



ЦЕНТРАЛЬНЫЙ БАНК
РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
(Банк России)

Департамент развития
финансовых рынков

107016, Москва, ул. Неглинная, 12

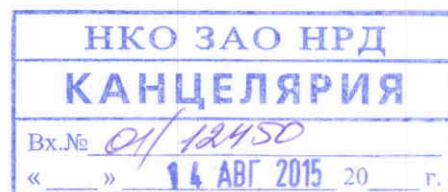
от 11.08.2015 № 51-4-3/340
на № _____ от _____

Вице-президенту
по развитию и работе с клиентами
НКО ЗАО НРД

М.Н. Лангуш

105066, г. Москва,
ул. Спартаковская, 12

О порядке отчетности по маржевым суммам
и справедливой (оценочной) стоимости



Уважаемая Мария Николаевна!

Департамент развития финансовых рынков (далее – Департамент) рассмотрел письмо НКО ЗАО НРД от 13.07.2015 № ЛМ-28/5356 и сообщает следующее.

В настоящее время Банком России разрабатывается проект указания Банка России «О внесении изменений в Указание Банка России от 30.04.2014 № 3253-У «О порядке ведения реестра договоров, заключенных на условиях генерального соглашения (единого договора), сроках предоставления информации, необходимой для ведения указанного реестра, и информации из указанного реестра, а также предоставления реестра договоров, заключенных на условиях генерального соглашения (единого договора), в Центральный банк Российской Федерации (Банк России)» (далее – Проект).

В соответствии с Проектом, информация согласно таблице 1 и 2 приложения 2 к Указанию Банка России от 30.04.2014 № 3253-У «О порядке ведения реестра договоров, заключенных на условиях генерального соглашения (единого договора), сроках предоставления информации, необходимой для ведения указанного реестра, и информации из

указанного реестра, а также предоставления реестра договоров, заключенных на условиях генерального соглашения (единого договора), в Центральный банк Российской Федерации (Банк России)» (далее – Указание) подлежит предоставлению в репозиторий только в отношении договора о порядке уплаты плавающих маржевых сумм, стандартные условия которого утверждены саморегулируемой организацией профессиональных участников рынка ценных бумаг и опубликованы в печати или размещены в сети «Интернет» в соответствии с пунктом 1 статьи 51.5 Федерального закона от 22.04.1996 года № 39-ФЗ «О рынке ценных бумаг». В случае если указанный договор не заключен, в описании к строке 2 и 3 таблицы 1 приложения 2 к Указанию будет необходимо ставить символ «U - договор о порядке уплаты плавающих маржевых сумм не заключен».

Информация о маржевых суммах будет предоставляться в течение пяти рабочих дней месяца, следующего за месяцем, в котором возникли обязательства по выплате маржевых сумм по состоянию на последний рабочий день указанного месяца. Определение минимальной суммы изменения маржевых сумм («minimum threshold»), которые бы позволили не предоставлять информацию в репозиторий, на данном этапе не планируется.

Согласно Проекту в репозиторий должна предоставляться информация о справедливой (оценочной) стоимости на основании отдельного договора, содержащего порядок ее определения, либо в отсутствие договора, на основании данных бухгалтерского учета. Если по данным бухгалтерского учета справедливая (оценочная) стоимость не определена и не заключен отдельный договор, содержащий порядок определения справедливой (оценочной) стоимости, то информация в соответствии с таблицей 3 приложения 2 к Указанию не предоставляется.

Информация о справедливой (оценочной) стоимости будет представляться в течение пяти рабочих дней месяца, следующего за месяцем, в котором произведена переоценка справедливой (оценочной) стоимости по состоянию на последний

рабочий день указанного месяца. Определение минимальной суммы изменения справедливой (оценочной) стоимости («minimum threshold»), которые бы позволили не предоставлять информацию в репозитарий, на данном этапе не планируется.

Дополнительно сообщаем, что в настоящее время Проект размещен на официальном сайте Банка России в сети «Интернет» в целях оценки регулирующего воздействия (<http://www.cbr.ru/analytics/?PrtId=project>).

И.о. директора

С уважением,



В.Ю. Степаненко