



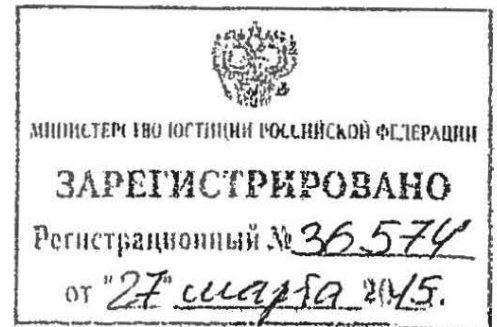
**ЦЕНТРАЛЬНЫЙ БАНК РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
(БАНК РОССИИ)**

« 16 » февраля 2015 г.

№ 3567-У

г Москва

У К А З А Н И Е



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)»

1. Внести 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 26 мая 2014 года № 32434, 24 сентября 2014 года № 34120 («Вестник Банка России» от 4 июня 2014 года № 52, от 1 октября 2014 года № 87), следующие изменения.

1.1. В пункте 3 слово «апреля» заменить словом «октября», после слов «видам договоров» дополнить словами «, если первоначально договор с репозитарием заключен в отношении отдельных видов договоров».

1.2. Пункт 4 после слов «2011 года» дополнить словом «включительно», слово «апреля» заменить словом «октября».

1.3. Абзац второй пункта 9 после слов «генерального соглашения» дополнить словами «, обязанных в соответствии с пунктом 1¹ настоящего Указания представлять информацию в репозитарий».

1.4. В пункте 12 слова «Если иное не предусмотрено настоящим Указанием, информация» заменить словом «Информация».

1.5. Пункт 13 признать утратившим силу.

1.6. Пункт 22 дополнить абзацем следующего содержания:

«уникальный код идентификации договора для договоров (генеральных соглашений), заключенных с 1 июля 2016 года.».

1.7. В пункте 24 слова «информирующим лицом являются обе стороны генерального соглашения – не позднее рабочего дня, следующего за днем получения последнего сообщения при условии установления совпадения всех данных в сообщениях, полученных от сторон такого соглашения» заменить словами «информирующих лиц более одного – не позднее рабочего дня, следующего за днем получения последнего сообщения при условии установления совпадения обязательных для сверки полей в сообщениях, полученных от информирующих лиц».

1.8. Пункт 25 дополнить абзацем следующего содержания:

«в сообщении отсутствует уникальный код идентификации договора, для договоров (генеральных соглашений), заключенных с 1 июля 2016 года.».

1.9. Пункт 32 изложить в следующей редакции:

«32. В реестр договоров включаются сведения согласно таблицам 1 и 2 приложения 1 к настоящему Указанию. При этом в реестр договоров включаются сведения, относящиеся к соответствующему виду договора согласно таблицам 3 – 8 приложения 1 и приложениям 2 – 7 к настоящему Указанию, а также сведения, которые дополнительно представлены информирующим лицом для включения в реестр.

Сведения по форме приложений к настоящему Указанию заполняются в соответствии с методическими указаниями по представлению сведений в репозитарий (приложение 8 к настоящему Указанию), и подлежат представлению в репозитарий с 1 октября 2015 года.

Сведения, указанные в настоящем пункте, могут включаться в реестр договоров на иностранном языке, если договор, о котором представляются эти сведения, составлен на иностранном языке.».

1.10. Пункт 34 признать утратившим силу.

1.11. В пункте 35 слова «о договоре» заменить словами «о заключении договора».

1.12. Приложения 1 – 4 изложить в редакции приложений 1 – 4 к настоящему Указанию соответственно.

1.13. Приложение 6 изложить в редакции приложения 5 к настоящему Указанию.

1.14. Приложение 8 изложить в редакции приложения 6 к настоящему Указанию.

2. Настоящее Указание вступает в силу по истечении 10 дней после дня его официального опубликования в «Вестнике Банка России».

Председатель
Центрального банка
Российской Федерации

Э.С. Набиуллина

Приложение 1
к Указанию 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)»

«Приложение 1
к Указанию 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)»

СВЕДЕНИЯ,
ПОДЛЕЖАЩИЕ ВКЛЮЧЕНИЮ В РЕЕСТР ДОГОВОРОВ

ТАБЛИЦА 1. СВЕДЕНИЯ О ГЕНЕРАЛЬНОМ СОГЛАШЕНИИ

Номер строки	Виды сведений	Описание
1	2	3
1	Идентификационный код генерального соглашения	Указывается уникальный код идентификации генерального соглашения
2	Дата и время внесения сведений о генеральном соглашении в реестр	Указываются дата и время регистрации генерального соглашения в реестре договоров в формате ГГГГ-ММ-ДДТЧЧ: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 (стороной) самостоятельно

1	2	3
4	Тип кода стороны 1	Указывается тип кода стороны по договору в соответствии с приоритетом использования кодов для идентификации сторон договора согласно приложению 8 к настоящему Указанию
5	Код стороны 1	Указывается значение кода идентификации стороны договора
6	Наименование стороны 1	Указывается полное фирменное наименование юридического лица или фамилия, имя и отчество (при наличии) физического лица
7	Код страны стороны 1	Указывается код страны
8	Вид экономической деятельности стороны 1	ССР – центральный контрагент; СИ – кредитная организация; В – брокер; D – дилер; 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
9	Тип кода стороны 2	Указывается тип кода стороны по договору в соответствии с приоритетом использования кодов для идентификации сторон договора согласно приложению 8 к настоящему Указанию
10	Код стороны 2	Указывается значение кода идентификации стороны договора
11	Наименование стороны 2	Указывается полное фирменное наименование юридического лица или фамилия, имя и отчество (при наличии) физического лица
12	Код страны стороны 2	Указывается код страны
13	Вид экономической деятельности стороны 2	ССР – центральный контрагент; СИ – кредитная организация; В – брокер; D – дилер; МС – управляющие компании инвестиционного фонда, паевого инвестиционного фонда и негосударственного пенсионного фонда; Dep – депозитарии; R – регистраторы; PF – негосударственные пенсионные фонды;

1	2	3
		IF – акционерные инвестиционные фонды; TA – организаторы торговли; CC – клиринговые организации; I – страховые организации; Other – прочие
14	Код информирующего лица стороны 1	Указывается международный код идентификации юридического лица
15	Наименование информирующего лица стороны 1	Указывается полное фирменное наименование юридического лица или фамилия, имя и отчество (при наличии) физического 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 или фамилия, имя и отчество (при наличии) физического лица
18	Аффилированность стороны 1 и стороны 2	Y – стороны являются аффилированными; N – стороны не являются аффилированными

ТАБЛИЦА 2. ОБЩИЕ СВЕДЕНИЯ О ДОГОВОРЕ

Номер строки	Виды сведений	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 вне условий генерального соглашения, поле остается пустым
3	Дата и время поступления договора в репозиторий	Указываются дата и время регистрации договора в журнале учета сообщений в формате ГГГГ-ММ-ДДТЧЧ:ММ:СС
4	Дата и время регистрации договора в реестре договоров	Указываются дата и время регистрации договора в реестре договоров в формате ГГГГ-ММ-ДДТЧЧ:ММ:СС
5	Код состояния обязательств по договору	R – исключение записи о заключении договора ввиду ошибочного внесения в реестр договоров или признания договора недействительным; N – прекращение обязательств по договору ввиду новации (новация отражается регистрацией нового договора); W – прекращение регистрации договора в репозитории ввиду перехода клиента в другой репозиторий;

1	2	3
		<p>Т – обязательства прекращены надлежащим исполнением в срок; TD – обязательства прекращены надлежащим исполнением досрочно; С – исполнение обязательств просрочено; Р – исполнение обязательств приостановлено по предусмотренным в договоре основаниям; D – обязательства прекращены по иным основаниям; Е – продление срока действия договора в результате наступления предусмотренного договором обстоятельства или события</p>
6	Дата заключения договора	Указывается дата заключения договора в формате ГГГГ-ММ-ДД
7	Дата вступления в силу договора	<p>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</p>
8	Дата окончания срока действия договора	<p>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</p>
9	Тип кода продавца по договору	Указывается тип кода продавца по договору в соответствии с приоритетом использования кодов для идентификации сторон договора согласно приложению 8 к настоящему Указанию
10	Код продавца по договору	<p>Указывается код, позволяющий идентифицировать лицо, определенное сторонами как продавец по договору. Если не применимо, поле остается пустым</p>
11	Наименование продавца по договору	Полное фирменное наименование юридического лица или фамилия, имя и отчество (при наличии) физического лица
12	Тип кода покупателя по договору	Указывается тип кода покупателя по договору в соответствии с приоритетом использования кодов для идентификации сторон договора согласно приложению 8 к настоящему Указанию
13	Код покупателя по договору	<p>Указывается код, позволяющий идентифицировать лицо, определенное сторонами как покупатель по договору. Если не применимо, поле остается пустым</p>
14	Наименование покупателя по договору	Полное фирменное наименование юридического лица или фамилия, имя и отчество (при наличии) физического лица

1	2	3
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	Указывается тип кода клиента в соответствии с приоритетом использования кодов для идентификации сторон договора согласно приложению 8 к настоящему Указанию
17	Код клиента стороны 1	Указывается код клиента стороны по договору, позволяющий идентифицировать клиента
18	Наименование клиента стороны 1	Полное фирменное наименование юридического лица или фамилия, имя и отчество (при наличии) физического лица
19	Код страны клиента 1	Указывается код страны
20	Тип клиента стороны 2	<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>
21	Тип кода клиента стороны 2	Указывается тип кода клиента в соответствии с приоритетом использования кодов для идентификации сторон договора согласно приложению 8 к настоящему Указанию
22	Код клиента стороны 2	Указывается код клиента стороны по договору, позволяющий идентифицировать клиента
23	Наименование клиента стороны 2	Полное фирменное наименование юридического лица или фамилия, имя и отчество (при наличии) физического лица
24	Код страны клиента 1	Указывается код страны
25	Код голосового 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>

1	2	3
26	Код участника клиринга	Указывается международный код идентификации юридического лица – участника клиринга. Если не применимо, поле остается пустым
27	Код типа расчетов	ОТС – внеклиринговый расчет; ССР – расчеты по результатам централизованного клиринга; CS – расчеты по результатам простого клиринга
28	Код метода расчетов	P – поставочный; C – расчетный; E – 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 централизованному клирингу; N – договор не подлежит обязательному централизованному клирингу
33	Дата и время клиринга	Указываются дата и время клиринга договора в журнале учета входящих сообщений в формате ГГГГ-ММ-ДДТЧЧ: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 ГГГГ-ММ-ДД. Если не применимо, поле остается пустым

ТАБЛИЦА 3. СВЕДЕНИЯ ОБ УСЛОВИЯХ ОПЦИОНА

Номер строки	Виды сведений	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

1	2	3
4	Дата исполнения опциона	Указывается дата, в которую покупатель опциона вправе требовать исполнения по договору (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 договору (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	Код единицы измерения базисного актива	Указывается код единицы измерения базисного актива согласно договору (штуки, тонны, баррели, литры и так далее), за исключением валюты
8	Количество базисного актива	Указывается числовое значение в единицах измерения базисного актива (в том 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 ОКВ (буквенный)
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, 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

1	2	3
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 (курс, процентная ставка)	Указывается барьерная цена (курс, 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 опционного договора
21	Код валюты, в которой выражается барьерная цена	Код ОКВ (буквенный)

ТАБЛИЦА 4. СВЕДЕНИЯ ОБ УСЛОВИЯХ СВОПА
(ЗА ИСКЛЮЧЕНИЕМ КРЕДИТНОГО СВОПА)

Номер строки	Виды сведений	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 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 своп договора в валюте, в которой выражен номинал
7	Код валюты, в которой выражена номинальная сумма	Код ОКВ (буквенный)
8	Код амортизации (увеличения) номинальной суммы	Указывается код в соответствии с приложением 4 к настоящему Указанию

1	2	3
9	Код амортизации (увеличения) ставки	Указывается код в соответствии с приложением 4 к настоящему Указанию
10	Фиксированная ставка (в %)	Указывается фиксированная процентная ставка
11	Максимальная ставка	Указывается верхний предел процентной ставки
12	Минимальная ставка	Указывается нижний предел процентной ставки
13	Периодичность платежей	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	Код единицы измерения базисного актива	Указывается код единицы измерения базисного актива согласно договору (штуки, тонны, баррели, литры и так далее), 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	Код единицы измерения базисного актива	Указывается код единицы измерения базисного актива (штуки, тонны, баррели, литры и так далее), согласно договору, 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 оговоренный размер номинальной суммы сделки в валюте, в которой выражена эта сумма, на первую дату расчетов

1	2	3
25	Код валюты, в которой выражена номинальная сумма сделки	Код ОКВ (буквенный)
26	Код амортизации (увеличения) номинальной суммы	Указывается код в соответствии с приложением 4 к настоящему Указанию и (или) указывается код «NAR», если пересчет номинальной суммы сделки осуществляется с учетом индексированной суммы
27	Первоначальная цена на дату заключения договора	Указывается первоначальная цена на дату заключения 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 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 своп договора в валюте, в которой выражен номинал
32	Код валюты, в которой выражена номинальная сумма	Код ОКВ (буквенный)
33	Код амортизации (увеличения) номинальной суммы	Указывается код в соответствии с приложением 4 к настоящему Указанию
34	Код амортизации (увеличения) ставки	Указывается код в соответствии с приложением 4 к настоящему Указанию
35	Фиксированная ставка (в %)	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	Код единицы измерения базисного актива	Указывается код единицы измерения базисного актива согласно договору (штуки, тонны, баррели, литры и так далее), 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)

1	2	3
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 индексируемых сумм		
45	Код базисного актива	Указывается код базисного актива в соответствии с приложением 7 к настоящему Указанию
46	Код единицы измерения базисного актива	Указывается код единицы измерения базисного актива согласно договору (штуки, тонны, баррели, литры и так далее), 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 (увеличения) номинальной суммы	Указывается код в соответствии с приложением 4 к настоящему Указанию и (или) указывается код «NAR», если пересчет номинальной суммы сделки осуществляется учетом индексируемой 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. СВЕДЕНИЯ ОБ УСЛОВИЯХ КРЕДИТНОГО СВОПА

Номер строки	Виды сведений	Описание
1	2	3
1	Идентификационный код договора	Указывается уникальный код идентификации договора

1	2	3
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	Код типа обязательств	Указывается код типа обязательств контрольного лица (долговое обязательство, корзина (портфель) долговых обязательств и так далее)
5	Код категории обязательств контрольного лица	Указывается код категории обязательств контрольного лица (облигация, заем, иная долговая ценная бумага и так далее)
6	Номинальная сумма	Указывается размер номинальной суммы своп 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. СВЕДЕНИЯ ОБ УСЛОВИЯХ ФОРWARDA

Номер строки	Виды сведений	Описание
1	2	3
1	Идентификационный код договора	Указывается уникальный код идентификации договора
2	Код классификации производного финансового инструмента	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	Код единицы измерения базисного актива	Указывается код единицы измерения базисного актива согласно договору (штуки, тонны, баррели, литры и так далее), за исключением валюты

1	2	3
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 форварда	Код ОКВ (буквенный). Если не применимо, поле остается пустым

ТАБЛИЦА 7. СВЕДЕНИЯ ОБ УСЛОВИЯХ ДОГОВОРА РЕПО

Номер строки	Виды сведений	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 репо в валюте, в которой выражается цена сделки по первой части

1	2	3
7	Код валюты, в которой выражается цена	Код ОКВ (буквенный)
8	Фиксированная ставка репо	Указывается фиксированная ставка репо
9	Плавающая ставка репо	Указывается плавающая ставка репо
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 репо в формате ГГГГ-ММ-ДД
13	Дата поставки по второй части	Указывается дата поставки по второй части договора репо в формате ГГГГ-ММ-ДД
14	Дата расчетов по первой части	Указывается дата оплаты по первой части договора репо в формате ГГГГ-ММ-ДД
15	Дата расчетов по второй части	Указывается дата оплаты по второй части договора репо в формате ГГГГ-ММ-ДД

ТАБЛИЦА 8. СВЕДЕНИЯ ОБ УСЛОВИЯХ ИНОГО ДОГОВОРА

Номер строки	Виды сведений	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 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	Код единицы измерения базисного актива	Указывается код единицы измерения базисного актива согласно договору (штуки, тонны, баррели, литры и так далее), 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»

1	2	3
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 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 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 (штуки, тонны, баррели, литры и так далее), 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 которой выражается цена базисного актива	Код ОКВ (буквенный)

1	2	3
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» 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)»

«Приложение 2
к Указанию 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)»

СВЕДЕНИЯ ОБ ОБЕСПЕЧЕНИИ ИСПОЛНЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ, ИНФОРМАЦИЯ О
МАРЖЕВЫХ СУММАХ И О СПРАВЕДЛИВОЙ (ОЦЕНОЧНОЙ) СТОИМОСТИ

ТАБЛИЦА 1. СВЕДЕНИЯ ОБ ОБЕСПЕЧЕНИИ

Номер строки	Виды сведений	Описание
1	2	3
1	Идентификационный код договора	Указывается уникальный код идентификации договора, в соответствии с которым вносится обеспечение
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); У – обязательства по данному договору не обеспечиваются

1	2	3
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 – обязательства по данному договору не обеспечиваются

ТАБЛИЦА 2. ИНФОРМАЦИЯ О МАРЖЕВЫХ СУММАХ

Номер строки	Виды сведений	Описание
1	2	3
1	Идентификационный код договора о порядке уплаты маржевых сумм	Указывается уникальный код идентификации договора о порядке уплаты маржевых сумм. Если не применимо, поле остается пустым
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 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 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 согласно приложению 8 к настоящему Указанию
10	Код получателя плавающей маржевой суммы	Указывается код, позволяющий идентифицировать получателя плавающей маржевой суммы

1	2	3
11	Тип кода плательщика плавающей маржевой суммы	Указывается тип кода плательщика плавающей маржевой суммы в соответствии с приоритетом использования кодов для идентификации сторон договора 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 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 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 сведений в реестр договоров	Указывается дата внесения сведений о маржевой сумме в реестр договоров в формате ГГГГ-ММ-ДД

ТАБЛИЦА 3. ИНФОРМАЦИЯ О СПРАВЕДЛИВОЙ (ОЦЕНОЧНОЙ) СТОИМОСТИ

Номер строки	Виды сведений	Описание
1	2	3
1	Идентификационный код договора о расчете справедливой стоимости	Указывается уникальный код идентификации договора о расчете справедливой стоимости
2	Идентификационный код договора	Указывается уникальный код идентификации договора

1	2	3
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» 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)»

«Приложение 3
к Указанию 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)»

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:

O – опционный договор (далее – опцион);

S – своп договор (далее – своп);

F – форвардный договор (далее – форвард);

R – договор репо (далее – репо).

Атрибуты кода классификации производных финансовых инструментов, являющихся опционами

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;

М – 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;

Х – 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:

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

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

С – товары, товарный индекс, корзина товарных активов;

V – валюта, валютный индекс, корзина валют;

A – договор, являющийся производным финансовым инструментом;

X – смешанный портфель, корзина неоднородных активов;

M – иное.

Атрибуты кода классификации производных финансовых инструментов, являющихся свопами

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 – иное.

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

A – номинал свопа амортизируется (уменьшается) во времени;

H – номинал свопа увеличивается во времени;

W – номинал свопа не меняется;

N – номинал свопа отсутствует;

X – иное.

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 изменить (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.

Атрибуты кода классификации производных финансовых инструментов, являющихся форвардами

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 – договор, являющийся производным финансовым инструментом;

X – смешанный инвестиционный портфель;

M – иное.

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.

Атрибуты кода классификации договоров репо

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» 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)»

«Приложение 4
к Указанию 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)»

КОДЫ

АМОРТИЗАЦИИ ИЛИ ПОВЫШЕНИЯ НОМИНАЛА СВОП ДОГОВОРОВ 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:

АМ – 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 предыдущей процентной ставке величины, на которую прибавляется указанный номинал или указанная процентная ставка;

М – 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 своп договоров, определенный в договорах.

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

1.4. Второй атрибут 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. Третий атрибут кода – числовое значение, отражающее количество дней со дня предыдущего определения или изменения номинала (процентной ставки) до дня изменения номинала или процентной ставки.

1.6. Четвертый атрибут 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 знаком «|».

Приложение 5
к Указанию 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)»

«Приложение 6
к Указанию 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)»

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 является простым инструментом, не входящим в какую-либо сложную структуру в качестве базисного актива и не являющимся основой какой-либо сложной структуры, 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 М.

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 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 присваивается:

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 элемента.»

Приложение 6
к Указанию 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)»

«Приложение 8
к Указанию 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)»

МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ ПО ПРЕДСТАВЛЕНИЮ СВЕДЕНИЙ В РЕПОЗИТАРИЙ

Приоритет использования кодов для идентификации сторон договора

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

2. Для юридических лиц, не обязанных направлять информацию в репозитарий, может указываться следующий тип кода: LEI, ИНН, SWIFT, коды информационных систем, собственные коды, присвоенные стороной генерального соглашения, стороной договора 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 генерального соглашения и

(или) договора, информирующих лиц, клиентов используются коды информационных агентств или собственные коды, присвоенные стороной договора или репозитарием, то при направлении выписки из реестра договоров, журнала учета сообщений и регистрационного журнала репозитарий передает в Банк России все доступные сведения, необходимые для идентификации клиента.

5. Сторона договора, направляющая информацию в репозитарий, вправе пользоваться услугами нескольких информирующих лиц для передачи данных по отдельным договорам, заключенным в рамках одного генерального соглашения. Занесению в реестр подлежат сведения о каждом информирующем лице, указанном в этом качестве отчитывающейся стороной.

6. 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).

Уникальный код идентификации договора

7. Уникальный код идентификации договора (Unique Trade Identifier, UTI) – это уникальный код, формируемый и присваиваемый в момент заключения договора, указанного в пунктах 2 и 3 настоящего Указания, который обеспечивает его однозначную идентификацию для целей представления информации в репозитарий.

8. В случае заключения договора, указанного в пунктах 2 и 3 настоящего Указания, при помощи электронной торговой площадки, формирование уникального кода идентификации договора (Unique Trade Identifier, UTI) осуществляется электронной площадкой.

9. В случае заключения договора, указанного в пунктах 2 и 3 настоящего Указания, на бумажном носителе, формирование уникального кода идентификации договора (Unique Trade Identifier, UTI) осуществляет одна из сторон такого договора по согласованию сторон.

10. Уникальный код идентификации договора (Unique Trade Identifier, UTI) состоит из следующих частей:

префикс, определяемый десятью символами международного кода идентификации юридического лица (Legal Entity Identifier, LEI) с седьмого по шестнадцатый включительно;

идентификатор сделки, максимальная длина которого составляет 42 символа.

11. 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.

Иные указания по представлению информации в репозитарий

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

13. Код страны указывается в соответствии с Общероссийским классификатором стран мира.

14. Сторона договора, обязанная направлять информацию в репозитарий, представляет все сведения, упомянутые в приложении 1 к настоящему Указанию, за исключением тех, которые не имеют отношения к договору.

15. Таблица 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 направлении выписки из реестра договоров, журнала учета сообщений и регистрационного журнала в Банк России репозитарий передает все доступные сведения, необходимые для идентификации клиента, продавца (покупателя).

16. Таблицы 3, 4, 5, 6, 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 производится 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. Таблица 2 приложения 2 к настоящему Указанию:

сведения о маржевых суммах заполняются в соответствии со стандартными условиями договора о порядке уплаты плавающих маржевых сумм, утвержденными саморегулируемой организацией профессиональных участников рынка ценных бумаг и опубликованными в печати или размещенными в сети «Интернет» в соответствии с пунктом 1 статьи 51⁵ 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, ст. 6249; 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; № 27, ст. 3880; № 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);

информация в соответствии с данным приложением предоставляется в течение трех рабочих дней после возникновения требований или обязательств по выплате первоначальной и плавающей маржевых сумм. Если требования или обязательства по выплате маржевых сумм не возникают, информация в соответствии с данным приложением не предоставляется;

допускается внесение в реестр договоров записей, содержащих разные значения маржевых сумм на одну дату оценки, полученную от разных сторон договора или информирующих лиц.

18. Таблица 3 приложения 2 к настоящему Указанию:

если справедливая (оценочная) стоимость договора определяется на основании отдельного договора, информация о сторонах договора и прочая информация предоставляются в соответствии с таблицей 3 приложения 2 к настоящему Указанию;

информация о справедливой (оценочной) стоимости направляется в репозиторий по мере переоценки стоимости не позднее трех рабочих дней с даты, на которую приводится информация о справедливой стоимости. В случае возникновения у сторон договора разногласий о величине справедливой (оценочной) стоимости, в репозиторий направляется информация о стоимости неоспариваемого размера. По мере урегулирования разногласий и окончательных расчетов соответствующая информация направляется в репозиторий;

допускается внесение в реестр договоров записей, содержащих разные значения справедливой (оценочной) стоимости на одну дату оценки, полученных от разных сторон договора или информирующих лиц.»