



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

Территориальные учреждения
Банка России

ПЕРВЫЙ ЗАМЕСТИТЕЛЬ ПРЕДСЕДАТЕЛЯ

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

от 02.11.2016 № ИН-05-19/76

на № _____ от _____

Информационное письмо Банка России о новой форме генерального соглашения, содержащей общие условия совершения Банком России и кредитной организацией сделок РЕПО на организованных торгах и не на организованных торгах в Российской Федерации

Банк России разработал новую форму Генерального соглашения об общих условиях совершения Банком России и кредитной организацией сделок РЕПО на организованных и не на организованных торгах в Российской Федерации (далее – Генеральное соглашение) с целью актуализации и унификации договорно-правового регулирования сделок РЕПО, которая приведена в приложении 1 к настоящему информационному письму.

Новый подход к структуре Генерального соглашения предусматривает заключение Банком России сделок РЕПО в соответствии с Условиями совершения Банком России и кредитной организацией сделок РЕПО на организованных и не на организованных торгах в Российской Федерации (далее – Условия), которые разработаны с учетом накопленного опыта проведения операций рефинансирования. Условия приведены в приложении 2 к настоящему информационному письму (редакция от «01» ноября 2016 года).

Условия включают в себя используемые в настоящее время Банком России способы заключения сделок РЕПО: организованные торги ЗАО ФБ ММВБ, организованные торги АО СПВБ и заключение сделок РЕПО с

использованием информационной системы Bloomberg. Генеральным соглашением предусмотрено право Банка России изменять Условия в одностороннем порядке с предварительным уведомлением кредитной организации без подписания дополнительных соглашений, что позволит более оперативно и эффективно реагировать на изменения законодательства Российской Федерации и основных параметров денежно-кредитной политики Банка России.

С учетом изложенного выше, Банк России сообщает следующее.

1. С 7 ноября 2016 года Банк России выражает свою готовность заключать Генеральное соглашение с обратившимися в указанных целях в Банк России кредитными организациями.

2. С 1 января 2017 года заключение сделок РЕПО с Банком России будет возможно только с кредитными организациями, заключившими Генеральное соглашение, и в соответствии с Условиями в редакции, действующей на дату заключения сделки РЕПО.

3. С 1 января 2017 года с кредитными организациями, не заключившими Генеральное соглашение, Банком России будут осуществлены все действия, необходимые для расторжения в одностороннем порядке действующих в настоящее время генеральных соглашений об общих условиях совершения Банком России и кредитной организацией сделок РЕПО в соответствии с их условиями, заключенных по формам, приведенным в письмах Банка России от 27 февраля 2013 года № 29-Т, от 29 марта 2013 года № 55-Т и от 28 сентября 2015 года № 03-19-4/8416.

4. При намерении заключить Генеральное соглашение кредитной организации целесообразно руководствоваться следующим.

В целях заключения Генерального соглашения в Банк России по адресу 107016, г. Москва, ул. Неглинная, 12, Операционный департамент, направляется заявление о намерении заключить Генеральное соглашение по форме, приведенной в приложении 3 к настоящему письму (далее – Заявление) с приложением двух подписанных экземпляров Генерального соглашения, а также доверенности на подписание Генерального соглашения, содержащей образец подписи лица, уполномоченного на его подписание, либо копии документа, подтверждающего полномочия должностного лица кредитной организации

на подписание Генерального соглашения, заверенной в порядке, установленном законодательством Российской Федерации (при подписании Генерального соглашения руководителем кредитной организации к Заявлению прилагаются только два подписанных экземпляра Генерального соглашения) (далее – Комплект документов).

Одновременно с направлением в соответствии с настоящим пунктом Заявления с Комплектом документов кредитная организация для сообщения Банку России реквизитов счетов для перечисления денежных средств и перевода ценных бумаг в целях пункта 2.13 Условий может передать Уведомление о платежных и иных реквизитах Кредитной организации, составленное по форме Приложения 4 к Условиям.

Заявление с Комплектом документов будут рассматриваться Банком России в срок не более десяти рабочих дней со дня получения Заявления с Комплектом документов. В случае наличия полного Комплекта документов и отсутствия в Заявлении и Комплекте документов ошибок в заполнении и неточностей Банком России будут подписаны два экземпляра Генерального соглашения и возвращен кредитной организации один экземпляр подписанного Генерального соглашения.

В случае наличия в Заявлении или Комплекте документов ошибок в заполнении, неточностей или отсутствия полного Комплекта документов Банк России в срок не позднее десяти рабочих дней со дня их получения направит кредитной организации письмо с приложением указанных документов и указанием причин их возврата. При повторном направлении кредитной организацией Заявления с Комплектом документов оно будет рассматриваться как вновь поступившее.

5. Пункт 11 Генерального соглашения целесообразно исключить из текста Генерального соглашения с кредитной организацией, ранее не заключавшей с Банком России генеральных соглашений об общих условиях совершения Банком России и кредитной организацией сделок РЕПО по формам, приведенным в письмах Банка России от 27 февраля 2013 года № 29-Т, от 27 февраля 2013 года № 30-Т, от 29 марта 2013 года № 55-Т и от 28 сентября 2015 года № 03-19-4/8416 (далее – иные соглашения). В обратном случае пункт 11 Генерального соглашения заполняется кредитной организацией с указанием реквизитов ранее заключенных иных соглашений.

6. Настоящее письмо, Условия и формы Заявления, Генерального соглашения и Уведомления о платежных и иных реквизитах Кредитной организации, а также рекомендации по их заполнению для направления в Банк России размещены на сайте Банка России в информационной телекоммуникационной сети «Интернет» в разделе «Денежно-кредитная политика», рубрика «Допуск к операциям РЕПО с Банком России».

Контактные телефоны сотрудников Банка России по вопросам заключения Генерального соглашения: (495) 771-46-18, 771-99-99 доб. 1-56-73.

7. С 1 января 2017 года не применяется письмо Банка России от 28 сентября 2015 года № 03-19-4/8416 «О новых формах генеральных соглашений, устанавливающих общие условия совершения Банком России и кредитной организацией сделок РЕПО на организованных торгах и не на организованных торгах».

8. Территориальным учреждениям Банка России довести настоящее письмо до сведения кредитных организаций.

Настоящее письмо подлежит размещению на официальном сайте Банка России в информационной телекоммуникационной сети «Интернет» и опубликованию в «Вестнике Банка России».

Приложение:

1. Форма Генерального соглашения об общих условиях совершения Банком России и кредитной организацией сделок РЕПО на организованных и не на организованных торгах в Российской Федерации – на 2 листах;
2. Условия совершения Банком России и кредитной организацией Сделок РЕПО на организованных и не на организованных торгах в Российской Федерации редакция от «01» ноября 2016 года – на 27 листах;
3. Форма заявления о намерении заключить Генеральное соглашение – на 1 листе.



К.В. Юдаева

**Генеральное соглашение № _____
об общих условиях совершения Банком России и кредитной организацией
сделок РЕПО на организованных и не на организованных торгах в Российской Федерации**

г. Москва

«__» _____ 20__ года

Центральный банк Российской Федерации (Банк России), именуемый в дальнейшем Банк России, в лице _____, действующего (ей) на основании _____, и _____, именуемое (ый) в дальнейшем Кредитная организация, в лице _____, действующего (ей) на основании _____, именуемые в дальнейшем Стороны, заключили настоящее Генеральное соглашение об общих условиях совершения Банком России и кредитной организацией сделок РЕПО на организованных и не на организованных торгах в Российской Федерации (далее – *Соглашение*) о нижеследующем.

1. Предметом настоящего *Соглашения* являются взаимоотношения Сторон при заключении и исполнении на территории Российской Федерации *Сделок РЕПО*, осуществляемых в порядке и на условиях, определенных Условиями совершения Банком России и кредитной организацией *Сделок РЕПО* на организованных и не на организованных торгах в Российской Федерации (далее – *Условия*), являющимися неотъемлемой частью настоящего *Соглашения*, размещенными на официальном сайте Банка России в информационно-телекоммуникационной сети «Интернет» по адресу: www.cbr.ru и опубликованными в «Вестнике Банка России».

2. Банк России вправе в одностороннем порядке вносить изменения в *Условия*, в том числе путем их изложения в новой редакции, с обязательным уведомлением Кредитной организации не менее, чем за 10 рабочих дней до введения в действие изменений (новой редакции). Уведомление Кредитной организации об изменении (изложении в новой редакции) *Условий* производится Банком России путем размещения соответствующей информации (новой редакции *Условий*) на официальном сайте Банка России в информационно-телекоммуникационной сети «Интернет» по адресу: www.cbr.ru и ее опубликования в «Вестнике Банка России». Датой уведомления считается дата размещения соответствующего уведомления (новой редакции *Условий*) на официальном сайте Банка России в информационно-телекоммуникационной сети «Интернет» по адресу: www.cbr.ru.

Кредитная организация самостоятельно осуществляет весь необходимый комплекс мер по получению указанных в настоящем пункте уведомлений.

Банк России не несет ответственность за неполучение Кредитной организацией указанной в настоящем пункте информации.

Стороны соглашаются, что размещение Банком России в соответствии с настоящим пунктом информации на официальном сайте Банка России в информационно-телекоммуникационной сети «Интернет» по адресу: www.cbr.ru признается Сторонами достаточным для информирования Кредитной организации об изменении (новой редакции) *Условий*.

3. Все заключаемые Сторонами сделки с *Ценными бумагами*, соответствующие указанному в разделе 1 «Термины и определения» *Условий* определению *Сделки РЕПО*, регулируются настоящим *Соглашением*, если при их заключении Стороны не договорились об ином регулировании.

4. В соответствии с настоящим *Соглашением* Стороны вправе, но не обязаны заключать *Сделки РЕПО*.

5. Правоотношения Сторон по заключенным *Сделкам РЕПО* регулируются настоящим *Соглашением* и в части, не урегулированной настоящим *Соглашением* и не противоречащей ему, – *Документами НКО АО НРД, Правилами торгов Ф Б ММВБ, Правилами торгов СПВБ, Правилами клиринга НКЦ*. В случаях, предусмотренных пунктом 3 статьи 51.5 Федерального закона от 22 апреля 1996 года № 39-ФЗ «О рынке ценных бумаг», а также в иных случаях, предусмотренных настоящим *Соглашением*, правоотношения Сторон по заключенным *Сделкам РЕПО* регулируются *Примерными условиями договоров РЕПО*.

6. Стороны не вправе уступать свои права и обязанности по настоящему *Соглашению* третьей стороне.

7. Любые изменения и дополнения к настоящему *Соглашению* имеют силу, если они оформлены в письменной форме и подписаны Сторонами, за исключением случаев, предусмотренных настоящим *Соглашением*.

В одностороннем порядке могут быть изменены и (или) дополнены адреса Сторон, а также иные реквизиты, указанные в пункте 12 настоящего *Соглашения*. Такие изменения должны быть совершены в письменной форме и направлены Стороной, реквизиты которой изменились, другой Стороне не позднее второго рабочего дня с даты произошедшего изменения.

8. Каждая из Сторон вправе в одностороннем порядке расторгнуть настоящее *Соглашение*. В случае расторжения настоящего *Соглашения* Сторона, расторгающая настоящее *Соглашение*, письменно не позднее чем за 10 (десять) рабочих дней до даты предполагаемого расторжения настоящего *Соглашения* уведомляет об этом другую Сторону.

Расторжение настоящего *Соглашения* не освобождает Стороны от выполнения обязательств, возникших в период его действия, в том числе по *Сделкам РЕПО*, не исполненным на дату его расторжения, а также от ответственности за неисполнение или ненадлежащее исполнение обязательств.

9. Настоящее *Соглашение* вступает в силу с даты подписания Сторонами.

10. Настоящее *Соглашение* составлено в 2 (двух) экземплярах, имеющих одинаковую юридическую силу, по одному экземпляру для каждой из Сторон.

11. С даты вступления в силу настоящего *Соглашения* считаются расторгнутыми следующие генеральные соглашения:

Генеральное соглашение об общих условиях совершения Банком России и кредитной организацией сделок РЕПО на Санкт-Петербургской Валютной Бирже от «__» _____ 20__ года № _____;

Генеральное соглашение об общих условиях совершения Банком России и кредитной организацией сделок РЕПО на Фондовой бирже ММВБ от «__» _____ 20__ года № _____;

Генеральное соглашение об общих условиях совершения Банком России и кредитной организацией сделок РЕПО не на организованных торгах в Российской Федерации с использованием информационной системы Bloomberg от «__» _____ 20__ года № _____;

Генеральное соглашение об общих условиях совершения Банком России и кредитной организацией сделок РЕПО не на организованных торгах в Российской Федерации с использованием информационной системы Московской Биржи от «__» _____ 20__ года № _____.

Расторжение перечисленных в настоящем пункте генеральных соглашений не освобождает Стороны от исполнения обязательств, возникших в период действия генеральных соглашений, в том числе обязательств по *Сделкам РЕПО*, которые не были исполнены на дату вступления в силу *Соглашения*.

12. Подписи, адреса и реквизиты Сторон:

Центральный банк Российской Федерации

Почтовый адрес: 107016, г. Москва,
ул. Неглинная, д. 12

ОГРН 1037700013020

(полное наименование Кредитной организации)
Почтовый адрес: _____

ОГРН _____

(должность)

(Ф.И.О.)

М.П.

(должность)

(Ф.И.О.)

М.П.

Условия совершения Банком России и кредитной организацией Сделок РЕПО на организованных и не на организованных торгах в Российской Федерации

редакция от 01 ноября 2016 года

Настоящие Условия совершения Банком России и кредитной организацией Сделок РЕПО на организованных и не на организованных торгах в Российской Федерации в редакции от 01 ноября 2016 года (далее – *Условия*) являются неотъемлемой частью *Соглашения* и устанавливают порядок заключения и исполнения на территории Российской Федерации *Сделок РЕПО*, а также ответственность Сторон за неисполнение или ненадлежащее исполнение обязательств по *Соглашению* и (или) указанным *Сделкам РЕПО*.

Раздел 1. Термины и определения

1.1. Для целей *Соглашения* и настоящих *Условий* применяются следующие термины и определения:

Сделка РЕПО – договор РЕПО, заключаемый Сторонами на организованных или не на организованных торгах в Российской Федерации, в соответствии с которым Кредитная организация (продавец по договору РЕПО) обязуется в срок, установленный условиями настоящего *Соглашения* и соответствующей *Сделкой РЕПО*, передать в собственность Банку России (покупатель по договору РЕПО) *Ценные бумаги*, а Банк России обязуется принять *Ценные бумаги* и уплатить за них *Сумму РЕПО* Кредитной организации (первая часть *Сделки РЕПО*), и по которому Банк России обязуется в срок, установленный условиями настоящего *Соглашения* и соответствующей *Сделкой РЕПО*, передать *Ценные бумаги* в собственность Кредитной организации, а Кредитная организация обязуется принять *Ценные бумаги* и уплатить за них *Стоимость обратного выкупа* Банку России (вторая часть *Сделки РЕПО*).

Ценные бумаги – ценные бумаги, принимаемые Банком России по *Сделкам РЕПО* на момент заключения *Сделки РЕПО* и (или) на момент подбора *Ценных бумаг* из *Корзины РЕПО* и (или) на момент внесения компенсационного взноса, за исключением ценных бумаг, эмитентом которых является Кредитная организация, а также ценных бумаг, в отношении которых Банком России принято решение не заключать *Сделки РЕПО* с Кредитной организацией.

Сумма РЕПО – сумма денежных средств, подлежащая уплате Банком России Кредитной организации за *Ценные бумаги* по первой части *Сделки РЕПО*.

Ставка РЕПО – величина, выраженная в процентах годовых, которая используется для расчета *Стоимости обратного выкупа*.

Плавающая Ставка РЕПО – условие *Сделки РЕПО*, при котором *Ставка РЕПО* может корректироваться в связи с изменением *Индикативной ставки* в течение *Срока Сделки РЕПО*.

Индикативная ставка – показатель (индикатор, ставка), соответствующий валюте *Сделки РЕПО*, изменение которого (ой) используется для расчета и корректировки *Ставки РЕПО* в случае заключения *Сделки РЕПО* на условиях *Плавающей Ставки РЕПО*.

Спред к индикативной ставке – величина отклонения *Ставки РЕПО* от *Индикативной ставки*, выраженная в процентах годовых.

Стоимость обратного выкупа – сумма денежных средств, подлежащая уплате Кредитной организацией Банку России за *Ценные бумаги* по второй части *Сделки РЕПО*.

Срок Сделки РЕПО – период времени в календарных днях между *Датой первой части Сделки РЕПО* включительно и *Датой второй части Сделки РЕПО*, исключая эту дату.

Дата первой части Сделки РЕПО – календарная дата, в которую должны быть исполнены *Обязательства Кредитной организации по первой части Сделки РЕПО* и *Обязательства Банка России по первой части Сделки РЕПО*.

Дата второй части Сделки РЕПО – календарная дата, в которую должны быть исполнены *Обязательства Кредитной организации по второй части Сделки РЕПО* и *Обязательства Банка России по второй части Сделки РЕПО*.

Аукцион РЕПО – форма заключения Банком России *Сделок РЕПО* на организованных и (или) не на организованных торгах в Российской Федерации, предусматривающая период сбора заявок на

заключение *Сделок РЕПО* для целей определения ставки отсечения и период их удовлетворения в порядке, установленном настоящими *Условиями*.

Торги по фиксированной ставке РЕПО – форма заключения Банком России *Сделок РЕПО* на организованных и (или) не на организованных торгах в Российской Федерации на условиях фиксированной *Ставки РЕПО* устанавливаемой Банком России.

Обязательства Кредитной организации по первой части Сделки РЕПО – обязательства Кредитной организации передать Банку России *Ценные бумаги*, являющиеся предметом *Сделки РЕПО*, в соответствии с условиями заключенной *Сделки РЕПО*, или *Ценные бумаги* из *Корзины РЕПО* в количестве, определяемом в соответствии с порядком, предусмотренным *Документами НКО АО НРД*.

Обязательства Банка России по первой части Сделки РЕПО – обязательства Банка России принять передаваемые Кредитной организацией по первой части *Сделки РЕПО* *Ценные бумаги*, являющиеся предметом *Сделки РЕПО*, в соответствии с условиями заключенной *Сделки РЕПО* или *Ценные бумаги* из *Корзины РЕПО* в количестве, определяемом в соответствии с порядком, предусмотренным *Документами НКО АО НРД*, и уплатить Кредитной организации денежные средства в *Сумме РЕПО*.

Обязательства Кредитной организации по второй части Сделки РЕПО – обязательства Кредитной организации принять *Ценные бумаги*, передаваемые Банком России по второй части *Сделки РЕПО*, и уплатить Банку России денежные средства в размере *Стоимости обратного выкупа*.

Обязательства Банка России по второй части Сделки РЕПО – обязательства Банка России передать Кредитной организации *Ценные бумаги* того же выпуска и в том же количестве, что и *Ценные бумаги*, полученные по первой части *Сделки РЕПО*, в результате замены *Ценных бумаг* в течение *Срока Сделки РЕПО* и (или) в качестве компенсационного взноса, за вычетом погашенных *Ценных бумаг*, *Ценных бумаг*, переданных Банком России Кредитной организации в качестве компенсационного взноса и (или) в результате замены *Ценных бумаг* в течение *Срока Сделки РЕПО* в соответствии с условиями заключенной *Сделки РЕПО*.

Обязательства по внесению компенсационного взноса – обязательство Банка России по внесению компенсационного взноса в форме *Ценных бумаг* или обязательство Кредитной организации по внесению компенсационного взноса в форме *Ценных бумаг* и (или) денежных средств в порядке и случаях, предусмотренных настоящими *Условиями* и (или) *Документами НКО АО НРД* и (или) *Правилами торгов ФБ ММВБ*.

Неурегулированные обязательства (Остаточные обязательства) Кредитной организации – сумма денежных средств, рассчитанная в результате неисполнения *Обязательств Кредитной организации по второй части Сделки РЕПО* в соответствии с приложением 1 к настоящим *Условиям*.

Неурегулированные обязательства (Остаточные обязательства) Банка России – сумма денежных средств, рассчитанная в соответствии с пунктом 6.3 раздела 6 настоящих *Условий* и используемая для осуществления *Процедуры урегулирования*.

Процедура урегулирования – установленные настоящими *Условиями* основания и порядок прекращения обязательств Сторон по *Сделке РЕПО* в случае неисполнения или ненадлежащего исполнения *Обязательства Кредитной организации по второй части Сделки РЕПО*, включающий порядок определения обязанной Стороны и суммы денежных средств (количества *Ценных бумаг*), подлежащих уплате (передаче) такой Стороной в связи с указанным выше прекращением обязательств по *Сделке РЕПО*.

Корзина РЕПО – зарегистрированные в соответствии с *Документами НКО АО НРД* в качестве *Корзины РЕПО* и принадлежащие Кредитной организации *Ценные бумаги*, которые могут быть подобраны Небанковской кредитной организацией акционерным обществом «Национальный расчетный депозитарий» (далее – *НКО АО НРД*) в соответствии с *Документами НКО АО НРД* и переданы Банку России для исполнения *Обязательства Кредитной организации по первой части Сделки РЕПО*, а также в иных предусмотренных *Документами НКО АО НРД* случаях.

Реестр Сделок РЕПО – перечень полученных с использованием информационной системы Bloomberg заявок Кредитной организации, удовлетворенных Банком России по результатам *Аукциона РЕПО* и (или) *Торгов по фиксированной ставке РЕПО*, содержащий основные (существенные) условия заключенных *Сделок РЕПО*.

Общий реестр Сделок РЕПО – общий перечень полученных с использованием информационной системы Bloomberg от всех кредитных организаций, участвовавших в *Аукционе РЕПО* и (или) *Торгах по фиксированной ставке РЕПО*, заявок, удовлетворенных Банком России по результатам *Аукциона РЕПО* и (или) *Торгов по фиксированной ставке РЕПО*, содержащий основные (существенные) условия заключенных *Сделок РЕПО*.

Момент получения Кредитной организацией направленного Банком России Реестра Сделок РЕПО – дата и время, в которые *Общий реестр Сделок РЕПО* размещен Банком России на сервере информационной системы Bloomberg.

Перенос даты второй части Сделки РЕПО – внесение изменений в соответствии с *Документами НКО АО НРД* в условия *Сделки РЕПО* путем установления *Даты второй части Сделки РЕПО* на рабочий день, следующий за днем неперечисления Кредитной организацией денежных средств для исполнения *Обязательства Кредитной организации по второй части Сделки РЕПО*.

Документы НКО АО НРД – утвержденные уполномоченным органом НКО АО НРД Правила осуществления клиринговой деятельности НКО АО НРД (далее – *Правила клиринга НРД*), Порядок взаимодействия клиентов и НКО АО НРД при оказании услуг по управлению обеспечением, Порядок взаимодействия Депозитария и Депонентов при реализации Условий осуществления депозитарной деятельности НКО АО НРД.

Правила торгов ФБ ММВБ – утвержденные уполномоченным органом закрытого акционерного общества «Фондовая биржа ММВБ» Правила проведения торгов по ценным бумагам в Закрытом акционерном обществе «Фондовая биржа ММВБ».

Правила торгов СПВБ – утвержденные уполномоченным органом акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа» Правила организованных торгов Закрытого акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа».

Правила клиринга НКЦ – утвержденные уполномоченным органом Банка «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество) (далее – Банк НКЦ (АО) Правила клиринга Банка «Национальный клиринговый центр» (АО).

Система ЭДО НРД – система электронного документооборота НКО АО НРД.

Договор об обмене электронными документами (Договор ЭДО) – договор, определяющий условия и порядок обмена электронными документами через систему ЭДО НРД, заключенный каждой из Сторон с НКО АО НРД.

Правила ЭДО НРД – утвержденные уполномоченным органом НКО АО НРД Правила электронного документооборота НКО АО НРД, являющиеся приложением к *Договору ЭДО*.

Лимит по Сделкам РЕПО – установленный Банком России максимально возможный объем обязательств Кредитной организации по всем действующим *Сделкам РЕПО* в валюте Российской Федерации, заключенным на организованных и не на организованных торгах в Российской Федерации.

Лимит на аукцион по предоставлению ликвидности – устанавливаемый Банком России максимальный объем предоставляемых кредитным организациям денежных средств:

в иностранной валюте на *Аукционе РЕПО*;

в валюте Российской Федерации при проведении Банком России *Аукциона РЕПО* и иных операций по предоставлению ликвидности, за исключением операций, проводимых по фиксированной ставке, и операций по предоставлению кредитов.

Цена Ценных бумаг по Сделке РЕПО (Цена РЕПО) – цена *Ценных бумаг* (без учета накопленного купонного дохода), используемая Банком России для заключения *Сделки РЕПО*.

Примерные условия договоров РЕПО – Примерные условия договоров РЕПО на Российском финансовом рынке (2-ая редакция), утвержденные Советом СРО НФА 23 ноября 2012 года (протокол № 12) и согласованные Федеральной службой по финансовым рынкам 9 апреля 2013 года.

1.2. Термины, не определенные в настоящих *Условиях*, применяются в значениях, установленных Федеральным законом от 22 апреля 1996 года № 39-ФЗ «О рынке ценных бумаг», *Документами НКО АО НРД*, *Правилами клиринга НКЦ*, *Правилами торгов ФБ ММВБ*, *Правилами торгов СПВБ*, *Правилами ЭДО НРД* и *Примерными условиями договоров РЕПО*.

1.3. Стороны соглашаются с тем, что в случае внесения изменений в *Документы НКО АО НРД*, *Правила клиринга НКЦ*, *Правила торгов ФБ ММВБ*, *Правила торгов СПВБ*, *Правила ЭДО НРД*, *Примерные условия договоров РЕПО*, в том числе в случае принятия указанных документов в новой редакции или утверждения соответствующих новых версий указанных документов, соответствующие изменения в *Документы НКО АО НРД*, *Правила клиринга НКЦ*, *Правила торгов ФБ ММВБ*, *Правила торгов СПВБ*, *Правила ЭДО НРД*, *Примерные условия договоров РЕПО* со дня введения в действие указанных изменений распространяются на отношения Сторон по *Соглашению* и настоящим *Условиям* и совершаемые в соответствии с ними *Сделки РЕПО*.

Раздел 2. Общие условия

2.1. Каждая из Сторон заключает *Сделки РЕПО* в соответствии с *Соглашением* и настоящими *Условиями* только от своего имени и за свой счет.

Информация о *Ценных бумагах* или ссылка на источник информации о *Ценных бумагах* размещается на официальном сайте Банка России в информационно-телекоммуникационной сети «Интернет».

Перечень ценных бумаг, в отношении которых Банком России принято решение не заключать *Сделки РЕПО*, доводится Банком России до сведения Кредитной организации через *Систему ЭДО НРД* и (или) письмами в произвольной форме.

2.2. *Сделки РЕПО* могут заключаться на организованных торгах в Российской Федерации в соответствии с *Правилами торгов ФБ ММВБ* или *Правилами торгов СПВБ*, а также не на организованных торгах в Российской Федерации с использованием информационной системы Bloomberg.

Сделки РЕПО, заключаемые в соответствии с *Правилами торгов ФБ ММВБ*, предусматривают условия осуществления клиринга в соответствии с *Правилами клиринга НКЦ* или *Правилами клиринга НРД*.

Сделки РЕПО, заключаемые в соответствии с *Правилами торгов СПВБ*, предусматривают условие осуществления клиринга в соответствии с *Правилами клиринга НРД*.

Сделки РЕПО, заключаемые не на организованных торгах в Российской Федерации с использованием информационной системы Bloomberg, предусматривают условия осуществления клиринга в соответствии с *Правилами клиринга НРД*.

2.3. *Сделки РЕПО* в валюте Российской Федерации заключаются Сторонами в пределах *Лимита по Сделкам РЕПО*.

Остаток *Лимита по Сделкам РЕПО* на начало дня доводится до сведения Кредитной организации в день проведения *Аукциона РЕПО* и (или) *Торгов по фиксированной ставке РЕПО* до начала приема заявок от Кредитной организации:

при заключении *Сделок РЕПО* в соответствии с *Правилами торгов ФБ ММВБ* – через *Систему торгов ФБ ММВБ* (термин определяется *Правилами торгов ФБ ММВБ*);

при заключении *Сделок РЕПО* в соответствии с *Правилами торгов СПВБ* – через *Систему торгов СПВБ* (термин определяется *Правилами торгов СПВБ*);

при заключении *Сделок РЕПО* с использованием информационной системы Bloomberg – через информационную систему Bloomberg.

Банк России вправе устанавливать ограничение на максимальный объем обязательств Кредитной организации по *Сделкам РЕПО* в иностранной валюте. Соответствующая информация доводится до сведения Кредитной организации не позднее дня проведения *Аукциона РЕПО* до начала приема заявок от Кредитной организации:

при заключении *Сделок РЕПО* в соответствии с *Правилами торгов ФБ ММВБ* – через *Систему торгов ФБ ММВБ*;

при заключении *Сделок РЕПО* в соответствии с *Правилами торгов СПВБ* – через *Систему торгов СПВБ*.

2.4. Информационный обмен между Банком России и Кредитной организацией осуществляется через:

2.4.1. *Систему ЭДО НРД* в соответствии с *Правилами ЭДО НРД*;

2.4.2. Если иное не предусмотрено настоящими *Условиями*:

для *Сделок РЕПО*, заключаемых в соответствии с *Правилами торгов ФБ ММВБ*, через *Систему торгов ФБ ММВБ*;

для *Сделок РЕПО*, заключаемых в соответствии с *Правилами торгов СПВБ*, через *Систему торгов СПВБ*;

для *Сделок РЕПО*, заключаемых с использованием информационной системы Bloomberg, через информационную систему Bloomberg;

2.4.3. В случаях, предусмотренных настоящими *Условиями*, – в письменной форме.

2.5. Условие *Сделки РЕПО* о *Ценных бумагах*, являющихся предметом *Сделки РЕПО*, согласовывается Сторонами следующим образом:

для *Сделок РЕПО*, клиринг которых будет осуществляться в соответствии с *Правилами клиринга НКЦ*, – в порядке, установленном *Правилами торгов ФБ ММВБ*;

для *Сделок РЕПО*, клиринг которых будет осуществляться в соответствии с *Правилами клиринга НРД*, – путем отсылки к *Корзине РЕПО*.

Право выбора *Ценных бумаг* из состава *Корзины РЕПО*, подлежащих передаче по первой части *Сделки РЕПО*, предоставляется Кредитной организации в порядке, установленном *Документами НКО АО НРД*.

Кредитная организация и Банк России вправе осуществлять замену *Ценных бумаг*, переданных по *Сделке РЕПО*, клиринг которой осуществляется в соответствии с *Правилами клиринга НРД*, на

другие *Ценные бумаги Корзины РЕПО* в соответствии с условиями, предусмотренными *Документами НКО АО НРД* и положениями абзацев 2 и 3 пункта 2.1 настоящих *Условий*.

2.6. Валютой денежных обязательств и валютой расчетов по *Сделкам РЕПО* является валюта Российской Федерации, или доллар США, или евро, за исключением *Сделок РЕПО*, заключаемых с использованием информационной системы Bloomberg, для которых валютой денежных обязательств и валютой расчетов является только валюта Российской Федерации.

2.7. Не позднее дня проведения *Аукциона РЕПО* и (или) *Торгов по фиксированной ставке РЕПО* до начала приема заявок от Кредитных организаций Банк России доводит до сведения Кредитной организации в соответствии подпунктом 2.4.2 пункта 2.4 настоящих *Условий* информацию о параметрах *Аукциона РЕПО* и (или) *Торгах по фиксированной ставке РЕПО*, в том числе валюте денежных обязательств и валюте расчетов по заключаемым *Сделкам РЕПО*, необходимости содержания в подаваемой на *Аукцион РЕПО* заявке Кредитной организации только *Ставки РЕПО* или только *Спреда к индикативной ставке*, предполагаемом *Сроке Сделки РЕПО*.

2.8. Для *Сделок РЕПО*, клиринг которых осуществляется в соответствии с *Правилами клиринга НРД*, Банк России устанавливает в соответствии с *Документами НКО АО НРД* значение *Допустимого уровня переоценки* (термин определяется *Документами НКО АО НРД*).

Информация об установленном значении *Допустимого уровня переоценки* доводится Банком России до сведения Кредитной организации через НКО АО НРД.

2.9. Для целей перечисления денежных средств в валюте Российской Федерации в соответствии с настоящими *Условиями* под рабочим днем понимается день, в который одновременно открыты для расчетов платежная система Банка России, Банк НКЦ (АО) и НКО АО НРД.

Для целей перечисления денежных средств в иностранной валюте, кроме евро, в соответствии с настоящими *Условиями* под рабочим днем понимается день, в который одновременно открыты для расчетов платежная система Банка России, Банк НКЦ (АО) и НКО АО НРД и являющийся одновременно рабочим днем в стране-эмитенте валюты платежа, в которой находятся банки-корреспонденты Банка России, если иное не установлено *Правилами клиринга НКЦ* или *Документами НКО АО НРД*.

Для целей перечисления денежных средств в евро в соответствии с настоящими *Условиями* под рабочим днем понимается день, в который одновременно открыты для расчетов платежная система Банка России, Банк НКЦ (АО) и НКО АО НРД и Трансевропейская автоматизированная экспресс-система валовых расчетов в режиме реального времени (TARGET2).

2.10. Определение обязательств Сторон по *Сделкам РЕПО*, заключенным на условиях клиринга в соответствии с *Правилами клиринга НРД*, включая:

Обязательства по внесению компенсационных взносов и информирование Сторон об указанных обязательствах;

клиринг обязательств по *Сделкам РЕПО*;

расчеты и передачу *Ценных бумаг* по заключенным *Сделкам РЕПО*;

осуществление замены *Ценных бумаг*;

изменение условий *Сделок РЕПО* – в случаях, предусмотренных настоящими *Условиями* и *Документами НКО АО НРД*;

выполнение для целей применения статьи 4.1 Федерального закона от 26.10.2002 № 127-ФЗ «О несостоятельности (банкротстве)» (далее – *Федеральный закон № 127-ФЗ*) функций репозитария, ведущего реестр договоров, в который внесена запись о заключении *Соглашения*;

представление соответствующей отчетной документации о *Сделках РЕПО*, а также совершение иных действий, необходимых для осуществления прав и исполнения обязанностей каждой из Сторон по *Сделке РЕПО*;

осуществляются НКО АО НРД в порядке, определенном *Документами НКО АО НРД*, за исключением случаев, предусмотренных настоящими *Условиями*.

Определение обязательств Сторон по *Сделкам РЕПО*, заключенным на условиях клиринга в соответствии с *Правилами клиринга НКЦ*, включая:

Обязательства по внесению компенсационных взносов и информирование Сторон об указанных обязательствах;

определение стоимости *Ценных бумаг* для целей проверки условия необходимости внесения компенсационного взноса;

клиринг обязательств по *Сделкам РЕПО*;

расчеты и передачу *Ценных бумаг* по заключенным *Сделкам РЕПО*;

представление соответствующей отчетной документации о *Сделках РЕПО*, а также совершение иных действий, необходимых для осуществления прав и исполнения обязанностей каждой из Сторон по *Сделке РЕПО*;

осуществляются закрытым акционерным обществом «Фондовая биржа ММВБ» в порядке, определенном *Правилами торгов ФБ ММВБ*, и Банком НКЦ (АО) в порядке, определенном *Правилами клиринга НКЦ*, за исключением случаев, предусмотренных настоящими *Условиями*.

2.11. Порядок расчета *Стоимости обратного выкупа* на момент заключения *Сделки РЕПО*, заключаемой с использованием информационной системы Bloomberg, приведен в настоящем пункте, а для *Сделки РЕПО*, заключаемой в соответствии с *Правилами торгов ФБ ММВБ* или *Правилами торгов СПВБ*, устанавливается соответствующими правилами организованных торгов.

Стоимость обратного выкупа на момент заключения *Сделки РЕПО*, заключаемой с использованием информационной системы Bloomberg, выражается в валюте *Сделки РЕПО*, рассчитывается исходя из *Ставки РЕПО*, *Срока РЕПО* и *Суммы РЕПО* по формуле:

$$S_2 = S_0 * (1 + \frac{r}{100\%} * (\frac{T365}{365} + \frac{T366}{366})), \text{ где}$$

S_0 – *Сумма РЕПО*;

S_2 – *Стоимость обратного выкупа*;

r – *Ставка РЕПО*, указанная в заявке Кредитной организации или рассчитанная исходя из указанного в заявке Кредитной организации *Спреда к индикативной ставке* и *Индикативной ставки*;

$T365$ и $T366$ – фактическое число календарных дней между датой первой части *Сделки РЕПО*, включая указанную дату, и датой второй части *Сделки РЕПО*, исключая указанную дату, приходящихся на календарный год, состоящий из 365 и 366 дней соответственно.

Стоимость обратного выкупа может быть скорректирована в порядке, предусмотренном *Документами НКО АО НРД* или *Правилами торгов ФБ ММВБ*.

2.12. Для заключения *Сделок РЕПО* с использованием информационной системы Bloomberg Кредитная организация сообщает Банку России индивидуальные коды в системе Bloomberg трейдеров Кредитной организации (код UUID), уполномоченных заключать сделки РЕПО с Банком России через информационную систему Bloomberg (далее – *трейдеры*), а также направляет в Банк России оформленные надлежащим образом доверенности на *трейдеров*. Индивидуальные коды *трейдеров* сообщаются Банку России через Систему ЭДО НРД и (или) в письменной форме.

2.13. Для перечисления денежных средств и перевода ценных бумаг в случаях, предусмотренных настоящими *Условиями*, Стороны не позднее 5 рабочих дней с даты подписания *Соглашения* сообщают друг другу реквизиты счетов для перечисления денежных средств и перевода ценных бумаг путем направления Кредитной организацией в Банк России Уведомления о платежных и иных реквизитах Кредитной организации, составленного по форме приложения 4 к настоящим *Условиям* (далее – *Уведомление о реквизитах Кредитной организации*), и Банком России в Кредитную организацию Уведомления о платежных и иных реквизитах Банка России, составленным по форме приложения 5 к настоящим *Условиям* (далее – *Уведомление о реквизитах Банка России*).

Уведомление о реквизитах Кредитной организации должно быть оформлено на фирменном бланке Кредитной организации, подписано лицом, уполномоченным на подписание и сообщение подобных сведений от имени Кредитной организации, и заверено печатью Кредитной организации (при наличии). Оригинал *Уведомления о реквизитах Кредитной организации* предоставляется (направляется) в Банк России по адресу: 107016, г. Москва, ул. Неглинная, 12, Операционный департамент Банка России.

Кредитная организация вправе вносить изменения в *Уведомления о реквизитах Кредитной организации*. Указанные изменения вносятся путем оформления с соблюдением требований настоящего пункта нового (измененного) *Уведомления о реквизитах Кредитной организации* и предоставления его в Банк России. Реквизиты счетов, содержащиеся в новом (измененном) *Уведомлении о реквизитах Кредитной организации*, подлежат применению не ранее 5 рабочих дней с даты получения Банком России нового (измененного) *Уведомления о реквизитах Кредитной организации*.

Изменения в ранее направленное Банком России в Кредитную организацию *Уведомление о реквизитах Банка России* вносятся Банком России в порядке аналогичном установленному абзацем 3 настоящего пункта и подлежат применению не ранее 5 рабочих дней с даты получения Кредитной организацией нового (измененного) *Уведомления о реквизитах Банка России*.

2.14. Перечисление денежных средств и (или) перевод *Ценных бумаг* в случаях, установленных настоящими *Условиями*, осуществляется Стороной по соответствующим реквизитам другой Стороны, указанным в *Уведомлении о реквизитах Кредитной организации* (приложение 4 к настоящим *Условиям*) или в *Уведомлении о реквизитах Банка России* (приложение 5 к настоящим *Условиям*) соответственно.

В случае отсутствия в *Уведомлении о реквизитах Кредитной организации* действующих счетов Кредитной организации для перечисления Банком России в соответствии с настоящими *Условиями* денежных средств в соответствующей валюте или перевода *Ценных бумаг* Банк России в произвольной форме направляет Кредитной организации уведомление об этом, а Кредитная организация информирует Банк России о реквизитах в письменной форме путем направления нового *Уведомления о реквизитах Кредитной организации*. В указанном случае Банк России перечисляет в соответствии с настоящими *Условиями* денежные средства в соответствующей валюте или переводит *Ценные бумаги* не ранее даты получения от Кредитной организации информации о реквизитах.

Раздел 3. Заключение Сделки РЕПО и исполнение обязательств по Сделке РЕПО

3.1. Заключение Сторонами *Сделок РЕПО* осуществляется на *Аукционе РЕПО* и (или) на *Торгах по фиксированной ставке РЕПО*.

При заключении *Сделок РЕПО* на *Аукционе РЕПО* *Сделка РЕПО* заключается Банком России по *Ставке РЕПО*, указанной в заявке Кредитной организации, но не ниже ставки отсечения, установленной Банком России по результатам приема заявок. В указанном случае решение о ставке отсечения принимается Банком России на основании ранжирования по уменьшению *Ставок РЕПО* в заявках кредитных организаций, поданных в рамках *Лимита на аукцион по предоставлению ликвидности*.

При заключении *Сделок РЕПО* на *Торгах по фиксированной ставке РЕПО* *Сделка РЕПО* заключается по фиксированной *Ставке РЕПО*, устанавливаемой Банком России.

В случае заключения *Сделки РЕПО* на условиях *Плавающей Ставки РЕПО* при изменении *Индикативной ставки* по *Ставке РЕПО* в течение *Срока Сделки РЕПО* *Ставка РЕПО* подлежит корректировке в порядке, установленном *Правилами торгов ФБ ММВБ, Правилами клиринга НКЦ* или *Документами НКО АО НРД*.

3.2. Заключение *Сделки РЕПО* осуществляется:

для *Сделок РЕПО*, заключаемых в соответствии с *Правилами торгов ФБ ММВБ*, путем обмена электронными документами в соответствии с *Правилами торгов ФБ ММВБ*;

для *Сделок РЕПО*, заключаемых в соответствии с *Правилами торгов СПВБ*, путем обмена электронными документами в соответствии с *Правилами торгов СПВБ*;

для *Сделок РЕПО*, заключаемых с использованием информационной системы Bloomberg, в порядке, установленном пунктом 3.3 настоящих *Условий*.

3.3. Порядок заключения *Сделок РЕПО* с использованием информационной системы Bloomberg.

3.3.1. *Сделки РЕПО* с использованием информационной системы Bloomberg заключаются путем подачи Кредитной организацией заявки через информационную систему Bloomberg и удовлетворения Банком России указанной заявки путем направления Кредитной организации *Реестра Сделок РЕПО* через информационную систему Bloomberg в порядке, установленном настоящим *Соглашением*.

На момент заключения указанной *Сделки РЕПО* Стороны в установленном подпунктами 3.3.2–3.3.4 пункта 3.3 настоящих *Условий* порядке согласовывают *Сумму РЕПО* и *Ставку РЕПО*.

Срок Сделки РЕПО определяется исходя из информации о параметрах *Аукциона РЕПО* и (или) *Торгах по фиксированной ставке РЕПО*, доведенной до сведения Кредитной организации в соответствии с пунктом 2.7 настоящих *Условий*.

Иные условия указанной *Сделки РЕПО* на момент ее заключения определяются (рассчитываются) в порядке, установленном настоящими *Условиями*.

3.3.2. При подаче заявки Кредитной организацией должны быть указаны:

идентификатор Кредитной организации в системе Bloomberg;

индивидуальный код *трейдера* в системе Bloomberg, информация о котором предоставлена Банку России в соответствии с пунктом 2.12 настоящих *Условий*;

сумма денежных средств, запрашиваемая Кредитной организацией, в пределах которой определяется объем обязательств Кредитной организации по *Корзине РЕПО* и формируется *Сумма РЕПО*;

Ставка РЕПО или *Спред к индикативной ставке*;

Индикативная ставка (в случае проведения *Аукциона РЕПО* по *Плавающей ставке РЕПО*);

ссылка на *Корзину РЕПО*.

3.3.3. По результатам проведения *Аукциона РЕПО (Торгов по фиксированной ставке РЕПО)* Банк России формирует и направляет через информационную систему Bloomberg Кредитной организации *Реестр Сделок РЕПО*, содержащий в том числе *Сумму РЕПО*.

Сумма РЕПО может быть скорректирована в соответствии с пунктом 3.10 настоящих *Условий*.

3.3.4. Стороны признают, что направленные ими через информационную систему Bloomberg заявки на заключение *Сделки РЕПО* и *Реестр Сделок РЕПО* равнозначны документам, оформленным в простой письменной форме с собственноручной подписью уполномоченного лица Стороны.

3.3.5. Стороны признают, что сформированный и переданный Банком России в НКО АО НРД *Общий реестр Сделок РЕПО* является двусторонним поручением Сторон на клиринг и расчеты в НКО АО НРД.

3.3.6. Банк России имеет право передавать Кредитной организации через информационную систему Bloomberg полученную от НКО АО НРД информацию о *Ценных бумагах*, переданных Кредитной организацией Банку России по *Сделке РЕПО*.

3.4. Заявка Кредитной организации, в которой указана процентная ставка, равная ставке отсечения, может быть удовлетворена Банком России частично в порядке, предусмотренном настоящими *Условиями*.

3.5. Частичное удовлетворение заявок, в которых указана процентная ставка, равная ставке отсечения, осуществляется в случае, если *Лимит на аукционы по предоставлению ликвидности*, меньше общей суммы денежных средств, указанной в заявках, поданных кредитными организациями для участия в *Аукционе РЕПО* и иных проводимых Банком России операций по предоставлению ликвидности в валюте Российской Федерации, за исключением операций, проводимых по фиксированной ставке, и операций по предоставлению кредитов, на организованных и не на организованных торгах в Российской Федерации, в которых указана процентная ставка не ниже ставки отсечения.

3.6. В случае, предусмотренном пунктом 3.5 настоящих *Условий*, заявка Кредитной организации, в которой указана процентная ставка, равная ставке отсечения, удовлетворяется частично в объеме, рассчитанном следующим образом:

а) определяется доля такой заявки Кредитной организации в общем объеме сумм, указанных в заявках всех участников *Аукциона РЕПО* и иных проводимых Банком России операций по предоставлению ликвидности в валюте Российской Федерации, за исключением операций, проводимых по фиксированной ставке, и операций по предоставлению кредитов, поданных на организованных и не на организованных торгах в Российской Федерации, в которых указана процентная ставка, равная ставке отсечения;

б) рассчитывается объем частичного удовлетворения такой заявки как произведение доли, определенной в соответствии с подпунктом «а» настоящего пункта, и суммы превышения *Лимита на аукционы по предоставлению ликвидности* над объемом сумм, указанных в заявках, поданных участниками *Аукциона РЕПО* и сумм заявок по иным проводимым Банком России операциям по предоставлению ликвидности в валюте Российской Федерации, за исключением операций, проводимых по фиксированной ставке, и операций по предоставлению кредитов, на организованных и не на организованных торгах в Российской Федерации, в которых указана процентная ставка выше ставки отсечения.

3.7. *Сделка РЕПО* считается заключенной:

для *Сделок РЕПО*, заключаемых в соответствии *Правилами торгов ФБ ММВБ*, с момента регистрации *Сделки РЕПО* в *Системе торгов ФБ ММВБ* в соответствии с *Правилами торгов ФБ ММВБ*;

для *Сделок РЕПО*, заключаемых в соответствии *Правилами торгов СПВБ*, с момента регистрации *Сделки РЕПО* в *Системе торгов СПВБ* в соответствии с *Правилами торгов СПВБ*;

для *Сделок РЕПО*, заключаемых с использованием информационной системы Bloomberg, с *Моментом получения Кредитной организацией направленного Банком России Реестра Сделок РЕПО*.

3.8. Момент исполнения обязательств по перечислению денежных средств и передаче *Ценных бумаг* по *Сделке РЕПО*, включая момент исполнения *Обязательств по внесению компенсационных взносов*, определяется:

для *Сделок РЕПО*, заключаемых на условиях клиринга в соответствии с *Правилами клиринга НКЦ* в порядке, предусмотренном *Правилами клиринга НКЦ*;

для *Сделок РЕПО*, заключаемых на условиях клиринга в соответствии с *Правилами клиринга НРД* в порядке, предусмотренном *Документами НКО АО НРД*.

3.9. Стороны признают, что отчетные документы, подготовленные в соответствии с *Документами НКО АО НРД*, *Правилами клиринга НКЦ* или *Правилами торгов ФБ ММВБ*, являются окончательными для определения обязательств Сторон по *Сделкам РЕПО*, предусмотренных пунктом 2.10 настоящих *Условий*.

3.10. Стороны соглашаются, что по *Сделкам РЕПО*, клиринг которых осуществляется в соответствии с *Правилами клиринга НРД*, Кредитная организация вправе в соответствии с *Правилами торгов ФБ ММВБ* и (или) *Документами НКО АО НРД*, частично исполнить *Обязательство*

Кредитной организации по первой части Сделки РЕПО и передать Ценные бумаги, стоимость которых меньше Суммы РЕПО (для Сделок РЕПО, заключенных не на организованных торгах в Российской Федерации с использованием информационной системы Bloomberg – Суммы РЕПО, указанной в Реестре Сделок РЕПО).

В указанном случае обязательства Сторон по первой и второй части такой Сделки РЕПО, определенные на момент заключения такой Сделки РЕПО, уменьшаются в соответствии с Документами НКО АО НРД. При этом уменьшение Суммы РЕПО осуществляется исходя из стоимости Ценных бумаг, передаваемых Кредитной организацией по первой части указанной Сделки РЕПО. Стороны исполняют обязательства в размере, рассчитанном в соответствии с настоящим абзацем.

Передача Кредитной организацией по первой части Сделки РЕПО Ценных бумаг, стоимость которых меньше Суммы РЕПО, указанной в Реестре Сделок РЕПО, подтверждается предоставляемым НКО АО НРД Банку России и Кредитной организации отчетом, содержащим информацию об объеме исполненных обязательств по первой части Сделки РЕПО.

При этом обязательства Сторон по первой части Сделки РЕПО в части, превышающей частично исполненные обязательства, считаются прекращенными, а Кредитная организация обязана уплатить сумму денежных средств в размере соответствующей валюте Сделки РЕПО ставки, установленной приложением 6 к настоящим Условиям, начисленной за один календарный день на разницу между Суммой РЕПО, указанной в Реестре Сделок РЕПО, и Суммой РЕПО, скорректированной в соответствии с Документами НКО АО НРД.

Направление Банком России уведомления, содержащего требование уплатить сумму денежных средств, указанную в абзаце четвертом настоящего пункта, ее размер и исполнение Кредитной организацией обязательства по уплате указанных в настоящем пункте денежных средств осуществляется в порядке, аналогичном предусмотренному пунктом 5.1 настоящих Условий для уплаты неустойки. При этом согласие Кредитной организации на списание денежных средств считается предоставленным.

3.11. В случае неперечисления Кредитной организацией в Дату второй части Сделки РЕПО денежных средств по второй части Сделки РЕПО, клиринг которой осуществляется в соответствии с Правилами клиринга НРД, Стороны соглашаются, что Банк России вправе изменить в соответствии с Документами НКО АО НРД следующие условия Сделки РЕПО:

Дату второй части Сделки РЕПО (осуществить Перенос даты второй части Сделки РЕПО);
Ставку РЕПО, применяемую для расчета Стоимости обратного выкупа;
Стоимость обратного выкупа.

Стороны соглашаются, что при Переносе даты второй части Сделки РЕПО для расчета Стоимости обратного выкупа за период между датой неперечисления Кредитной организацией денежных средств по второй части Сделки РЕПО и Датой второй части Сделки РЕПО, измененной в результате Переноса даты второй части Сделки РЕПО, используется фиксированная Ставка РЕПО, установленная Банком России на дату осуществления Переноса даты второй части Сделки РЕПО, а для Сделки РЕПО, обязательства по которой выражены в иностранной валюте, – удвоенная Ставка РЕПО, установленная на дату заключения Сделке РЕПО.

Перенос Даты второй части Сделки РЕПО осуществляется при соблюдении следующих условий:

отсутствие Обязательств Кредитной организации по первой части Сделки РЕПО с текущей Датой первой части Сделки РЕПО, достаточных для осуществления процедуры зачета встречных однородных требований в соответствии с Документами НКО АО НРД;

наличие на счете Кредитной организации, открытом в НКО АО НРД, Ценных бумаг и (или) денежных средств в количестве, достаточном для обеспечения исполнения Кредитной организацией рассчитанного НКО АО НРД Обязательства по внесению компенсационного взноса;

количество ранее осуществленных Переносов даты второй части Сделки РЕПО по данной Сделке РЕПО менее трех.

Раздел 4. Выплаты по Ценным бумагам и участие в корпоративных действиях

4.1. При получении Банком России денежных средств в качестве выплат по Ценным бумагам, переданным Кредитной организацией Банку России по Сделке РЕПО, по которым список лиц, имеющих право на их получение, определяется в период после момента фактического исполнения обязательств Кредитной организации по передаче Ценных бумаг по Сделке РЕПО и до исполнения обязательств Банка России по возврату Кредитной организации полученных Ценных бумаг по Сделке РЕПО, а в случае проведения Процедуры урегулирования – до даты, определяемой в соответствии с пунктом 6.9 настоящих Условий (не включая указанную дату), у Банка России возникает

обязательство по возврату Кредитной организации указанных выше выплат по *Ценным бумагам*, за исключением случаев, установленных пунктом 4.2 настоящих *Условий*.

Банк России осуществляет возврат Кредитной организации указанных настоящим пункте выплат по *Ценным бумагам*:

по *Сделкам РЕПО*, клиринг которой осуществляется в соответствии с *Правилами клиринга НРД*, – в соответствии с *Документами НКО АО НРД*;

по *Сделкам РЕПО*, заключенным в соответствии с *Правилами торгов ФБ ММВБ* и клиринг которых осуществляется в соответствии с *Правилами клиринга НКЦ*, – в соответствии с *Правилами клиринга НКЦ* и (или) *Правилами торгов ФБ ММВБ*.

4.2. Обязательство по возврату Кредитной организации указанных в пункте 4.1 настоящих *Условий* выплат по *Ценным бумагам* не возникает у Банка России в случае:

если на величину указанных в пункте 4.1 настоящих *Условий* выплат по *Ценным бумагам* в порядке, предусмотренном *Правилами клиринга НКЦ* и (или) *Правилами торгов ФБ ММВБ*, была уменьшена *Стоимость обратного выкупа*;

наличие *Неурегулированных обязательств (Остаточных обязательств) Кредитной организации*.

4.3. В случае получения Банком России выплат, по которым НКО АО НРД в соответствии с *Документами НКО АО НРД* не осуществляет функции по передаче Кредитным организациям выплат по *Ценным бумагам* или по которым НКЦ в соответствии с *Правилами клиринга НКЦ* не осуществляет функции по передаче Кредитным организациям выплат по *Ценным бумагам* и (или) по которым в соответствии с *Правилами торгов ФБ ММВБ* не была уменьшена *Стоимость обратного выкупа*, Банк России не позднее 3 (третьего) рабочего дня со дня получения выплат направляет Кредитной организации в письменной форме уведомление о получении выплат по *Ценным бумагам*. Банк России перечисляет Кредитной организации денежные средства в сумме и в валюте фактически поступивших выплат по *Ценным бумагам* в течение 3 (трех) рабочих дней с даты направления уведомления, а случае отсутствия соответствующих реквизитов счетов Кредитной организации – с даты, определенной в соответствии с пунктом 2.14 настоящих *Условий*.

4.4. В случае неисполнения или ненадлежащего исполнения (далее – неисполнение) эмитентом обязательств по перечислению денежных средств в качестве выплат по *Ценным бумагам*, на сумму которых в соответствии с *Правилами торгов ФБ ММВБ* была уменьшена *Стоимость обратного выкупа*, у Кредитной организации в дату такого уменьшения *Стоимости обратного выкупа* возникает обязательство по перечислению Банку России денежных средств в валюте и сумме, на которую была уменьшена *Стоимость обратного выкупа*.

В указанном случае Банк России направляет Кредитной организации уведомление, содержащее информацию о неисполнении эмитентом обязательств по осуществлению выплат по *Ценным бумагам* и о сумме денежных средств в валюте денежных обязательств по *Сделке РЕПО*, подлежащей перечислению Кредитной организацией.

Кредитная организация перечисляет Банку России сумму, указанную в уведомлении, направленном в соответствии с настоящим пунктом, в течение 7 (семи) рабочих дней со дня направления Банком России соответствующего уведомления.

В случае исполнения эмитентом обязательств по осуществлению выплат по *Ценным бумагам* после перечисления Кредитной организацией денежных средств в соответствии с настоящим пунктом Банк России перечисляет Кредитной организации сумму полученных выплат по *Ценным бумагам* в валюте фактически поступивших выплат по *Ценным бумагам* в течение 7 (семи) рабочих дней со дня фактического зачисления указанных выплат на счет Банка России.

4.5. В случае если в результате совершения *Сделки РЕПО* у Банка России возникает обязанность в соответствии с пунктом 2 статьи 57 Федерального закона от 26 декабря 1995 года № 208-ФЗ «Об акционерных обществах» выдать Кредитной организации доверенность на голосование на общем собрании акционеров акционерного общества, акции которого передавались Кредитной организацией Банку России по *Сделке РЕПО*, или возникает право на участие в общем собрании владельцев облигаций, которые передавались Кредитной организацией Банку России по *Сделке РЕПО*, то для получения доверенности Кредитная организация не позднее, чем за 9 (девять) рабочих дней до даты проведения общего собрания акционеров акционерного общества или общего собрания владельцев облигаций, направляет в Банк России письмо с приложением доверенности на имя лица, уполномоченного Кредитной организацией на передачу и (или) получение документов в Банке России (далее – Письмо Кредитной организации). Письмо Кредитной организации должно содержать следующее:

ссылку на Соглашение;

перечень Сделок РЕПО с акциями или облигациями, по которым Банком России получено право на участие в общем собрании акционеров или общем собрании владельцев облигаций;
образец доверенности на голосование на общем собрании акционеров (на голосование на общем собрании владельцев облигаций);
полное и сокращенное (при наличии) фирменное наименование Кредитной организации, ОГРН, ИНН, БИК;
контактные данные для информирования Кредитной организации.

Банк России оформляет доверенность на Кредитную организацию на голосование на общем собрании акционеров (на голосование на общем собрании владельцев облигаций) и информирует Кредитную организацию о необходимости ее получения в срок не позднее 8 (восемь) рабочих дней с даты получения Письма Кредитной организации. Передача доверенности на голосование на общем собрании акционеров (на голосование на общем собрании владельцев облигаций) и сопроводительного письма в адрес Кредитной организации осуществляется через окно приема нарочной корреспонденции Банка России по адресу: Москва, Сандуновский переулок, дом 3, строение 1 при предъявлении лицом, уполномоченным Кредитной организацией на передачу и (или) получение документов в Банке России, доверенности или ее копии, заверенной в соответствии с законодательством Российской Федерации, и документа, удостоверяющего личность. Полученные Банком России от акционерного общества, акции которого переданы Кредитной организацией Банку России по Сделке РЕПО, или от эмитента облигаций материалы для участия в общем собрании акционеров (владельцев облигаций) Кредитной организации не передаются.

В случае ненаправления Кредитной организацией Письма Кредитной организации в предусмотренные настоящим пунктом сроки или отсутствия в Письме Кредитной организации одного из элементов, перечисленных в абзаце первом настоящего пункта, признается, что у Кредитной организации отсутствует потребность в получении указанной доверенности.

Раздел 5. Ответственность Сторон

5.1. В случае неисполнения *Обязательств Кредитной организацией по первой части Сделки РЕПО* Кредитная организация обязана уплатить неустойку в размере соответствующей валюте *Сделки РЕПО* ставки, установленной приложением 6 к настоящим *Условиям*, начисленной за один календарный день на *Сумму РЕПО* (для *Сделок РЕПО*, заключенных не на организованных торгах в Российской Федерации с использованием информационной системы Bloomberg, – на *Сумму РЕПО*, указанную в *Реестре Сделок РЕПО*).

Для целей расчета в соответствии с настоящим пунктом неустойки пересчет обязательств Кредитной организации по уплате неустойки, выраженных в иностранной валюте, в валюту Российской Федерации осуществляется по официальному курсу Банка России, установленному для такой иностранной валюты к рублю на *Дату первой части Сделки РЕПО*.

Информация о неисполнении *Обязательств Кредитной организации по первой части Сделки РЕПО* содержится в предоставляемом Банку России и Кредитной организации в соответствии с *Документами НКО АО НРД* или *Правилами клиринга НКЦ* документе (отчете), содержащем информацию о неисполненных *Сделках РЕПО*.

Банк России направляет Кредитной организации уведомление, содержащее требование уплатить неустойку и сумму неустойки.

Неустойка подлежит уплате Кредитной организацией в течение 3 (трех) рабочих дней с *Даты первой части Сделки РЕПО*. В поле «Назначение платежа» платежного поручения должна быть сделана ссылка на дату заключения и номер *Сделки РЕПО* (*Сделок РЕПО*).

В случае неуплаты Кредитной организацией неустойки в установленный настоящим пунктом срок Банк России начиная с 4 (четвертого) рабочего дня с *Даты первой части Сделки РЕПО* вправе осуществить списание суммы неустойки с корреспондентского счета (субсчета (субсчетов) Кредитной организации, открытого (открытых) в подразделении (подразделениях) расчетной сети Банка России, банковских счетов Кредитной организации, открытых в НКО АО НРД, на основании распоряжений Банка России о переводе денежных средств. Согласие Кредитной организации на списание суммы неустойки считается представленным.

В указанном в абзаце 1 настоящего пункта случае исполнение *Обязательства Банка России по первой части Сделки РЕПО* не производится, а обязательства Сторон по *Сделке РЕПО* прекращаются с момента направления Кредитной организации предусмотренного настоящим пунктом уведомления, содержащего требование уплатить неустойку и сумму неустойки.

5.2. В случае неперечисления Кредитной организацией в установленный пунктом 4.4 настоящих *Условий* срок Банку России денежных средств в валюте и сумме не осуществленной эмитентом выплаты по *Ценным бумагам*, на которую была уменьшена *Стоимость*

обратного выкупа, Банк России начиная с 8 (восьмого) рабочего дня с даты направления Кредитной организации уведомления вправе осуществить списание денежных средств в сумме не осуществленной эмитентом выплаты по *Ценным бумагам*, на которую была уменьшена *Стоимость обратного выкупа*, с корреспондентского счета (субсчета (субсчетов) Кредитной организации, открытого (открытых) в подразделении (подразделениях) расчетной сети Банка России, банковских счетов Кредитной организации, открытых в НКО АО НРД, на основании распоряжений Банка России о переводе денежных средств. Согласие Кредитной организации на списание указанных в настоящем абзаце денежных средств считается предоставленным.

В случае если денежные средства на указанных в настоящем пункте счетах Кредитной организации, с которых производится списание Банком России в соответствии с настоящим пунктом, выражены в валюте, отличной от валюты денежного обязательства по перечислению выплат, предусмотренных пунктом 4.4 настоящих *Условий*, пересчет сумм списываемых денежных средств в валюту денежного обязательства осуществляется по официальному курсу Банка России, установленному для соответствующей иностранной валюты к рублю на дату списания денежных средств или по кросс-курсу соответствующих иностранных валют, определяемому исходя из официальных курсов Банка России, установленных для соответствующих иностранных валют на дату списания денежных средств.

5.3. В случае нарушения Банком России срока перечисления денежных средств в соответствии с пунктом 4.1 и (или) 4.3 настоящих *Условий* Банк России уплачивает Кредитной организации неустойку, начисленную на сумму не перечисленных в установленный срок денежных средств, в размере соответствующей ставки, указанной в Приложении 6 к настоящим *Условиям*.

Расчет суммы неустойки осуществляется за все календарные дни начиная с календарного дня, следующего за последним днем срока перечисления денежных средств, определяемого в соответствии с пунктом 4.1 и (или) 4.3 настоящих *Условий*, и до дня их возврата либо до дня уменьшения в соответствии с пунктом 5.9 настоящих *Условий Неурегулированных обязательств (Остаточных обязательств) Кредитной организации* на сумму не перечисленных Банком России в установленный срок денежных средств включительно.

5.4. *Обязательства Кредитной организации по второй части Сделки РЕПО* признаются неисполненными в случае неперечисления Кредитной организацией денежных средств по второй части *Сделки РЕПО* в *Дату второй части Сделки РЕПО* либо в дату, в которую Кредитная организация обязана перечислить денежные средства по вторым частям *Сделок РЕПО* в соответствии с пунктом 5.13 настоящих *Условий*, и для *Сделки РЕПО*, клиринг которой осуществляется в соответствии с *Правилами клиринга НРД*, при дополнительном условии, что в *Дату второй части Сделки РЕПО* не осуществлен *Перенос даты второй части Сделки РЕПО*.

Подтверждением неисполнения *Обязательств Кредитной организации по второй части Сделки РЕПО* является соответствующий документ (отчет), предоставляемый Банку России и Кредитной организации в соответствии с *Документами НКО АО НРД* или *Правилами клиринга НКЦ*.

5.5. В случае неисполнения *Обязательства Кредитной организации по второй части Сделки РЕПО*:

прекращаются обязательства Сторон по *Сделкам РЕПО*, по которым еще не осуществлено исполнение обязательств Сторон по первой части *Сделки РЕПО*;

не осуществляется исполнение *Обязательств Банка России по второй части Сделки РЕПО* и определяется в соответствии с приложением 1 к настоящим *Условиям* сумма (величина) *Неурегулированных обязательств (Остаточных обязательств) Кредитной организации*, включающая сумму (величину) неустойки, рассчитанной в порядке, установленном в приложении 1 к настоящим *Условиям*, и подлежащей уплате Кредитной организацией Банку России в указанном в настоящем пункте случае.

Неустойка начисляется за период с календарного дня, следующего за датой неисполнения *Обязательств Кредитной организации по второй части Сделки РЕПО*, до дня погашения *Неурегулированных обязательств (Остаточных обязательств) Кредитной организации* (включая эти дни).

5.6. В случае неисполнения *Обязательств Кредитной организации по второй части Сделки РЕПО* Банк России начиная со дня, следующего за *Датой второй части Сделки РЕПО*, и до урегулирования неисполненных *Обязательств Кредитной организации по второй части Сделки РЕПО* в полном объеме направляет Кредитной организации в простой письменной форме информацию:

в рабочий день, следующий за *Датой второй части Сделки РЕПО*, – о сумме (величине) *Неурегулированных обязательств (Остаточных обязательств) Кредитной организации*;

по рабочим дням, в случае изменения суммы (величины) *Неурегулированных обязательств (Остаточных обязательств) Кредитной организации*, – об изменении суммы (величины) *Неурегулированных обязательств (Остаточных обязательств) Кредитной организации*.

5.7. Банк России вправе принять от Кредитной организации в качестве исполнения *Неурегулированных обязательств (Остаточных обязательств) Кредитной организации* денежные средства, перечисленные Кредитной организацией на счета Банка России, реквизиты которых указаны в приложении 5 к настоящим *Условиям*, или по *Сделке РЕПО*, клиринг которой осуществляется в соответствии с *Правилами клиринга НКЦ*, – в порядке, предусмотренном *Правилами торгов ФБ ММВБ и Правилами клиринга НКЦ*.

В случае превышения суммы *Неурегулированных обязательств (Остаточных обязательств) Кредитной организации* над суммой денежных средств, полученной Банком России в целях исполнения *Обязательств Кредитной организации по второй части Сделки РЕПО* в порядке, предусмотренном *Правилами торгов ФБ ММВБ и Правилами клиринга НКЦ*, Кредитная организация перечисляет на счет Банка России, реквизиты которого указаны в приложении 5 к настоящим *Условиям*, разницу между указанными в настоящем абзаце суммами.

5.8. В случае неисполнения *Обязательств Кредитной организации по второй части Сделки РЕПО* Банк России начиная с рабочего дня, следующего за *Датой второй части Сделки РЕПО*, вправе по своему усмотрению:

осуществлять списание денежных средств в сумме *Неурегулированных обязательств (Остаточных обязательств) Кредитной организации* с корреспондентского счета (субсчета) (субсчетов) Кредитной организации, открытого (открытых) в подразделении (подразделениях) Банка России, банковских счетов Кредитной организации, открытых в НКО АО НРД, на основании распоряжений Банка России о переводе денежных средств. Согласие Кредитной организации на списание денежных средств считается представленным;

проводить *Процедуру урегулирования* в соответствии с разделом 6 настоящих *Условий*.

5.9. При неисполнении *Обязательств Кредитной организации по второй части Сделки РЕПО* Банк России не перечисляет (не передает) Кредитной организации полученные выплаты по *Ценным бумагам*. При этом сумма *Неурегулированных обязательств (Остаточных обязательств) Кредитной организации* уменьшается на сумму денежных средств, полученных Банком России в качестве выплат по *Ценным бумагам*.

В случае погашения *Ценных бумаг*, переданных по *Сделке РЕПО*, а также в случае приобретения *Ценных бумаг*, переданных по *Сделке РЕПО*, их эмитентом в соответствии со статьей 17.2 Федерального закона от 22 апреля 1996 года № 39-ФЗ «О рынке ценных бумаг» или в соответствии со статьей 24.4 Федерального закона от 7 февраля 2011 года № 7-ФЗ «О клиринге, клиринговой деятельности и центральном контрагенте» (далее – выкуп) Банк России в дату зачисления на соответствующий счет Банка России причитающихся Банку России в результате указанных в настоящем абзаце действий денежных средств уменьшает сумму *Неурегулированных обязательств (Остаточных обязательств) Кредитной организации* на сумму погашения номинальной стоимости *Ценных бумаг* или сумму денежных средств, полученную в результате выкупа.

Для целей настоящего пункта пересчет сумм денежных средств, выраженных в валюте, отличной от валюты денежных обязательств по *Сделке РЕПО*, в валюту денежных обязательств по *Сделке РЕПО* осуществляется по официальному курсу Банка России, установленному для соответствующей иностранной валюты к рублю на дату уменьшения суммы *Неурегулированных обязательств (Остаточных обязательств) Кредитной организации*, или по кросс-курсу соответствующих иностранных валют, определяемому исходя из официальных курсов Банка России, установленных для соответствующих иностранных валют на дату уменьшения суммы *Неурегулированных обязательств (Остаточных обязательств) Кредитной организации*.

Банк России вправе уменьшить сумму *Неурегулированных обязательств (Остаточных обязательств) Кредитной организации* на величину следующих обязательств Банка России, возникших в соответствии с настоящими *Условиями* на момент расчета *Неурегулированных обязательств (Остаточных обязательств) Кредитной организации*:

по перечислению денежных средств и (или) возврату ценных бумаг в соответствии с пунктом 5.11 настоящих *Условий*. Для целей настоящего пункта стоимость *Ценных бумаг* определяется в соответствии с пунктом 6.3 настоящих *Условий*, при этом в качестве даты, на которую определяется стоимость, используется дата уменьшения суммы *Неурегулированных обязательств (Остаточных обязательств) Кредитной организации*;

по перечислению денежных средств в соответствии с пунктом 6.4 настоящих *Условий*;

по перечислению предусмотренной настоящими *Условиями* неустойки.

Банк России вправе увеличить сумму *Неурегулированных обязательств (Остаточных обязательств) Кредитной организации* на величину следующих обязательств Кредитной организации, возникших в соответствии с настоящими *Условиями* на момент расчета *Неурегулированных обязательств (Остаточных обязательств) Кредитной организации*:

- по уплате денежных средств в соответствии с пунктом 3.10 настоящих *Условий*;
- по перечислению предусмотренной настоящими *Условиями* неустойки;
- по перечислению денежных средств в соответствии с пунктом 4.4 настоящих *Условий*;
- по перечислению денежных средств в соответствии с пунктом 6.5 настоящих *Условий*.

При наличии на определенную дату нескольких *Неурегулированных обязательств (Остаточных обязательств) Кредитной организации* предусмотренное настоящим пунктом увеличение или уменьшение суммы *Неурегулированных обязательств (Остаточных обязательств) Кредитной организации* осуществляется в последовательности, определяемой Банком России.

5.10. Погашение требований Банка России по *Неурегулированным обязательствам (Остаточным обязательствам) Кредитной организации*, за исключением случая, установленного разделом 6 настоящих *Условий*, осуществляется в следующем порядке:

в первую очередь погашается сумма *Обязательств Кредитной организации по второй части Сделки РЕПО*;

во вторую очередь погашается сумма неустойки, подлежащая уплате в связи с неисполнением *Обязательств Кредитной организации по второй части Сделки РЕПО*.

При наличии на определенную дату нескольких неисполненных Кредитной организацией *Сделок РЕПО, Дата второй части Сделки РЕПО* которых наступила, *Неурегулированные обязательства (Остаточные обязательства) Кредитной организации* погашаются в последовательности, определяемой Банком России.

5.11. После прекращения *Неурегулированных обязательств (Остаточных обязательств) Кредитной организации* в полном объеме по *Сделке РЕПО* за исключением случая, установленного разделом 6 настоящих *Условий*, Банк России в течение 7 (семи) рабочих дней осуществляет передачу Кредитной организации *Ценных бумаг* и (или) перечисление денежных средств, оставшихся после прекращения *Неурегулированных обязательств (Остаточных обязательств) Кредитной организации*, за исключением денежных средств, на сумму которых уменьшаются по иным *Сделкам РЕПО Неурегулированные обязательства (Остаточные обязательства) Кредитной организации* в соответствии с положениями абзаца 4 пункта 5.9 настоящих *Условий*.

В случае нарушения срока перечисления денежных средств Банк России уплачивает Кредитной организации неустойку, начисленную на сумму неперечисленных в установленный срок денежных средств, в размере соответствующей ставки, установленной приложением 6 к настоящим *Условиям*.

Расчет суммы неустойки осуществляется за все календарные дни начиная с календарного дня, следующего за 7 (седьмым) рабочим днем с даты урегулирования *Остаточных обязательств Кредитной организации* в полном объеме (3 (третьим) рабочим днем со дня получения от Кредитной организации информации о реквизитах в соответствии с пунктом 2.14 настоящих *Условий*), и до дня перечисления указанных денежных средств либо до дня уменьшения в соответствии с пунктом 5.9 иных *Неурегулированных обязательств (Остаточных обязательств) Кредитной организации* на сумму не перечисленных Банком России в соответствии с настоящим пунктом в установленный срок денежных средств включительно.

5.12. В случае излишнего взыскания Банком России денежных средств на основании распоряжений Банка России о переводе денежных средств с Кредитной организации согласно пунктам 3.10, 5.1, 5.2, 5.8 и разделу 6 настоящих *Условий* Банк России возвращает излишне взысканные денежные средства на соответствующий счет Кредитной организации, реквизиты которого указаны в Уведомлении о реквизитах счетов Кредитной организации для перечисления денежных средств и перевода ценных бумаг (приложение 4 к настоящим *Условиям*), и уплачивает Кредитной организации неустойку исходя из суммы излишне взысканных денежных средств отдельно по каждой излишне взысканной сумме в размере соответствующей ставки, установленной приложением 6 к настоящим *Условиям*.

Расчет суммы неустойки осуществляется отдельно по каждой излишне взысканной сумме за все календарные дни начиная со второго рабочего дня, следующего за днем, в который Банком России согласно пунктам 3.10, 5.1, 5.2, 5.8 и разделом 6 настоящих *Условий* были излишне взысканы с Кредитной организации денежные средства, и до дня возврата излишне взысканных денежных средств либо до дня уменьшения в соответствии с пунктом 5.9 настоящих *Условий* иных *Неурегулированных обязательств (Остаточных обязательств) Кредитной организации* на сумму не перечисленных Банком России в соответствии с настоящим пунктом в установленный срок денежных средств включительно.

5.13. В случае неисполнения Кредитной организацией *Обязательств по внесению компенсационного взноса* или в случае неперечисления Кредитной организацией в установленный пунктом 4.4 настоящих *Условий* срок Банку России денежных средств в валюте и сумме не осуществленной эмитентом выплаты по *Ценным бумагам*, на которую была уменьшена *Стоимость обратного выкупа* по *Сделке РЕПО*, или в случае неисполнения по другой *Сделке РЕПО* *Обязательств Кредитной организации по второй части Сделки РЕПО* Банк России вправе потребовать по такой *Сделке РЕПО* досрочного исполнения *Обязательства Кредитной организации по второй части Сделки РЕПО*, а также *Обязательств Кредитной организации по второй части Сделки РЕПО* по другой (им) *Сделке (Сделкам) РЕПО*, заключенной (заключенным) Банком России с Кредитной организацией на организованных и (или) не на организованных торгах в Российской Федерации, если реализация указанного права предусмотрена *Документами НКО АО НРД* и (или) *Правилами клиринга НКЦ*.

Банк России направляет Кредитной организации уведомление о необходимости досрочного исполнения обязательств по вторым частям всех или части *Сделок РЕПО*, заключенных Банком России с Кредитной организацией на организованных и (или) не на организованных торгах в Российской Федерации.

В указанном случае Кредитная организация обязана перечислить денежные средства по вторым частям *Сделок РЕПО*, заключенных Банком России с Кредитной организацией, в рабочий день, следующий за днем уведомления Банком России Кредитной организации о принятии указанного в настоящем пункте решения, если в уведомлении Банка России не указано иное.

При этом перечисление денежных средств и перевод *Ценных бумаг* по вторым частям *Сделок РЕПО* осуществляется в порядке, установленном настоящим *Соглашением*, *Документами НКО АО НРД* и (или) *Правилами клиринга НКЦ*.

5.14. В случаях, предусмотренных статьей 4.1 *Федерального закона № 127-ФЗ*, обязательства Сторон по всем *Сделкам РЕПО* прекращаются возникновением денежного обязательства, размер которого определяется в порядке, предусмотренном *Правилами клиринга НРД* и (или) *Правилами клиринга НКЦ*, а в случае прекращения обслуживания указанных выше *Сделок РЕПО* в соответствии с *Правилами клиринга НКЦ* и (или) *Правилами клиринга НРД* – в порядке, предусмотренном приложением 2 к настоящим *Условиям*.

В случае если в результате расчета размера *Нетто-обязательства* (термин определяется приложением 2 к настоящим *Условиям*) в соответствии с порядком, предусмотренном приложением 2 к настоящим *Условиям*, у Банка России возникает обязательство по перечислению суммы денежных средств в *Базовой валюте* (термин определяется приложением 2 к настоящим *Условиям*) в размере рассчитанного *Нетто-обязательства* (термин определяется приложением 2 к настоящим *Условиям*), такое перечисление осуществляется не позднее 30 (тридцати) календарных дней после наступления *Даты прекращения* (термин определяется приложением 2 к настоящим *Условиям*) по реквизитам Кредитной организации для *Базовой валюты* (термин определяется приложением 2 к настоящим *Условиям*), указанным в *Уведомлении о реквизитах Кредитной организации* (приложение 4 к *Условиям*).

5.15. Стороны принимают на себя всю ответственность за действия своих сотрудников, имеющих доступ к информационной системе Bloomberg.

5.16. Обязательства Сторон по перечислению денежных средств в соответствии с настоящим разделом считаются исполненными с момента их зачисления на соответствующие счета Сторон, реквизиты которых указаны в *Уведомлении о реквизитах Кредитной организации* (приложение 4 к настоящим *Условиям*) или в Платежных и иных реквизитах Банка России (приложение 5 к настоящим *Условиям*) соответственно.

В указанном в пункте 5.7 и (или) абзаце 2 пункта 5.8 настоящих *Условий* случае *Неурегулированные обязательства (Остаточные обязательства) Кредитной организации* считаются прекращенными, а обязательства Сторон по *Сделке РЕПО*, по которой не исполнено *Обязательство Кредитной организации по второй части Сделки РЕПО*, прекращенными в случае, если сумма денежных средств, полученная в результате списания на основании распоряжений Банка России о переводе денежных средств и (или) в результате исполнения *Неурегулированных обязательств (Остаточных обязательств) Кредитной организации* предусмотренным пунктом 5.7 настоящих *Условий* способом, равна или превышает сумму *Неурегулированных обязательств (Остаточных обязательств) Кредитной организации*. При этом датой погашения *Неурегулированных обязательств (Остаточных обязательств) Кредитной организации* считается дата зачисления достаточной для их погашения суммы денежных средств, указанной в настоящем пункте, на соответствующий счет Банка России, реквизиты которого указаны в приложении 5 к настоящим *Условиям*.

5.17. Предусмотренная настоящими *Условиями* неустойка рассчитывается исходя из указанной в приложении 6 к настоящим *Условиям* ставки, соответствующей валюте нарушенного (неисполненного) обязательства и действующей на дату нарушения (неисполнения) обязательства, а в случае если неустойка начисляется за период времени – то на каждую дату в течение данного периода.

Неустойка подлежит уплате в валюте Российской Федерации, при этом пересчет суммы неустойки, выраженной в иностранной валюте, в валюту Российской Федерации осуществляется по официальному курсу Банка России, установленному для соответствующей иностранной валюты к рублю на дату возникновения обязательства по уплате неустойки.

Расчет суммы неустойки, уплачиваемой Сторонами в соответствии с настоящими *Условиями*, а также процентов за пользование денежными средствами за дни, приходящиеся на календарный год с количеством дней 365, производится из расчета 365 календарных дней в году, а за дни, приходящиеся на календарный год с количеством дней 366, – из расчета 366 календарных дней в году.

Раздел 6. Процедура урегулирования

6.1. Банк России начиная с рабочего дня, следующего за *Датой второй части Сделки РЕПО*, по *Сделке РЕПО*, по которой не исполнено *Обязательство Кредитной организации по второй части Сделки РЕПО*, вправе принять решение о проведении *Процедуры урегулирования*. *Процедура урегулирования* может проводиться одновременно по совокупности *Сделок РЕПО*, по которым не исполнено *Обязательство Кредитной организации по второй части Сделки РЕПО*.

6.2. Банк России в рабочий день, но не ранее рабочего дня, следующего за *Датой второй части Сделки РЕПО*, рассчитывает сумму *Неурегулированных обязательств (Остаточных обязательств) Кредитной организации* и сумму *Неурегулированных обязательств (Остаточных обязательств) Банка России* по *Сделкам РЕПО*, по которым проводится *Процедура урегулирования*, и направляет Кредитной организации Уведомление о проведении *Процедуры урегулирования* по форме приложения 3 к настоящим *Условиям*.

6.3. *Неурегулированные обязательства (Остаточные обязательства) Банка России* рассчитываются как стоимость с учетом накопленного купонного дохода *Ценных бумаг*, полученных по *Сделке РЕПО*, по которой были не исполнены *Обязательства Кредитной организации по второй части Сделки РЕПО*, на дату, определенную в соответствии с пунктом 6.2 настоящих *Условий*. Стоимость *Ценных бумаг* определяется Банком России на основании указанных в настоящем пункте способов в следующей последовательности:

в первую очередь, последней известной на дату, определенную в соответствии с пунктом 6.2 настоящих *Условий*, *Цены Ценных бумаг по Сделке РЕПО (Цены РЕПО)*;

во вторую очередь, фактической цены реализации ценных бумаг того же выпуска;

в третью очередь, среднего арифметического не менее трех котировок соответствующих ценных бумаг того же выпуска, полученных Банком России от различных профессиональных участников рынка ценных бумаг, осуществляющих дилерскую деятельность в качестве основного (одного из основных) вида хозяйственной деятельности и (или) выполняющих функции маркет-мейкера в отношении любых ценных бумаг и не являющихся аффилированными лицами Банка России. Указанные котировки должны быть получены по состоянию и с учетом оценки указанными профессиональными участниками состояния рынка на дату, определенную в соответствии с пунктом 6.2 настоящих *Условий*;

в четвертую очередь, письма Банка России от 29 декабря 2009 г. № 186-Т «О Методических рекомендациях «Об оценке финансовых инструментов по текущей (справедливой) стоимости».

6.4. В случае если сумма *Неурегулированных обязательств (Остаточных обязательств) Банка России* превышает сумму *Неурегулированных обязательств (Остаточных обязательств) Кредитной организации*, Банк России возвращает Кредитной организации разницу между суммой *Неурегулированных обязательств (Остаточных обязательств) Банка России* и суммой *Неурегулированных обязательств (Остаточных обязательств) Кредитной организации* путем перечисления денежных средств в валюте Российской Федерации и (или) перевода по выбору Банка России полученных по *Сделке РЕПО*, в отношении которой осуществляется *Процедура урегулирования*, *Ценных бумаг*. При этом сумма перечисляемых денежных средств и определенная в соответствии с пунктом 6.3 настоящих *Условий* стоимость переводимых *Ценных бумаг* должны в сумме быть равны определенной в соответствии с настоящим пунктом разнице.

6.5. В случае если сумма *Неурегулированных обязательств (Остаточных обязательств) Банка России* меньше суммы *Неурегулированных обязательств (Остаточных обязательств) Кредитной организации*, Кредитная организация уплачивает Банку России разницу между суммой *Неурегулированных обязательств (Остаточных обязательств) Кредитной организации* и суммой

Неурегулированных обязательств (Остаточных обязательств) Банка России путем перечисления соответствующей указанной разнице суммы денежных средств в валюте Российской Федерации.

6.6. В случае если сумма *Неурегулированных обязательств (Остаточных обязательств) Банка России* равна сумме *Неурегулированных обязательств (Остаточных обязательств) Кредитной организации* перечисление денежных средств и (или) перевод *Ценных бумаг* не осуществляются.

6.7. Для целей проведения *Процедуры урегулирования* расчет суммы *Неурегулированных обязательств (Остаточных обязательств) Кредитной организации* и суммы *Неурегулированных обязательств (Остаточных обязательств) Банка России* осуществляется в валюте Российской Федерации. При этом пересчет сумм денежных средств, выраженных в иностранной валюте, в валюту Российской Федерации осуществляется по официальному курсу Банка России, установленному для такой иностранной валюты на дату, в которую осуществляется *Процедура урегулирования*.

6.8. Перечисление денежных средств и (или) перевод *Ценных бумаг* в соответствии с пунктом 6.4 и 6.5 настоящих *Условий* осуществляется в течение 3 (трех) рабочих дней с даты направления Уведомления о проведении *Процедуры урегулирования* по форме приложения 3 к настоящим *Условиям* на соответствующие счета Сторон, реквизиты которых указаны в *Уведомлении о реквизитах Кредитной организации* (приложение 4 к настоящим *Условиям*) или в *Уведомлении о реквизитах Банка России* (приложение 5 к настоящим *Условиям*) соответственно, за исключением случая, установленного пунктом 5.9 настоящих *Условий*.

6.9. Обязательства Сторон по *Сделке РЕПО*, в отношении которой проводится *Процедура урегулирования*, прекращаются с даты направления в соответствии с пунктом 6.2 настоящих *Условий* Уведомления о проведении *Процедуры урегулирования* по форме приложения 3 к настоящим *Условиям*.

6.10. В случае неперечисления Кредитной организацией денежных средств в установленный пунктом 6.8 настоящих *Условий* срок Банк России вправе осуществить их списание с корреспондентского счета (субсчета (субсчетов) Кредитной организации, открытого (открытых) в подразделении (подразделениях) расчетной сети Банка России, банковских счетов Кредитной организации, открытых в НКО АО НРД, на основании распоряжений Банка России о переводе денежных средств. Согласие Кредитной организации на списание указанных денежных средств считается представленным.

6.11. В случае нарушения установленного пунктом 6.8 настоящих *Условий* срока перечисления денежных средств нарушившая Сторона уплачивает другой Стороне неустойку, начисленную на сумму неперечисленных в установленный срок денежных средств, в размере соответствующей ставки, установленной приложением 6 к настоящим *Условиям*.

Расчет суммы неустойки осуществляется за все календарные дни начиная с календарного дня, следующего за 3 (третьим) рабочим днем с даты направления Уведомления о проведении *Процедуры урегулирования* по форме приложения 3 к настоящим *Условиям*, и до дня перечисления указанных денежных средств либо до дня изменения в соответствии с пунктом 5.9 настоящих *Условий* по иным *Сделкам РЕПО Неурегулированных обязательств (Остаточных обязательств) Кредитной организации* на сумму денежных средств, не перечисленных нарушившей Стороной в соответствии с настоящим пунктом в установленный срок, включительно.

Раздел 7. Основания освобождения от ответственности

7.1. Ни одна из Сторон не несет ответственность перед другой Стороной за частичное или полное неисполнение обязательств по *Соглашению*, в том числе настоящим *Условиям*, и заключенным в соответствии с ним *Сделкам РЕПО*, обусловленное действием обстоятельств непреодолимой силы, то есть чрезвычайных и непредотвратимых при данных условиях обстоятельств.

7.2. В случае возникновения обстоятельств непреодолимой силы, влияющих на возможность выполнения Стороной обязательств по *Соглашению*, в том числе настоящим *Условиям*, и заключенным в соответствии с ним *Сделкам РЕПО*, Сторона обязана проинформировать другую Сторону об их наступлении и прекращении в день их наступления и прекращения (в следующий за ним первый рабочий день – в случае их наступления и прекращения в нерабочий день).

Раздел 8. Применимое право. Порядок разрешения споров

8.1. *Соглашение*, в том числе настоящие *Условия*, и *Сделки РЕПО*, заключенные в соответствии с ним, а также все вытекающие из них права и обязанности Сторон регулируются и толкуются в соответствии с законодательством Российской Федерации.

8.2. Все споры и разногласия Сторон по исполнению *Соглашения*, в том числе настоящих *Условий*, и, если иное не предусмотрено *Правилами торгов ФБ ММВБ, Правилами клиринга НКЦ* или *Документами НКО АО НРД*, заключенным в его рамках *Сделкам РЕПО*, разрешаются Сторонами путем переговоров.

Споры и разногласия по исполнению *Соглашения*, в том числе настоящих *Условий*, и, если иное не предусмотрено *Правилами торгов ФБ ММВБ, Правилами клиринга НКЦ* или *Документами НКО АО НРД*, заключенным в его рамках *Сделкам РЕПО*, по которым Стороны не достигнут договоренности, подлежат рассмотрению и разрешению в установленном законодательством Российской Федерации порядке в Арбитражном суде города Москвы.

8.3. Стороны признают, что в случае судебных разбирательств и иных процессуальных действий подтверждение факта информационного обмена и условий *Сделок РЕПО*, заключенных с использованием информационной системы Bloomberg, предоставленное в письменной форме Bloomberg и (или) НКО АО НРД, свидетельствует о действительности, полноте и достоверности информации, которой обменивались Стороны при заключении таких *Сделок РЕПО*.

Раздел 9. Прочие условия

9.1. Стороны признают, что условия *Сделок РЕПО*, заключенных в соответствии с *Соглашением*, в том числе настоящими *Условиями*, а также любая информация, предоставляемая каждой из Сторон в связи с заключением и исполнением *Соглашения*, в том числе настоящих *Условий*, являются конфиденциальными и не подлежат разглашению, распространению или передаче третьим лицам, за исключением случаев, когда такие действия необходимы для исполнения требований законодательства Российской Федерации, *Документов НКО АО НРД, Правил торгов ФБ ММВБ, Правил торгов СПВБ* и (или) *Правил клиринга НКЦ*.

9.2. К настоящим *Условиям* прилагаются и являются его неотъемлемой частью:

приложение 1 – Порядок расчета *Неурегулированных обязательств (Остаточных обязательств) Кредитной организации*;

приложение 2 – Порядок прекращения обязательств с введением процедур банкротства Кредитной организации;

приложение 3 – Уведомление о проведении *Процедуры урегулирования*;

приложение 4 – Уведомление о платежных и иных реквизитах Кредитной организации;

приложение 5 – Уведомление о платежных и иных реквизитах Банка России;

приложение 6 – Ставки для начисления неустойки.

Приложение 1 к
Условиям совершения Банком России и
кредитной организацией Сделок РЕПО на
организованных и не на организованных
торгах в Российской Федерации

Порядок расчета Неурегулированных обязательств (Остаточных обязательств) Кредитной организации

1. Величина Неурегулированных обязательств (Остаточных обязательств) Кредитной организации на i -й календарный день с Даты второй части Сделки РЕПО рассчитывается по следующей формуле:

$$L_i = \max\{0; L_{i-1} - D_{i-1} - B_{i-1} - K_{i-1} + N_{i-1} - V_{i-1} + F_i\},$$

где:

S_2	Стоимость обратного выкупа на Дату второй части Сделки РЕПО, определенная в соответствии с Документами НКО АО НРД и (или) Правилами торгов ММВБ
L_{i-1}	Величина Неурегулированных обязательств (Остаточных обязательств) Кредитной организации на $i-1$ календарный день с Даты второй части Сделки РЕПО. $L_0 = S_2$
D_{i-1}	Сумма денежных средств, перечисленная Кредитной организацией по Сделке РЕПО в день $i-1$ в соответствии с пунктом 5.7 Условий для исполнения Неурегулированных обязательств (Остаточных обязательств) Кредитной организации
B_{i-1}	Сумма денежных средств, списанных по Сделке РЕПО в соответствии с пунктом 5.8 Условий со счетов Кредитной организации на основании распоряжений Банка России о переводе денежных средств в день $i-1$
K_{i-1}	Сумма поступивших Банку России выплат по Ценным бумагам в соответствии с пунктом 5.9 Условий, направленная в день $i-1$ на уменьшение величины Неурегулированных обязательств (Остаточных обязательств) Кредитной организации
N_{i-1}	Сумма обязательств Кредитной организации перед Банком России, на величину которых увеличивается величина Неурегулированных обязательств (Остаточных обязательств) Кредитной организации в день $i-1$ в соответствии с пунктом 5.9 Условий
V_{i-1}	Сумма обязательств Банка России перед Кредитной организацией, на величину которых уменьшается величина Неурегулированных обязательств (Остаточных обязательств) Кредитной организации в день $i-1$ в соответствии с пунктом 5.9 Условий
F_i	Сумма указанной в п. 5.5 Условий неустойки в день i . $F_0 = 0$
$\max(A; B)$	Функция выбора максимального значения

2. Сумма неустойки в день i рассчитывается в валюте Сделки РЕПО по следующей формуле:

$$F_i = F_{i-1} + \frac{R^F}{100\%} * \frac{1}{base} * \left[\max\left\{0; S_2 + \sum_{j=1}^i (-D_{j-1} - B_{j-1} - K_{j-1} + N_{j-1} - V_{j-1})\right\} \right],$$

где:

R^F	Ставка для расчета неустойки, установленная в приложении 6 к настоящим Условиям для сумм в валюте Сделки РЕПО (% годовых)
$base$	Количество календарных дней в году, установленное пунктом 5.17 Условий

Приложение 2 к
Условиям совершения Банком России и
кредитной организацией Сделок РЕПО на
организованных и не на организованных
торгах в Российской Федерации

Порядок прекращения обязательств с введением процедур банкротства Кредитной организации

1. Настоящий Порядок прекращения обязательств с введением процедур банкротства Кредитной организации (далее – *Порядок*) разработан в соответствии с *Примерными условиями договоров РЕПО*.

2. Все термины и определения, специально не оговоренные в настоящем *Порядке*, применяются в значениях, установленных в *Соглашении*.

3. В соответствии с настоящим *Порядком* в случае отзыва у Кредитной организации лицензии на осуществление банковских операций (далее – *События*) обязательства Сторон по всем *Сделкам РЕПО*, заключенным в соответствии с *Соглашением* до даты назначения временной администрации по управлению кредитной организацией или до даты отзыва лицензии на осуществление банковских операций, в зависимости от того, какая из указанных дат наступила ранее, прекращаются возникновением (путем замены) денежного обязательства (далее – *Нетто-обязательства*), размер которого определяется в следующем порядке.

3.1. В соответствии с пунктом 3 настоящего *Порядка* обязательства Сторон по всем *Сделкам РЕПО* прекращаются, а нетто-обязательство возникает в дату, предшествующую дате назначения в Кредитную организацию временной администрации по управлению кредитной организацией или дате отзыва у Кредитной организации лицензии на осуществление банковских операций, в зависимости от того, какая из указанных дат наступила ранее (далее – *Дата прекращения*).

3.2. Банк России осуществляет в соответствии с настоящим *Порядком* расчет размера *Нетто-обязательства* и уведомляет о его размере Кредитную организацию, в отношении которой наступило соответствующее *Событие*, не позднее 30 (тридцати) календарных дней после наступления *Даты прекращения*.

3.3. *Нетто-обязательство* рассчитывается и уплачивается в валюте Российской Федерации (далее – *Базовая валюта*) путем сальдирования сумм обязательств Сторон по *Сделкам РЕПО*, заключенным в рамках *Соглашения*. *Нетто-обязательство* возникает у Стороны, совокупный объем обязательств которой превышает совокупный объем обязательств другой Стороны.

3.4. При расчете размера *Нетто-обязательства* учитываются следующие обязательства по каждой *Сделке РЕПО*:

стоимость *Ценных бумаг*, не переданных во исполнение *Обязательств Банка России по второй части Сделки РЕПО*, и *Стоимость обратного выкупа*, не уплаченная во исполнение *Обязательств Кредитной организации по второй части Сделки РЕПО*;

подлежащие возврату продавцу по договору РЕПО / покупателю по договору РЕПО суммы денежных средств, полученные в результате проведения *Нижней переоценки* (термин используется в значении, установленном *Примерными условиями договоров РЕПО*) / *Верхней переоценки* (термин используется в значении, установленном *Примерными условиями договоров РЕПО*), с процентами, если их начисление предусмотрено по договоренности Сторон;

стоимость подлежащих возврату продавцу по договору РЕПО / покупателю по договору РЕПО *Ценных бумаг*, полученных в результате проведения *Нижней переоценки* (термин используется в значении, установленном *Примерными условиями договоров РЕПО*) / *Верхней переоценки* (термин используется в значении, установленном *Примерными условиями договоров РЕПО*);

доход по *Ценным бумагам*, подлежащий передаче, но ранее не переданный продавцу по договору РЕПО / покупателю по договору РЕПО;

иные обязательства Сторон, за исключением обязательств по возмещению убытков в форме упущенной выгоды и обязательств по уплате неустойки (штрафа, пени).

3.5. Для целей расчета *Нетто-обязательства* все прекращающиеся обязательства Сторон по *Сделкам РЕПО*, заключенным в рамках *Соглашения*, подлежат пересчету в *Базовую валюту*. При этом:

3.5.1. По обязательству по поставке *Ценных бумаг* в расчет принимается стоимость *Ценных бумаг*, определенная на *Дату прекращения* одним из способов, предусмотренных пунктом 3.7 настоящего *Порядка*, по выбору Банка России.

3.5.2. По платежным обязательствам, выраженным в валюте, отличной от *Базовой валюты*, суммы обязательств подлежат конвертации по среднему рыночному курсу, сформировавшемуся на межбанковском денежном рынке на *Дату прекращения*, по которому Банк России мог бы, действуя добросовестно и коммерчески обоснованно, конвертировать сумму соответствующих платежных обязательств в *Базовую валюту*.

3.6. При определении *Нетто-обязательства* в расчет не включаются и, соответственно, не прекращаются обязательства по уплате неустойки (пени, штраф), предусмотренной *Соглашением*. Кроме того, при определении *Нетто-обязательства* не учитываются требования о возмещении убытков в форме упущенной выгоды.

3.7. Стоимость *Ценных бумаг* для целей расчета *Нетто-обязательства* при прекращении обязательств по *Сделкам РЕПО* в связи с наступлением в отношении одной из Сторон соответствующего *События* определяется одним из следующих способов по выбору Банка России:

3.7.1. На основании фактической цены приобретения либо фактической цены реализации *Ценных бумаг*:

в случае если Банк России является продавцом по договору РЕПО или *Стороной*, передавшей *Ценные бумаги* в качестве *Маржинального взноса* (термин используется в значении, установленном *Примерными условиями договоров РЕПО*) / компенсационного взноса, стоимость *Ценных бумаг* для целей расчета *Нетто-обязательства* может быть определена по фактической цене приобретения соответствующих *Ценных бумаг*;

в случае если Банк России является покупателем по договору РЕПО или *Стороной*, получившей *Ценные бумаги* в качестве *Маржинального взноса* (термин используется в значении, установленном *Примерными условиями договоров РЕПО*)/компенсационного взноса, стоимость *Ценных бумаг* может быть определена по фактической цене реализации соответствующих *Ценных бумаг*.

При этом:

фактическая цена приобретения не может превышать *Текущую стоимость* (термин используется в значении, установленном *Примерными условиями договоров РЕПО*), порядок определения которой согласован *Сторонами* не позднее, чем за 190 (Сто девяносто) календарных дней до *Даты прекращения*, увеличенной с учетом *Начального коэффициента обеспечения* (термин используется в значении, установленном *Примерными условиями договоров РЕПО*) / значения дисконта;

фактическая цена реализации не может быть ниже *Текущей стоимости* (термин используется в значении, установленном *Примерными условиями договоров РЕПО*), порядок определения которой согласован *Сторонами* не позднее, чем за 190 (Сто девяносто) календарных дней до *Даты прекращения*, уменьшенной с учетом *Начального коэффициента обеспечения* (термин используется в значении, установленном *Примерными условиями договоров РЕПО*) / значения дисконта;

фактическое приобретение или фактическая реализация осуществляются Банком России не ранее даты заключения соответствующей *Сделки РЕПО*;

фактическая цена приобретения или фактическая цена реализации могут быть документально подтверждены.

3.7.2. На основании котировки соответствующих ценных бумаг. При этом:

3.7.2.1. Под котировкой *Ценных бумаг*, допущенных к обращению у организатора торговли, то есть *Ценных бумаг*, сделки с которыми могут быть заключены на торгах соответствующего организатора торговли, понимается среднее арифметическое цен всех сделок, заключенных в торговой системе соответствующего организатора торговли в течение торгового дня, являющегося *Датой прекращения*. В случае если в *Дату прекращения* в торговой системе какого-либо организатора торговли отсутствуют заявки на заключение сделок с такой *Ценной бумагой*, а равно и в случае, когда число таких заявок менее, чем 3 (Три), котировка для таких *Ценных бумаг* определяется в порядке, установленном для определения котировок *Ценных бумаг*, не допущенных к торгам у организатора торговли в соответствии с подпунктом 3.7.2.2 настоящего *Порядка*.

3.7.2.2. Под котировкой *Ценных бумаг*, не допущенных к обращению у организатора торговли, понимается среднее арифметическое не менее трех *Признаваемых котировок* (термин используется в значении, установленном *Примерными условиями договоров РЕПО*), то есть котировок на соответствующий объем ценных бумаг, полученных Банком России от различных профессиональных участников рынка ценных бумаг, осуществляющих дилерскую деятельность в качестве основного (одного из основных) вида хозяйственной деятельности, выполняющих функции маркет-мейкера в отношении любых ценных бумаг и не являющихся аффилированными лицами Банка России. Такие

котировки должны быть получены по состоянию и с учетом оценки профессиональными участниками состояния финансового и фондового рынка на *Дату прекращения*.

3.7.3. В соответствии с порядком, согласованным Сторонами для определения *Текущей стоимости* (термин используется в значении, установленном *Примерными условиями договоров РЕПО*), при условии, что порядок определения *Текущей стоимости* (термин используется в значении, установленном *Примерными условиями договоров РЕПО*) согласован Сторонами не позднее, чем за 190 (Сто девяносто) календарных дней до *Даты прекращения*.

3.7.4. В соответствии с оценкой справедливой стоимости *Ценных бумаг*, произведенной независимым оценщиком по заказу Банка России.

Приложение 3 к
Условиям совершения Банком России и
кредитной организацией Сделок РЕПО на
организованных и не на организованных
торгах в Российской Федерации

(на бланке структурного подразделения Банка России)

_____ (наименование Кредитной организации)

_____ (адрес местонахождения Кредитной организации)

Уведомление о проведении Процедуры урегулирования

Настоящим уведомляем _____ о проведении
(полное наименование Кредитной организации)

«__» _____ 20__ года в соответствии с разделом 6 Условий совершения Банком России и кредитной организацией Сделок РЕПО на организованных и не на организованных торгах в Российской Федерации в редакции от «__» _____ 20__ года (далее – Условия), являющимся неотъемлемой частью Генерального соглашения об общих условиях совершения Банком России и кредитной организацией сделок РЕПО на организованных и не на организованных торгах в Российской Федерации от «__» _____ 20__ года № _____ (далее – Генеральное соглашение), Процедуры урегулирования по указанным в настоящем уведомлении Сделкам РЕПО.

Все термины и определения, используемые в настоящем уведомлении, понимаются и толкуются в соответствии с Условиями и Генеральным соглашением.

Сумма Неурегулированных обязательств (Остаточных обязательств) Кредитной организации на «__» _____ 20__ года составляет _____ рублей (сумма прописью), в том числе неустойка в размере _____ рублей (сумма прописью).

Сумма Неурегулированных обязательств (Остаточных обязательств) Банка России на «__» _____ 20__ года составляет _____ рублей (сумма прописью), при этом стоимость Ценных бумаг определена Банком России на основании _____.

(указывается основание, установленное пунктом 6.3 Условий)

№	№ Сделки РЕПО	Дата заключения Сделки РЕПО	Дата 1-й части Сделки РЕПО	Дата 2-й части Сделки РЕПО	ISIN	Эмитент	Валюта номинала	Номинал в валюте номинала	Кол-во Ценных бумаг по Сделке РЕПО, шт.	НКД ¹ на шт. на _____ в валюте номинала а	Определено Банком России	
											Цена без НКД на _____ %	Стоимость с НКД на _____ руб
Итого												

В результате проведения Процедуры урегулирования определенная в соответствии пунктом 6.3 Условий сумма Неурегулированных обязательств (Остаточных обязательств) Банка России²:

вариант 1: превышает сумму Неурегулированных обязательств (Остаточных обязательств) Кредитной организации, и Банк России возвращает Кредитной организации разницу между суммой Неурегулированных обязательств (Остаточных обязательств) Банка России и суммой Неурегулированных обязательств (Остаточных обязательств) Кредитной организации, составляющую _____ рублей (сумма прописью), путем³:

вариант а: ее перечисления в полном размере;

вариант б: перевода указанного ниже количества Ценных бумаг и⁴ перечисления суммы денежных средств в размере _____ рублей (сумма прописью), определенной путем уменьшения указанной выше разницы между суммой Неурегулированных обязательств (Остаточных обязательств) Банка России и суммой Неурегулированных обязательств (Остаточных обязательств) Кредитной организации

¹ Накопленный купонный доход по Ценным бумагам.

² В зависимости от результата определения суммы Неурегулированных обязательств (Остаточных обязательств) Банка России в тексте Уведомления оставляется (используется) «вариант 1» или «вариант 2» или «вариант 3».

³ В случае если в тексте Уведомления оставлен (используется) «вариант 1» то по выбору Банка России в тексте «вариант 1» оставляется (используется) «вариант а» или «вариант б».

⁴ В случае если итоговая стоимость возвращаемых Ценных бумаг равна разнице между суммой Неурегулированных обязательств (Остаточных обязательств) Банка России и суммой Неурегулированных обязательств (Остаточных обязательств) Кредитной организации текст «варианта б» используется до союза «и».

обязательств) Кредитной организации на приведенную ниже итоговую стоимость возвращаемых
Ценных бумаг;

ISIN	Эмитент	Валюта	Количество, шт.	Номинал	НКД на шт. на _____, руб.	Цена без НКД на _____, %	Стоимость с НКД на _____, руб.
Итого:							

вариант 2: меньше суммы Неурегулированных обязательств (Остаточных обязательств) Кредитной организации, и Кредитная организация уплачивает Банку России разницу между суммой Неурегулированных обязательств (Остаточных обязательств) Кредитной организации и суммой Неурегулированных обязательств (Остаточных обязательств) Банка России, составляющую _____ рублей (сумма прописью);

вариант 3: равна сумме Неурегулированных обязательств (Остаточных обязательств) Кредитной организации, и перечисление денежных средств и (или) перевод Ценных бумаг не осуществляется.

Перечисление денежных средств и (или) перевод Ценных бумаг в соответствии с настоящим уведомлением осуществляется в течение 3 (трех) рабочих дней с даты его направления по соответствующим реквизитам Сторон, указанным в Уведомлении о реквизитах Кредитной организации (приложение 4 к настоящим Условиям) или в Уведомлении о реквизитах Банка России (приложение 5 к настоящим Условиям)⁵.

Наименование должности

уполномоченного лица

Банка России

Личная подпись

Инициалы, фамилия

Дата

М.П.

Наименование должности

исполнителя, номер телефона, инициалы, фамилия

⁵ В случае если в тексте Уведомления оставлен (используется) «вариант 3» то данный абзац удаляется из текста Уведомления.

Приложение 4 к
Условиям совершения Банком России и
кредитной организацией Сделок РЕПО на
организованных и не на организованных
торгах в Российской Федерации

(на фирменном бланке Кредитной организации)
(при наличии)

Операционный департамент
Банка России
107016, г. Москва, ул. Неглинная, 12

**Уведомление
о платежных и иных реквизитах Кредитной организации**

Настоящим _____ сообщает Вам для целей
(полное фирменное наименование Кредитной организации)
Генерального соглашения об общих условиях совершения Банком России и кредитной организацией сделок РЕПО
на организованных и не на организованных торгах в Российской Федерации от «__» _____ 20__ года
№ _____ следующие реквизиты.

Международный код идентификации юридического лица LEI: _____

Код кредитной организации в системе ЭДО НРД: _____

Реквизиты счета для перечисления денежных средств в рублях:
Корреспондентский счет № _____, открытый в _____

Реквизиты счета для перечисления денежных средств в долларах США:
Корреспондентский счет № _____, открытый в _____ SWIFT-код банка-корреспондента: _____,
Банк-посредник (при необходимости) _____ SWIFT-код банка-посредника: _____

Реквизиты счета для перечисления денежных средств в евро:
Корреспондентский счет № _____, открытый в _____ SWIFT-код банка-корреспондента: _____,
Банк-посредник (при необходимости) _____ SWIFT-код банка-посредника: _____

Реквизиты счета для перечисления денежных средств в фунтах стерлингов:
Корреспондентский счет № _____, открытый в _____ SWIFT-код банка-корреспондента: _____,
Банк-посредник (при необходимости) _____ SWIFT-код банка-посредника: _____

Реквизиты для исполнения обязательств по передаче Ценных бумаг:
счет депо, открытый в НКО АО НРД № _____, раздел № _____

Адрес электронной почты: _____	Код Участника торгов ЗАО «ФБ ММВБ»: _____
Факс: _____	Депозитарный код в НКО АО НРД: _____
Bloomberg-код: _____	SWIFT-код: _____
БИК _____	ИНН _____
КПП _____	Контактные телефоны подразделения, ответственного за исполнение обязательств по сделкам РЕПО с Банком России: _____

Наименование должности
уполномоченного лица
Кредитной организации

Личная подпись

Инициалы, фамилия

Дата
М.П. (при наличии печати)

Наименование должности
исполнителя, номер телефона, инициалы, фамилия

Приложение 5 к
Условиям совершения Банком России и
кредитной организацией Сделок РЕПО на
организованных и не на организованных
торгах в Российской Федерации

(на бланке структурного подразделения Банка России)

(наименование Кредитной организации)

(адрес местонахождения Кредитной организации)

Уведомление о платежных и иных реквизитах Банка России

Международный код идентификации юридического лица LEI: _____

Код Банка России в системе ЭДО НРД: _____

Реквизиты счета для перечисления денежных средств в рублях:

Счет для перечисления неустойки при неисполнении Обязательств Кредитной организации по первой части Сделки РЕПО:

№ _____, открытый в _____

Счет для перечисления выплат по Ценным бумагам и (или) денежных средств для исполнения Неурегулированных обязательств (Остаточных обязательств) Кредитной организации:

№ _____, открытый в _____

Реквизиты счета для перечисления денежных средств в долларах США:

Корреспондентский счет № _____, открытый в _____

SWIFT-код банка-корреспондента: _____

Реквизиты счета для перечисления денежных средств в евро:

Корреспондентский счет № _____, открытый в _____

SWIFT-код банка-корреспондента: _____

Реквизиты счета для перечисления денежных средств в фунтах стерлингов:

Корреспондентский счет № _____, открытый в _____

SWIFT-код банка-корреспондента: _____

Реквизиты для исполнения обязательств по передаче Ценных бумаг:

Счет депо, открытый в НКО АО НРД № _____, раздел № _____

Адрес электронной почты: _____	Bloomberg-код: _____
Факс: _____	SWIFT-код: CBRFRUMM
БИК 044501002	ИНН 7702235133
КПП 775001001	

Наименование должности
уполномоченного лица
Банка России

Личная подпись

Инициалы, фамилия

Наименование должности
исполнителя, номер телефона, инициалы, фамилия

Приложение 6 к
Условиям совершения Банком России и
кредитной организацией Сделок РЕПО на
организованных и не на организованных
торгах в Российской Федерации

Ставки для начисления неустойки

Для начисления неустойки на сумму в соответствующей валюте используется ставка, определяемая как наибольшая из 3 (трех) процентов годовых и удвоенного значения указанной ниже ставки для соответствующей валюты:

для суммы в рублях – ключевая ставка Банка России, публикуемая на официальном сайте Банка России в информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»;

для суммы в долларах США – верхняя граница целевого диапазона ставки Федеральной резервной системы США «Federal Funds Rate», значения которой определяются в соответствии с данными информационных систем «Thomson Reuters» (USFFTARGET=) или Bloomberg (FDTR<INDEX>);

для суммы в евро – ставка по операциям Европейского центрального банка «Main Refinancing Operations», значения которой определяются в соответствии с данными информационных систем «Thomson Reuters» (ECBMRO=ECBF) или Bloomberg (EURR002W<INDEX>);

для суммы в фунтах стерлингов – ставка Банка Англии «Official Bank Rate», значения которой определяются в соответствии с данными информационных систем «Thomson Reuters» (GBBASE=) или Bloomberg (UKBRBASE<INDEX>);

для суммы в юанях – годовая ставка Народного банка Китая «Benchmark Lending Rate», значения которой определяются в соответствии с данными информационных систем «Thomson Reuters» (CNYT1L=PBOC) или Bloomberg (CHLR12M<INDEX>);

для суммы в швейцарских франках – середина целевого диапазона Национального банка Швейцарии для ставки «Three-Month Swiss franc Libor», значения которой определяются в соответствии с данными информационных систем «Thomson Reuters» (CHLIBTARGET=, mid) или Bloomberg (SZLTTR<INDEX>);

для суммы в австралийских долларах – ставка Резервного банка Австралии «Cash Rate Target», значения которой определяются в соответствии с данными информационных систем «Thomson Reuters» (AUCASH=RBAA) или Bloomberg (RBATCTR<INDEX>).

Приложение 3
к информационному письму
Банка России
от « 2 » ноября 2016 года
№ ИН-05-19/76

« ____ » _____ 20__ г.

Операционный департамент

Банка России

107016, г. Москва, ул. Неглинная, 12

Заявление

**о намерении заключить Генеральное соглашение об общих условиях совершения
Банком России и кредитной организацией сделок РЕПО на организованных
и не на организованных торгах в Российской Федерации**

Настоящим _____ (_____),
(полное фирменное наименование и сокращенное фирменное наименование (при наличии)
кредитной организации)

лицензия Центрального банка Российской Федерации на осуществление банковских
операций _____

(дата выдачи и номер)

почтовый адрес для получения корреспонденции от Банка России:

_____,
выражает намерение заключить с Банком России Генеральное соглашение об общих
условиях совершения Банком России и кредитной организацией сделок РЕПО на
организованных и не на организованных торгах в Российской Федерации (далее –
Генеральное соглашение).

К настоящему заявлению прилагаются:

два подписанных экземпляра Генерального соглашения, на ___ листах;

доверенность на подписание генерального соглашения, содержащая образец подписи
лица, уполномоченного на его подписание, либо копия документа, подтверждающего
полномочия должностного лица кредитной организации на подписание генерального
соглашения, заверенная в порядке, установленном законодательством Российской
Федерации (при подписании генерального соглашения руководителем кредитной
организации к заявлению прилагаются только два подписанных экземпляра генерального
соглашения), на ___ листах.

Наименование должности
уполномоченного лица
кредитной организации

Личная подпись

Инициалы, фамилия

Дата
М.П. (при наличии печати)

Наименование должности
исполнителя, номер телефона, инициалы, фамилия