Указание Банка России от 16.07.2021 N 5864-У (ред. от 22.02.2023) "О требованиях к формату, порядку и каналам передачи центральным контрагентом информации в Банк России и составу такой информации" (Зарегистрировано в Минюсте России 08.09.2021 N 64934)

ЦЕНТРАЛЬНЫЙ БАНК РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ

УКАЗАНИЕ
ОТ 16 ИЮЛЯ 2021 Г. N 5864-У

О ТРЕБОВАНИЯХ К ФОРМАТУ, ПОРЯДКУ И КАНАЛАМ ПЕРЕДАЧИ ЦЕНТРАЛЬНЫМ КОНТРАГЕНТОМ ИНФОРМАЦИИ В БАНК РОССИИ И СОСТАВУ ТАКОЙ ИНФОРМАЦИИ

Настоящее Указание на основании части 16.1 статьи 5 Федерального закона от 7 февраля 2011 года N 7-ФЗ "О клиринге, клиринговой деятельности и центральном контрагенте" (Собрание законодательства Российской Федерации, 2011, N 7, ст. 904; 2018, N 24, ст. 3399) устанавливает требования к формату, порядку и каналам передачи центральным контрагентом информации в Банк России и составу такой информации.

1. Центральный контрагент должен передавать в Банк России достоверную информацию в составе, предусмотренном таблицами приложений 1 и 2 к настоящему Указанию.

2. Центральный контрагент должен передавать информацию в Банк России одним из следующих способов:

направлять информацию в Банк России в форме электронных документов, подписанных усиленной квалифицированной электронной подписью уполномоченного лица центрального контрагента, в соответствии с порядком взаимодействия Банка России с некредитными финансовыми организациями, определенным на основании частей первой и восьмой статьи 76.9 Федерального закона от 10 июля 2002 года N 86-ФЗ "О Центральном банке Российской Федерации (Банке России)" (Собрание законодательства Российской Федерации, 2002, N 28, ст. 2790; 2021, N 27, ст. 5187) (далее - Федеральный закон "О Центральном банке Российской Федерации (Банке России)");

предоставлять Банку России бесперебойный защищенный доступ к информации.

3. Центральный контрагент должен передавать в Банк России информацию в составе, предусмотренном таблицами приложения 1 к настоящему Указанию, каждый календарный день, в котором центральным контрагентом осуществляется клиринг в соответствии с правилами клиринга (далее - торговый день).

Информация, предусмотренная таблицами приложения 1 к настоящему Указанию, должна передаваться центральным контрагентом в Банк России по итогам клиринга по состоянию на конец торгового дня, предшествующего дню ее передачи в Банк России.

4. Центральный контрагент должен передавать в Банк России информацию в составе, предусмотренном таблицами приложения 2 к настоящему Указанию, по состоянию на конец торгового дня, предшествующего дню ее передачи в Банк России, в следующие сроки:

информация, предусмотренная таблицей 1 приложения 2 к настоящему Указанию, - не позднее окончания торгового дня, следующего за торговым днем, в течение которого центральным контрагентом было предъявлено требование участнику клиринга о внесении обеспечения в дополнение к обеспечению, ранее внесенному участником клиринга;

информация, предусмотренная таблицей 2 приложения 2 к настоящему Указанию, - не позднее окончания торгового дня, следующего за торговым днем, в котором у центрального контрагента появилась информация об активах, являющихся предметом сделок, совершаемых участниками клиринга с центральным контрагентом;

информация, предусмотренная таблицей 3 приложения 2 к настоящему Указанию, - не позднее окончания торгового дня, следующего за торговым днем, в котором центральным контрагентом был осуществлен перевод долга и уступка требования одного участника клиринга по допущенным к клирингу обязательствам, возникшим из договоров, заключенных за счет клиента указанного участника клиринга, другому участнику клиринга или другому центральному контрагенту;

информация, предусмотренная таблицей 4 приложения 2 к настоящему Указанию, - не позднее окончания торгового дня, следующего за торговым днем, в течение которого у центрального контрагента появилась информация об участниках клиринга или о клиентах участников клиринга;

информация, предусмотренная таблицей 5 приложения 2 к настоящему Указанию, - не позднее окончания торгового дня, следующего за торговым днем, в течение которого произошло исполнение обязательства участника клиринга перед центральным контрагентом в соответствии с частью 8 статьи 18 Федерального закона от 7 февраля 2011 года N 7-ФЗ "О клиринге, клиринговой деятельности и центральном контрагенте" (Собрание законодательства Российской Федерации, 2011, N 7, ст. 904; 2020, N 31, ст. 5012) (далее соответственно - Федеральный закон "О клиринге, клиринговой деятельности и центральном контрагенте", ликвидационный неттинг);

информация, предусмотренная таблицей 6 приложения 2 к настоящему Указанию, - не позднее окончания торгового дня, следующего за торговым днем, в котором обязательства участников клиринга не были исполнены перед центральным контрагентом, за исключением обязательств, которые были исполнены посредством ликвидационного неттинга;

информация, предусмотренная таблицей 7 приложения 2 к настоящему Указанию, - не позднее окончания торгового дня, следующего за торговым днем, в течение которого

центральный контрагент не исполнил обязательства перед участниками клиринга;

информация, предусмотренная таблицей 8 приложения 2 к настоящему Указанию, - не позднее окончания торгового дня, следующего за торговым днем, в течение которого возникли нестандартные и чрезвычайные ситуации, которые нарушают нормальное осуществление деятельности центрального контрагента (далее - НЧС).

5. При отсутствии у центрального контрагента отдельной информации центральный контрагент вместо этой информации должен указывать в таблицах символ "-" (прочерк) в случае передачи информации в Банк России в виде таблиц.

6. В случае если информация содержит значения, выраженные в иностранной валюте, указанная информация должна передаваться центральным контрагентом в Банк России в рублевом эквиваленте, рассчитанном центральным контрагентом по официальному курсу иностранной валюты по отношению к рублю, установленному Банком России в соответствии с пунктом 15 статьи 4 Федерального закона "О Центральном банке Российской Федерации (Банке России)" (Собрание законодательства Российской Федерации, 2002, N 28, ст. 2790; 2021, N 27, ст. 5187) в торговый день, за который центральный контрагент передает информацию.

В случае если официальный курс иностранной валюты по отношению к рублю не устанавливается Банком России, рублевый эквивалент должен рассчитываться центральным контрагентом по курсу, рассчитанному в торговый день, за который центральный контрагент передает информацию, по котировкам иностранной валюты на международных валютных рынках, а в случае отсутствия указанных котировок - по устанавливаемому центральным (национальным) банком, осуществляющим эмиссию данной иностранной валюты, курсу к любой третьей валюте, официальный курс которой по отношению к рублю устанавливается Банком России.

7. Информация о датах и времени должна определяться центральным контрагентом по московскому времени.

Даты должны указываться центральным контрагентом в формате "гггг-мм-дд", где "гггг" - год, "мм" - месяц, "дд" - день. Время должно указываться в формате "чч:мм:сс", где "чч" - часы, "мм" - минуты, "сс" - секунды. Буква "T" должна служить разделителем между датой и временем.

8. Центральный контрагент должен передавать в Банк России информацию в формате "*.xml".

9. При передаче центральным контрагентом информации в Банк России путем предоставления Банку России бесперебойного защищенного доступа к информации центральный контрагент должен организовать два канала передачи информации, функционально дублирующие друг друга, для обеспечения бесперебойной передачи информации в случае недоступности одного из каналов (далее - каналы передачи информации).

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

обеспечение способности каналов передачи информации передавать информацию в объеме, соразмерном объему информации, передаваемой центральным контрагентом в Банк России, в том числе в условиях увеличения объема передаваемой центральным контрагентом информации и (или) в условиях НЧС;

ограничение возможности неправомерных доступа, уничтожения, модифицирования, блокирования, копирования, распространения информации и иных неправомерных действий в отношении информации в целях обеспечения ее защиты;

обеспечение технической возможности начала передачи центральным контрагентом информации в Банк России посредством перехода на использование дублирующего канала передачи информации в течение 2 часов с момента возникновения сбоя в передаче или прекращения передачи информации в Банк России посредством другого канала передачи информации.

11. В случае если торговые дни, за которые информация передается центральным контрагентом в Банк России, установленные пунктами 3 и 4 настоящего Указания, приходятся на выходной или нерабочий праздничный день, признаваемый таковым в соответствии со статьями 111 и 112 Трудового кодекса Российской Федерации (Собрание законодательства Российской Федерации, 2002, N 1, ст. 3; 2006, N 27, ст. 2878; 2012, N 18, ст. 2127), окончание срока передачи информации в Банк России переносится на ближайший следующий за ним рабочий день.

12. Настоящее Указание подлежит официальному опубликованию и в соответствии с решением Совета директоров Банка России (протокол заседания Совета директоров Банка России от 10 февраля 2023 года N ПСД-5) вступает в силу с 1 октября 2023 года.

13. Со дня вступления в силу настоящего Указания признать утратившим силу Указание Банка России от 13 марта 2017 года N 4312-У "О требованиях к формату, порядку и каналам передачи центральным контрагентом информации в Банк России и составу такой информации", зарегистрированное Министерством юстиции Российской Федерации 5 мая 2017 года N 46618.

Председатель Центрального банка
Российской Федерации
Э.С.НАБИУЛЛИНА

Приложение 1
к Указанию Банка России
от 16 июля 2021 года N 5864-У
"О требованиях к формату,
порядку и каналам передачи
центральным контрагентом
информации в Банк России
и составу такой информации"

СОСТАВ
ИНФОРМАЦИИ ЦЕНТРАЛЬНОГО КОНТРАГЕНТА, ПОДЛЕЖАЩЕЙ ПЕРЕДАЧЕ В БАНК РОССИИ НА РЕГУЛЯРНОЙ ОСНОВЕ

Таблица 1. Информация о сделках участников клиринга, совершенных с центральным контрагентом в течение торгового дня, в разрезе участников клиринга и клиентов участника клиринга

Номер строки	Вид информации	Описание
1	2	3
1	Номер сделки	Указывается номер сделки, присваиваемый организатором торговли или центральным контрагентом (в случае если организатором торговли номер сделки не присвоен). Информация указывается в случае присвоения организатором торговли или центральным контрагентом номера сделки
2	Дата и время совершения сделки	Указываются календарная дата и время совершения сделки

3	Наименование идентификатора участника клиринга, совершившего сделку	Указывается наименование одного из следующих идентификаторов участника клиринга, совершившего сделку: ИНН - идентификационный номер налогоплательщика для участников клиринга - резидентов Российской Федерации, определяемых в соответствии с пунктом 6 части 1 статьи 1 Федерального закона от 10 декабря 2003 года N 173-ФЗ "О валютном регулировании и валютном контроле" (Собрание законодательства Российской Федерации, 2003, N 50, ст. 4859; 2019, N 49, ст. 6957) (далее - резидент) (кроме банков); TIN - регистрационный номер в стране регистрации (Tax Identification Number) для участников клиринга - нерезидентов Российской Федерации, определяемых в соответствии с пунктом 7 части 1 статьи 1 Федерального закона от 10 декабря 2003 года N 173-ФЗ "О валютном регулировании и валютном контроле" (далее - нерезидент); БИК - банковский идентификационный код для участников клиринга - резидентов, являющихся банками; ОГРН - основной государственный регистрационный номер (в случае отсутствия ИНН) для участников клиринга - резидентов (кроме банков); REG_NUM - регистрационный номер в стране регистрации (в случае отсутствия TIN) для участников клиринга - нерезидентов; LEI - идентификатор юридического лица (Legal Entity Identifier) (в случае отсутствия TIN и REG_NUM) для участников клиринга - нерезидентов. В случае отсутствия у участника клиринга указанных идентификаторов указывается наименование иного идентификатора, имеющегося у центрального контрагента

4	Значение идентификатора участника клиринга, совершившего сделку	Указывается значение идентификатора участника клиринга, совершившего сделку, наименование которого указано в соответствии со строкой 3 настоящей таблицы
5	Наименование идентификатора клиента участника клиринга, за счет которого совершена сделка	В случае если сделка совершена за счет клиента участника клиринга, являющегося юридическим лицом, указывается наименование одного из следующих идентификаторов клиента участника клиринга: ИНН - идентификационный номер налогоплательщика для клиентов участника клиринга - резидентов (кроме банков); TIN - регистрационный номер в стране регистрации (Tax Identification Number) для клиентов участника клиринга - нерезидентов; БИК - банковский идентификационный код для клиентов участника клиринга - резидентов, являющихся банками; ОГРН - основной государственный регистрационный номер (в случае отсутствия ИНН) для клиентов участника клиринга - резидентов; REG_NUM - регистрационный номер в стране регистрации (в случае отсутствия TIN) для клиентов участника клиринга - нерезидентов; LEI - идентификатор юридического лица (Legal Entity Identifier) (в случае отсутствия TIN и REG_NUM) для клиентов участника клиринга - нерезидентов. В случае отсутствия у клиента участника клиринга указанных идентификаторов указывается наименование иного идентификатора, имеющегося у центрального контрагента. Информация указывается в случае ее наличия у центрального контрагента. Информация не указывается, если сделка совершена клиентом участника клиринга, являющимся физическим лицом

6	Значение идентификатора клиента участника клиринга, за счет которого совершена сделка	В случае если сделка совершена за счет клиента участника клиринга в рамках доверительного управления или за счет клиента участника клиринга, в отношении которого в соответствии с частью 4.1 статьи 16, частью 4 статьи 22, частью 3 статьи 23 или частью 7 статьи 24.1 Федерального закона "О клиринге, клиринговой деятельности и центральном контрагенте" (Собрание законодательства Российской Федерации, 2011, N 7, ст. 904; 2016, N 1, ст. 23; 2018, N 24, ст. 3399; 2020, N 31, ст. 5012) по требованию участника клиринга центральным контрагентом ведется отдельный внутренний учет денежных средств и (или) иного имущества, являющегося предметом индивидуального клирингового обеспечения и иного обеспечения (далее - сегрегированный клиент), указывается значение идентификатора указанного клиента участника клиринга, наименование которого указано в соответствии со строкой 5 настоящей таблицы. В случае если сделка совершена участником клиринга за счет клиента участника клиринга, не являющегося сегрегированным клиентом участника клиринга (далее - несегрегированный клиент участника клиринга), данная информация указывается при ее наличии у центрального контрагента
7	Значение внутрисистемного идентификатора участника клиринга, совершившего сделку	Указывается значение внутрисистемного идентификатора участника клиринга, совершившего сделку, который присваивается центральным контрагентом во внутренних системах учета. В случае если центральный контрагент не присваивает внутрисистемный идентификатор участника клиринга, указывается уникальный код, присвоенный организатором торговли участнику клиринга и используемый центральным контрагентом во внутренних системах учета (далее - уникальный код)

8	Значение внутрисистемного идентификатора клиента участника клиринга, за счет которого совершена сделка	В случае если сделка совершена за счет клиента участника клиринга, указывается значение внутрисистемного идентификатора клиента участника клиринга, который присваивается центральным контрагентом во внутренних системах учета. В случае если центральный контрагент не присваивает внутрисистемный идентификатор клиента участника клиринга, указывается уникальный код. Информация о значении внутрисистемного идентификатора клиента участника клиринга указывается в случае ее наличия у центрального контрагента
9	Направление сделки	В случае если участник клиринга или клиент участника клиринга приобретает актив, являющийся предметом совершенной сделки, указывается буквенный код "Buy". В случае если участник клиринга или клиент участника клиринга отчуждает актив, являющийся предметом совершенной сделки, указывается буквенный код "Sell"
10	Код сделки (операции)	Указывается один из следующих кодов сделки (операции): 1 - конверсионная операция; 2 - своп-договор; 3 - договор купли-продажи ценных бумаг; 4 - договор купли-продажи драгоценных металлов; 5 - договор банковского вклада (депозита); 6 - договор репо, по которому передаются клиринговые сертификаты участия; 7 - договор репо, по которому не передаются клиринговые сертификаты участия; 8 - фьючерсный договор; 9 - опционный договор; 10 - иное

11	Наименование идентификатора актива, являющегося предметом совершенной сделки	Указывается наименование одного из следующих идентификаторов актива, являющегося предметом совершенной сделки: ISIN - международный идентификационный код ценной бумаги (International Security Identification Number); GR - государственный регистрационный номер выпуска ценной бумаги (в случае отсутствия международного идентификационного кода ценной бумаги (ISIN); UTI - уникальный код идентификации договора (Unique Trade Identifier); OKB - общероссийский классификатор валют (цифровой). В случае отсутствия указанных идентификаторов актива, являющегося предметом совершенной сделки, указывается наименование иного идентификатора, имеющегося у центрального контрагента
12	Значение идентификатора актива, являющегося предметом совершенной сделки	Указывается значение идентификатора актива, являющегося предметом совершенной сделки, наименование которого указано в соответствии со строкой 11 настоящей таблицы
13	Цена актива, являющегося предметом совершенной сделки, в соответствии с условиями данной сделки за единицу актива	Указывается цена актива, являющегося предметом совершенной сделки, в соответствии с условиями данной сделки за единицу актива
14	Цена актива, являющегося предметом совершенной сделки, в российских рублях	Указывается цена актива, являющегося предметом совершенной сделки, рассчитанная на день заключения сделки, в российских рублях

15	Единицы измерения актива	Указывается единица измерения, в которой выражен актив, являющийся предметом совершенной сделки: 1 - штука; 2 - тонна; 3 - пункт; 4 - грамм; 5 - баррель. В случае отсутствия указанных единиц измерения указывается единица измерения, примененная для измерения актива, являющегося предметом совершенной сделки
16	Количество актива, являющегося предметом совершенной сделки	Указывается количество актива, являющегося предметом совершенной сделки, в единицах измерения данного актива согласно условиям сделки
17	Цена сделки	Указывается фактическая цена сделки по состоянию на торговый день, за который передается информация в соответствии с настоящей таблицей, рассчитанная в порядке, установленном центральным контрагентом
18	Дисконт (премия) по активу, являющемуся предметом совершенной сделки	В случае если в соответствии с условиями сделки по активу, являющемуся предметом сделки, определен дисконт (премия), указывается размер дисконта (премии) в соответствии с условиями сделки в процентах
19	Процент (купон) по активу, являющемуся предметом совершенной сделки	Указывается процент (купон) по активу, являющемуся предметом совершенной сделки, в случае если указанным активом является облигация
20	Процентная ставка, установленная по сделке	В случае установления процентной ставки по сделке указывается данная процентная ставка
21	Дата расчетов по сделке	Указывается календарная дата расчетов по сделке в соответствии с условиями сделки

22	Наименование торговой (биржевой) секции и режим торгов, в которых совершена сделка	В случае совершения сделки на торгах организатора торговли указываются наименование торговой (биржевой) секции, в которой совершена сделка, и режим торгов (в случае если на торговой (биржевой) секции предусмотрено несколько режимов торгов), определенные правилами клиринга (в случае определения правилами клиринга наименования торговой (биржевой) секции и режима торгов). В случае совершения сделки не на организованных торгах указывается код "ОТС"
23	Комиссионное вознаграждение за совершение сделки (далее - комиссия по сделке)	Указывается комиссия по сделке, взимаемая центральным контрагентом в зависимости от объема сделки и подлежащая уплате участником клиринга, в российских рублях. В случае начисления комиссии по совокупности сделок указывается среднее арифметическое значение величин комиссий по каждой из сделок
24	Дополнительная информация о сделке	Строка заполняется в случае наличия у центрального контрагента дополнительной информации о сделке
25	Дата передачи информации	Указывается календарная дата передачи центральным контрагентом в Банк России информации, предусмотренной настоящей таблицей
26	Сведения о должностном лице, уполномоченном осуществлять контроль формирования информации и ее передачи в Банк России (далее - должностное лицо)	В случае если центральным контрагентом назначено должностное лицо, указываются фамилия, имя, отчество (последнее - при наличии) и номер телефона должностного лица

Таблица 2. Информация об открытых позициях участников клиринга в результате совершения за счет участников клиринга сделок с центральным контрагентом и (или) об открытых позициях в пользу клиентов участников клиринга в результате совершения за счет клиентов участников клиринга сделок с центральным контрагентом

Номер строки	Вид информации	Описание
1	2	3
1	Наименование идентификатора участника клиринга, открывшего позицию	Указывается наименование одного из следующих идентификаторов участника клиринга, открывшего позицию: ИНН - идентификационный номер налогоплательщика для участников клиринга - резидентов (кроме банков); TIN - регистрационный номер в стране регистрации (Tax Identification Number) для участников клиринга - нерезидентов; БИК - банковский идентификационный код для участников клиринга - резидентов, являющихся банками; ОГРН - основной государственный регистрационный номер (в случае отсутствия ИНН) для участников клиринга - резидентов (кроме банков); REG_NUM - регистрационный номер в стране регистрации (в случае отсутствия TIN) для участников клиринга - нерезидентов; LEI - идентификатор юридического лица (Legal Entity Identifier) (в случае отсутствия TIN и REG_NUM) для участников клиринга - нерезидентов. В случае отсутствия у участника клиринга, открывшего позицию, указанных идентификаторов указывается наименование иного идентификатора, имеющегося у центрального контрагента
2	Значение идентификатора участника клиринга, открывшего позицию	Указывается значение идентификатора участника клиринга, открывшего позицию, наименование которого указано в соответствии со строкой 1 настоящей таблицы

3	Наименование идентификатора клиента участника клиринга, в пользу которого открыта позиция	В случае если позиция открыта в пользу клиента участника клиринга, являющегося юридическим лицом, указывается наименование одного из следующих идентификаторов клиента участника клиринга: ИНН - идентификационный номер налогоплательщика для клиентов участника клиринга - резидентов (кроме банков); TIN - регистрационный номер в стране регистрации (Tax Identification Number) для клиентов участника клиринга - нерезидентов; БИК - банковский идентификационный код для клиентов участника клиринга - резидентов, являющихся банками; ОГРН - основной государственный регистрационный номер (в случае отсутствия ИНН) для клиентов участника клиринга - резидентов; REG_NUM - регистрационный номер в стране регистрации (в случае отсутствия TIN) для клиентов участника клиринга - нерезидентов; LEI - идентификатор юридического лица (Legal Entity Identifier) (в случае отсутствия TIN и REG_NUM) для клиентов участника клиринга - нерезидентов. В случае если позиция открыта в пользу несегрегированного клиента участника клиринга, данная информация указывается при ее наличии у центрального контрагента. Информация не указывается, если позиция открыта в пользу клиента участника клиринга, являющегося физическим лицом

4	Значение идентификатора клиента участника клиринга, в пользу которого открыта позиция	В случае если позиция открыта в пользу клиента участника клиринга, указывается значение идентификатора клиента участника клиринга, наименование которого указано в соответствии со строкой 3 настоящей таблицы. Информация о значении идентификатора клиента участника клиринга, в пользу которого открыта позиция, указывается при ее наличии у центрального контрагента
5	Значение внутрисистемного идентификатора участника клиринга, открывшего позицию	В случае если сделка совершена за счет участника клиринга, указывается значение внутрисистемного идентификатора участника клиринга, открывшего позицию, который присваивается центральным контрагентом во внутренних системах учета. В случае если центральный контрагент не присваивает внутрисистемный идентификатор участника клиринга или клиента участника клиринга, в пользу которого открыта позиция, указывается уникальный код, присвоенный организатором торговли указанному участнику клиринга, открывшему позицию, или клиенту участника клиринга, в пользу которого открыта позиция

6	Значение внутрисистемного идентификатора клиента участника клиринга, в пользу которого открыта позиция	В случае если позиция открыта в пользу клиента участника клиринга, указывается значение идентификатора клиента участника клиринга, в пользу которого открыта позиция, присваиваемого центральным контрагентом во внутренних системах учета. В случае если центральный контрагент не присваивает внутрисистемный идентификатор клиента участника клиринга, в пользу которого открыта позиция, указывается уникальный код, присвоенный организатором торговли участнику клиринга, открывшему позицию, или клиенту участника клиринга, в пользу которого открыта позиция. Информация о значении внутрисистемного идентификатора клиента участника клиринга, в пользу которого открыта позиция, указывается в случае ее наличия у центрального контрагента
7	Наименование идентификатора актива, в котором открыта позиция	Указывается наименование одного из следующих идентификаторов актива, в котором открыта позиция: ISIN - международный идентификационный код ценной бумаги (International Security Identification Number); GR - государственный регистрационный номер выпуска ценной бумаги (в случае отсутствия международного идентификационного кода ценной бумаги (ISIN); UTI - уникальный код идентификации договора (Unique Trade Identifier); OKB - общероссийский классификатор валют (цифровой). В случае отсутствия указанных идентификаторов актива, в котором открыта позиция, указывается наименование иного идентификатора, имеющегося у центрального контрагента

8	Значение идентификатора актива, в котором открыта позиция	Указывается значение идентификатора актива, в котором открыта позиция, наименование которого указано в соответствии со строкой 7 настоящей таблицы
9	Значение внутреннего идентификатора актива, в котором открыта позиция	Указывается значение внутреннего идентификатора актива, в котором открыта позиция, присвоенного центральным контрагентом во внутреннем учете. В случае использования центральным контрагентом внутреннего идентификатора актива, присвоенного организатором торговли, указывается значение данного идентификатора
10	Величина открытой позиции	Указывается величина открытой позиции участника клиринга или его клиента в российских рублях. Величина открытой позиции по опционным договорам указывается с учетом теоретической цены опционного договора, определяемой в порядке, предусмотренном пунктом 8 приложения 2 к Положению Банка России от 17 октября 2014 года N 437-П "О деятельности по проведению организованных торгов", зарегистрированному Министерством юстиции Российской Федерации 30 декабря 2014 года N 35494, 16 февраля 2018 года N 50066, 16 октября 2020 года N 60426). В случае если открытая позиция является короткой, указывается величина открытой короткой позиции со знаком "-" (минус)
11	Количество актива, в котором открыта позиция	Указывается количество актива, в котором открыта позиция, в единицах измерения указанного актива. В случае если активом, в котором открыта позиция, является валюта, указывается сумма в той валюте, по отношению к которой устанавливается цена сделки

12	Единица измерения актива	Указывается единица измерения актива, в котором открыта позиция: 1 - штука; 2 - тонна; 3 - пункт; 4 - грамм; 5 - баррель. В случае отсутствия указанных единиц измерения актива, в котором открыта позиция, указывается единица измерения, примененная для измерения актива, в котором открыта позиция
13	Дата исполнения обязательств по сделке (закрытия позиции)	Указывается календарная дата исполнения обязательств по сделке (закрытия позиции)
14	Наименование торговой (биржевой) секции и режим торгов	В случае открытия позиции на организованных торгах указываются наименование торговой (биржевой) секции и режим торгов (в случае если на торговой (биржевой) секции предусмотрено несколько режимов торгов), определенные во внутренних документах организатора торговли или правилами клиринга центрального контрагента. В случае если позиция открыта не на организованных торгах, указывается код "ОТС". В случае если часть позиции открыта на организованных торгах, а часть позиции - не на организованных торгах, указывается код "ОТ/ОТС"
15	Дополнительная информация	Строка заполняется в случае наличия у центрального контрагента дополнительной информации
16	Торговый день	Указывается торговый день, по состоянию на конец которого центральный контрагент передает информацию, предусмотренную настоящей таблицей
17	Дата передачи информации	Указывается календарная дата передачи центральным контрагентом в Банк России информации, предусмотренной настоящей таблицей

18	Сведения о должностном лице	В случае если центральным контрагентом назначено должностное лицо, указываются фамилия, имя, отчество (последнее - при наличии) и номер телефона должностного лица

Таблица 3. Информация об имуществе, предназначенном для обеспечения исполнения обязательств участником клиринга или его клиентом

Номер строки	Вид информации	Описание
1	2	3

1	Наименование идентификатора участника клиринга, внесшего имущество, предназначенное для обеспечения исполнения обязательств (далее - обеспечение)	Указывается наименование одного из следующих идентификаторов участника клиринга, внесшего имущество, предназначенное для обеспечения: ИНН - идентификационный номер налогоплательщика для участников клиринга - резидентов (кроме банков); TIN - регистрационный номер в стране регистрации (Tax Identification Number) для участников клиринга - нерезидентов; БИК - банковский идентификационный код для участников клиринга - резидентов, являющихся банками; ОГРН - основной государственный регистрационный номер (в случае отсутствия ИНН) для участников клиринга - резидентов (кроме банков); REG_NUM - регистрационный номер в стране регистрации (в случае отсутствия TIN) для участников клиринга - нерезидентов; LEI - идентификатор юридического лица (Legal Entity Identifier) (в случае отсутствия TIN и REG_NUM) для участников клиринга - нерезидентов. В случае отсутствия у участника клиринга указанных идентификаторов указывается наименование иного идентификатора, имеющегося у центрального контрагента
2	Значение идентификатора участника клиринга, внесшего имущество в обеспечение	Указывается значение идентификатора участника клиринга, внесшего имущество в обеспечение, наименование которого указано в соответствии со строкой 1 настоящей таблицы

3	Наименование идентификатора клиента участника клиринга, имущество которого внесено в обеспечение	Указывается наименование одного из следующих идентификаторов клиента участника клиринга, имущество которого внесено в обеспечение, являющегося юридическим лицом: ИНН - идентификационный номер налогоплательщика для клиентов участника клиринга - резидентов (кроме банков); TIN - регистрационный номер в стране регистрации (Tax Identification Number) для клиентов участника клиринга - нерезидентов; БИК - банковский идентификационный код для клиентов участника клиринга - резидентов, являющихся банками; ОГРН - основной государственный регистрационный номер (в случае отсутствия ИНН) для клиентов участника клиринга - резидентов (кроме банков); REG_NUM - регистрационный номер в стране регистрации (в случае отсутствия TIN) для клиентов участника клиринга - нерезидентов; LEI - идентификатор юридического лица (Legal Entity Identifier) (в случае отсутствия TIN и REG_NUM) для клиентов участника клиринга - нерезидентов. В случае если в обеспечение внесено имущество клиента участника клиринга, являющегося несегрегированным клиентом участника клиринга или клиентом участника клиринга в рамках доверительного управления, данная информация указывается при ее наличии у центрального контрагента. Информация не указывается, если в обеспечение внесено имущество клиента участника клиринга, являющегося физическим лицом

4	Значение идентификатора клиента участника клиринга, имущество которого внесено в обеспечение	В случае если в обеспечение внесено имущество клиента участника клиринга, являющегося юридическим лицом, указывается значение идентификатора клиента участника клиринга, наименование которого указано в соответствии со строкой 3 настоящей таблицы. В случае если в обеспечение внесено имущество несегрегированного клиента участника клиринга или клиента участника клиринга в рамках доверительного управления, данная информация указывается при ее наличии у центрального контрагента
5	Значение внутрисистемного идентификатора участника клиринга, внесшего имущество в обеспечение	В случае если в обеспечение внесено имущество участника клиринга, указывается значение внутрисистемного идентификатора участника клиринга, который присваивается центральным контрагентом во внутренних системах учета. В случае если центральный контрагент не присваивает внутрисистемный идентификатор участника клиринга, указывается уникальный код, присвоенный организатором торговли участнику клиринга

6	Значение внутрисистемного идентификатора клиента участника клиринга, имущество которого внесено в обеспечение	В случае если в обеспечение внесено имущество клиента участника клиринга, указывается значение внутрисистемного идентификатора клиента участника клиринга, который присваивается центральным контрагентом во внутренних системах учета. В случае если центральный контрагент не присваивает внутрисистемный идентификатор клиента участника клиринга, указывается уникальный код, присвоенный организатором торговли клиенту участника клиринга, имущество которого внесено в обеспечение. Информация о значении внутрисистемного идентификатора клиента участника клиринга, имущество которого внесено в обеспечение, указывается в случае ее наличия у центрального контрагента
7	Наименование идентификатора имущества, внесенного в обеспечение	Указывается наименование одного из следующих идентификаторов имущества, внесенного в обеспечение: ISIN - международный идентификационный код ценной бумаги (International Security Identification Number); GR - государственный регистрационный номер выпуска ценной бумаги (в случае отсутствия международного идентификационного кода ценной бумаги (ISIN); OKB - общероссийский классификатор валют (цифровой). В случае отсутствия указанных идентификаторов имущества, внесенного в обеспечение, указывается наименование иного идентификатора, имеющегося у центрального контрагента
8	Значение идентификатора имущества, внесенного в обеспечение	Указывается значение идентификатора имущества, внесенного в обеспечение, наименование которого указано в соответствии со строкой 7 настоящей таблицы

9	Значение внутреннего идентификатора имущества, внесенного в обеспечения	Указывается значение внутреннего идентификатора имущества, внесенного в обеспечение, который присвоен центральным контрагентом или организатором торговли (в случае если центральным контрагентом не присвоен внутренний идентификатор имущества, внесенного в обеспечение) во внутренних системах учета. Информация указывается в случае присвоения центральным контрагентом или организатором торговли внутреннего идентификатора имущества, внесенного в обеспечение
10	Код имущества, внесенного в обеспечение	Указывается один из следующих кодов имущества, внесенного в обеспечение: 1 - имущество, внесенное в обеспечение за счет участника клиринга; 2 - имущество, внесенное в обеспечение за счет сегрегированного клиента участника клиринга, за исключением клиента указанного участника клиринга в рамках доверительного управления (в случае если указанный участник клиринга осуществляет деятельность по доверительному управлению); 3 - имущество, внесенное в обеспечение за счет несегрегированного клиента участника клиринга; 4 - имущество, внесенное в обеспечение за счет клиента участника клиринга в рамках доверительного управления

11	Код, характеризующий возможность использования имущества, внесенного в обеспечение, для исполнения и (или) обеспечения исполнения обязательств, возникших из сделок, совершенных на различных торговых (биржевых) секциях, а также не на организованных торгах, клиринг которых осуществляет центральный контрагент	Указывается один из следующих кодов, характеризующих возможность использования имущества, внесенного в обеспечение, для исполнения и (или) обеспечения исполнения обязательств, возникших из сделок, совершенных на различных торговых (биржевых) секциях, а также не на организованных торгах, клиринг которых осуществляет центральный контрагент: 1 - имущество, внесенное в обеспечение, используется для исполнения и (или) обеспечения исполнения обязательств, возникших из сделок, совершенных на всех торговых (биржевых) секциях, а также не на организованных торгах, клиринг которых осуществляет центральный контрагент; 2 - имущество, внесенное в обеспечение, используется для исполнения и (или) обеспечения исполнения обязательств, возникших из сделок, совершенных на одной или нескольких (не всех) торговых (биржевых) секциях и (или) не на организованных торгах, клиринг, которых осуществляет центральный контрагент
12	Стоимость за единицу имущества, внесенного в обеспечение	Указывается определенная в порядке, установленном центральным контрагентом, стоимость за единицу имущества, внесенного в обеспечение, в единицах измерения
13	Величина (количество) имущества, внесенного в обеспечение	Указывается величина (количество) имущества, внесенного в обеспечение, в единицах измерения, соответствующих виду имущества, внесенного в обеспечение
14	Стоимость имущества, внесенного в обеспечение, в российских рублях	Указывается определенная в порядке, установленном центральным контрагентом, стоимость имущества, внесенного в обеспечение, в российских рублях

15	Код обеспечения	Указывается один из следующих кодов обеспечения: 1 - индивидуальное клиринговое обеспечение, за исключением индивидуального клирингового обеспечения, вносимого участником клиринга в целях снижения кредитного и рыночного рисков центрального контрагента при стрессовых изменениях конъюнктуры рынка и (или) управления риском концентрации и обеспечения необходимого уровня диверсификации активов, переданных участниками клиринга в качестве обеспечения; 2 - коллективное клиринговое обеспечение; 3 - индивидуальное клиринговое обеспечение, вносимое участником клиринга в целях снижения кредитного и рыночного рисков центрального контрагента при стрессовых изменениях конъюнктуры рынка; 4 - индивидуальное клиринговое обеспечение, вносимое участником клиринга в целях управления риском концентрации и обеспечения необходимого уровня диверсификации активов, переданных участниками клиринга или их клиентами в качестве обеспечения; 5 - иное

16	Код, характеризующий взаимосвязь эмитента и участника клиринга	В случае если имуществом, внесенным в обеспечение, являются ценные бумаги, указывается код, характеризующий взаимосвязь ценных бумаг и участника клиринга: 1 - участник клиринга является эмитентом ценных бумаг, внесенных им в обеспечение; 2 - участник клиринга не является эмитентом ценных бумаг, внесенных им в обеспечение; 3 - участник клиринга - кредитная организация является связанным лицом с эмитентом ценных бумаг, внесенных участником клиринга в обеспечение, в соответствии с частями второй и четвертой статьи 64.1 Федерального закона "О Центральном банке Российской Федерации (Банке России)" (Собрание законодательства Российской Федерации, 2002, N 28, ст. 2790; 2017, N 18, ст. 2669)
17	Торговый день	Указывается торговый день, по состоянию на конец которого центральный контрагент передает информацию, предусмотренную настоящей таблицей
18	Дата передачи информации	Указывается календарная дата передачи центральным контрагентом в Банк России информации, предусмотренной настоящей таблицей
19	Сведения о должностном лице	В случае если центральным контрагентом назначено должностное лицо, указываются фамилия, имя, отчество (последнее - при наличии) и номер телефона должностного лица

Таблица 4. Информация об имуществе, в том числе имуществе клиентов участника клиринга, внесенном участником клиринга в имущественный пул

Номер строки	Вид информации	Описание
1	2	3

1	Наименование идентификатора участника клиринга, внесшего имущество в имущественный пул, сформированный центральным контрагентом (далее - имущественный пул)	Указывается наименование одного из следующих идентификаторов участника клиринга, внесшего имущество в имущественный пул: ИНН - идентификационный номер налогоплательщика для участников клиринга - резидентов (кроме банков); TIN - регистрационный номер в стране регистрации (Tax Identification Number) для участников клиринга - нерезидентов; БИК - банковский идентификационный код для участников клиринга - резидентов, являющихся банками; ОГРН - основной государственный регистрационный номер (в случае отсутствия ИНН) для участников клиринга - резидентов (кроме банков); REG_NUM - регистрационный номер в стране регистрации (в случае отсутствия TIN) для участников клиринга - нерезидентов; LEI - идентификатор юридического лица (Legal Entity Identifier) (в случае отсутствия TIN и REG_NUM) для участников клиринга - нерезидентов. В случае отсутствия у участника клиринга указанных идентификаторов указывается наименование иного идентификатора, имеющегося у центрального контрагента
2	Значение идентификатора участника клиринга, внесшего имущество в имущественный пул	Указывается значение идентификатора участника клиринга, внесшего имущество в имущественный пул, наименование которого указано в соответствии со строкой 1 настоящей таблицы

3	Наименование идентификатора клиента участника клиринга, имущество которого внесено в имущественный пул	Указывается одно из следующих наименований идентификатора клиента участника клиринга, имущество которого внесено в имущественный пул, являющегося юридическим лицом: ИНН - идентификационный номер налогоплательщика для клиентов участника клиринга - резидентов (кроме банков); TIN - регистрационный номер в стране регистрации (Tax Identification Number) для клиентов участника клиринга - нерезидентов; БИК - банковский идентификационный код для клиентов участника клиринга - резидентов, являющихся банками; ОГРН - основной государственный регистрационный номер (в случае отсутствия ИНН) для клиентов участника клиринга - резидентов (кроме банков); REG_NUM - регистрационный номер в стране регистрации (в случае отсутствия TIN) для клиентов участника клиринга - нерезидентов; LEI - идентификатор юридического лица (Legal Entity Identifier) (в случае отсутствия TIN и REG_NUM) для клиентов участника клиринга - нерезидентов. В случае если в имущественный пул внесено имущество клиента участника клиринга, являющегося несегрегированным клиентом участника клиринга или клиентом участника клиринга в рамках доверительного управления, данная информация указывается при ее наличии у центрального контрагента. Информация не указывается, если в имущественный пул внесено имущество клиента участника клиринга, являющегося физическим лицом

4	Значение идентификатора клиента участника клиринга, имущество которого внесено в имущественный пул	В случае если в имущественный пул внесено имущество клиента участника клиринга, являющегося юридическим лицом, указывается значение идентификатора клиента участника клиринга, наименование которого указано в соответствии со строкой 6 настоящей таблицы. В случае если в имущественный пул внесено имущество несегрегированного клиента участника клиринга или клиента участника клиринга в рамках доверительного управления, данная информация указывается при ее наличии у центрального контрагента
5	Значение внутрисистемного идентификатора участника клиринга, внесшего имущество в имущественный пул	В случае если имущество участника клиринга внесено в имущественный пул, указывается значение внутрисистемного идентификатора участника клиринга, который присваивается центральным контрагентом во внутренних системах учета. В случае если центральный контрагент не присваивает внутрисистемный идентификатор участника клиринга, указывается уникальный код, присвоенный организатором торговли участнику клиринга, внесшему имущество в имущественный пул

6	Значение внутрисистемного идентификатора клиента участника клиринга, имущество которого внесено в имущественный пул	В случае если имущество клиента участника клиринга внесено в имущественный пул, указывается значение внутрисистемного идентификатора клиента участника клиринга, который присваивается центральным контрагентом во внутренних системах учета. В случае если центральный контрагент не присваивает внутрисистемный идентификатор клиента участника клиринга, указывается уникальный код, присвоенный организатором торговли клиенту участника клиринга, имущество которого внесено в имущественный пул. Информация о значении внутрисистемного идентификатора клиента участника клиринга, имущество которого внесено в имущественный пул, указывается в случае ее наличия у центрального контрагента
7	Индивидуальное обозначение имущественного пула	Указывается индивидуальное обозначение имущественного пула
8	Код имущества, внесенного в имущественный пул	Указывается один из следующих кодов имущества, внесенного в имущественный пул: 1 - ценная бумага; 2 - денежные средства; 3 - драгоценные металлы; 4 - иное. В случае если в имущественный пул внесено несколько видов имущества, указываются все коды имущества, внесенного в имущественный пул

9	Наименование идентификатора имущества, внесенного в имущественный пул	Указывается наименование одного из следующих идентификаторов имущества, внесенного в имущественный пул: ISIN - международный идентификационный код ценной бумаги (International Security Identification Number); GR - государственный регистрационный номер выпуска ценной бумаги (в случае отсутствия международного идентификационного кода ценной бумаги (ISIN); ОКВ - общероссийский классификатор валют (цифровой). В случае отсутствия указанных идентификаторов имущества, внесенного в имущественный пул, указывается наименование иного идентификатора, имеющегося у центрального контрагента
10	Значение идентификатора имущества, внесенного в имущественный пул	Указывается значение идентификатора имущества, внесенного в имущественный пул, наименование которого указано в соответствии со строкой 9 настоящей таблицы
И	Значение внутреннего идентификатора имущества, внесенного в имущественный пул	В случае присвоения центральным контрагентом во внутренних системах учета внутреннего идентификатора имущества, внесенного в имущественный пул, указывается значение внутреннего идентификатора
12	Количество имущества, внесенного в имущественный пул	Указывается количество имущества, внесенного в имущественный пул, в единицах измерения, примененных к данному имуществу
13	Единица измерения имущества	Указывается единица измерения имущества, внесенного в имущественный пул: 1 - штука; 2 - тонна; 3 - пункт; 4 - грамм; 5 - баррель. В случае отсутствия указанных единиц измерения указывается единица измерения, примененная для измерения имущества, внесенного в имущественный пул

14	Стоимость имущества, внесенного в имущественный пул	Указывается стоимость имущества, внесенного в имущественный пул, определенная в соответствии с порядком, установленным центральным контрагентом, в российских рублях
15	Номинальная стоимость выпущенных центральным контрагентом клиринговых сертификатов участия (далее - КСУ), сформированных из имущества, внесенного в имущественный пул	Указывается номинальная стоимость КСУ, сформированных из имущества, внесенного в имущественный пул, в российских рублях
16	Количество выпущенных центральным контрагентом КСУ, сформированных из имущества, внесенного в имущественный пул	Указывается количество выпущенных центральным контрагентом КСУ, сформированных из имущества, внесенного в имущественный пул, в штуках
17	Торговый день	Указывается торговый день, по состоянию на конец которого центральный контрагент передает информацию, предусмотренную настоящей таблицей
18	Дата передачи информации	Указывается календарная дата передачи центральным контрагентом в Банк России информации, предусмотренной настоящей таблицей
19	Сведения о должностном лице	В случае если центральным контрагентом назначено должностное лицо, указываются фамилия, имя, отчество (последнее - при наличии) и номер телефона должностного лица

Приложение 2
к Указанию Банка России

от 16 июля 2021 года N 5864-У
"О требованиях к формату,
порядку и каналам передачи
центральным контрагентом
информации в Банк России
и составу такой информации"

СОСТАВ
ИНФОРМАЦИИ ЦЕНТРАЛЬНОГО КОНТРАГЕНТА, ПОДЛЕЖАЩЕЙ ПЕРЕДАЧЕ В БАНК РОССИИ НА НЕРЕГУЛЯРНОЙ ОСНОВЕ

Таблица 1. Информация о предъявленных центральным контрагентом участникам клиринга требованиях о внесении обеспечения в дополнение к обеспечению, ранее внесенному участниками клиринга

Номер строки	Вид информации	Описание
1	2	3
1	Дата предъявления центральным контрагентом участнику клиринга требования о внесении обеспечения в дополнение к обеспечению, ранее внесенному участниками клиринга (далее - требование о внесении дополнительного обеспечения)	Указывается календарная дата предъявления центральным контрагентом участнику клиринга требования о внесении дополнительного обеспечения
2	Время предъявления центральным контрагентом требования о внесении дополнительного обеспечения	В случае предъявления центральным контрагентом участнику клиринга требования о внесении дополнительного обеспечения внутри торгового дня указывается время предъявления центральным контрагентом участнику клиринга требования о внесении дополнительного обеспечения

3	Наименование идентификатора участника клиринга, которому предъявлено требование о внесении дополнительного обеспечения	Указывается наименование одного из следующих идентификаторов участников клиринга, которому предъявлено требование о внесении дополнительного обеспечения: ИНН - идентификационный номер налогоплательщика для участников клиринга - резидентов (кроме банков); TIN - регистрационный номер в стране регистрации (Tax Identification Number) для участников клиринга - нерезидентов; БИК - банковский идентификационный код для участников клиринга - резидентов, являющихся банками; ОГРН - основной государственный регистрационный номер (в случае отсутствия ИНН) для участников клиринга - резидентов (кроме банков); REG_NUM - регистрационный номер в стране регистрации (в случае отсутствия TIN) для участников клиринга - нерезидентов; LEI - идентификатор юридического лица (Legal Entity Identifier) (в случае отсутствия TIN и REG_NUM) для участников клиринга - нерезидентов. В случае отсутствия у участника клиринга указанных идентификаторов указывается наименование иного идентификатора, имеющегося у центрального контрагента
4	Значение идентификатора участника клиринга, которому предъявлено требование о внесении дополнительного обеспечения	Указывается значение идентификатора участника клиринга, которому предъявлено требование о внесении дополнительного обеспечения, наименование которого указано в соответствии со строкой 3 настоящей таблицы

5	Значение внутрисистемного идентификатора участника клиринга, которому предъявлено требование о внесении дополнительного обеспечения	Указывается значение внутрисистемного идентификатора, который присваивается центральным контрагентом во внутренних системах учета участнику клиринга, которому предъявлено требование о внесении дополнительного обеспечения. В случае если центральный контрагент не присваивает внутрисистемный идентификатор участника клиринга, которому предъявлено требование о внесении дополнительного обеспечения, указывается уникальный код, присвоенный организатором торговли данному участнику клиринга
6	Величина требования о внесении дополнительного обеспечения	Указывается величина требования о внесении дополнительного обеспечения в российских рублях

7	Код требования о внесении дополнительного обеспечения	Указывается один из следующих кодов требования о внесении дополнительного обеспечения: 1 - требование о внесении индивидуального клирингового обеспечения, за исключением индивидуального клирингового обеспечения, вносимого участником клиринга по требованию центрального контрагента в целях снижения кредитного и рыночного рисков центрального контрагента при стрессовых изменениях конъюнктуры рынка и (или) управления риском концентрации и обеспечения необходимого уровня диверсификации активов, переданных участниками клиринга в качестве обеспечения; 2 - требование о внесении индивидуального клирингового обеспечения, вносимого участником клиринга по требованию центрального контрагента в целях снижениях кредитного и рыночного рисков центрального контрагента при стрессовых изменениях конъюнктуры рынка; 3 - требование о внесении индивидуального клирингового обеспечения, вносимого участником клиринга по требованию центрального контрагента в целях управления риском концентрации и обеспечения необходимого уровня диверсификации активов, переданных участниками клиринга или их клиентами в качестве обеспечения; 4 - требование о внесении коллективного клирингового обеспечения; 5 - иное требование о внесении обеспечения
8	Дата передачи информации	Указывается календарная дата передачи центральным контрагентом в Банк России информации, предусмотренной настоящей таблицей

9	Сведения о должностном лице	В случае если центральным контрагентом назначено должностное лицо, указываются фамилия, имя, отчество (последнее - при наличии) и номер телефона должностного лица

Таблица 2. Информация об активах, являющихся предметом сделок, совершаемых участниками клиринга с центральным контрагентом

Номер строки	Вид информации	Описание
1	2	3
1	Код актива, являющегося предметом совершаемой сделки	Указывается один из следующих кодов актива, являющегося предметом совершаемых сделок: 1 - ценная бумага; 2 - валюта; 3 - товар (за исключением драгоценных металлов); 4 - драгоценный металл; 5 - фьючерсный договор; 6 - опционный договор; 7 - иное

2	Наименование идентификатора актива, являющегося предметом совершаемой сделки	Указывается наименование одного из следующих идентификаторов актива, являющегося предметом совершаемых сделок: ISIN - международный идентификационный код ценной бумаги (International Security Identification Number); GR - государственный регистрационный номер выпуска ценной бумаги (в случае отсутствия международного идентификационного кода ценной бумаги (ISIN); UTI - уникальный код идентификации договора (Unique Trade Identifier); OKB - общероссийский классификатор валют (цифровой). В случае отсутствия указанных идентификаторов актива, являющегося предметом совершаемой сделки, указывается наименование иного идентификатора, имеющегося у центрального контрагента
3	Значение идентификатора актива, являющегося предметом совершаемой сделки	Указывается значение идентификатора актива, являющегося предметом совершаемой сделки, наименование которого указано в соответствии со строкой 2 настоящей таблицы
4	Наименование актива, являющегося предметом совершаемой сделки	Указывается наименование актива, являющегося предметом совершаемой сделки
5	Код актива, являющегося предметом совершаемой сделки	В случае присвоения организатором торговли во внутренних системах учета кода актива, являющегося предметом совершаемой сделки, указывается данный код

6	Наименование идентификатора базового (базисного) актива производного финансового инструмента	Указывается наименование одного из следующих идентификаторов базового (базисного) актива производного финансового инструмента, в случае если предметом совершаемых сделок является производный финансовый инструмент: ISIN - международный идентификационный код ценной бумаги (International Security Identification Number); GR - государственный регистрационный номер выпуска ценной бумаги (в случае отсутствия международного идентификационного кода ценной бумаги (ISIN); UTI - уникальный код идентификации договора (Unique Trade Identifier); OKB - общероссийский классификатор валют (цифровой). В случае отсутствия указанных идентификаторов базового (базисного) актива производного финансового инструмента указывается наименование иного идентификатора, имеющегося у центрального контрагента
7	Значение идентификатора базового (базисного) актива производного финансового инструмента	Указывается значение идентификатора базового (базисного) актива производного финансового инструмента, в случае если предметом совершаемых сделок является производный финансовый инструмент, наименование которого указано в соответствии со строкой 6 настоящей таблицы
8	Количество единиц базового (базисного) актива производного финансового инструмента	Указывается количество единиц базового (базисного) актива производного финансового инструмента, в случае если предметом совершаемой сделки является производный финансовый инструмент
9	Код валюты актива, являющегося предметом совершаемой сделки	Указывается код валюты актива, в которой оценивается актив, являющийся предметом совершаемой сделки, в соответствии с Общероссийским классификатором валют (OKB) (цифровой)

10	Код метода исполнения обязательств по совершаемой сделке, предметом которой является производный финансовый инструмент	Указывается код метода исполнения обязательств, в случае если предметом совершаемой сделки является производный финансовый инструмент: 1 - поставочный; 2 - расчетный
11	Наименование торговой (биржевой) секции, на которой совершается сделка	В случае если предметом совершаемой сделки является актив, который торгуется на организованных торгах, указывается наименование торговой (биржевой) секции, на которой торгуется указанный актив, определенное правилами клиринга (в случае определения наименования торговой (биржевой) секции правилами клиринга). В случае если предметом совершаемой сделки является актив, который не торгуется на организованных торгах, указывается код "ОТС"
12	Наименование эмитента актива, являющегося предметом совершаемой сделки	В случае если предметом совершаемой сделки являются ценные бумаги, указывается полное наименование эмитента ценных бумаг

13	Наименование идентификатора эмитента	В случае если предметом совершаемой сделки являются ценные бумаги, указывается наименование одного из следующих идентификаторов эмитента ценных бумаг: ИНН - идентификационный номер налогоплательщика для эмитентов - резидентов (кроме банков); TIN - регистрационный номер в стране регистрации (Tax Identification Number) для эмитентов - нерезидентов; БИК - банковский идентификационный код для эмитентов - резидентов, являющихся банками; ОГРН - основной государственный регистрационный номер (в случае отсутствия ИНН) для эмитентов - резидентов (кроме банков); REG_NUM - регистрационный номер в стране регистрации (в случае отсутствия TIN) для эмитентов - нерезидентов; LEI - идентификатор юридического лица (Legal Entity Identifier) (в случае отсутствия TIN и REG_NUM) для эмитентов - нерезидентов. В случае отсутствия у эмитента указанных идентификаторов указывается наименование иного идентификатора, имеющегося у центрального контрагента
14	Значение идентификатора эмитента актива, являющегося предметом совершаемой сделки	В случае если предметом совершаемой сделки являются ценные бумаги, указывается значение идентификатора эмитента ценных бумаг, наименование которого указано в соответствии со строкой 13 настоящей таблицы
15	Единица измерения актива, являющегося предметом совершаемой сделки	Указывается единица измерения актива, являющегося предметом совершаемой сделки, в соответствии с условиями сделки (за исключением актива, являющегося предметом совершаемой сделки, указанного в соответствии со строкой 8 настоящей таблицы)

16	Дата погашения	В случае если актив, являющийся предметом совершаемой сделки, или базовый (базисный) актив производного финансового инструмента имеет дату погашения, указывается календарная дата погашения указанного актива
17	Торговый день	Указывается торговый день, по состоянию за который центральный контрагент передает информацию, предусмотренную настоящей таблицей
18	Дата передачи информации	Указывается календарная дата передачи центральным контрагентом в Банк России информации, предусмотренной настоящей таблицей
19	Сведения о должностном лице	В случае если центральным контрагентом назначено должностное лицо, указываются фамилия, имя, отчество (последнее - при наличии) и номер телефона должностного лица

Таблица 3. Информация об осуществлении центральным контрагентом перевода долга и 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 информации	Описание
1	2	3
1	Дата перевода долга и уступки требования	Указывается календарная дата осуществления центральным контрагентом перевода долга и уступки требования одного участника клиринга другому участнику клиринга или другому центральному контрагенту

2	Наименование участника клиринга, перевод долга и уступка требования которого осуществлена центральным контрагентом	В случае если перевод долга и уступка требования участника клиринга осуществлена центральным контрагентом другому участнику клиринга или другому центральному контрагенту, указывается полное наименование участника клиринга, перевод долга и уступка требования которого осуществлена центральным контрагентом
3	Наименование идентификатора участника клиринга, перевод долга и уступка требования которого осуществлены центральным контрагентом	В случае если центральным контрагентом осуществлены перевод долга и уступка требования участника клиринга, указывается наименование одного из следующих идентификаторов участника клиринга: ИНН - идентификационный номер налогоплательщика для участников клиринга - резидентов (кроме банков); TIN - регистрационный номер в стране регистрации (Tax Identification Number) для участников клиринга - нерезидентов; БИК - банковский идентификационный код для участников клиринга - резидентов, являющихся банками; ОГРН - основной государственный регистрационный номер (в случае отсутствия ИНН) для участников клиринга - резидентов (кроме банков); REG_NUM - регистрационный номер в стране регистрации (в случае отсутствия TIN) для участников клиринга - нерезидентов; LEI - идентификатор юридического лица (Legal Entity Identifier) (в случае отсутствия TIN и REG_NUM) для участников клиринга - нерезидентов. В случае отсутствия у участника клиринга указанных идентификаторов указывается наименование иного идентификатора, имеющегося у центрального контрагента

4	Значение идентификатора участника клиринга, перевод долга и уступка требования которого осуществлены центральным контрагентом	В случае если центральным контрагентом осуществлены перевод долга и уступка требования участника клиринга, указывается значение идентификатора участника клиринга, наименование которого указано в соответствии со строкой 3 настоящей таблицы
5	Полное наименование участника клиринга или центрального контрагента, которому центральный контрагент осуществил перевод долга и уступку требования другого участника клиринга	В случае если центральный контрагент осуществил перевод долга и уступку требования участника клиринга другому участнику клиринга или другому центральному контрагенту, указывается полное наименование участника клиринга или центрального контрагента, которому центральный контрагент осуществил перевод долга и уступку требования другого участника клиринга

6	Наименование идентификатора участника клиринга или центрального контрагента, которому осуществлены перевод долга и уступка требования	В случае если центральный контрагент осуществил перевод долга и уступку требования участника клиринга другому участнику клиринга или другому центральному контрагенту, указывается наименование одного из следующих идентификаторов участника клиринга или центрального контрагента: ИНН - идентификационный номер налогоплательщика для участников клиринга - резидентов (кроме банков); TIN - регистрационный номер в стране регистрации (Tax Identification Number) для участников клиринга - нерезидентов; БИК - банковский идентификационный код для участников клиринга - резидентов, являющихся банками; ОГРН - основной государственный регистрационный номер (в случае отсутствия ИНН) для участников клиринга - резидентов (кроме банков); REG_NUM - регистрационный номер в стране регистрации (в случае отсутствия TIN) для участников клиринга - нерезидентов; LEI - идентификатор юридического лица (Legal Entity Identifier) (в случае отсутствия TIN и REG_NUM) для участников клиринга - нерезидентов. В случае отсутствия у участника клиринга или центрального контрагента указанных идентификаторов указывается наименование иного идентификатора, имеющегося у центрального контрагента
7	Значение идентификатора участника клиринга или центрального контрагента, которому осуществлены перевод долга и уступка требования	В случае если центральный контрагент осуществил перевод долга и уступку требования участника клиринга другому участнику клиринга или другому центральному контрагенту, указывается значение идентификатора участника клиринга или центрального контрагента, наименование которого указано в соответствии со строкой 6 настоящей таблицы

8	Величина обязательства, возникшего из договора, заключенного за счет сегрегированного клиента	В случае если перевод долга и уступка требования осуществлены центральным контрагентом по обязательству, возникшему из договора, заключенного за счет сегрегированного клиента, указывается величина указанного обязательства в российских рублях
9	Стоимость имущества сегрегированного клиента, переданного участником клиринга для обеспечения исполнения обязательства, по которому осуществлены перевод долга и уступка требования	Указывается стоимость имущества сегрегированного клиента, переданного участником клиринга для обеспечения исполнения обязательства, по которому осуществлены перевод долга и уступка требования в порядке, установленном центральным контрагентом. В случае когда имущество сегрегированного клиента, являющегося обеспечением исполнения обязательства, по которому осуществлены перевод долга и уступка требования участника клиринга, учитывается в совокупности по всем сделкам (портфелю сделок), совершенным участником клиринга за счет указанного клиента, отражается общая стоимость указанного имущества в российских рублях
10	Величина перевода долга и уступки требования участника клиринга по обязательству, возникшему из договора, заключенного за счет сегрегированного клиента	Указывается величина перевода долга и уступки требования участника клиринга, которые осуществлены центральным контрагентом по обязательству, возникшему из договора, заключенного за счет сегрегированного клиента, в российских рублях
11	Дата передачи информации	Указывается календарная дата передачи центральным контрагентом в Банк России информации, предусмотренной настоящей таблицей
12	Сведения о должностном лице	В случае если центральным контрагентом назначено должностное лицо, указываются фамилия, имя, отчество (последнее - при наличии) и номер телефона должностного лица

Таблица 4. Информация об участниках клиринга или о клиентах участников клиринга

Номер строки	Вид информации	Описание
1	2	3
1	Наименование участника клиринга	Указывается полное наименование участника клиринга
2	Наименование идентификатора участника клиринга	Указывается наименование одного из следующих идентификаторов участников клиринга: ИНН - идентификационный номер налогоплательщика для участников клиринга - резидентов (кроме банков); TIN - регистрационный номер в стране регистрации (Tax Identification Number) для участников клиринга - нерезидентов; БИК - банковский идентификационный код для участников клиринга - резидентов, являющихся банками; ОГРН - основной государственный регистрационный номер (в случае отсутствия ИНН) для участников клиринга - резидентов (кроме банков); REG_NUM - регистрационный номер в стране регистрации (в случае отсутствия TIN) для участников клиринга - нерезидентов; LEI - идентификатор юридического лица (Legal Entity Identifier) (в случае отсутствия TIN и REG_NUM) для участников клиринга - нерезидентов. В случае отсутствия у участника клиринга указанных идентификаторов указывается наименование иного идентификатора, имеющегося у центрального контрагента
3	Значение идентификатора участника клиринга	Указывается значение идентификатора участника клиринга, наименование которого указано в соответствии со строкой 2 настоящей таблицы

4	Страна регистрации участника клиринга	Указывается код страны, в которой зарегистрирован участник клиринга, в соответствии с Общероссийским классификатором стран мира (ОКСМ) (цифровой)
5	Группа (категория), к которой отнесен участник клиринга	В случае определения центральным контрагентом в правилах клиринга различных групп (категорий) участников клиринга в соответствии с частью 1 статьи 11 Федерального закона "О клиринге, клиринговой деятельности и центральном контрагенте" (Собрание законодательства Российской Федерации, 2011, N 7, ст. 904; 2020, N 31, ст. 5012) указывается группа (категория), к которой отнесен участник клиринга
6	Значение внутрисистемного идентификатора участника клиринга	Указывается значение внутрисистемного идентификатора участника клиринга, который присваивается центральным контрагентом во внутренних системах учета. Информация указывается в случае присвоения центральным контрагентом внутрисистемного идентификатора участника клиринга
7	Код участника клиринга	Указывается один из следующих кодов участника клиринга: 1 - кредитная организация; 2 - профессиональный участник рынка ценных бумаг, не являющийся кредитной организацией; 3 - страховая организация; 4 - иное юридическое лицо

8	Тип внутрисистемного идентификатора участника клиринга	Указывается один из следующих типов внутрисистемного идентификатора участника клиринга, который присваивается центральным контрагентом во внутренних системах учета для учета: 1 - собственные позиции участника клиринга; 2 - позиции сегрегированного клиента участника клиринга; 3 - позиции несегрегированного клиента участника клиринга; 4 - позиции клиента участника клиринга в рамках доверительного управления
9	Значение внутрисистемного идентификатора клиента участника клиринга	Указывается значение внутрисистемного идентификатора клиента участника клиринга, который присваивается центральным контрагентом во внутренних системах учета. В случае если центральный контрагент не присваивает внутрисистемный идентификатор клиента участника клиринга, указывается уникальный код, присвоенный организатором торговли. Информация о значении внутрисистемного идентификатора клиента участника клиринга указывается в случае ее наличия у центрального контрагента
10	Наименование клиента участника клиринга	Указывается полное наименование клиента участника клиринга, являющегося юридическим лицом. В случае если клиентом участника клиринга является физическое лицо, указывается внутрисистемный идентификатор клиента участника клиринга, указанный в соответствии со строкой 9 настоящей таблицы. В случае если клиентом участника клиринга является несегрегированный клиент или клиент в рамках доверительного управления, данная информация указывается при ее наличии у центрального контрагента

11	Наименование идентификатора клиента участника клиринга	Указывается наименование одного из следующих идентификаторов клиента участника клиринга, являющегося юридическим лицом: ИНН - идентификационный номер налогоплательщика для клиентов участника клиринга - резидентов (кроме банков); TIN - регистрационный номер в стране регистрации (Tax Identification Number) для клиентов участника клиринга - нерезидентов; БИК - банковский идентификационный код для клиентов участника клиринга - резидентов, являющихся банками; ОГРН - основной государственный регистрационный номер (в случае отсутствия ИНН) для клиентов участника клиринга - резидентов (кроме банков); REG_NUM - регистрационный номер в стране регистрации (в случае отсутствия TIN) для клиентов участника клиринга - нерезидентов; LEI - идентификатор юридического лица (Legal Entity Identifier) (в случае отсутствия TIN и REG_NUM) для клиентов участника клиринга - нерезидентов. В случае отсутствия у клиента участника клиринга указанных идентификаторов указывается наименование иного идентификатора, имеющегося у центрального контрагента. Информация указывается в случае ее наличия у центрального контрагента. Информация не указывается, если сделка совершена клиентом участника клиринга, являющимся физическим лицом

12	Значение идентификатора клиента участника клиринга	Указывается значение идентификатора клиента участника клиринга, являющегося юридическим лицом, наименование которого указано в соответствии со строкой 11 настоящей таблицы. В случае если клиентом участника клиринга является физическое лицо, указывается значение внутрисистемного идентификатора клиента участника клиринга, который присваивается центральным контрагентом во внутренних системах учета (в случае присвоения центральным контрагентом внутрисистемного идентификатора клиента участника клиринга). В случае если клиентом участника клиринга является несегрегированный клиент или клиент в рамках доверительного управления, данная информация указывается при ее наличии у центрального контрагента
13	Код клиента участника клиринга	Указывается один из следующих кодов клиента участника клиринга, за счет которого совершена сделка (в случае наличия данной информации у центрального контрагента): 1 - кредитная организация; 2 - профессиональный участник рынка ценных бумаг, не являющийся кредитной организацией; 3 - страховая организация; 4 - иное юридическое лицо; 5 - физическое лицо
14	Страна регистрации клиента участника клиринга	Указывается код страны, в которой зарегистрирован клиент участника клиринга, являющийся юридическим лицом, в соответствии с Общероссийским классификатором стран мира (ОКСМ) (цифровой)

15	Наименование торговой (биржевой) секции, к клирингу на которой допущен участник клиринга	В случае допуска участника клиринга к клирингу на торговой биржевой секции указывается наименование торговой (биржевой) секции (в случае определения наименования торговой (биржевой) секции правилами клиринга центрального контрагента). В случае если участник клиринга допущен к клирингу не на организованных торгах, указывается код "ОТС". В случае допуска участника клиринга к клирингу одновременно на торговой биржевой секции (торговых биржевых секциях) и не на организованных торгах указывается код "ОТ/ОТС"
16	Торговый день	Указывается торговый день, по состоянию на конец которого центральный контрагент передает информацию, предусмотренную настоящей таблицей
17	Дата передачи информации	Указывается календарная дата передачи центральным контрагентом в Банк России информации, предусмотренной настоящей таблицей
18	Сведения о должностном лице	В случае если центральным контрагентом назначено должностное лицо, указываются фамилия, имя, отчество (последнее - при наличии) и номер телефона должностного лица

Таблица 5. Информация об обязательствах участников клиринга перед центральным контрагентом, которые были исполнены в течение торгового дня в соответствии с частью 8 статьи 18 Федерального закона "О клиринге, клиринговой деятельности и центральном контрагенте", и о величине активов, подлежащих возврату участникам клиринга

Номер строки	Вид информации	Описание
1	2	3

1	Наименование идентификатора участника клиринга, обязательства которого перед центральным контрагентом были исполнены посредством ликвидационного неттинга	В случае если обязательства участника клиринга перед центральным контрагентом были исполнены посредством ликвидационного неттинга, указывается наименование одного из следующих идентификаторов участника клиринга: ИНН - идентификационный номер налогоплательщика для участников клиринга - резидентов (кроме банков); TIN - регистрационный номер в стране регистрации (Tax Identification Number) для участников клиринга - нерезидентов; БИК - банковский идентификационный код для участников клиринга - резидентов, являющихся банками; ОГРН - основной государственный регистрационный номер (в случае отсутствия ИНН) для участников клиринга - резидентов (кроме банков); REG_NUM - регистрационный номер в стране регистрации (в случае отсутствия TIN) для участников клиринга - нерезидентов; LEI - идентификатор юридического лица (Legal Entity Identifier) (в случае отсутствия TIN и REG_NUM) для участников клиринга - нерезидентов. В случае отсутствия у участника клиринга указанных идентификаторов указывается наименование иного идентификатора, имеющегося у центрального контрагента
2	Значение идентификатора участника клиринга, обязательства которого перед центральным контрагентом были исполнены посредством ликвидационного неттинга	Указывается значение идентификатора участника клиринга, обязательства которого перед центральным контрагентом были исполнены посредством ликвидационного неттинга, наименование которого указано в соответствии со строкой 1 настоящей таблицы

3	Значение внутрисистемного идентификатора участника клиринга, обязательства которого перед центральным контрагентом были исполнены посредством ликвидационного неттинга	Указывается значение внутрисистемного идентификатора участника клиринга, обязательства которого перед центральным контрагентом были исполнены посредством ликвидационного неттинга, который присваивается центральным контрагентом во внутренних системах учета
4	Дата исполнения обязательств участника клиринга перед центральным контрагентом посредством ликвидационного неттинга	Указывается календарная дата исполнения обязательств участника клиринга перед центральным контрагентом посредством ликвидационного неттинга
5	Наименование идентификатора актива, являющегося предметом совершенных сделок, по которым определено нетто-обязательство	Указывается наименование одного из следующих идентификаторов актива, являющегося предметом совершенных сделок, по которым определено нетто-обязательство: ISIN - международный идентификационный код ценной бумаги (International Security Identification Number); GR - государственный регистрационный номер выпуска ценной бумаги (в случае отсутствия международного идентификационного кода ценной бумаги (ISIN); OKB - общероссийский классификатор валют. В случае отсутствия указанных идентификаторов актива, являющегося предметом совершенной сделки, по которой определено нетто-обязательство, указывается наименование иного идентификатора, имеющегося у центрального контрагента
6	Значение идентификатора актива, являющегося предметом совершенных сделок, по которым определено нетто-обязательство	Указывается значение идентификатора актива, являющегося предметом совершенных сделок, по которым определено нетто-обязательство, наименование которого указано в соответствии со строкой 5 настоящей таблицы

7	Величина нетто-обязательства	Указывается значение величины нетто-обязательства, определенного в связи с прекращением обязательств участника клиринга перед центральным контрагентом посредством ликвидационного неттинга, в российских рублях
8	Размер средств, подлежащих возврату участнику клиринга в связи с исполнением обязательств участника клиринга перед центральным контрагентом посредством ликвидационного неттинга	Указывается размер средств, подлежащих возврату участнику клиринга в связи с исполнением обязательств участника клиринга перед центральным контрагентом посредством ликвидационного неттинга, в российских рублях
9	Наименование идентификатора актива, подлежащего возврату участнику клиринга в связи с исполнением обязательств участника клиринга перед центральным контрагентом посредством ликвидационного неттинга	Указывается наименование одного из следующих идентификаторов актива, подлежащего возврату участнику клиринга в связи с исполнением обязательств участника клиринга перед центральным контрагентом посредством ликвидационного неттинга: ISIN - международный идентификационный код ценной бумаги (International Security Identification Number); GR - государственный регистрационный номер выпуска ценной (в случае отсутствия международного идентификационного кода ценной бумаги (ISIN); OKB - общероссийский классификатор валют. В случае отсутствия указанных идентификаторов актива, подлежащего возврату участнику клиринга в связи с исполнением обязательств участника клиринга перед центральным контрагентом посредством ликвидационного неттинга, указывается наименование иного идентификатора, имеющегося у центрального контрагента

10	Значение идентификатора актива, подлежащего возврату участнику клиринга в связи с исполнением обязательств участника клиринга перед центральным контрагентом посредством ликвидационного неттинга	Указывается значение идентификатора актива, подлежащего возврату участнику клиринга в связи с исполнением обязательств участника клиринга перед центральным контрагентом посредством ликвидационного неттинга, наименование которого указано в соответствии со строкой 9 настоящей таблицы
11	Наименование торговой (биржевой) секции и режим торгов, на которых были совершены сделки участника клиринга, обязательства по которым были исполненены посредством ликвидационного неттинга	В случае если сделки, обязательства по которым были исполнены посредством ликвидационного неттинга, совершались на организованных торгах, указываются наименование торговой (биржевой) секции, на которой совершены указанные сделки, и режим торгов (в случае если на торговой (биржевой) секции предусмотрено несколько режимов торгов), определенные правилами клиринга (в случае определения наименования торговой (биржевой) секции и режима торгов правилами клиринга). В случае если сделки, обязательства по которым исполнены посредством ликвидационного неттинга, совершались не на организованных торгах, указывается код "ОТС"
12	Дата передачи информации	Указывается календарная дата передачи центральным контрагентом в Банк России информации, предусмотренной настоящей таблицей
13	Сведения о должностном лице	В случае если центральным контрагентом назначено должностное лицо, указываются фамилия, имя, отчество (последнее - при наличии) и номер телефона должностного лица

Таблица 6. Информация о неисполнении участниками клиринга обязательств перед центральным контрагентом, за исключением обязательств, которые исполнены в соответствии с частью 8 статьи 18 Федерального закона "О клиринге, клиринговой деятельности и центральном контрагенте"

Номер строки	Вид информации	Описание
1	2	3
1	Наименование идентификатора участника клиринга, не исполнившего обязательства перед центральным контрагентом, за исключением обязательств, которые исполнены посредством ликвидационного неттинга (далее - обязательства)	Указывается наименование одного из следующих идентификаторов участника клиринга, не исполнившего обязательства: ИНН - идентификационный номер налогоплательщика для участников клиринга - резидентов (кроме банков); TIN - регистрационный номер в стране регистрации (Tax Identification Number) для участников клиринга - нерезидентов; БИК - банковский идентификационный код для участников клиринга - резидентов, являющихся банками; ОГРН - основной государственный регистрационный номер (в случае отсутствия ИНН) для участников клиринга - резидентов (кроме банков); REG_NUM - регистрационный номер в стране регистрации (в случае отсутствия TIN) для участников клиринга - нерезидентов; LEI - идентификатор юридического лица (Legal Entity Identifier) (в случае отсутствия TIN и REG_NUM) для участников клиринга - нерезидентов. В случае отсутствия у участника клиринга, не исполнившего обязательства, указанных идентификаторов указывается наименование иного идентификатора, имеющегося у центрального контрагента
2	Значение идентификатора участника клиринга, не исполнившего обязательства	Указывается значение идентификатора участника клиринга, не исполнившего обязательства, наименование которого указано в соответствии со строкой 1 настоящей таблицы
3	Дата неисполнения участником клиринга обязательства	Указывается календарная дата, на которую участник клиринга был обязан исполнить обязательство, но не исполнил

4	Наименование идентификатора актива, являющегося предметом совершенной сделки, из которой возникло обязательство	Указывается наименование одного из следующих идентификаторов актива, являющегося предметом совершенной сделки, из которой возникло обязательство: ISIN - международный идентификационный код ценной бумаги (International Security Identification Number); GR - государственный регистрационный номер выпуска ценной бумаги (в случае отсутствия международного идентификационного кода ценной бумаги (ISIN); UTI - уникальный код идентификации договора (Unique Trade Identifier); OKB - общероссийский классификатор валют (цифровой). В случае отсутствия указанных идентификаторов актива, являющегося предметом совершенной сделки, из которой возникло обязательство, указывается наименование иного идентификатора, имеющегося у центрального контрагента
5	Значение идентификатора актива, являющегося предметом совершенной сделки, из которой возникло обязательство	Указывается значение идентификатора актива, являющегося предметом совершенной сделки, из которой возникло обязательство, наименование которого указано в соответствии со строкой 4 настоящей таблицы
6	Значение внутреннего идентификатора актива, являющегося предметом совершенной сделки, из которой возникло обязательство	В случае присвоения организатором торговли во внутренних системах учета внутреннего идентификатора актива, являющегося предметом совершенной сделки, из которой возникло обязательство, указывается значение внутреннего идентификатора
7	Величина обязательства	Указывается величина обязательства в российских рублях

8	Наименование торговой (биржевой) секции, на которой была совершена сделка, из которой возникло обязательство	В случае совершения сделки, из которой возникло обязательство, на организованных торгах указывается наименование торговой (биржевой) секции, на которой была совершена указанная сделка, определенное правилами клиринга (в случае определения наименования торговой (биржевой) секции правилами клиринга). В случае совершения сделки, из которой возникло обязательство, не на организованных торгах указывается код "ОТС". В случае совершения сделки, из которой возникло обязательство, на организованных торгах и не на организованных торгах указывается код "ОТ/ОТС"
9	Код действий, совершенных центральным контрагентом для урегулирования обязательств участника клиринга в соответствии с правилами клиринга	Указывается код действий, совершенных центральным контрагентом для урегулирования обязательств участника клиринга в соответствии с правилами клиринга: 1 - принудительное закрытие позиции; 2 - перенос позиции; 3 - иное
10	Финансовый результат, полученный центральным контрагентом в результате урегулирования им обязательств участника клиринга в соответствии с правилами клиринга	Указывается финансовый результат, полученный центральным контрагентом в результате урегулирования им обязательств участника клиринга в соответствии с правилами клиринга, в российских рублях
11	Торговый день	Указывается торговый день, по состоянию на конец которого центральный контрагент передает информацию, предусмотренную настоящей таблицей
12	Дата передачи информации	Указывается календарная дата передачи центральным контрагентом в Банк России информации, предусмотренной настоящей таблицей
13	Сведения о должностном лице	В случае если центральным контрагентом назначено должностное лицо, указываются фамилия, имя, отчество (последнее - при наличии) и номер телефона должностного лица

Таблица 7. Информация о не исполненных в течение торгового дня центральным контрагентом обязательствах перед участниками клиринга

Номер строки	Вид сведений	Описание
1	2	3
1	Наименование идентификатора участника клиринга, обязательства перед которым не исполнены центральным контрагентом в течение торгового дня	В случае если центральный контрагент не исполнил обязательства перед участником клиринга в течение торгового дня, указывается наименование одного из следующих идентификаторов указанного участника клиринга: ИНН - идентификационный номер налогоплательщика для участников клиринга - резидентов (кроме банков); TIN - регистрационный номер в стране регистрации (Tax Identification Number) для участников клиринга - нерезидентов; БИК - банковский идентификационный код для участников клиринга - резидентов, являющихся банками; ОГРН - основной государственный регистрационный номер (в случае отсутствия ИНН) для участников клиринга - резидентов (кроме банков); REG_NUM - регистрационный номер в стране регистрации (в случае отсутствия TIN) для участников клиринга - нерезидентов; LEI - идентификатор юридического лица (Legal Entity Identifier) (в случае отсутствия TIN и REG_NUM) для участников клиринга - нерезидентов. В случае отсутствия у участника клиринга, обязательства перед которым не исполнены центральным контрагентом в течение торгового дня, указанных идентификаторов указывается наименование иного идентификатора, имеющегося у центрального контрагента

2	Значение идентификатора участника клиринга, обязательства перед которым не исполнены центральным контрагентом в течение торгового дня	В случае если обязательства перед участником клиринга не исполнены центральным контрагентом в течение торгового дня, указывается значение идентификатора участника клиринга, наименование которого указано в соответствии со строкой 1 настоящей таблицы
3	Дата неисполнения центральным контрагентом обязательств перед участником клиринга	Указывается календарная дата, на которую центральный контрагент был обязан исполнить обязательства перед участником клиринга, но не исполнил
4	Наименование идентификатора актива, являющегося предметом сделки, обязательства по которой не были исполнены центральным контрагентом перед участником клиринга в течение торгового дня	Указывается наименование одного из следующих идентификаторов актива, являющегося предметом сделки, обязательства по которой не были исполнены центральным контрагентом перед участником клиринга в течение торгового дня: ISIN - международный идентификационный код ценной бумаги (International Security Identification Number); GR - государственный регистрационный номер выпуска ценной бумаги (при отсутствии международного идентификационного кода ценной бумаги (ISIN); UTI - уникальный код идентификации договора (Unique Trade Identifier); ОКВ - общероссийский классификатор валют (цифровой). В случае отсутствия указанных идентификаторов актива, являющегося предметом сделки, обязательства по которой не были исполнены центральным контрагентом перед участником клиринга в течение торгового дня, указывается наименование иного идентификатора, имеющегося у центрального контрагента

5	Значение идентификатора актива, являющегося предметом сделки, обязательства по которой не были исполнены центральным контрагентом перед участником клиринга в течение торгового дня	Указывается значение идентификатора актива, являющегося предметом сделки, обязательства по которой не были исполнены центральным контрагентом перед участником клиринга в течение торгового дня, наименование которого указано в соответствии со строкой 4 настоящей таблицы
6	Значение внутреннего идентификатора актива, являющегося предметом сделки, обязательства по которой не были исполнены центральным контрагентом перед участником клиринга в течение торгового дня	В случае присвоения организатором торговли во внутренних системах учета внутреннего идентификатора актива, являющегося предметом сделки, обязательства по которой не были исполнены центральным контрагентом перед участником клиринга в течение торгового дня, указывается значение внутреннего идентификатора
7	Номер сделки, обязательства по которой не были исполнены центральным контрагентом	Указывается номер сделки, обязательства по которой не были исполнены центральным контрагентом, в случае если нетто-обязательство определяется по одной сделке (при наличии у центрального контрагента данной информации)
8	Величина обязательств, не исполненных центральным контрагентом перед участником клиринга в течение торгового дня	Указывается величина обязательств, не исполненных центральным контрагентом перед участником клиринга в течение торгового дня, в российских рублях
9	Величина обязательств, не исполненных центральным контрагентом перед участником клиринга в течение торгового дня, в разрезе активов	Указывается величина обязательств, не исполненных центральным контрагентом перед участником клиринга в течение торгового дня, которая раскрывается в разрезе активов, являющихся предметом совершенных сделок (в штуках или иных единицах измерения, применяемых для определения величины актива)

10	Наименование торговой (биржевой) секции, на которой была совершена сделка, обязательства по которой не были исполнены центральным контрагентом перед участником клиринга в течение торгового дня	В случае совершения сделки, обязательства по которой не были исполнены центральным контрагентом перед участником клиринга в течение торгового дня, на организованных торгах указывается наименование торговой (биржевой) секции, на которой совершена указанная сделка, определенное правилами клиринга (в случае определения наименования торговой (биржевой) секции правилами клиринга). В случае совершения сделки, обязательства по которой не были исполнены центральным контрагентом перед участником клиринга в течение торгового дня, не на организованных торгах указывается код "ОТС"
11	Причина неисполнения центральным контрагентом обязательств перед участником клиринга в течение торгового дня	Указывается причина неисполнения центральным контрагентом обязательств перед участником клиринга в течение торгового дня
12	Порядок прекращения центральным контрагентом обязательств, не исполненных перед участником клиринга в течение торгового дня	Указывается порядок прекращения центральным контрагентом обязательств, не исполненных перед участником клиринга в течение торгового дня, в соответствии с правилами клиринга. В случае если обязательства прекращены в связи с совершением новой сделки, указывается номер данной сделки участника клиринга, присвоенный центральным контрагентом (в случае присвоения номера сделки центральным контрагентом)
13	Дата передачи информации	Указывается календарная дата передачи центральным контрагентом в Банк России информации, предусмотренной настоящей таблицей
14	Информация о должностном лице	В случае если центральным контрагентом назначено должностное лицо, указываются фамилия, имя, отчество (последнее - при наличии) и номер телефона должностного лица

Таблица 8. Информация о нестандартных и чрезвычайных ситуациях, которые нарушают нормальное осуществление деятельности центрального контрагента, причинах и последствиях их возникновения и времени восстановления работоспособности программно-технических средств и сетевых коммуникаций

Номер строки	Вид информации	Описание
1	2	3
1	Дата и время возникновения НЧС	Указываются календарная дата и время возникновения НЧС
2	Описание НЧС	Указывается краткое описание НЧС, в том числе причины их возникновения
3	Принятые центральным контрагентом меры для устранения НЧС	Указывается перечень принятых центральным контрагентом мер для устранения НЧС
4	Последствия возникновения НЧС	Указываются последствия возникновения НЧС для центрального контрагента
5	Время восстановления работоспособности программно-технических средств и сетевых коммуникаций	Указывается количество фактического времени восстановления работоспособности программно-технических средств и сетевых коммуникаций центрального контрагента
6	Дата передачи информации	Указывается календарная дата передачи центральным контрагентом в Банк России информации, предусмотренной настоящей таблицей
7	Сведения о должностном лице	В случае если центральным контрагентом назначено должностное лицо, указываются фамилия, имя, отчество (последнее - при наличии) и номер телефона должностного лица

Версия #1
Журнал АО создал 16 июля 2021 19:34:00
Журнал АО обновил 26 февраля 2024 15:26:21