

Приложение 1

УТВЕРЖДЕНЫ
приказом НКО НКЦ (АО)
от «26» августа 2020 года
№ 01-01/143

**ФОРМЫ И ФОРМАТЫ ДОКУМЕНТОВ И ОТЧЕТОВ
НА РЫНКЕ СТАНДАРТИЗИРОВАННЫХ ПФИ.
ЧАСТЬ VI.**

г. Москва
2020 г.

СОДЕРЖАНИЕ

1. Общие положения	3
2. Формы документов в бумажном виде или в виде документа ЭДО, предоставляемых Участниками клиринга	4
2.1. Заявление на открытие регистра учета позиций	4
2.2. Заявление на регистрацию регистра учета позиций	5
2.3. Заявление на аннулирование/ изменение регистрации регистра учета позиций	6
2.4. Заявление на закрытие регистра учета позиций.....	7
2.5. Заявление об изменении условий Договора СПФИ.....	8
2.6. Заявление о досрочном прекращении Договора СПФИ.....	9
2.7. Заявление об изменении учёта обязательств по Договорам СПФИ.....	10
2.8. Требование об исполнении Опционного договора	11
2.9. Письмо об ознакомлении с Декларацией.....	12
3. Формы и форматы отчетов, предоставляемых Участникам клиринга Клиринговым центром	13
3.1. Клиринговый отчет.....	14

1. Общие положения

- 1.1. Настоящий документ «Формы и форматы документов и отчетов на рынке Стандартизированных ПФИ. Часть VI» совместно с «Формами и форматами документов и отчетов. Часть I. Общая часть» описывают формы и форматы документов и отчетов, предоставляемых Участниками клиринга в адрес НКО НКЦ (АО) (далее – Клиринговый центр), а также Клиринговым центром в адрес указанных лиц в соответствии с Правилами клиринга Небанковской кредитной организации-центрального контрагента «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество) утвержденными уполномоченным органом Клирингового центра и зарегистрированными Банком России, с учетом требований законодательства Российской Федерации (далее – Правила клиринга).

2. Формы документов в бумажном виде или в виде документа ЭДО, предоставляемых Участниками клиринга

2.1. Заявление на открытие регистра учета позиций

В НКО НКЦ (АО)

ЗАЯВЛЕНИЕ НА ОТКРЫТИЕ РЕГИСТРА УЧЕТА ПОЗИЦИЙ

(полное наименование Участника клиринга)

Идентификатор Участника клиринга: _____

В соответствии с Правилами клиринга Небанковской кредитной организации-центрального контрагента «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество) просим открыть следующие регистры учета позиций:

Тип регистра учета позиций*	Код регистра учета позиций	Расчетный код**

Идентификатор Участника торгов***	Наименование Участника торгов***

(Должность руководителя) _____ / Ф.И.О. /

М.П.

« ____ » _____ 20 ____ год.

Исполнитель Ф.И.О., телефон _____

* Поле «Тип регистра учета позиций» может принимать одно из следующих значений:

- дополнительный собственный регистр учета позиций;
- клиентский регистр учета позиций;
- регистр учета позиций ДУ.

** Тип Расчетного кода, ранее открытый Участнику клиринга, должен совпадать с типом регистра учета позиций. Одному Расчетному коду могут соответствовать несколько регистров учета позиций.

*** Указанная информация заполняется в случае необходимости открытия регистров учета позиций и определения Участника торгов, имеющего право подавать заявки от имени Участника клиринга с указанием такого регистра учета позиций. В дополнение к данному заявлению должно быть также подано Заявление на регистрацию регистра, учета позиций, форма которого определена в п.2.3 Форм и форматов.

2.2. Заявление на регистрацию регистра учета позиций

В НКО НКЦ (АО)

ЗАЯВЛЕНИЕ НА РЕГИСТРАЦИЮ РЕГИСТРА УЧЕТА ПОЗИЦИЙ

(полное наименование Участника клиринга)

Идентификатор Участника клиринга: _____

В соответствии с Правилами клиринга Небанковской кредитной организации-центрального контрагента «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество) просим открыть регистры учета позиций для Участника(ов) торгов, который(е) вправе подавать Заявки на заключение Договоров СПФИ с указанием такого(их) регистра(ов) учета позиций:

Тип регистра учета позиций*	Код регистра учета позиций	Расчетный код*	Идентификатор Участника торгов	Наименование Участника торгов

(Должность руководителя) _____ / Ф.И.О. /

М.П.

« ____ » _____ 20 ____ год.

Исполнитель Ф.И.О., телефон _____

* Поля «Тип регистра учета позиций» и «Расчетный код» не являются обязательными для заполнения в случае, если регистр учета позиций был ранее зарегистрирован на основании Заявления на открытие регистра учета позиций.

Поле «Тип регистра учета позиций» может принимать одно из следующих значений:

- клиентский регистр учета позиций;
- регистр учета позиций ДУ.

Тип Расчетного кода, ранее открытый Участнику клиринга, должен совпадать с типом регистра учета позиций.

2.3. Заявление на аннулирование/ изменение регистрации регистра учета позиций

В НКО НКЦ (АО)

**ЗАЯВЛЕНИЕ НА АННУЛИРОВАНИЕ/ ИЗМЕНЕНИЕ РЕГИСТРАЦИИ
РЕГИСТРА УЧЕТА ПОЗИЦИЙ**

(полное наименование Участника клиринга)

Идентификатор Участника клиринга: _____

В соответствии с Правилами клиринга Небанковской кредитной организации-центрального контрагента «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество) просим:

- ☐ аннулировать соответствие между регистром учета позиций и Участником торгов, который вправе подавать Заявки на заключение Договоров СПФИ с указанием такого регистра учета позиций;
- ☐ изменить Участника торгов, который вправе подавать Заявки на заключение Договоров СПФИ с указанным регистром учета позиций, на:

Код регистра учета позиций	Идентификатор Участника торгов	Наименование Участника торгов

(Должность руководителя)

_____/ Ф.И.О. /

М.П.

« ____ » _____ 20 ____ год.

Исполнитель Ф.И.О., телефон _____

2.4. Заявление на закрытие регистра учета позиций

В НКО НКЦ (АО)

ЗАЯВЛЕНИЕ НА ЗАКРЫТИЕ РЕГИСТРА УЧЕТА ПОЗИЦИЙ

(полное наименование Участника клиринга)

Идентификатор Участника клиринга: _____

В соответствии с Правилами клиринга Небанковской кредитной организации-центрального контрагента «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество) просим закрыть* следующие регистры учета позиций:

Код регистра учета позиций

(Должность руководителя)

_____/Ф.И.О. /

М.П.

« ____ » _____ 20 ____ год.

Исполнитель Ф.И.О., телефон _____

* Закрытие регистра учета позиций осуществляется при условии отсутствия у Участника клиринга Договоров СПФИ, сделок своп и сделок купли-продажи с иностранной валютой, учитываемых по такому регистру учета позиций.

2.5. Заявление об изменении условий Договора СПФИ

В НКО НКЦ (АО)

ЗАЯВЛЕНИЕ ОБ ИЗМЕНЕНИИ УСЛОВИЙ ДОГОВОРА СПФИ

(полное наименование Участника клиринга)

Идентификатор Участника клиринга: _____

В соответствии с Правилами клиринга Небанковской кредитной организации-центрального контрагента «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество) просим изменить следующие условия Договора ПФИ:

Идентификационный номер Договора СПФИ		
Условие Договора СПФИ, подлежащее изменению		
Старое значение Условия Договора СПФИ		
Новое значение Условия Договора СПФИ		
Платёж при изменении условий Договора	Валюта	
	Сумма	

(Должность руководителя) _____ / Ф.И.О. /

М.П.

« ____ » _____ 20 ____ год.

Исполнитель Ф.И.О., телефон _____

2.6. Заявление о досрочном прекращении Договора СПФИ

В НКО НКЦ (АО)

ЗАЯВЛЕНИЕ О ДОСРОЧНОМ ПРЕКРАЩЕНИИ ДОГОВОРА СПФИ

(полное наименование Участника клиринга)

Идентификатор Участника клиринга: _____

В соответствии с Правилами клиринга Небанковской кредитной организации-центрального контрагента «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество) просим досрочно прекратить следующие Договора ПФИ:

Идентификационный номер Договора СПФИ	Сумма компенсации, наименование валюты

(Должность руководителя) _____ / Ф.И.О. /

М.П.

« ____ » _____ 20 ____ год.

Исполнитель Ф.И.О., телефон _____

2.7. Заявление об изменении учёта обязательств по Договорам СПФИ

В НКО НКЦ (АО)

**ЗАЯВЛЕНИЕ ОБ ИЗМЕНЕНИИ УЧЕТА ОБЯЗАТЕЛЬСТВ
ПО ДОГОВОРАМ СПФИ**

(полное наименование Участника клиринга)

Идентификатор Участника клиринга: _____

В соответствии с Правилами клиринга Небанковской кредитной организации-центрального контрагента «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество) просим изменить учет обязательств по Договорам СПФИ и начать учитывать указанные обязательства на регистрах учета позиций в соответствии с нижеприведенной таблицей:

Идентификационный номер Договора СПФИ	Код регистра учёта позиций

(Должность руководителя) _____ / Ф.И.О. /

М.П.

« ____ » _____ 20 ____ год.

Исполнитель Ф.И.О., телефон _____

2.8. Требование об исполнении Опционного договора

В НКО НКЦ (АО)

ТРЕБОВАНИЕ ОБ ИСПОЛНЕНИИ ОПЦИОННОГО ДОГОВОРА

(полное наименование Участника клиринга)

Идентификатор Участника клиринга: _____

В соответствии с Правилами клиринга Небанковской кредитной организации-центрального контрагента «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество) для осуществления права на исполнение Опционного договора направляем Требование об исполнении всех Опционных договоров, имеющих одно время закрытия, обязательства по которым учитываются на регистрах учета позиций, соответствующих Расчетному коду _____.

(Должность руководителя)

М.П.

_____/Ф.И.О./

« ____ » _____ 20__ год.

Исполнитель Ф.И.О., телефон _____

2.9. Письмо об ознакомлении с Декларацией

В НКО НКЦ (АО)

ПИСЬМО ОБ ОЗНАКОМЛЕНИИ С ДЕКЛАРАЦИЕЙ

(полное наименование Участника клиринга)

Идентификатор Участника клиринга: _____

В соответствии с Правилами клиринга Небанковской кредитной организации-центрального контрагента «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество) подтверждаем факт своего ознакомления с ранее подписанной Декларацией о рисках, возникающих в связи с заключением договоров, являющихся производными финансовыми инструментами, с центральным контрагентом на внебиржевом рынке.

(Должность руководителя) _____ /Ф.И.О./

М.П.

« ____ » _____ 20 ____ год.

Исполнитель Ф.И.О., телефон _____

3. Формы и форматы отчетов, предоставляемых Участникам клиринга Клиринговым центром

Отчетные документы формируются в Клиринговой системе в соответствии с Правилами клиринга и направляются Участникам клиринга в форме электронных документов.

Данные электронные документы являются документами, сформированными в соответствии с требованиями языка XML версии 1.0, а также в соответствии со стандартами XML версии FpML 5.6.

Полная спецификация языка XML версии 1.0 приводится в документе Extensible Markup Language (XML) 1.0 (Second Edition), разработанном W3C и опубликованном в сети Интернет по адресу <http://www.w3.org/TR/REC-xml>.

Описание версии FpML 5.6 опубликовано в сети Интернет по адресу <http://www.fpml.org/spec/fpml-5-6-8-rec-3/>.

Каждый электронный документ содержит заголовок в виде текстовых строк и содержательную часть, представляющую собой строки с данными.

Каждая строка с данными представляет собой последовательность полей, разделенных символом табуляции (шестнадцатеричный код 09). Строки должны заканчиваться сочетанием символов «возврат каретки - перевод строки» (шестнадцатеричные коды 0D,0A).

Отчетный документ в формате XML может быть преобразован в любой удобный получателю формат (в том числе, формат TXT с разделителями) путем обработки собственными программными средствами бэк-офиса и/или стандартными программными средствами (MS Excel).

Отчетный документ в формате XML, включая версию FpML 5.6, может быть преобразован в печатную форму путем открытия в Microsoft Internet Explorer.

Формы документов, преобразованных для вывода на печать (на бумажном носителе), приведены в качестве примеров для отчетных документов в формате XML.

3.1. Клиринговый отчет

Описание xml-файла Клирингового отчета указывается в XSD-схеме, размещаемой на сайте Клирингового центра по адресу <https://www.nationalclearingcentre.ru/catalog/021005>.

Печатная форма Клирингового отчета:

Рынок стандартизированных ПФИ
Клиринговый отчет за <дата>

Номер сообщения:

Отправитель:

Получатель:

Дата клиринга:

Клиринговая сессия:

Время формирования отчета:

Обеспечение

Расчетный код _____

Расчетный код Единого пула

Оценка Обеспечения

Код актива/ профиля актива	Баланс по итогам клиринга	Курс оценки	Оценка в российских рублях	Доступно к возврату*

* указывается максимальная сумма для каждого актива при условии сохранения остатков в иных активах

Оценка Обеспечения без Риск-неттинга	
Оценка Обеспечения (включает Риск-Неттинг)	
Требование к Обеспечению	

Оценка свободных средств	
--------------------------	--

Расчеты / <Идентификатор валюты>	
Баланс по итогам клиринга	
Ввод/вывод после клиринга	
Начало дня	
Ввод/вывод в ходе торгов	
Перед клирингом	
Нетто-обязательства	
Платежи	
После клиринга	

Нетто-обязательства по типам / <Идентификатор валюты>	
Обмен номиналами (FX Swap)	
Проценты на накопленную ДМ	
Процентный платеж	
Депозитная маржа	
Возврат накопленной депозитной маржи	
Проценты на Обеспечение	
Срок	
База для начисления	
Ставка	

Быстрая навигация по сделкам

<номер сделки>	<дата>	<код инструмента>	<режим>	<код валюты>
----------------	--------	-------------------	---------	--------------

Валюта	Сумма NPV по всем сделкам	Сумма будущих платежей
RUB		
USD		
EUR		
CHF		

Сделка №

Основные параметры

Номер сделки	
Контрагент	
Сторона парного договора	
Тип сделки	
Клиринговый идентификатор	
Время заключения сделки	

Дополнительные параметры

Тип инструмента	
Расчетный код	
CSA	
Дополнительный платеж	
Биржевой сбор	
Клиринговый сбор	

NPV сегодня:

Депозитная маржа за сегодня:

Проценты на ДМ за сегодня:

Дата	NPV	ДМ	%

Параметры форвардных договоров/ валютных фьючерсных договоров

Дата платежа	
Сумма первого платежа	
Сумма второго платежа	
Курс валют	
Дата фиксинга	
Фиксинг	
Платеж по расчетному Договору	

Параметры договоров валютный своп

для первоначального и окончательного платежей

Дата платежа	
Сумма первого платежа	
Сумма второго платежа	
Курс валют	
Перенос платежей	
Торгуемая валюта	

Параметры договоров процентный своп, валютно-процентный своп

Поток с фиксированной ставкой

Плательщик	
Получатель	
Начало периода	
Окончание периода	

Поток с плавающей ставкой

Плательщик	
Получатель	
Начало периода	
Окончание периода	

Процентный период		Процентный период	
Частота платежей		Частота платежей	
Перенос окончания процентного периода		Перенос окончания процентного периода	
Перенос платежей		Перенос платежей	
Конвенция		Конвенция	
Номинал		Номинал	
Ставка		Ставка	
		Спрэд	
		Офсет фиксинга (раб. дней)	
		Частота смены ставки	

График платежей

Тип	Дата	Сумма	Процентный период	Ставка	Фиксинг	Изменение ставки

Параметры опционных договоров	
Покупатель	
Продавец	
Тип	
Дата и время исполнения	
Дата поставки	
Сумма продажи	
Сумма покупки	
Курс	
Дата уплаты Премии	
Сумма Премии	
Правило переноса уплаты Премии	

Список участников и позиционных регистров

Участники

Идентификатор	Наименование

Регистры

Код	Наименование

Список клиринговых идентификаторов

Фиксинг и ставки

Фиксинг	Значение	Ставка	Значение

Центральный курс	Значение