



**ФЕДЕРАЛЬНАЯ СЛУЖБА ПО ФИНАНСОВЫМ РЫНКАМ  
(ФСФР России)**

20 НОЯ 2012

**П Р И К А З**

Москва

№ 12-95/м-к

**О внесении изменений в приказ ФСФР России от 24.08.2006 № 06-95/пз-н  
«О порядке оказания услуг, способствующих заключению срочных  
договоров (контрактов), а также особенностях осуществления клиринга  
срочных договоров (контрактов)»**

В соответствии с пунктами 3, 4 и 13 статьи 42 Федерального закона от 22.04.1996 № 39-ФЗ «О рынке ценных бумаг» (Собрание законодательства Российской Федерации, 1996, № 17, ст. 1918; 1998, № 48, ст. 5857; 1999, № 28, ст. 3472; 2001, № 33, ст. 3424; 2002, № 52, ст. 5141; 2004, № 27, ст. 2711; № 31, ст. 3225; 2005, № 11, ст. 900; № 25, ст. 2426; 2006, № 1, ст. 5; № 2, ст. 172; № 17, ст. 1780; № 31, ст. 3437; № 43, ст. 4412; 2007, № 1, ст. 45; № 18, ст. 2117; № 22, ст. 2563; № 41, ст. 4845; № 50, ст. 6247, ст. 6249; 2008, № 44, ст. 4982; № 52, ст. 6221; 2009, № 1, ст. 28; № 7, ст. 777; № 18, ст. 2154; № 23, ст. 2770; № 29, ст. 3642; № 48, ст. 5731; № 52, ст. 6428; 2010, № 17, ст. 1988; № 31, ст. 4193; № 41, ст. 5193; 2011, № 7, ст. 905; № 23, ст. 3262; № 27, ст. 3873; № 27, ст. 3880; № 29, ст. 4291; № 48, ст. 6728; № 49, ст. 7040; № 50, ст. 7357; 2012, № 25, ст. 3269; № 31, ст. 4334) и Положением о Федеральной службе по финансовым рынкам, утвержденным постановлением Правительства Российской Федерации от 29.08.2011 № 717 (Собрание законодательства Российской Федерации, 2011, № 36, ст. 5148; 2012, № 20, ст. 2562),

п р и к а з ы в а ю:

1. Внести следующие изменения в приказ ФСФР России от 24.08.2006 № 06-95/пз-н «О порядке оказания услуг, способствующих заключению срочных договоров (контрактов), а также особенностях осуществления клиринга срочных

договоров (контрактов)» (зарегистрирован в Министерстве юстиции Российской Федерации 15.09.2006, регистрационный № 8300)\* (далее - Приказ):

1.1. Название Приказа изложить в следующей редакции:

«О порядке оказания услуг, способствующих заключению договоров, являющихся производными финансовыми инструментами».

1.2. Пункт 1 Приказа изложить в следующей редакции:

«Утвердить прилагаемое Положение о порядке оказания услуг, способствующих заключению договоров, являющихся производными финансовыми инструментами (далее - Положение).».

1.3. Пункт 2 Приказа исключить.

2. Внести следующие изменения в Положение о порядке оказания услуг, способствующих заключению срочных договоров (контрактов), а также особенностях осуществления клиринга срочных договоров (контрактов), утвержденное Приказом (далее - Положение о порядке оказания услуг):

2.1. Название Положения о порядке оказания услуг изложить в следующей редакции:

«Положение о порядке оказания услуг, способствующих заключению договоров, являющихся производными финансовыми инструментами».

2.2. По тексту Положения о порядке оказания услуг и в названиях разделов слова «срочный договор (контракт)» или «срочные договоры (контракты)» заменить словами «договор, являющийся производным финансовым инструментом» или

---

\* С изменениями, внесенными приказом ФСФР России от 29.03.2007 № 07-33/пз-н «О внесении изменений в Положение о порядке оказания услуг, способствующих заключению срочных договоров (контрактов), а также особенностях осуществления клиринга срочных договоров (контрактов), утвержденное приказом Федеральной службы по финансовым рынкам от 24 августа 2006 г. № 06-95/пз-н» (зарегистрирован Министерством юстиции Российской Федерации 17.05.2007, регистрационный № 9502), приказом ФСФР России 10.11.2009 № 09-45/пз-н «Об утверждении Положения о снижении (ограничении) рисков, связанных с доверительным управлением активами инвестиционных фондов, размещением средств пенсионных резервов, инвестированием средств пенсионных накоплений и накоплений для жилищного обеспечения военнослужащих, а также об утверждении изменений в некоторые нормативные правовые акты Федеральной службы по финансовым рынкам» (зарегистрирован Министерством юстиции Российской Федерации 20.01.2010, регистрационный № 16030), приказом ФСФР России от 21.01.2011 № 11-2/пз-н «Об утверждении Положения о порядке и условиях поддержания цен, спроса, предложения или объема торгов финансовым инструментом, иностранной валютой и (или) товаром и изменений в положение о порядке оказания услуг, способствующих заключению срочных договоров (контрактов), а также особенностях осуществления клиринга срочных договоров (контрактов), утвержденное приказом ФСФР России от 24.08.2006 № 06-95/пз-н» (зарегистрирован Министерством юстиции Российской Федерации 04.04.2011, регистрационный № 20392)

«договоры, являющиеся производными финансовыми инструментами» в соответствующих числе и падеже.

2.3. По тексту Положения о порядке оказания услуг слова «базовый актив» или «базовые активы» заменить словами «базисный (базовый) актив» или «базисные (базовые) активы» в соответствующих числе и падеже.

2.4. По тексту Положения о порядке оказания услуг слова «федеральный орган исполнительной власти в сфере финансовых рынков» заменить словами «федеральный орган исполнительной власти по рынку ценных бумаг» в соответствующем падеже.

2.5. Пункт 1.1 Положения о порядке оказания услуг изложить в следующей редакции:

«1.1. Настоящее Положение определяет требования и условия оказания услуг, способствующих заключению договоров, являющихся производными финансовыми инструментами.».

2.6. Пункт 1.5 Положения о порядке оказания услуг исключить.

2.7. В пункт 2.2 Положения о порядке оказания услуг изложить в следующей редакции:

«2.2. Ценные бумаги могут быть базисными (базовыми) активами, в случаях, установленных подпунктами 2.2.1 - 2.2.6 настоящего Положения.

2.2.1. Эмиссионные ценные бумаги могут быть базисным (базовым) активом договоров, являющихся производными финансовыми инструментами, если:

ценные бумаги включены в список ценных бумаг, допущенных к торгам (далее - Список), хотя бы одного организатора торговли;

среднемесячный объем сделок с такими ценными бумагами, рассчитанный по итогам торгов на организаторах торговли Российской Федерации за последние 3 месяца, составлял не менее 250 млн. рублей;

для расчетных фьючерсных договоров (контрактов) и расчетных опционных (договоров) контрактов, базисным (базовым) активом которых являются акции, капитализация акций составляет не менее 25 млрд. рублей;

для расчетных фьючерсных договоров (контрактов) и расчетных опционных

(договоров) контрактов, базисным (базовым) активом которых являются облигации, объем выпуска составляет не менее 3 млрд. рублей.

2.2.2. Иностранные финансовые инструменты могут быть базисным (базовым) активом договоров, являющихся производными финансовыми инструментами, если:

иностранные финансовые инструменты квалифицированы в соответствии с законодательством Российской Федерации в качестве акций, депозитарных расписок на акции, акций или паев иностранных инвестиционных фондов, облигаций или депозитарных расписок на облигации;

эмитентами указанных ценных бумаг или ценных бумаг, права собственности в отношении которых удостоверяются ценными бумагами (далее – представляемые ценные бумаги), являются иностранные организации, соответствующие требованиям пункта 2 статьи 51<sup>1</sup> Федерального закона от 22.04.1996 № 39-ФЗ «О рынке ценных бумаг».

2.2.3. Иностранные финансовые инструменты, квалифицированные в соответствии с законодательством Российской Федерации как акции или депозитарные расписки на акции, могут быть базисным (базовым) активом договоров, являющихся производными финансовыми инструментами, при условии соблюдения требований пункта 2.2.2 настоящего Положения, а также при условии, что:

данные ценные бумаги или представляемые ценные бумаги включены в Список хотя бы одного организатора торговли Российской Федерации или прошли процедуру листинга на иностранной фондовой бирже, входящей в перечень иностранных фондовых бирж, прохождение процедуры листинга на которых является обязательным условием для принятия российской фондовой биржей решения о допуске ценных бумаг иностранных эмитентов к торгам без решения федерального органа исполнительной власти по рынку ценных бумаг об их допуске к публичному размещению и (или) публичному обращению в Российской Федерации, утвержденный федеральным органом исполнительной власти по рынку ценных бумаг (далее – Перечень иностранных фондовых бирж), или эмитенту (выпуску) указанных ценных бумаг присвоен рейтинг долгосрочной

кредитоспособности по обязательствам в валюте Российской Федерации или в иностранной валюте не ниже уровня, установленного пунктом 2.2.6 настоящего Положения;

среднемесячный объем сделок с данными ценными бумагами или представляемыми ценными бумагами, рассчитанный по итогам торгов на организаторах торговли Российской Федерации и иностранных фондовых биржах, входящих в Перечень иностранных фондовых бирж, за последние 3 месяца, составлял не менее 250 млн рублей;

капитализация данных ценных бумаг или представляемых ценных бумаг по итогам торгов на организаторе торговли в Российской Федерации или на иностранной фондовой бирже, входящей в Перечень иностранных фондовых бирж, составляет не менее 25 млрд. рублей.

В случае если ценные бумаги (представляемые ценные бумаги к депозитарным распискам на акции) допущены к торгам на нескольких иностранных фондовых биржах и (или) организаторах торговли в Российской Федерации, то капитализация определяется по итогам торгов на иностранной фондовой бирже и (или) организаторе торговли в Российской Федерации, на которой (котором) в календарный день, по состоянию на который рассчитывается капитализация, был зафиксирован наибольший объем сделок по соответствующим ценным бумагам (представляемым ценным бумагам к депозитарным распискам на акции).

2.2.4. Иностранные финансовые инструменты, квалифицированные в соответствии с законодательством Российской Федерации как облигации или как депозитарные расписки на облигации (за исключением финансовых инструментов, выпущенных международными финансовыми организациями, иностранными государствами или центральными банками иностранных государств), могут быть базисным (базовым) активом договоров, являющихся производными финансовыми инструментами, при условии соблюдения требований пункта 2.2.2 настоящего Положения, а также при условии, что:

данные ценные бумаги или представляемые ценные бумаги включены в Список хотя бы одного организатора торговли Российской Федерации или прошли

процедуру листинга на иностранной фондовой бирже, входящей в перечень иностранных фондовых бирж, или эмитенту (выпуску) указанных ценных бумаг присвоен рейтинг долгосрочной кредитоспособности по обязательствам в валюте Российской Федерации или в иностранной валюте не ниже уровня, установленного пунктом 2.2.6 настоящего Положения;

объем выпуска таких ценных бумаг (представляемых ценных бумаг) составляет не менее 3 млрд. рублей.

2.2.5. Иностранные финансовые инструменты, квалифицированные в соответствии с законодательством Российской Федерации как паи или акции инвестиционных фондов, могут быть базисным (базовым) активом договоров, являющихся производными финансовыми инструментами, при условии соблюдения требований пункта 2.2.2 настоящего Положения, а также при условии, что:

данные ценные бумаги включены в Список хотя бы одного организатора торговли Российской Федерации или прошли процедуру листинга на иностранной фондовой бирже, входящей в Перечень иностранных фондовых бирж;

среднемесячный объем сделок с данными ценными бумагами, рассчитанный по итогам торгов на организаторах торговли Российской Федерации и иностранных фондовых биржах, входящих в Перечень иностранных фондовых бирж, за последние 3 месяца, составлял не менее 250 млн. рублей;

иностранные инвестиционные фонды (инвестиционные компании), акции или паи которых являются базисным (базовым) активом договоров, являющихся производными финансовыми инструментами, в соответствии с личным законом этих фондов (компаний) относятся к схемам коллективного инвестирования, созданным с единственной целью инвестировать публично привлеченные средства на принципе пропорционального распределения риска, и проспект ценных бумаг (правила) этих фондов (компаний) предусматривает выкуп (приобретение) их ценных бумаг на фондовой бирже по цене, существенно не отличающейся от цены, определенной исходя из стоимости их чистых активов (далее - иностранные биржевые инвестиционные фонды);

в проспекте ценных бумаг (правилах) иностранного биржевого инвестиционного фонда, одобренном соответствующим уполномоченным органом иностранного государства в соответствии с личным законом этого иностранного биржевого инвестиционного фонда, предусмотрены ограничение на привлечение заемных средств, подлежащих возврату за счет средств указанного фонда, до 10 процентов стоимости составляющих его активов, а также положения, в соответствии с которыми не допускается совершение сделок, увеличивающих риск снижения стоимости чистых активов иностранного биржевого инвестиционного фонда по отношению к рыночному риску снижения стоимости активов, предусмотренных в проспекте ценных бумаг (правилах) иностранного биржевого инвестиционного фонда, в том числе договоров репо и договоров, являющихся производными финансовыми инструментами.

2.2.6. В случаях, предусмотренных настоящим Положением, ценные бумаги и представляемые ценные бумаги должны иметь рейтинг не ниже следующего уровня рейтинга по международной шкале долгосрочной кредитоспособности по обязательствам в валюте Российской Федерации или в иностранной валюте, присвоенного рейтинговыми агентствами:

Фитч Рейтингз (Fitch Ratings) – «BBB-»;

Стандард энд Пурс (Standard & Poor's) – «BBB-»;

Мудис Инвесторс Сервис (Moody's Investors Service) – «Вaa3».

6. Абзац первый пункта 2.8 Положения о порядке оказания услуг после слов «один раз в квартал,» дополнить словами «либо проводит оценку указанных показателей на основании информации, раскрываемой иностранными фондовыми биржами в отношении иностранных финансовых инструментов, являющихся базисным (базовым) активом договоров, являющихся производными финансовыми инструментами.».

2.8. Пункт 2.7 Положения о порядке оказания услуг исключить.

2.9. В пункте 2.9 Положения о порядке оказания услуг после слов «таких договоров» слово «(контрактов)» исключить.

2.10. Пункт 2.13 Положения о порядке оказания услуг изложить в следующей редакции:

«2.13. При определении показателей, предусмотренных настоящим Положением и исчисляемых в рублях, для расчета которых используются значения в иностранной валюте, иностранная валюта пересчитывается в рубли по курсу Центрального банка Российской Федерации, а в случае отсутствия официального курса – по кросс-курсу соответствующей валюты к рублю на дату расчета таких показателей.».

2.11. Пункты 2.13.1 - 2.13.6 и 2.14 Положения о порядке оказания услуг исключить.

2.12. В последнем абзаце пункта 3.1.4 Положения о порядке оказания услуг после слов «нестандартные договоры» слово «контракты)/» исключить.

2.13. Пункт 4.1 Положения о порядке оказания услуг после слова «активом» дополнить словами «с учетом особенностей, установленных пунктом 4.5 настоящего Положения.».

2.14. Пункт 4.2.2 Положения о порядке оказания услуг изложить в следующей редакции:

«4.2.2. Вид договора, являющегося производным финансовым инструментом, в соответствии с Положением о видах производных финансовых инструментов, утвержденным приказом ФСФР России от 04.03.2010 № 10-13/пз-н (зарегистрирован в Министерстве юстиции Российской Федерации 14.04.2010, регистрационный № 16898)».

2.15. Раздел IV Положения о порядке оказания услуг дополнить пунктом 4.5 следующего содержания:

«4.5. Биржа вправе утвердить единую спецификацию для нескольких договоров, являющихся производными финансовыми инструментами и имеющих разные базисные (базовые) активы (далее – единая спецификация), если указанные договоры имеют одинаковые условия, указанные в пунктах 4.2.2, 4.2.8 - 4.2.11 настоящего Положения.



В этом случае биржа вправе не включать в единую спецификацию условия, предусмотренные пунктами 4.2.1, 4.2.3 - 4.2.7 настоящего Положения. При этом условия, предусмотренные настоящим Положением, не включенные в единую спецификацию, должны быть утверждены отдельным документом биржи.».

2.16. В пункте 5.2 Положения о порядке оказания услуг:

в абзаце первом слова «и работников участников торгов, допущенных к торгам от имени участников торгов» исключить;

абзац второй исключить.

2.17. Пункт 5.3 Положения о порядке оказания услуг исключить.

2.18. Пункт 6.2.4 Положения о порядке оказания услуг изложить в следующей редакции: «6.2.4. Разнонаправленные заявки, поданные за счет одного и того же лица (в соответствии с кодом этого лица), условия которых позволяют в порядке, определенном правилами организованных торгов, установить их полное или частичное соответствие, не могут являться основанием для заключения сделок с клиринговой организацией.».

2.19. В абзаце первом пункта 6.7 Положения о порядке оказания услуг слова «соответствующего срочного договора (контракта)» заменить словами «соответствующего договора».

2.20. Раздел VII Положения о порядке оказания услуг исключить.

2.21. В третьем абзаце пункта 8.2 Положения слова «тем же срочным договорам (контрактам)» заменить словами «указанным договорам».

Руководитель

Д.В. Панкин



26 НОЯ 2012

Заместитель начальника  
Управления делами и архива  
*(Н. И. Родина)*