

саморегулируемая
организация



НАЦИОНАЛЬНАЯ
ФИНАНСОВАЯ
АССОЦИАЦИЯ

107045 г. Москва,
Большой Сергиевский переулок, 10
+7 (495) 980 98 74; www.nfa.ru; info@nfa.ru

Директору Департамента развития
финансовых рынков
Банка России

Е.В. Чайковской

Исх. № 1527 от 30 октября 2017 года

«О порядке применения Указания Банка
России от 16.08.2016 N 4104-У»

Уважаемая Елена Викторовна!

В целях уточнения ответа Банка России от 15.05.2017 № 51-4-3/156 просим Вас дать дополнительные разъяснения по порядку указания в Отчете об исполнении обязательств по сделке, представляемой в репозитарий в соответствии с требованиями Указания Банка России от 16 августа 2016 г. №4104-У, кода состояния обязательств по договору в случае прекращения обязательств зачетом (неттингом).

В соответствии с пунктом 5 таблицы 2 «Общая информация о договоре» приложения 1 «Информация о договоре, подлежащая представлению в репозитарий» в случае прекращения обязательств зачетом (неттингом), а также прекращения обязательств по договору в связи с проведением процедуры ликвидационного неттинга (по основаниям, предусмотренным статьей 4.1 Федерального закона от 26 октября 2002 года № 127-ФЗ «О несостоятельности (банкротстве)») в качестве значения кода состояния обязательств по договору указывается код «SO».

При этом в рыночной практике, закрепленной в условиях генеральных соглашений, в расчет нетто-обязательств включаются все исполняющиеся сделки на определенную дату валютирования, что приводит к невозможности определения на этапе формирования отчетности в репозитарий, по каким конкретно сделкам обязательства прекращены полностью, а по каким - частично, так как все они участвовали в неттинге. Кроме того, распространены случаи, когда стороны согласовывают порядок расчетов через неттинг даже в случае закрытия единственной сделки в текущую дату валютирования (т.е. на этапе расчетов сделка рассчитывается путем осуществления переводов денежных средств).

В связи с этим просим уточнить, возможно ли при направлении в репозитарий отчетности о прекращении обязательств по договорам указывать код «Т», как общий случай для кода «SO» при прекращении обязательств зачетом (неттингом) встречных требований. При этом применение кода «SO» допускать только в случае прекращения обязательств по договору в связи с проведением процедуры ликвидационного неттинга (по основаниям, предусмотренным статьей 4.1 Федерального закона от 26 октября 2002 года № 127-ФЗ «О несостоятельности (банкротстве)»).

с уважением,

Президент

В.В. Заблоцкий

Исп.: О.Е. Шитикова, +7 (495) 980-98-74

