

2. Первый атрибут кода классификации производных финансовых инструментов и договоров репо присваивается по виду производного финансового инструмента или договора репо:

О – опцион;

S – своп;

F – форвард;

R – договор репо.

3. Второй атрибут кода классификации производных финансовых инструментов, являющихся опционами, характеризует право покупателя по опционному договору приобрести базисный актив, потребовать оплаты базисного актива, заключить соответствующий договор или потребовать уплаты денежной суммы:

P – опцион, предоставляющий право покупателю по опциону продать базисный актив или получить выгоду продавца базисного актива (продавца

по договору, являющемуся базисным активом опциона) (опцион пут);

C – опцион, предоставляющий право покупателю по опциону купить базисный актив или получить выгоду покупателя базисного актива (покупателя по договору, являющемуся базисным активом опциона) (опцион колл);

Z – опцион с правом выбора покупателем типа опциона в будущем.

4. Третий атрибут кода классификации производных финансовых инструментов, являющихся опционами, присваивается по стилю опциона:

A – американский опцион – покупатель опциона вправе требовать исполнения опциона в любой день в течение срока осуществления права на его исполнение;

E – европейский опцион – покупатель опциона вправе требовать его исполнения только в предусмотренную договором дату исполнения опциона;

B – бермудский опцион – покупатель опциона имеет право требовать его исполнения в определенные договором даты.

5. Четвертый атрибут кода классификации производных финансовых инструментов, являющихся опционами, присваивается по цене исполнения:

F – фиксированная цена исполнения;

L – плавающая цена исполнения, определяемая в будущем по установленным договором правилам;

X – цена исполнения опциона определяется иным способом, предусмотренным договором.

6. Пятый атрибут кода классификации производных финансовых инструментов, являющихся опционами, присваивается по наличию и виду барьерного условия исполнения опциона:

N – условие, определяющее значение барьерной цены базисного или иного актива, при котором покупатель опциона вправе в оговоренную договором дату (период времени) требовать исполнения опциона или при которой исполнение опциона прекращается, не установлено;

В – право требовать исполнения по опциону возникает с момента, когда цена (курс) базисного или иного актива, или процентная ставка достигли определенного в договоре значения барьерной цены (курса) или процентной ставки, или на дату истечения опциона при условии, что цена (курс) базисного или иного актива, или процентная ставка достигли определенного в договоре значения барьерной цены (курса) или процентной ставки;

D – право требовать исполнения по опциону прекращается с момента, когда цена (курс) базисного или иного актива, или процентная ставка достигли определенного в договоре значения барьерной цены (курса) или процентной ставки, или на дату истечения опциона при условии, что цена (курс) базисного или иного актива, или процентная ставка достигли определенного в договоре значения барьерной цены (курса) или процентной ставки;

M – право требовать исполнения по опциону возникает при условии, что цена (курс) базисного или иного актива, или процентная ставка находятся в определенном в договоре диапазоне барьерных значений (максимального и минимального) цены (курса) базисного актива или процентных ставок, или на дату истечения опциона, при условии, что цена (курс) базисного или иного актива, или процентная ставка находятся в определенном в договоре диапазоне барьерных значений цены (курса) или процентной ставки;

X – предусмотрены иные условия, связанные с наличием барьерных значений, при которых покупатель опциона вправе в оговоренную договором дату (период времени) требовать исполнения опциона.

7. Шестой атрибут кода классификации производных финансовых инструментов, являющихся опционами, присваивается по базисному активу:

E – долевые инструменты (акции, паи, депозитарные расписки на акции), индекс долевых инструментов, корзина долевых инструментов;

D – долговые финансовые инструменты (облигации, процентные ставки), индекс долговых инструментов, корзина долговых инструментов;

- С – товары, товарный индекс, корзина товарных активов;
- V – валюта, валютный индекс, корзина валют;
- A – производный финансовый инструмент;
- X – смешанный портфель, корзина неоднородных активов;
- M – иной базисный актив.

8. Второй атрибут кода классификации производных финансовых инструментов, являющихся свопами, характеризует разновидность свопа по видам базисных активов:

- V – валютный своп;
- P – процентный своп;
- G – валютно-процентный своп;
- C – товарный своп;
- A – своп на ценные бумаги или на индекс;
- M – своп иных активов или смешанных активов.

9. Третий атрибут кода классификации производных финансовых инструментов, являющихся свопами, характеризует обязательства сторон и выражается в единицах, принятых для количественного выражения соответствующего обязательства:

- F – фиксированное обязательство против фиксированного обязательства;
- V – переменное обязательство против переменного обязательства;
- D – фиксированное обязательство против переменного обязательства;
- X – иной характер обязательства.

10. Четвертый атрибут кода классификации производных финансовых инструментов, являющихся свопами, характеризует номинал свопа:

- A – номинал свопа уменьшается во времени;
- H – номинал свопа увеличивается во времени;
- W – номинал свопа не меняется;
- N – номинал свопа отсутствует;
- X – иной номинал свопа.

11. Пятый атрибут кода классификации производных финансовых инструментов, являющихся свопами, указывает на наличие иных производных финансовых инструментов в качестве базисных активов свопа:

F – один или более одного из базисных активов является производным финансовым инструментом;

N – ни одного базисного актива, являющегося производным финансовым инструментом.

12. Шестой атрибут кода классификации производных финансовых инструментов, являющихся свопами, указывает на право одной из сторон изменить срок свопа:

E – право одной из сторон продлить срок свопа;

T – право одной из сторон сократить срок свопа;

W – право одной из сторон продлить или сократить срок свопа;

N – право сторон в одностороннем порядке изменять срок свопа не установлено.

13. Седьмой атрибут кода классификации производных финансовых инструментов, являющихся свопами, присваивается по верхним и нижним пределам, ограничивающим сумму обязательства:

U – установлен верхний предел, ограничивающий сумму обязательства;

D – установлен нижний предел, ограничивающий сумму обязательства;

W – установлены верхний и нижний пределы, ограничивающие сумму обязательства;

N – ограничений на сумму обязательств не установлено.

14. Второй атрибут кода классификации производных финансовых инструментов, являющихся форвардами, присваивается по видам базисных активов:

E – долевые инструменты (акции, паи, депозитарные расписки на акции), индекс долевых инструментов, корзина долевых инструментов;

D – долговые финансовые инструменты (облигации, процентные

ставки), индекс долговых инструментов, корзина долговых инструментов;

C – товары, товарный индекс, корзина товарных активов;

V – валюта, валютный индекс, корзина валют;

A – производный финансовый инструмент;

X – смешанный инвестиционный портфель;

M – иной вид базисного актива.

15. Третий атрибут кода классификации производных финансовых инструментов, являющихся форвардами, присваивается по количеству базисных активов:

O – один базисный актив;

W – корзина базисных активов с полной поставкой;

S – корзина базисных активов с расчетом по одному или нескольким базисным активам на выбор одной из сторон или определенному (определенным) в соответствии с договором.

16. Четвертый атрибут кода классификации производных финансовых инструментов, являющихся форвардами, присваивается по форвардной цене:

F – фиксированная форвардная цена (курс) или процентная ставка;

L – плавающая форвардная цена (курс) или процентная ставка, определяемая в будущем по установленным договором правилам;

R – диапазон форвардной цены (курса) или процентной ставки, определяемый минимальным и максимальным значением цены (курса) или процентной ставки.

17. Пятый атрибут кода классификации производных финансовых инструментов, являющихся форвардами, присваивается по наличию условия досрочного исполнения:

E – одна из сторон или обе стороны имеют право требования досрочного исполнения;

N – условие досрочного исполнения не установлено.

18. Второй атрибут кода классификации договоров репо присваивается

по видам активов:

E – долевые инструменты (акции, паи, депозитарные расписки на акции), корзина долевых инструментов;

D – долговые финансовые инструменты (облигации, процентные ставки), корзина долговых инструментов;

X – смешанный портфель, корзина неоднородных активов.

19. Третий атрибут кода договоров репо присваивается по количеству видов активов:

O – один актив;

W – корзина активов без возможности замены обеспечения;

S – корзина активов с возможностью замены обеспечения.

20. Четвертый атрибут кода классификации договоров репо присваивается по ставке репо:

F – фиксированная ставка репо;

Z – ставка репо равна нулю;

L – плавающая ставка репо;

R – диапазон ставки репо, определяемый минимальным и максимальным значением ставки репо.

21. Пятый атрибут кода классификации договоров репо присваивается по сроку договора репо:

F – фиксированный срок договора репо;

E – фиксированный срок договора репо с правом требования досрочного исполнения одной из сторон договора;

O – договор репо с открытой датой.

Приложение 4

к Указанию Банка России

от « 16 » августа 2016 года № 4104 -У

«О видах договоров, заключенных не на организованных торгах, информация о которых предоставляется в репозитарий, лицах, предоставляющих в репозитарий информацию о таких договорах, порядке, составе, форме и сроках предоставления ими информации в репозитарий, дополнительных требованиях к порядку ведения репозитарием реестра договоров, порядке и сроках предоставления информации репозитарием, а также порядке, составе, форме и сроках предоставления репозитарием в Банк России реестра договоров»

Коды амортизации или повышения номинала свопов или фиксированных процентных ставок

1. Коды амортизации или повышения номинальной суммы, предусмотренной договором (далее – номинал), или фиксированных процентных ставок (далее – процентные ставки) имеют последовательность следующих атрибутов.

1.1. Первый атрибут кода:

AM – обозначает вычитание из суммы предыдущего номинала или предыдущей процентной ставки величины, на которую амортизируется указанный номинал или указанная процентная ставка;

AU – обозначает прибавление к сумме предыдущего номинала или к предыдущей процентной ставке величины, на которую прибавляется указанный номинал или указанная процентная ставка;

M – выражает умножение суммы предыдущего номинала или предыдущей процентной ставки на коэффициент, на который умножается указанный номинал или указанная процентная ставка;

N – обозначает график изменения номинала свопов, определенный в договорах.

1.2. Вторым атрибутом кода с первым атрибутом AM и AU – числовое значение величины, на которую амортизируется предыдущий номинал (предыдущая процентная ставка) или которая прибавляется к предыдущему номиналу (предыдущей процентной ставке). Указанное числовое значение выражается в тех же единицах измерения, что и предыдущий номинал (предыдущая процентная ставка).

1.3. Вторым атрибутом кода с первым атрибутом M – числовой коэффициент, на который умножается предыдущее значение номинала (процентной ставки).

1.4. Вторым атрибутом кода с первым атрибутом N – текстовое значение, включающее дату (ГГГГ-ММ-ДД) и значение параметра (процентная ставка или номинал). Комбинация «дата, значение параметра» повторяется для каждого момента изменения параметров, зафиксированных в договоре.

1.5. Третьим атрибутом кода – числовое значение, отражающее количество дней со дня предыдущего определения или изменения номинала (процентной ставки) до дня изменения номинала или процентной ставки.

1.6. Четвертым атрибутом кода R – указывается, если последующие величины (коэффициенты) изменений значения номинала (процентных ставок) и периоды времени, через которые они изменяются, совпадают.

2. Если хотя бы один из соответствующих атрибутов кода не совпадает со вторым и третьим атрибутом, атрибуты кода, начиная с четвертого, повторяются.

3. Каждый из атрибутов кода разделяется символом «|».

Приложение 5

к Указанию Банка России

от «16 » августа 2016 года № 4104 -У

«О видах договоров, заключенных не на организованных торгах, информация о которых предоставляется в репозитарий, лицах, предоставляющих в репозитарий информацию о таких договорах, порядке, составе, форме и сроках предоставления ими информации в репозитарий, дополнительных требованиях к порядку ведения репозитарием реестра договоров, порядке и сроках предоставления информации репозитарием, а также порядке, составе, форме и сроках предоставления репозитарием в Банк России реестра договоров»

Коды периодичности

1. Коды периодичности платежей и переоценки обеспечения имеют последовательность атрибутов, указанных в пунктах 2–5 настоящего приложения.

2. Первый атрибут кода – числовое значение, отражающее, например, количество платежей, переоценки, в период времени, соответствующий второму атрибуту кода.

3. Второй атрибут кода:

H – час;

D – день;

W – неделя;

M – месяц;

Q – квартал;

Y – год.

4. Третий атрибут кода:

E – например, платеж, переоценка дополнительно осуществляется при наступлении события, предусмотренного в договоре;

N – договором не предусмотрено условий, при которых, например, платеж, переоценка осуществляются дополнительно.

5. Четвертый атрибут кода:

Е – например, платеж, переоценка не осуществляется в определенный договором период при наступлении события, предусмотренного в договоре;

N – договором не предусмотрено условий, при которых, например, платеж, переоценка не осуществляются.

Приложение 6

к Указанию Банка России

от « 16 » августа 2016 года № 4104 -у

«О видах договоров, заключенных не на организованных торгах, информация о которых предоставляется в репозитарий, лицах, предоставляющих в репозитарий информацию о таких договорах, порядке, составе, форме и сроках предоставления ими информации в репозитарий, дополнительных требованиях к порядку ведения репозитарием реестра договоров, порядке и сроках предоставления информации репозитарием, а также порядке, составе, форме и сроках предоставления репозитарием в Банк России реестра договоров»

Коды взаимосвязи элементов различных видов производных финансовых инструментов в смешанном производном финансовом инструменте и производных финансовых инструментов, являющихся базисным активом другого производного финансового инструмента

1. Если производный финансовый инструмент не является частью иного производного финансового инструмента и не является базисным активом производного финансового инструмента, то такому договору присваивается код S.

2. Если производный финансовый инструмент не является базисным активом другого производного финансового инструмента, и базисным активом этого производного финансового инструмента является производный финансовый инструмент, то такому договору присваивается код M.

3. Если производный финансовый инструмент содержит элементы двух или более производных финансовых инструментов (далее – комплементарные элементы договоров), и при этом он не является базисным активом другого производного финансового инструмента, то каждому комплементарному элементу такого производного финансового

инструмента присваивается:

в качестве первого атрибута кода взаимосвязи – атрибут М;

в качестве второго атрибута кода взаимосвязи – номер соответствующего элемента.

4. Производному финансовому инструменту, являющемуся базисным активом другого производного финансового инструмента, в качестве первого атрибута кода взаимосвязи присваивается атрибут В, а в качестве последующих атрибутов кода взаимосвязи присваиваются атрибуты производного финансового инструмента, базисным активом которого является данный производный финансовый инструмент.

5. Если производный финансовый инструмент является базисным активом другого производного финансового инструмента и одновременно содержит комплементарные элементы договоров, то каждому такому элементу присваиваются:

в качестве первого атрибута кода взаимосвязи – атрибут В;

в качестве следующих атрибутов кода взаимосвязи – атрибуты производного финансового инструмента, базисным активом которого является данный производный финансовый инструмент;

в качестве следующего за атрибутом кода взаимосвязи, указанного в абзаце втором настоящего пункта, – атрибут С и порядковый номер соответствующего комплементарного элемента.

Приложение 7

к Указанию Банка России

от « 16 » августа 2016 года № 4104 -у

«О видах договоров, заключенных не на организованных торгах, информация о которых предоставляется в репозитарий, лицах, предоставляющих в репозитарий информацию о таких договорах, порядке, составе, форме и сроках предоставления ими информации в репозитарий, дополнительных требованиях к порядку ведения репозитарием реестра договоров, порядке и сроках предоставления информации репозитарием, а также порядке, составе, форме и сроках предоставления репозитарием в Банк России реестра договоров»

Коды базисного актива производного финансового инструмента

1. Если базисным активом производного финансового инструмента является валюта, кодом такого актива является буквенный код ОКВ.

2. Если базисным активом производного финансового инструмента является ценная бумага, кодом такого актива является международный идентификационный код ценной бумаги (International Security Identification Number, ISIN) (далее – код ISIN). При отсутствии у ценной бумаги кода ISIN соответствующий код присваивается в порядке, определенном репозитарием. При отсутствии у ценной бумаги кода ISIN соответствующий код присваивается в порядке, определенном репозитарием.

3. Если базисным активом производного финансового инструмента является товар, такому активу присваивается код в порядке, определенном репозитарием исходя из кода классификации товара по единой Товарной номенклатуре внешнеэкономической деятельности Евразийского экономического союза и Единому таможенному тарифу Евразийского экономического союза, утвержденных Решением Совета Евразийской

экономической комиссии от 16 июля 2012 года № 54 «Об утверждении единой Товарной номенклатуры внешнеэкономической деятельности Евразийского экономического союза и Единого таможенного тарифа Евразийского экономического союза», и кода регулируемого рынка, на котором осуществляется обращение указанного товара. Код регулируемого рынка присваивается в порядке, определенном репозитарием.

4. Если базисным активом производного финансового инструмента является процентная ставка, такому активу присваивается код в порядке, определенном репозитарием.

5. Если базисным активом производного финансового инструмента являются несколько активов, отличающихся друг от друга по одному или нескольким признакам (далее – корзина), такому активу присваивается код В, и информация, предусмотренная приложением 1 к настоящему Указанию, дополняется следующей информацией:

код актива в корзине в соответствии с настоящим приложением;

вес указанного актива в корзине (в процентах);

количество указанных активов в корзине и единицы их измерения.

Приложение 8

к Указанию Банка России

от «16 » августа 2016 года № 4104 -У

«О видах договоров, заключенных не на организованных торгах, информация о которых предоставляется в репозитарий, лицах, предоставляющих в репозитарий информацию о таких договорах, порядке, составе, форме и сроках предоставления ими информации в репозитарий, дополнительных требованиях к порядку ведения репозитарием реестра договоров, порядке и сроках предоставления информации репозитарием, а также порядке, составе, форме и сроках предоставления репозитарием в Банк России реестра договоров»

Порядок предоставления отдельных сведений в репозитарий

1. Для юридических лиц, обязанных предоставлять информацию в репозитарий, указывается международный код идентификации юридического лица (Legal Entity Identifier, LEI) (далее – международный код идентификации юридического лица).

2. Для юридических лиц, не обязанных предоставлять информацию в репозитарий, может указываться следующий тип кода: международный код идентификации юридического лица, ИНН, SWIFT, коды информационных систем, собственные коды, присвоенные стороной договора (генерального соглашения) или репозитарием. Типы кодов перечислены в порядке убывания приоритета.

3. Для физических лиц может указываться номер паспорта или страховой номер индивидуального лицевого счета (СНИЛС).

4. Если в качестве идентификаторов сторон договора (генерального соглашения), информирующих лиц, клиентов используются коды информационных агентств или собственные коды, присвоенные стороной договора или репозитарием, то при предоставлении выписки из реестра договоров репозитарий передает в Банк России все доступные сведения,

необходимые для идентификации клиента.

5. Аффилированность стороны 1 и стороны 2 определяется в соответствии со статьей 4 Закона РСФСР от 22 марта 1991 года № 948-1 «О конкуренции и ограничении монополистической деятельности на товарных рынках» (Ведомости Съезда народных депутатов РСФСР и Верховного Совета РСФСР, 1991, № 16, ст. 499; Собрание законодательства Российской Федерации, 1995, № 22, ст. 1977; 1998, № 19, ст. 2066; 2002, № 41, ст. 3969; 2006, № 31, ст. 3434).

6. Уникальный код идентификации договора (Unique Trade Identifier, UTI) предоставляет собой уникальный код, обеспечивающий однозначную идентификацию договора, указанного в пункте 1 настоящего Указания, для целей предоставления информации в репозиторий (далее – уникальный код идентификации договора).

7. Уникальный код идентификации договора формируется и присваивается договору, указанному в пункте 1 настоящего Указания, не позднее момента предоставления в репозиторий информации о заключении такого договора в соответствии с требованием пункта 4 настоящего Указания.

Стороны вправе сформировать и присвоить уникальный код идентификации договора договору, указанному в пункте 1 настоящего Указания, заключенному до 1 июля 2016 года, запись о котором внесена в раздел 2 реестра договоров.

При прекращении обязательства, существующего между сторонами договора, указанного в пункте 1 настоящего Указания, заключенного не с центральным контрагентом, заменой новым обязательством между каждой из сторон указанного договора и центральным контрагентом в соответствии с частью 12 статьи 4 Федерального закона от 7 февраля 2011 года № 7-ФЗ «О клиринге, клиринговой деятельности и центральном контрагенте» (Собрание законодательства Российской Федерации, 2011, № 7, ст. 904; № 48, ст. 6728; № 49, ст. 7040, ст. 7061; 2012, № 53, ст. 7607; 2013,

№ 30, ст. 4084; 2014, № 11, ст. 1098; 2015, № 27, ст. 4001; № 29, ст. 4357; 2016, № 1, ст. 23, ст. 47) осуществляется формирование нового уникального кода идентификации договора в отношении каждого заключенного с центральным контрагентом договора.

8. Уникальный код идентификации договора содержит не более 52 символов и состоит из следующих частей:

префикса, состоящего из 20 символов международного кода идентификации юридического лица, осуществляющего формирование уникального кода идентификации договора (далее – формирующее лицо);

идентификатора сделки, максимальная длина которого не превышает 32 символов, формируемого в соответствии с алгоритмом, определенным формирующим лицом.

9. В случае изменения у формирующего лица международного кода идентификации юридического лица, формирующее лицо обязано использовать новый префикс при формировании уникальных кодов идентификации договоров, указанных в пункте 1 настоящего Указания, заключенных после изменения у формирующего лица международного кода идентификации юридического лица. При этом уникальные коды идентификации договора, присвоенные договорам, указанным в пункте 1 настоящего Указания, до изменения у формирующего лица международного кода идентификации юридического лица, не изменяются.

10. Формирующее лицо обязано обеспечить уникальность идентификатора сделки, исключаящую возможность повторного использования ранее присвоенных идентификаторов сделки.

Для формирования идентификатора сделки используются следующие символы: Z, Y, X, W, V, U, T, S, R, Q, P, O, N, M, L, K, J, I, H, G, F, E, D, C, B, A, 9, 8, 7, 6, 5, 4, 3, 2, 1, 0.

11. Формирование и присвоение уникального кода идентификации договора по соглашению сторон договора, указанного в пункте 1 настоящего Указания, осуществляет сторона такого договора либо третье лицо.

В случае если соглашение между сторонами договора, указанного в пункте 1 настоящего Указания, в отношении выбора формирующего лица не достигнуто, формирующим лицом является сторона договора, обязанная предоставлять информацию в репозитарий в соответствии с пунктами 2 и 3 настоящего Указания.

В случае, когда обе стороны договора, указанного в пункте 1 настоящего Указания, являются лицами, обязанными предоставлять информацию в репозитарий в соответствии с пунктами 2 и 3 настоящего Указания, формирующим лицом является лицо, международный код идентификации юридического лица которого, начиная с седьмого символа, содержит символы, приоритет которых установлен в следующем порядке: Z, Y, X, W, V, U, T, S, R, Q, P, O, N, M, L, K, J, I, H, G, F, E, D, C, B, A, 9, 8, 7, 6, 5, 4, 3, 2, 1, 0.

12. Формирующее лицо направляет сформированный уникальный код идентификации договора другой стороне договора (сторонам договора), указанного в пункте 1 настоящего Указания, путем обмена электронными документами, передаваемыми по каналам связи, позволяющим установить, что электронный документ, содержащий уникальный код идентификации договора, исходит от формирующего лица.

13. При указании даты и времени в формате ГГГГ-ММ-ДДТЧЧ:ММ:СС символ «Т» является разделителем между датой и временем.

14. Код страны указывается в соответствии Общероссийским классификатором стран мира ОК (МК (ИСО 3166) 004-97) 025-2001, принятым Постановлением Госстандарта России от 14 декабря 2001 года № 529-ст «О принятии и введении в действие Общероссийского классификатора стран мира».

15. Требования, связанные с предоставлением сведений в соответствии с

таблицей 2 приложения 1 к настоящему Указанию:

в отношении кодов клиента стороны 1 (стороны 2), продавца по договору (покупателя по договору), если в качестве идентификаторов клиентов, продавца и покупателя по договору используются иные коды, например, коды информационных агентств или собственные коды, присвоенные стороной договора или репозитарием, при предоставлении реестра договоров в Банк России репозитарий передает все доступные сведения, необходимые для идентификации клиента, продавца (покупателя).

16. Требования, связанные с предоставлением сведений в соответствии с таблицами 3–6 и 8 приложения 1 к настоящему Указанию:

код базисного актива (в случае если базисным активом является валюта, указывается код валюты, по отношению к единице которой устанавливается цена исполнения);

в качестве валюты базисного актива указывается валюта, в которой осуществляется платеж по первой и второй частям договора в одинаковой сумме (поставляемый актив);

если в валютном опционе базисный актив не определен, то за базисный актив принимается актив, определенный в соответствии с договором об оказании репозитарных услуг;

если в соответствии с договором об оказании репозитарных услуг определить базисный актив невозможно, то базисный актив определяется по договоренности сторон.

17. Требования, связанные с предоставлением сведений в соответствии с таблицей 1 приложения 2 к настоящему Указанию:

если сторонами заключен договор о порядке уплаты плавающих маржевых сумм, указанный в абзаце втором пункта 18 настоящего приложения, то сведения, указанные в таблице 1 приложения 2 к настоящему Указанию, заполняются в соответствии с таким договором;

если сторонами заключен иной договор об обеспечении исполнения

обязательств, то в графе 3 строки 1 таблицы 1 приложения 2 к настоящему Указанию указывается идентификационный код такого договора. При этом в графе 3 строк 2 и 3 данной таблицы указывается символ «U»;

стороны вправе предоставить иную информацию о договоре, заключенном в целях обеспечения исполнения обязательств, не предусмотренную таблицей 1 приложения 2 к настоящему Указанию, в порядке, установленном репозитарием.

18. Требования, связанные с предоставлением сведений в соответствии с таблицей 2 приложения 2 к настоящему Указанию:

информация о маржевых суммах заполняется в соответствии со стандартными условиями договора о порядке уплаты плавающих маржевых сумм (примерными условиями договора), утвержденными саморегулируемой организацией в сфере финансового рынка, объединяющей брокеров, саморегулируемой организацией в сфере финансового рынка, объединяющей дилеров, саморегулируемой организацией в сфере финансового рынка, объединяющей управляющих, и опубликованными в печати или размещенными в информационно-телекоммуникационной сети «Интернет» в соответствии с пунктом 1 статьи 51⁵ Федерального закона «О рынке ценных бумаг»;

информация в соответствии с данной таблицей предоставляется в течение пяти рабочих дней месяца, следующего за месяцем, в котором возникли требования и (или) обязательства по выплате маржевых сумм по состоянию на дату возникновения требований и (или) обязательств. Если требования и (или) обязательства по выплате маржевых сумм не возникают, информация в соответствии с данной таблицей не предоставляется;

допускается внесение в раздел 2 реестра договоров записей, содержащих разные значения маржевых сумм на одну дату оценки, полученную от разных сторон договора.

19. Требования, связанные с предоставлением сведений в соответствии с таблицей 3 приложения 2 к настоящему Указанию:

если справедливая (оценочная) стоимость договора определяется на основании отдельного договора, содержащего порядок определения справедливой (оценочной) стоимости, то информация, указанная в данной таблице, заполняется в соответствии с таким договором;

если справедливая (оценочная) стоимость договора определяется на основании данных бухгалтерского учета, то информация, указанная в данной таблице, заполняется в соответствии с данными бухгалтерского учета;

информация о справедливой (оценочной) стоимости направляется в репозиторий по мере переоценки стоимости не позднее пяти рабочих дней месяца, следующего за месяцем, в котором осуществлена переоценка справедливой (оценочной) стоимости;

если по данным бухгалтерского учета справедливая (оценочная) стоимость не определена и не заключен отдельный договор, содержащий порядок определения справедливой (оценочной) стоимости, то информация в соответствии с данной таблицей не предоставляется;

допускается внесение в раздел 2 реестра договоров записей, содержащих разные значения справедливой (оценочной) стоимости на одну дату оценки, полученных от разных сторон договора.