

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



« 13 » марта 2017 г.

МИНИСТЕРСТВО ЮСТИЦИИ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ

№ 4312-У

ЗАРЕГИСТРИРОВАНО

г. Москва

Регистрационный № 46618

от «05» март 2017 г.

УКАЗАНИЕ

**О требованиях к формату, порядку и каналам передачи
центральным контрагентом информации в Банк России
и составу такой информации**

Настоящее Указание на основании части 16¹ статьи 5 Федерального закона от 7 февраля 2011 года № 7-ФЗ «О клиринге, клиринговой деятельности и центральном контрагенте» (Собрание законодательства Российской Федерации, 2011, № 7, ст. 904; № 48, ст. 6728; № 49, ст. 7040, ст. 7061; 2012, № 53, ст. 7607; 2013, № 30, ст. 4084; 2014, № 11, ст. 1098; 2015, № 27, ст. 4001; № 29, ст. 4357; 2016, № 1, ст. 23, ст. 47) (далее – Федеральный закон «О клиринге, клиринговой деятельности и центральном контрагенте») устанавливает требования к формату, порядку и каналам передачи центральным контрагентом информации в Банк России и составу такой информации.

1. Центральный контрагент должен обеспечить передачу в Банк России актуальной и достоверной информации в составе, предусмотренном приложениями 1 и 2 к настоящему Указанию (далее – информация).

Сведения в отношении клиента участника клиринга, предусмотренные приложениями 1 и 2 к настоящему Указанию, передаются в Банк России в

случае, если в соответствии со статьями 16, 22, 23 или 24¹ Федерального закона «О клиринге, клиринговой деятельности и центральном контрагенте» по требованию участника клиринга центральным контрагентом ведется отдельный внутренний учет денежных средств клиента участника клиринга и (или) иного имущества, являющегося предметом индивидуального клирингового обеспечения и иного обеспечения.

2. Центральный контрагент должен осуществлять передачу информации в Банк России с соблюдением требований, установленных пунктом 3 настоящего Указания, путем ее представления в Банк России либо путем предоставления Банку России бесперебойного защищенного доступа к информации в режиме реального времени.

3. Центральный контрагент осуществляет передачу в Банк России информации с соблюдением следующих требований.

3.1. Сведения о сделках (операциях), совершаемых в течение торгового дня на организованных торгах, об участниках клиринга (клиентах участников клиринга), их имуществе, предусмотренные приложением 1 к настоящему Указанию, передаются на регулярной основе не позднее следующего рабочего дня по состоянию на конец предыдущего торгового дня по итогам клиринга.

3.2. Сведения о сделках (операциях), совершаемых в течение дня не на организованных торгах, об участниках клиринга (клиентах участников клиринга), их имуществе, предусмотренные приложением 1 к настоящему Указанию (за исключением таблицы 10), передаются на регулярной основе не позднее следующего рабочего дня по состоянию на 20.00 часов предыдущего дня по местному времени, определяемому по месту нахождения центрального контрагента.

3.3. Сведения, предусмотренные таблицами 1–4, 6 приложения 2 к настоящему Указанию, передаются на нерегулярной основе не позднее

следующего рабочего дня со дня появления (возникновения) указанных сведений у центрального контрагента.

3.4. Сведения, предусмотренные таблицей 5 приложения 2 к настоящему Указанию, передаются на нерегулярной основе не позднее одного часа после возникновения нестандартных и чрезвычайных ситуаций (далее – НЧС), которые могут препятствовать нормальному осуществлению деятельности центрального контрагента.

3.5. Сведения, содержащие информацию о стоимости, предусмотренные приложениями 1 и 2 к настоящему Указанию, передаются в Банк России в рублевом эквиваленте, рассчитанном по официальному курсу иностранной валюты, установленному Банком России на дату составления соответствующих сведений.

3.6. Даты и время, указываемые в сведениях, определяются по московскому времени.

Даты указываются в формате «гггг-мм-дд», где «гггг» – год, «мм» – месяц, «дд» – день. Время указывается в формате «чч:мм:сс», где «чч» – часы, «мм» – минуты, «сс» – секунды. Буква «Т» служит разделителем между датой и временем.

4. Информация передается в Банк России в форме электронного документа, подписанного усиленной квалифицированной электронной подписью в соответствии с Федеральным законом от 6 апреля 2011 года № 63-ФЗ «Об электронной подписи» (Собрание законодательства Российской Федерации, 2011, № 15, ст. 2036; № 27, ст. 3880; 2012, № 29, ст. 3988; 2013, № 14, ст. 1668; № 27, ст. 3463, ст. 3477; 2014, № 11, ст. 1098; № 26, ст. 3390; 2016, № 1, ст. 65; № 26 ст. 3889).

5. Электронный документ, содержащий информацию, представляется в одном из следующих форматов: PDF, DBF, DB2, CSV, XML, FrML, XLSX, XLS, DOC, DOCX, RTF.

6. Передача центральным контрагентом информации в Банк России осуществляется посредством каналов передачи информации, удовлетворяющих требованиям, установленным пунктами 8 и 9 настоящего Указания.

7. В случае непредставления центральным контрагентом информации в Банк России центральный контрагент не позднее рабочего дня после истечения срока для представления информации в Банк России в соответствии с пунктом 3 настоящего Указания представляет в Банк России сведения о причинах непредставления информации.

8. Информация передается в Банк России посредством основных и резервных каналов передачи информации, функционально дублирующих друг друга.

9. Каналы передачи информации, в том числе предоставленные центральному контрагенту в пользование третьими лицами, должны обладать характеристиками, обеспечивающими соблюдение следующих требований:

возможность передачи информации в Банк России соразмерно объему и характеру совершаемых центральным контрагентом операций, в том числе в условиях увеличения объемов оказываемых центральным контрагентом услуг и (или) НЧС;

исключение неправомерных доступа, уничтожения, модифицирования, блокирования, копирования, представления, распространения информации, иных неправомерных действий в отношении информации;

обеспечение технической возможности незамедлительного начала передачи информации посредством резервных каналов передачи информации в случае возникновения сбоя в передаче или прекращения передачи информации посредством основных каналов передачи информации.

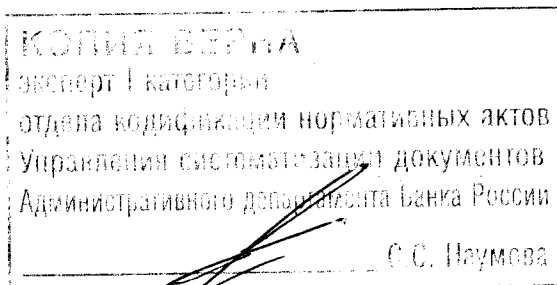
10. Настоящее Указание вступает в силу по истечении 10 дней после дня его официального опубликования.

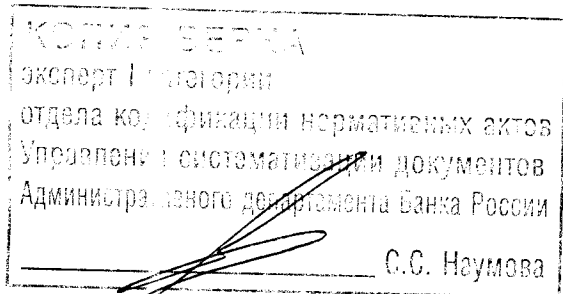
11. Настоящее Указание применяется в отношении юридических лиц, которым Банком России присвоен статус центрального контрагента в соответствии со статьей 27¹ Федерального закона «О клиринге, клиринговой деятельности и центральном контрагенте».

Председатель
Центрального банка
Российской Федерации



Э.С. Набиуллина





Приложение 1
 к Указанию Банка России
 от 13 марта 2017 года № 4312-У
 «О требованиях к формату, порядку и каналам
 передачи центральным контрагентом информации в
 Банк России и составу такой информации»

Состав сведений центрального контрагента, подлежащих передаче
 в Банк России на регулярной основе

Таблица 1. Сведения о сделках (операциях) участников клиринга или их
 клиентов, заключенных с центральным контрагентом

Номер строки	Вид сведений	Описание
1	2	3
1	Номер сделки (операции)	Указывается номер (идентификатор) сделки (операции)
2	Дата и время заключения сделки (совершения операции)	Указываются дата и время заключения сделки (совершения операции)
3	Направление сделки (совершения операции)	Указывается направление сделки (совершения операции): Buy – покупка торгуемого финансового инструмента; Sell – продажа торгуемого финансового инструмента
4	Тип стороны сделки (операции)	Указывается тип стороны сделки (операции): 1 – участники клиринга; 2 – клиенты участника клиринга
5	Тип участника клиринга	Указывается тип участника клиринга: 1 – кредитные организации; 2 – профессиональные участники

1	2	3
		рынка ценных бумаг; 3 – иные юридические лица
6	Тип клиента участника клиринга	Указывается тип клиента участника клиринга: 1 – кредитные организации; 2 – профессиональные участники рынка ценных бумаг; 3 – иные юридические лица; 4 – физические лица
7	Код валюты цены сделки (операции)	Указывается код валюты цены сделки (операции) участника клиринга в соответствии с Общероссийским классификатором валют (ОКВ)
8	Вид сделки (операции)	Указывается вид сделки (операции): 1 – конверсионная операция; 2 – купля-продажа; 3 – депозит; 4 – РЕПО; 5 – иное
9	Тип торгуемого финансового инструмента по сделке (операции)	Указывается тип торгуемого финансового инструмента по сделке (операции): 1 – ценная бумага; 2 – валюта; 3 – товар; 4 – драгоценные металлы; 5 – производный финансовый инструмент; 6 – иное

1	2	3
10	Идентификатор торгуемого финансового инструмента по сделке (операции)	<p>Указывается идентификатор торгуемого финансового инструмента:</p> <p>ISIN – международный идентификационный код ценной бумаги (International Security Identification Number);</p> <p>GR – государственный регистрационный номер выпуска ценной бумаги – для ценных бумаг, выпущенных на территории Российской Федерации;</p> <p>UTI – уникальный код идентификации договора</p>
11	Код торгуемого финансового инструмента по сделке (операции)	Указывается код торгуемого финансового инструмента по сделке (операции) в соответствии с идентификатором
12	Внутрисистемный идентификатор участника клиринга	Указывается идентификатор участника клиринга, который присваивается центральным контрагентом во внутренних системах
13	Внутрисистемный идентификатор клиента участника клиринга	Указывается идентификатор клиента участника клиринга, который присваивается центральным контрагентом во внутренних системах
14	Цена сделки (операции)	Указывается фактическая цена торгуемого финансового

1	2	3
		инструмента, являющегося объектом сделки (операции), заключенной (совершенной) участником клиринга
15	Количество торгуемых финансовых инструментов в сделке (операции)	Указывается количество торгуемых финансовых инструментов, являющихся объектом сделки (операции), заключенной (совершенной) участником клиринга, в единицах
16	Объем сделки (операции)	Указывается стоимость сделки (операции), заключенной (совершенной) участником клиринга
17	Ставка индивидуального клирингового обеспечения и иного обеспечения, за исключением коллективного клирингового обеспечения, предназначенного для обеспечения исполнения обязательств участника клиринга (далее – ставка обеспечения), по торгуемому финансовому инструменту по сделке (операции)	Указывается величина ставки обеспечения по торгуемому финансовому инструменту, являющемуся объектом сделки (операции), заключенной (совершенной) участником клиринга, в процентах
18	Дисконт (премия) по торгуемому финансовому инструменту по сделке (операции)	Указывается дисконт (премия) по торгуемому финансовому инструменту, являющемуся объектом сделки (операции), заключенной (совершенной) участником клиринга, в процентах

1	2	3
19	Купон по торгуемому финансовому инструменту по сделке (операции)	Указывается купон по торгуемому финансовому инструменту по сделке (операции) в случаях, когда торгуемым финансовым инструментом по сделке является облигация
20	Дата исполнения сделки (совершения операции)	Указывается дата исполнения сделки (совершения операции) в зависимости от торгуемого финансового инструмента, являющегося объектом сделки (операции), заключенной (совершенной) участником клиринга
21	Наименование участника клиринга по сделке (операции) с центральным контрагентом	Указывается полное наименование участника клиринга, заключившего сделку (совершившего операцию) с центральным контрагентом
22	Наименование клиента участника клиринга по сделке (операции) с центральным контрагентом	Указывается полное наименование клиента участника клиринга, в интересах которого была заключена сделка (совершена операция) с центральным контрагентом. В случае если такая сделка (операция) была заключена (совершена) участником клиринга в собственных интересах и за счет собственных средств, приводится указание на это
23	Объем обеспечения по сделке	Указывается стоимость обеспечения, внесенного участником клиринга по

1	2	3
		<p>сделке.</p> <p>В случае, когда обеспечение участника клиринга или его клиента учитывается в совокупности по всем сделкам (портфелю) участника клиринга или его клиента, или в случае заключения сделки, закрывающей позицию, указывается общая стоимость обеспечения по портфелю, по сделке соответственно</p>
24	<p>Тип торгуемого финансового инструмента, являющегося обеспечением по сделке</p>	<p>Указывается тип торгуемого финансового инструмента, являющегося обеспечением по сделке:</p> <p>1 – ценная бумага; 2 – валюта; 3 – товар; 4 – драгоценные металлы; 5 – иное</p>
25	<p>Идентификатор торгуемого финансового инструмента, являющегося обеспечением по сделке</p>	<p>Указывается идентификатор торгуемого финансового инструмента, являющегося обеспечением по сделке:</p> <p>ISIN – международный идентификационный код ценной бумаги (International Security Identification Number); GR – государственный регистрационный номер выпуска ценной бумаги – для ценных бумаг,</p>

1	2	3
		<p>выпущенных на территории Российской Федерации; UTI – уникальный код идентификации договора</p>
26	<p>Код идентификатора торгуемого финансового инструмента, являющегося обеспечением по сделке</p>	<p>Указывается код идентификатора торгуемого финансового инструмента, являющегося обеспечением по сделке, в соответствии с идентификатором</p>
27	<p>Код валюты обеспечения по сделке</p>	<p>Указывается код валюты обеспечения, внесенного участником клиринга по сделке, в соответствии с Общероссийским классификатором валют (ОКВ)</p>
28	<p>Наименование торговой (биржевой) секции, на которой заключена сделка (совершена операция)</p>	<p>В случае заключения сделки (совершения операции) на организованных торгах указывается наименование торговой (биржевой) секции, определенное правилами клиринга. В случае заключения сделки (совершения операции) не на организованных торгах указывается, что сделка заключена не на организованных торгах</p>
29	<p>Уплаченная комиссия по сделке (операции)</p>	<p>Указывается фактически уплаченная участником клиринга комиссия по сделке (операции). В случае уплаты комиссии по совокупности сделок (операций), указывается среднее арифметическое значение</p>

Таблица 2. Сведения о торгуемых финансовых инструментах с центральным контрагентом

Номер строки	Вид сведений	Описание
1	2	3
1	Номер сделки	Указывается номер (идентификатор) сделки
2	Тип торгуемого финансового инструмента	Указывается тип торгуемого финансового инструмента: 1 – ценная бумага; 2 – валюта; 3 – товар; 4 – драгоценные металлы; 5 – производный финансовый инструмент; 6 – иное
3	Идентификатор торгуемого финансового инструмента	Указывается идентификатор торгуемого финансового инструмента: ISIN – международный идентификационный код ценной бумаги (International Security Identification Number); GR – государственный регистрационный номер выпуска ценной бумаги – для ценных бумаг, выпущенных на территории Российской Федерации; UTI – уникальный код идентификации договора

1	2	3
4	Код идентификатора торгуемого финансового инструмента	Указывается код идентификатора торгуемого финансового инструмента в соответствии с идентификатором
5	Наименование торгуемого финансового инструмента	Указывается полное наименование торгуемого финансового инструмента
6	Краткое наименование торгуемого финансового инструмента	Указывается краткое наименование торгуемого финансового инструмента
7	Код торгуемого финансового инструмента	Указывается код торгуемого финансового инструмента, который присваивается биржей во внутренних системах (если применимо)
8	Дата и время создания записи	Указываются дата и время создания записи о торгуемом финансовом инструменте
9	Количество единиц базового (базисного) актива торгуемого финансового инструмента	Указывается количество единиц базового (базисного) актива торгуемого финансового инструмента
10	Код метода расчетов торгуемого финансового инструмента	Указывается код метода расчетов торгуемого финансового инструмента в случаях, когда торгуемым финансовым инструментом является производный финансовый инструмент: 0 – поставочный;

1	2	3
		1 – расчетный; 2 – расчетно-поставочный, предполагающий выбор какой-либо стороной договора метода расчетов: поставочный или расчетный
11	Дата и время внесения записи о торгуемом финансовом инструменте	Указываются дата и время внесения записи о торгуемом финансовом инструменте
12	Наименование торговой (биржевой) секции, на которой торгуется финансовый инструмент	В случае если финансовый инструмент торгуется на организованных торгах, указывается наименование торговой (биржевой) секции, определенное правилами клиринга. В случае если финансовый инструмент торгуется не на организованных торгах, указывается, что финансовый инструмент торгуется не на организованных торгах

Таблица 3. Сведения об открытых позициях участников клиринга или его клиентов в отношении центрального контрагента

Номер строки	Вид сведений	Описание
1	2	3
1	Дата и время открытия позиции	Указываются дата и время открытия позиции участником клиринга или его клиентом по московскому времени. Для позиций, образующихся в результате заключения нескольких

1	2	3
		сделок, указываются дата и время заключения последней сделки
2	Наименование участника клиринга или его клиента, открывшего позицию	Указывается полное наименование участника клиринга или его клиента, открывшего позицию
3	Идентификатор участника клиринга или его клиента, открывшего позицию	<p>Указывается идентификатор участника клиринга или его клиента, открывшего позицию:</p> <p>ИНН – идентификационный номер налогоплательщика для участников клиринга или их клиентов – резидентов;</p> <p>TIN – регистрационный номер в стране регистрации (Tax Identification Number) для участников клиринга или их клиентов – нерезидентов;</p> <p>BIC – банковский идентификационный код для участников клиринга или их клиентов – резидентов;</p> <p>LEI – идентификатор юридического лица (Legal Entity Identifier) для участников клиринга или их клиентов – нерезидентов;</p> <p>REG_NUM – регистрационный номер для участников клиринга или их клиентов – резидентов;</p> <p>OGRN – основной государственный регистрационный номер для</p>

1	2	3
		участников клиринга – резидентов; НСП – символный идентификатор клиентов участника клиринга – резидентов
4	Код идентификатора участника клиринга или его клиента, открывшего позицию	Указывается код идентификатора участника клиринга или его клиента в соответствии с идентификатором
5	Наименование торгуемого финансового инструмента по открытой позиции	Указывается полное наименование торгуемого финансового инструмента по открытой позиции участника клиринга или его клиента
6	Идентификатор торгуемого финансового инструмента по открытой позиции	Указывается идентификатор торгуемого финансового инструмента по открытой позиции: ISIN – международный идентификационный код ценной бумаги (International Security Identification Number); GR – государственный регистрационный номер выпуска ценной бумаги – для ценных бумаг, выпущенных на территории Российской Федерации; UTI – уникальный код идентификации договора
7	Код идентификатора торгуемого финансового инструмента по открытой позиции	Указывается код идентификатора торгуемого финансового инструмента по открытой позиции в соответствии с идентификатором

1	2	3
8	Внутренний идентификатор торгуемого финансового инструмента по открытой позиции	Указывается внутренний идентификатор торгуемого финансового инструмента по открытой позиции, который присваивается биржей в ее внутренних системах учета (если применимо)
9	Объем открытой позиции	Указывается стоимость открытой позиции участника клиринга или его клиента по торгуемому финансовому инструменту
10	Объем обеспечения по открытой позиции	Указывается стоимость обеспечения, внесенного участником клиринга или его клиентом по открытой позиции
11	Наименование торговой (биржевой) секции, на которой открыта позиция	В случае открытия позиции на организованных торгах указывается наименование торговой (биржевой) секции, определенное правилами клиринга. В случае открытия позиции не на организованных торгах указывается, что позиция открыта не на организованных торгах

Таблица 4. Сведения об обеспечении, внесенном участником клиринга или его клиентом

Номер строки	Вид сведений	Описание
1	2	3
1	Дата и время внесения обеспечения	Указываются дата и время внесения обеспечения участником клиринга или

1	2	3
		его клиентом
2	Наименование участника клиринга или его клиента, внесшего обеспечение	Указывается полное наименование участника клиринга или его клиента, внесшего обеспечение
3	Идентификатор участника клиринга или его клиента, внесшего обеспечение	<p>Указывается идентификатор участника клиринга или его клиента, внесшего обеспечение:</p> <p>ИНН – идентификационный номер налогоплательщика для участников клиринга или их клиентов – резидентов;</p> <p>TIN – регистрационный номер в стране регистрации (Tax Identification Number) для участников клиринга или их клиентов – нерезидентов;</p> <p>BIC – банковский идентификационный код для участников клиринга или их клиентов – резидентов;</p> <p>LEI – идентификатор юридического лица (Legal Entity Identifier) для участников клиринга или их клиентов – нерезидентов;</p> <p>REG_NUM – регистрационный номер для участников клиринга или их клиентов – резидентов</p> <p>OGRN – основной государственный регистрационный номер для участников клиринга – резидентов;</p> <p>НСП – символьный идентификатор клиентов участника клиринга – резидентов</p>

1	2	3
4	Код идентификатора участника клиринга или его клиента, внесшего обеспечение	Указывается код идентификатора участника клиринга или его клиента, внесшего обеспечение, в соответствии с идентификатором
5	Тип обеспечения	Указывается тип обеспечения: 1 – ценная бумага; 2 – валюта; 3 – товар; 4 – драгоценные металлы; 5 – иное
6	Наименование торгуемого финансового инструмента обеспечения	Указывается полное наименование торгуемого финансового инструмента обеспечения, внесенного участником клиринга или его клиентом
7	Объем обеспечения, внесенного участником клиринга или его клиентом	Указывается стоимость обеспечения, внесенного участником клиринга или его клиентом по соответствующим обязательствам, в разрезе по типам обеспечения
8	Идентификатор торгуемого финансового инструмента обеспечения	Указывается идентификатор торгуемого финансового инструмента обеспечения: ISIN – международный идентификационный код ценной бумаги (International Security Identification Number); GR – государственный регистрационный номер выпуска ценной бумаги – для ценных бумаг, выпущенных на территории

1	2	3
		Российской Федерации; UTI – уникальный код идентификации договора
9	Код идентификатора торгуемого финансового инструмента обеспечения	Указывается код идентификатора торгуемого финансового инструмента обеспечения в соответствии с идентификатором
10	Внутренний идентификатор торгуемого финансового инструмента обеспечения	Указывается внутренний идентификатор торгуемого финансового инструмента обеспечения, который присваивается биржей в ее внутренних системах учета (если применимо)
11	Код валюты обеспечения	Указывается код валюты обеспечения, внесенного участником клиринга или его клиентом, в соответствии с Общероссийским классификатором валют (ОКВ)

Таблица 5. Сведения о неисполненных обязательствах участников клиринга

Номер строки	Вид сведений	Описание
1	2	3
1	Наименование участника клиринга, не исполнившего обязательства	Указывается полное наименование участника клиринга, не исполнившего обязательства перед центральным контрагентом
2	Идентификатор участника клиринга, не исполнившего обязательства	Указывается идентификатор участника клиринга, не исполнившего обязательства: ИНН – идентификационный номер

1	2	3
		<p>налогоплательщика для участников клиринга – резидентов;</p> <p>TIN – регистрационный номер в стране регистрации (Tax Identification Number) для участников клиринга – нерезидентов;</p> <p>BIC – банковский идентификационный код для участников клиринга – резидентов;</p> <p>LEI – идентификатор юридического лица (Legal Entity Identifier) для участников клиринга – нерезидентов;</p> <p>REG_NUM – регистрационный номер для участников клиринга – резидентов;</p> <p>OGRN – основной государственный регистрационный номер для участников клиринга – резидентов</p>
3	Код идентификатора участника клиринга, не исполнившего обязательства	Указывается код идентификатора участника клиринга, не исполнившего обязательства перед центральным контрагентом, в соответствии с идентификатором
4	Дата возникновения обязательства участника клиринга перед центральным контрагентом	Указывается дата, на которую участник клиринга был обязан исполнить обязательства перед центральным контрагентом, но не исполнил
5	Наименование торгуемого финансового инструмента по неисполненным обязательствам участника клиринга	Указывается полное наименование торгуемого финансового инструмента по неисполненным обязательствам участника клиринга перед центральным контрагентом

1	2	3
6	Идентификатор торгуемого финансового инструмента по неисполненным обязательствам участника клиринга	Указывается идентификатор торгуемого финансового инструмента по неисполненным обязательствам участника клиринга: ISIN – международный идентификационный код ценной бумаги (International Security Identification Number); GR – государственный регистрационный номер выпуска ценной бумаги – для ценных бумаг, выпущенных на территории Российской Федерации; UTI – уникальный код идентификации договора
7	Код идентификатора торгуемого финансового инструмента по неисполненным обязательствам участника клиринга	Указывается код идентификатора торгуемого финансового инструмента по неисполненным обязательствам участника клиринга в соответствии идентификатором
8	Внутренний идентификатор торгуемого финансового инструмента по неисполненным обязательствам участника клиринга	Указывается внутренний идентификатор торгуемого финансового инструмента по неисполненным обязательствам участника клиринга, который присваивается биржей во внутренних системах (если применимо)
9	Номер сделки по неисполненным	Указывается номер сделки по неисполненным обязательствам

1	2	3
	обязательствам участника клиринга	участника клиринга перед центральным контрагентом
10	Объем неисполненных обязательств участника клиринга	Указывается стоимость неисполненных обязательств участника клиринга перед центральным контрагентом
11	Наименование торговой (биржевой) секции, на которой была заключена сделка, по которой участником клиринга не исполнены обязательства	В случае заключения сделки на организованных торгах указывается наименование торговой (биржевой) секции, определенное правилами клиринга. В случае заключения сделки не на организованных торгах указывается, что сделка заключена не на организованных торгах

Таблица 6. Сведения о неисполненных центральным контрагентом обязательствах

Номер строки	Вид сведений	Описание
1	2	3
1	Наименование участника клиринга, в отношении которого центральным контрагентом не исполнены обязательства	Указывается полное наименование участника клиринга, в отношении которого центральным контрагентом не исполнены обязательства
2	Идентификатор участника клиринга, в отношении которого центральным контрагентом не исполнены обязательства	Указывается идентификатор участника клиринга, в отношении которого центральным контрагентом не исполнены обязательства: ИНН – идентификационный номер налогоплательщика для участников клиринга – резидентов;

1	2	3
		<p>TIN – регистрационный номер в стране регистрации (Tax Identification Number) для участников клиринга – нерезидентов;</p> <p>BIC – банковский идентификационный код для участников клиринга – резидентов;</p> <p>LEI – идентификатор юридического лица (Legal Entity Identifier) для участников клиринга – нерезидентов;</p> <p>REG_NUM – регистрационный номер для участников клиринга – резидентов;</p> <p>OGRN – основной государственный регистрационный номер для участников клиринга – резидентов</p>
3	Код идентификатора участника клиринга, в отношении которого центральным контрагентом не исполнены обязательства	Указывается код идентификатора участника клиринга, в отношении которого центральным контрагентом не исполнены обязательства, в соответствии с идентификатором
4	Дата возникновения обязательств центрального контрагента перед участником клиринга	Указывается дата, на которую центральный контрагент обязан был исполнить обязательства перед участником клиринга, но не исполнил
5	Наименование торгуемого финансового инструмента по неисполненным центральным контрагентом обязательствам	Указывается полное наименование торгуемого финансового инструмента, по неисполненным центральным контрагентом обязательствам перед участником клиринга

1	2	3
6	Идентификатор торгуемого финансового инструмента по неисполненным центральным контрагентом обязательствам	Указывается идентификатор торгуемого финансового инструмента по неисполненным центральным контрагентом обязательствам: ISIN – международный идентификационный код ценной бумаги (International Security Identification Number); GR – государственный регистрационный номер выпуска ценной бумаги – для ценных бумаг, выпущенных на территории Российской Федерации; UTI – уникальный код идентификации договора
7	Код идентификатора торгуемого финансового инструмента по неисполненным центральным контрагентом обязательствам	Указывается код идентификатора торгуемого финансового инструмента по неисполненным центральным контрагентом обязательствам перед участником клиринга в соответствии с идентификатором
8	Внутренний идентификатор торгуемого финансового инструмента по неисполненным центральным контрагентом обязательствам	Указывается внутренний идентификатор торгуемого финансового инструмента по неисполненным центральным контрагентом обязательствам перед участником клиринга, который присваивается биржей в ее внутренних системах учета (если применимо)

1	2	3
9	Номер сделки по неисполненным центральным контрагентом обязательствам	Указывается номер сделки по неисполненным центральным контрагентом обязательствам перед участником клиринга (если применимо)
10	Объем неисполненных центральным контрагентом обязательств	Указывается величина неисполненных центральным контрагентом обязательств перед участником клиринга
11	Наименование торговой (биржевой) секции, на которой была заключена сделка, по которой не исполнены обязательства центральным контрагентом	В случае заключения сделки на организованных торгах указывается наименование торговой (биржевой) секции, определенное правилами клиринга. В случае заключения сделки не на организованных торгах указывается, что сделка заключена не на организованных торгах
12	Причина неисполнения центральным контрагентом обязательств	Указывается причина неисполнения центральным контрагентом обязательств перед участником клиринга
13	Порядок прекращения неисполненных центральным контрагентом обязательств	Указывается порядок прекращения неисполненных центральным контрагентом обязательств в соответствии с правилами клиринга. В случае если неисполненные обязательства прекращены в связи с заключением новой сделки, указывается номер такой сделки участника клиринга, присвоенный центральным контрагентом

Таблица 7. Сведения о предъявленных центральным контрагентом требованиях к участникам клиринга о внесении дополнительного обеспечения

Номер строки	Вид сведений	Описание
1	2	3
1	Дата предъявления требования о внесении дополнительного обеспечения	Указывается дата предъявления центральным контрагентом требования к участнику клиринга о внесении дополнительного обеспечения
2	Наименование участника клиринга, которому предъявлено требование о внесении дополнительного обеспечения	Указывается полное наименование участника клиринга, которому центральным контрагентом предъявлено требование о внесении дополнительного обеспечения
3	Номер сделки, по которой предъявлено требование о внесении дополнительного обеспечения	Указывается номер сделки участника клиринга, по которой предъявлено центральным контрагентом требование к участнику клиринга о внесении дополнительного обеспечения (если применимо)
4	Объем внесенного обеспечения по сделке, по которой предъявлено требование о внесении дополнительного обеспечения	Указывается стоимость обеспечения, внесенного участником клиринга по сделке, по которой предъявлено центральным контрагентом требование о внесении дополнительного обеспечения. В случае, когда обеспечение участника клиринга учитывается в совокупности по всем сделкам (портфелю) участника клиринга, указывается общая стоимость дополнительного обеспечения, внесенного участником клиринга по портфелю

1	2	3
5	Объем требования о внесении дополнительного обеспечения	Указывается величина требования о внесении дополнительного обеспечения, предъявленного центральным контрагентом участнику клиринга
6	Ставка обеспечения по торгуемым финансовым инструментам по сделке, по которой предъявлено требование о внесении дополнительного обеспечения	Указывается величина ставки обеспечения по торгуемым финансовым инструментам, выступающим в качестве объектов по сделкам участников клиринга, по обязательствам из которых участнику клиринга предъявлены требования о внесении дополнительного обеспечения, в процентах (если применимо)

Таблица 8. Сведения об итогах торгов с центральным контрагентом

Номер строки	Вид сведений	Описание
1	2	3
1	Дата и время торгов	Указываются дата и время торгов
2	Идентификатор торгуемого финансового инструмента	Указывается идентификатор торгуемого финансового инструмента: ISIN – международный идентификационный код ценной бумаги (International Security Identification Number); GR – государственный регистрационный номер выпуска ценной бумаги – для ценных бумаг, выпущенных на территории

1	2	3
		Российской Федерации; UTI – уникальный код идентификации договора
3	Код идентификатора торгуемого финансового инструмента	Указывается код идентификатора торгуемого финансового инструмента в соответствии с идентификатором
4	Минимальное изменение цены торгуемого финансового инструмента	Указывается минимальное изменение цены торгуемого финансового инструмента
5	Минимальная цена сделки с торгуемым финансовым инструментом	Указывается минимальная цена сделки с торгуемым финансовым инструментом по итогам торгового дня
6	Максимальная цена сделки с торгуемым финансовым инструментом	Указывается максимальная цена сделки с торгуемым финансовым инструментом по итогам торгового дня
7	Средневзвешенная цена сделки с торгуемым финансовым инструментом	Указывается средневзвешенная цена сделки с торгуемым финансовым инструментом по итогам торгового дня
8	Цена последней сделки с торгуемым финансовым инструментом	Указывается цена последней сделки с торгуемым финансовым инструментом по итогам торгового дня
9	Количество сделок с торгуемым финансовым инструментом	Указывается количество сделок с торгуемым финансовым инструментом, заключенных за торговый день
10	Объем торгов	Указывается объем торгов за торговый день
11	Объем торгов в единицах измерения веса	Указывается объем торгов за торговый день в единицах измерения веса (объема) товара в случаях, когда торгуемым финансовым инструментом

1	2	3
		по сделке является товар, драгоценный металл
12	Код валюты цены	Указывается код валюты цены торгуемого финансового инструмента в соответствии с Общероссийским классификатором валют (ОКВ)
13	Наименование торговой (биржевой) секции, на которой заключена сделка	В случае заключения сделки на организованных торгах указывается наименование торговой (биржевой) секции, определенное правилами клиринга. В случае заключения сделки не на организованных торгах указывается, что сделка заключена не на организованных торгах

Таблица 9. Сведения об опционных договорах, заключенных с центральным контрагентом

Номер строки	Вид сведений	Описание
1	2	3
1	Номер опционного договора	Указывается номер опционного договора
2	Код торгуемого финансового инструмента опционного договора	Указывается код торгуемого финансового инструмента опционного договора
3	Количество единиц базового (базисного) актива в опционном договоре	Указывается количество единиц базового (базисного) актива в опционном договоре
4	Дата и время начала опционного договора	Указываются дата и время начала опционного договора

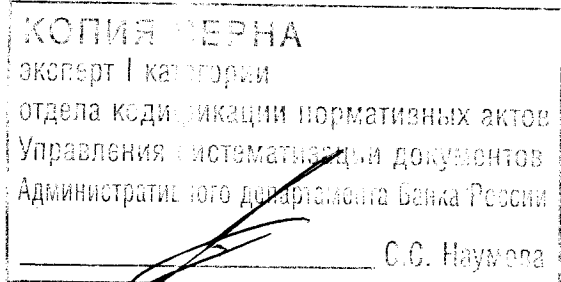
1	2	3
5	Дата и время окончания опционного договора	Указываются дата и время окончания опционного договора
6	Дата и время исполнения опционного договора	Указываются дата и время исполнения опционного договора
7	Код базового (базисного) актива	Указывается код базового (базисного) актива опционного договора
8	Наименование базового (базисного) актива	Указывается полное наименование базового (базисного) актива опционного договора
9	Тип опционного договора	Указывается тип опционного договора: 0 – опционный договор CALL 1 – опционный договор PUT
10	Стиль опционного договора	Указывается стиль опционного договора: 0 – американский опционный договор: покупатель опциона вправе требовать исполнения опционного договора в любой день в течение срока осуществления права на его исполнение; 1 – европейский опционный договор: покупатель опционного договора вправе требовать его исполнения только в предусмотренную договором дату исполнения опциона; 2 – бермудский опционный договор: покупатель опционного договора имеет право требовать его исполнения в определенные договором даты

1	2	3
11	Цена исполнения опционного договора	Указывается цена исполнения опционного договора в валюте заключения договора за единицу базового (базисного) актива
12	Наименование торговой (биржевой) секции, на которой заключена сделка	В случае заключения сделки на организованных торгах указывается наименование торговой (биржевой) секции, определенное правилами клиринга. В случае заключения сделки не на организованных торгах указывается, что сделка заключена не на организованных торгах

Таблица 10. Сведения о фьючерсных договорах, заключенных с центральным контрагентом

Номер строки	Вид сведений	Описание
1	2	3
1	Номер фьючерсного договора	Указывается номер фьючерсного договора
2	Код торгуемого финансового инструмента фьючерсного договора	Указывается код торгуемого финансового инструмента фьючерсного договора
3	Количество единиц базового (базисного) актива фьючерсного договора	Указывается количество единиц базового (базисного) актива фьючерсного договора
4	Дата и время начала фьючерсного договора	Указываются дата и время начала фьючерсного договора
5	Дата и время окончания фьючерсного договора	Указываются дата и время окончания фьючерсного договора
6	Дата и время исполнения фьючерсного договора	Указываются дата и время исполнения фьючерсного договора

1	2	3
7	Код базового (базисного) актива	Указывается код базового (базисного) актива фьючерсного договора
8	Наименование базового (базисного) актива	Указывается полное наименование базового (базисного) актива фьючерсного договора
9	Наименование торговой (биржевой) секции, на которой заключена сделка	Указывается наименование торговой (биржевой) секции, на которой заключена сделка, определенное правилами клиринга



Приложение 2
к Указанию Банка России
от 13 марта 2017 года № 4312 -У
«О требованиях к формату, порядку и каналам
передачи центральным контрагентом информации в
Банк России и составу такой информации»

Состав сведений центрального контрагента, подлежащих передаче
в Банк России на нерегулярной основе

Таблица 1. Сведения о клиентах участника клиринга, имущество которых
учитывается центральным контрагентом отдельно от имущества
участника клиринга

Номер строки	Вид сведений	Описание
1	2	3
1	Дата проведения операции отдельного учета имущества клиента участника клиринга	Указывается дата, с которой имущество клиента участника клиринга учитывается отдельно от имущества участника клиринга
2	Наименование участника клиринга, который ведет учет имущества клиента отдельно	Указывается полное наименование участника клиринга, который ведет учет имущества клиента отдельно
3	Наименование клиента участника клиринга, имущество которого учитывается отдельно	Указывается полное наименование клиента участника клиринга, имущество которого учитывается отдельно от имущества участника клиринга
4	Идентификатор участника клиринга, который ведет учет имущества клиента отдельно	Указывается идентификатор участника клиринга, который ведет учет имущества клиента отдельно: ИНН – идентификационный номер налогоплательщика для участников клиринга – резидентов;

1	2	3
		<p>налогоплательщика для участников клиринга – резидентов;</p> <p>TIN – регистрационный номер в стране регистрации (Tax Identification Number) для участников клиринга – нерезидентов;</p> <p>BIC – банковский идентификационный код для участников клиринга – резидентов;</p> <p>LEI – идентификатор юридического лица (Legal Entity Identifier) для участников клиринга– нерезидентов;</p> <p>REG_NUM – регистрационный номер для участников клиринга – резидентов;</p> <p>OGRN – основной государственный регистрационный номер для участников клиринга – резидентов</p>
5	Идентификатор клиента участника клиринга, имущество которого учитывается отдельно	<p>Указывается идентификатор клиента участника клиринга, имущество которого учитывается отдельно от имущества участника клиринга:</p> <p>ИНН – идентификационный номер налогоплательщика для клиентов участников клиринга – резидентов;</p> <p>TIN – регистрационный номер в стране регистрации (Tax Identification Number) для клиентов участников – нерезидентов;</p> <p>BIC – банковский идентификационный код для клиентов участников</p>

1	2	3
		клиринга – резидентов; LEI – идентификатор юридического лица (Legal Entity Identifier) для клиентов участников клиринга – нерезидентов; REG_NUM – регистрационный номер для клиентов участников клиринга – резидентов; OGRN – основной государственный регистрационный номер для клиентов участников клиринга – резидентов; НСП – символьный идентификатор клиентов участника клиринга – резидентов
6	Код идентификатора участника клиринга, который ведет учет имущества клиента отдельно	Указывается код идентификатора участника клиринга, который ведет учет имущества клиента отдельно, в соответствии с идентификатором
7	Код идентификатора клиента участника клиринга, имущество которого учитывается отдельно	Указывается код идентификатора клиента участника клиринга, имущество которого учитывается отдельно от имущества участника клиринга, в соответствии с идентификатором
8	Объем имущества клиента участника клиринга, имущество которого учитывается отдельно	Указывается стоимость имущества клиента участника клиринга, учитываемого центральным контрагентом отдельно от имущества участника клиринга

Таблица 2. Сведения об осуществлении центральным контрагентом перевода долга и (или) уступки требования одного участника клиринга по допущенным к клирингу обязательствам, возникшим из договоров, заключенных за счет клиента, другому участнику клиринга или центральному контрагенту

Номер строки	Вид сведений	Описание
1	2	3
1	Дата перевода долга и (или) уступки требования	Указывается дата осуществления перевода долга и (или) уступки требования одного участника клиринга другому участнику клиринга или центральному контрагенту
2	Наименование участника клиринга, по отношению к которому осуществлен перевод долга и (или) осуществлена уступка требования	Указывается полное наименование участника клиринга, по отношению к которому центральный контрагент осуществил перевод долга и (или) уступку требования другому участнику клиринга или центральному контрагенту
3	Идентификатор участника клиринга, по отношению к которому осуществлен перевод долга и (или) осуществлена уступка требования	Указывается идентификатор участника клиринга, по отношению к которому центральный контрагент осуществил перевод долга и (или) уступку требования: ИНН – идентификационный номер налогоплательщика для участников клиринга – резидентов; TIN – регистрационный номер в стране регистрации (Tax Identification Number) для участников клиринга –

1	2	3
		<p>нерезидентов; BIC – банковский идентификационный код для участников клиринга – резидентов; LEI – идентификатор юридического лица (Legal Entity Identifier) для участников клиринга – нерезидентов; REG_NUM – регистрационный номер для участников клиринга – резидентов; OGRN – основной государственный – регистрационный номер для участников клиринга – резидентов</p>
4	<p>Код идентификатора участника клиринга, по отношению к которому осуществлен перевод долга и (или) осуществлена уступка требования</p>	<p>Указывается код идентификатора участника клиринга, по отношению к которому центральный контрагент осуществил перевод долга и (или) уступку требования другому участнику клиринга или центральному контрагенту, в соответствии с идентификатором</p>
5	<p>Наименование участника клиринга или центрального контрагента, которому осуществлен перевод долга и (или) осуществлена уступка требования</p>	<p>Указывается полное наименование участника клиринга или центрального контрагента, которому центральный контрагент осуществил перевод долга и (или) уступку требования другого участника клиринга</p>
6	<p>Идентификатор участника клиринга или центрального контрагента, которому осуществлен перевод долга</p>	<p>Указывается идентификатор участника клиринга или центрального контрагента, которому осуществлен перевод долга и (или) осуществлена</p>

1	2	3
	и (или) осуществлена уступка требования	<p>уступка требования:</p> <p>ИНН – идентификационный номер налогоплательщика для участников клиринга или центральных контрагентов – резидентов;</p> <p>TIN – регистрационный номер в стране регистрации (Tax Identification Number) для участников клиринга или центральных контрагентов – нерезидентов;</p> <p>BIC – банковский идентификационный код для участников клиринга или центральных контрагентов – резидентов;</p> <p>LEI – идентификатор юридического лица (Legal Entity Identifier) для участников клиринга или центральных контрагентов – нерезидентов;</p> <p>REG_NUM – регистрационный номер для участников клиринга или центральных контрагентов – резидентов;</p> <p>OGRN – основной государственный регистрационный номер для участников клиринга или центральных контрагентов – резидентов</p>
7	Код идентификатора участника клиринга или центрального контрагента, которому осуществлен перевод долга и (или)	Указывается код идентификатора участника клиринга или центрального контрагента, которому центральный контрагент осуществил перевод долга и (или) уступку требования другого

1	2	3
	осуществлена уступка требования	участника клиринга, в соответствии с идентификатором
8	Объем обязательств клиента	Указывается стоимость обязательств клиента, выступающего в качестве должника, имущество которого учитывается во внутреннем учете центрального контрагента отдельно
9	Объем обеспечения, внесенного клиентом по обязательствам	Указывается стоимость обеспечения, по обязательствам клиента, имущество которого учитывается во внутреннем учете центрального контрагента отдельно. В случае, когда обеспечение клиента учитывается в совокупности по всем сделкам (портфелю), указывается общая стоимость обеспечения, внесенного клиентом по обязательствам
10	Объем долга и (или) уступки требования	Указывается стоимость осуществленных центральным контрагентом перевода долга и (или) уступки требования в отношении клиента, имущество которого учитывается во внутреннем учете центрального контрагента отдельно

Таблица 3. Сведения об участниках клиринга или его клиентах

Номер строки	Вид сведений	Описание
1	2	3
1	Дата и время внесения сведений об участнике	Указываются дата и время внесения сведений об участнике клиринга или

1	2	3
	клиринга или его клиенте	его клиенте
2	Наименование участника клиринга	Указывается полное наименование участника клиринга
3	Наименование клиента участника клиринга	Указывается полное наименование клиента участника клиринга
4	Статус клиента участника клиринга	<p>Указывается статус клиента участника клиринга:</p> <p>1 – физическое лицо;</p> <p>2 – юридическое лицо;</p> <p>3 – иное лицо</p>
5	Идентификатор участника клиринга	<p>Указывается идентификатор участника клиринга:</p> <p>ИНН – идентификационный номер налогоплательщика для участников клиринга – резидентов;</p> <p>TIN – регистрационный номер в стране регистрации (Tax Identification Number) для участников клиринга – нерезидентов;</p> <p>BIC – банковский идентификационный код для участников клиринга – резидентов;</p> <p>LEI – идентификатор юридического лица (Legal Entity Identifier) для участников клиринга – нерезидентов;</p> <p>REG_NUM – регистрационный номер для участников клиринга–резидентов;</p> <p>OGRN – основной государственный</p>

1	2	3
		регистрационный номер для участников клиринга – резидентов
6	Идентификатор клиента участника клиринга	<p>Указывается идентификатор клиента участника клиринга:</p> <p>ИНН – идентификационный номер налогоплательщика для клиентов участников клиринга – резидентов;</p> <p>TIN – регистрационный номер в стране регистрации (Tax Identification Number) для клиентов участников клиринга – нерезидентов;</p> <p>BIC – банковский идентификационный код для клиентов участников клиринга – резидентов;</p> <p>LEI – идентификатор юридического лица (Legal Entity Identifier) для клиентов участников клиринга – нерезидентов;</p> <p>REG_NUM – регистрационный номер для клиентов участников клиринга – резидентов;</p> <p>НСП – символьный идентификатор клиентов участника клиринга – резидентов</p>
7	Код идентификатора участника клиринга	Указывается код идентификатора участника клиринга в соответствии с идентификатором
8	Код идентификатора клиента участника клиринга	Указывается код идентификатора клиента участника клиринга в соответствии с идентификатором

1	2	3
9	ОГРН / ОГРНИП участника клиринга	Указывается основной государственный регистрационный номер участника клиринга
10	ОГРН / ОГРНИП клиента участника клиринга	Указывается основной государственный регистрационный номер клиента участника клиринга (не заполняется в отношении физического лица)
11	Страна участника клиринга	Указывается код страны, в которой зарегистрирован участник клиринга, в соответствии с Общероссийским классификатором стран мира (ОКСМ)
12	Страна клиента участника клиринга	Указывается код страны, в которой зарегистрирован клиент участника клиринга, в соответствии с Общероссийским классификатором стран мира (ОКСМ)
13	Группа (категория) участника клиринга	Указывается группа (категория), к которой относится участник клиринга, в соответствии с правилами клиринга (если применимо)
14	Внутрисистемный идентификатор участника клиринга	Указывается идентификатор участника клиринга, который присваивается центральным контрагентом во внутренних системах
15	Внутрисистемный идентификатор клиента участника клиринга	Указывается идентификатор клиента участника клиринга, который присваивается центральным контрагентом во внутренних

1	2	3
		системах

Таблица 4. Сведения о ставках обеспечения, лимитах концентрации, иностранной валюте, расчетных ценах по ценным бумагам, допущенным к клирингу с частичным обеспечением

Номер строки	Вид сведений	Описание
1	2	3
1	Дата внесения сведений	Указывается дата внесения сведений
2	Идентификатор торгуемого финансового инструмента (ценной бумаги, иностранной валюты)	Указывается идентификатор торгуемого финансового инструмента (ценной бумаги, иностранной валюты)
3	Код иностранной валюты	Указывается код иностранной валюты в соответствии с Общероссийским классификатором валют (ОКВ)
4	Расчетная цена	Указывается расчетная цена в случаях, когда торгуемым финансовым инструментом по сделке является ценная бумага
5	Ставка обеспечения	Указывается ставка обеспечения в соответствии с уровнями, предусмотренными внутренними документами центрального контрагента, в процентах
6	Лимит концентрации торгуемого финансового инструмента (ценной бумаги, иностранной валюты)	Указывается лимит концентрации торгуемого финансового инструмента (ценной бумаги, иностранной валюты) в соответствии с уровнями, предусмотренными внутренними документами центрального контрагента, в единицах (если

1	2	3
		применимо)

Таблица 5. Сведения о НЧС, которые могут препятствовать нормальному осуществлению деятельности центрального контрагента

Номер строки	Вид сведений	Описание
1	2	3
1	Дата и время возникновения НЧС, которая может препятствовать нормальному осуществлению деятельности центрального контрагента	Указываются дата и время возникновения НЧС, которая может препятствовать нормальному осуществлению деятельности центрального контрагента
2	Описание НЧС, которая может препятствовать нормальному осуществлению деятельности центрального контрагента	Указывается краткое описание НЧС, которая может препятствовать нормальному осуществлению деятельности центрального контрагента, в том числе причины ее возникновения
3	Принятые центральным контрагентом меры, необходимые для перехода на резервный канал передачи информации	Указывается информация о принятых центральным контрагентом мерах, необходимых для перехода на резервный канал передачи информации в Банк России

Таблица 6. Сведения о последствиях НЧС, которые могут препятствовать нормальному осуществлению деятельности центрального контрагента, и времени восстановления работоспособности программно-технических средств и сетевых коммуникаций

Номер строки	Вид сведений	Описание
1	2	3
1	Последствия возникновения	Указываются последствия

1	2	3
	НЧС	возникновения НЧС, которая может препятствовать нормальному осуществлению деятельности центрального контрагента
2	Время восстановления работоспособности программно-технических средств и сетевых коммуникаций	Указывается количество фактического времени восстановления работоспособности программно-технических средств и сетевых коммуникаций центрального контрагента