

УТВЕРЖДЕНЫ

Правлением
Банка «Национальный Клиринговый Центр»
(Акционерное общество)

Протокол № 36 от «06» сентября 2017 года

Председатель Правления
Банка «Национальный Клиринговый Центр»
(Акционерное общество)

А.С. Хавин



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

г. Москва
2017 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. Заявление о прекращении допуска к клиринговому обслуживанию.....	11
2.9. Требование об исполнении Опционного договора	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. Заявление о прекращении допуска к клиринговому обслуживанию

В НКО НКЦ (АО)

**ЗАЯВЛЕНИЕ О ПРЕКРАЩЕНИИ ДОПУСКА К КЛИРИНГОВОМУ
ОБСЛУЖИВАНИЮ**

(полное наименование Участника клиринга)

Идентификатор Участника клиринга: _____

В соответствии с Правилами клиринга Небанковской кредитной организации-центрального контрагента «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество) просим прекратить* допуск к клиринговому обслуживанию на рынке Стандартизированных ПФИ.

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

М.П.

« ___ » _____ 20__ год.

Исполнитель Ф.И.О., телефон _____

* Прекращение допуска к клиринговому обслуживанию на рынке Стандартизированных ПФИ осуществляется при условии отсутствия учитываемых на регистрах учета позиций и Расчетных кодах Участника клиринга не прекращённых обязательств / требований Участника клиринга.

2.9. 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 _____

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/сpec/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 <http://nkcbank.ru/UserFiles/File/CK24/spfi-1-4.xsd>.

Печатная форма Клирингового отчета:

Рынок стандартизированных ПФИ Клиринговый отчет за <дата>

Номер сообщения:
Отправитель:
Получатель:
Дата клиринга:
Дата формирования отчета:
Время формирования отчета:

Обеспечение

Расчетный код _____

Оценка Обеспечения

Код актива	Баланс по итогам клиринга	Курс оценки	Оценка
Суммарная оценка			
Требование к Обеспечению			
Оценка свободных средств			

Расчеты <Идентификатор валюты>	
Начало дня	
Перед клирингом	
Нетто-обязательства	
Платежи	
После клиринга	

Нетто-обязательства по типам <Идентификатор валюты >	
Проценты на накопленную депозитную маржу	
Вариационная маржа	
Депозитная маржа	
Проценты на Обеспечение	

Проценты на Обеспечение

Быстрая навигация по сделкам

<номер сделки>	<код инструмента>	<дата>

Сделка №

Основные параметры

Дополнительные параметры

Номер сделки		Тип инструмента	
Контрагент		Расчетный код	
Сторона парного договора		CSA	
Тип сделки		Биржевой сбор	
Время заключения сделки		Клиринговый сбор	

Параметры форвардных договоров/ валютных фьючерсных договоров	
Дата платежа	
Сумма первого платежа	
Сумма второго платежа	
Курс валют	
Дата фиксинга	
Фиксинг	
Окончательный платеж	

Параметры договоров валютный своп для первоначального и окончательного платежей	
Дата платежа	
Сумма первого платежа	
Сумма второго платежа	
Курс валют	
Правило переноса платежей	

Параметры договоров процентный своп, валютно-процентный своп	
Плательщик	
Получатель	
Начало периода	
Окончание периода	
Процентный период	
Частота платежей	
Правило переноса платежей	
Конвенция	
Номинал	
Ставка	
Спрэд	
Офсет фиксинга (раб. дней)	

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	

Депозитная маржа/ Вариационная маржа за сегодня:
Проценты на депозитную маржу

Список участников и позиционных регистров

Участники		Регистры	
Идентификатор	Наименование	Код	Наименование

Расчетные коды

Список клиринговых идентификаторов

Фиксинг и ставки

Валютная пара	Значение	Ставка	Значение
		Проценты на Обеспечение	