



**ЦЕНТРАЛЬНЫЙ БАНК РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
(БАНК РОССИИ)**

« 22 » декабря 2017 г.

№ 4660-У

г. Москва

У К А З А Н И Е



**Об объеме и порядке раскрытия
информации репозитарием**

Настоящее Указание на основании пункта 11 статьи 15⁸ Федерального закона от 22 апреля 1996 года № 39-ФЗ «О рынке ценных бумаг» (Собрание законодательства Российской Федерации, 1996, № 17, ст. 1918; 2001, № 33, ст. 3424; 2002, № 52, ст. 5141; 2004, № 27, ст. 2711; № 31, ст. 3225; 2005, № 11, ст. 900; № 25, ст. 2426; 2006, № 1, ст. 5; № 2, ст. 172; № 17, ст. 1780; № 31, ст. 3437; № 43, ст. 4412; 2007, № 1, ст. 45; № 18, ст. 2117; № 22, ст. 2563; № 41, ст. 4845; № 50, ст. 6247; 2008, № 52, ст. 6221; 2009, № 1, ст. 28; № 18, ст. 2154; № 23, ст. 2770; № 29, ст. 3642; № 48, ст. 5731; № 52, ст. 6428; 2010, № 17, ст. 1988; № 31, ст. 4193; № 41, ст. 5193; 2011, № 7, ст. 905; № 23, ст. 3262; № 29, ст. 4291; № 48, ст. 6728;

№ 49, ст. 7040; № 50, ст. 7357; 2012, № 25, ст. 3269; № 31, ст. 4334; № 53, ст. 7607; 2013, № 26, ст. 3207; № 30, ст. 4043, ст. 4082, ст. 4084; № 51, ст. 6699; № 52, ст. 6985; 2014, № 30, ст. 4219; 2015; № 1, ст. 13; № 14, ст. 2022; № 27, ст. 4001; № 29, ст. 4348, ст. 4357; 2016, № 1, ст. 50, ст. 81; № 27, ст. 4225; 2017, № 25, ст. 3592; № 27, ст. 3925; № 30, ст. 4444; «Официальный интернет-портал правовой информации» (www.pravo.gov.ru), 25 ноября 2017 года) устанавливает объем и порядок раскрытия информации репозитарием.

1. Репозитарий обязан раскрывать информацию в следующем объеме (далее – раскрываемая информация).

1.1. Показатели, основанные на внесенной в реестр договоров, ведение которого осуществляется репозитарием (далее – реестр договоров), информации о заключенных не на организованных торгах договорах репо, договорах, являющихся производными финансовыми инструментами, договорах иного вида, определенных в пункте 1 Указания Банка России от 16 августа 2016 года № 4104-У «О видах договоров, заключенных не на организованных торгах, информация о которых предоставляется в репозитарий, лицах, предоставляющих в репозитарий информацию о таких договорах, порядке, составе, форме и сроках предоставления ими информации в репозитарий, дополнительных требованиях к порядку ведения репозитарием реестра договоров, порядке и сроках предоставления информации репозитарием, а также порядке, составе, форме и сроках предоставления репозитарием в Банк России реестра договоров», зарегистрированного Министерством юстиции Российской Федерации 23 сентября 2016 года № 43786 (далее – договоры), рассчитанные репозитарием за календарный месяц в установленном им порядке (далее – обобщенные показатели) (приложение к настоящему Указанию):

1.1.1. Количество договоров, информация о которых внесена в реестр договоров, в том числе договоров, расчеты по которым завершены, по видам договоров, составляющим следующие группы (далее – группы договоров):

договоры репо (все виды договоров репо);

производные финансовые инструменты, базисным активом которых является наступление обстоятельства, являющегося кредитным событием (все виды производных финансовых инструментов, базисным активом которых является наступление обстоятельства, являющегося кредитным событием);

производные финансовые инструменты, базисным активом которых является валюта (конверсионные договоры, форвардные договоры, валютные своп-договоры, опционные договоры);

производные финансовые инструменты, базисным активом которых являются процентные ставки (процентные своп-договоры, соглашения о будущей процентной ставке, опционные договоры, включая договоры, базисным активом которых является максимальная и минимальная процентная ставка);

производные финансовые инструменты, базисным активом которых являются ценные бумаги (форвардные договоры, базисным активом которых являются облигации, форвардные договоры, базисным активом которых являются акции, своп-договоры на акции, опционные договоры, базисным активом которых являются облигации (корзина облигаций), опционные договоры, базисным активом которых являются акции);

производные финансовые инструменты, базисным активом которых являются товары (форвардные договоры, товарные своп-договоры, опционные договоры).

1.1.2. Общий размер обязательств из договоров, информация о которых внесена в реестр договоров, в рублевом эквиваленте, определенном по официальному курсу, установленному Банком России на дату заключения договоров, в том числе договоров, расчеты по которым завершены, по видам договоров, составляющим группы договоров.

1.2. Порядок расчета обобщенных показателей, установленный и применяемый репозитарием.

1.3. Изменения, вносимые в порядок расчета обобщенных показателей.

2. Репозитарий обязан раскрывать обобщенные показатели, обеспечивая конфиденциальность записей, составляющих реестр договоров.

В случае если количество договоров, информация о которых внесена в реестр договоров, в группе договоров по итогам календарного месяца не превышает десяти, то общий размер обязательств из таких договоров не раскрывается.

3. Раскрытие информации репозитарием осуществляется путем ее размещения на официальном сайте репозитария в информационно-телекоммуникационной сети «Интернет» (далее – сайт).

Репозитарий обязан на главной (начальной) странице разместить ссылку на раздел сайта, содержащий раскрываемую информацию. При наличии у репозитария нескольких сайтов раскрываемая информация подлежит размещению на каждом из них.

4. Репозитарий обязан размещать на сайте рассчитанные за календарный месяц обобщенные показатели не позднее восьмого рабочего дня месяца после его окончания.

Указанные обобщенные показатели размещаются репозитарием на сайте в хронологическом порядке с указанием даты их раскрытия.

5. Репозитарий обязан размещать на сайте изменения, вносимые в порядок расчета обобщенных показателей, за два месяца до даты вступления их в силу с указанием даты вступления таких изменений в силу.

В дату вступления в силу изменений, вносимых в порядок расчета обобщенных показателей, репозитарий обязан размещать на сайте порядок расчета обобщенных показателей в новой редакции.

6. Репозитарий обязан обеспечить доступ к раскрываемой информации для ознакомления всем заинтересованным лицам круглосуточно в течение не менее трех лет с даты раскрытия указанной информации.

7. Настоящее Указание вступает в силу по истечении 10 дней после дня его официального опубликования.

Председатель
Центрального банка
Российской Федерации

Э.С. Набиуллина

Приложение
к Указанию Банка России
от « 22 » декабря 2017 года № 4660-У
«Об объеме и порядке раскрытия
информации репозитарием»

(рекомендуемый образец)

Обобщенные показатели

№	Виды договоров	Количество договоров, информация о которых внесена в реестр договоров	Общий размер обязательств из договоров, информация о которых внесена в реестр договоров
1	2	3	4
1. Группа договоров «Договоры репо»			
1.1	Все виды договоров репо	Указывается количество заключенных договоров репо	Указывается общий размер обязательств из заключенных договоров репо по первой части договора
2. Группа договоров «Производные финансовые инструменты, базисным активом которых является наступление обстоятельства, являющегося кредитным событием»			
2.1	Все виды производных финансовых инструментов, базисным активом которых является наступление обстоятельства, являющегося кредитным событием	Указывается количество договоров, являющихся производными финансовыми инструментами, базисным активом которых является наступление обстоятельства, являющегося кредитным событием	Указывается общий размер обязательств из заключенных договоров, являющихся производными финансовыми инструментами, базисным активом которых является наступление обстоятельства, являющегося кредитным событием, по номинальной стоимости
3. Группа договоров «Производные финансовые инструменты, базисным активом которых является валюта»			
3.1	Конверсионные договоры, форвардные договоры, валютные своп-договоры	Указывается количество заключенных конверсионных договоров, форвардных договоров, валютных своп-договоров	Указывается общий размер обязательств из заключенных конверсионных договоров, форвардных договоров, валютных своп-договоров по номинальной стоимости
3.2	Оptionные договоры	Указывается количество заключенных опционных договоров	Указывается общий размер обязательств из заключенных опционных договоров по номинальной стоимости
3.3	Иные договоры	Указывается количество иных заключенных	Указывается общий размер обязательств из иных

		договоров, являющихся производными финансовыми инструментами, базисным активом которых является валюта	заключенных договоров, являющихся производными финансовыми инструментами, базисным активом которых является валюта
4. Группа договоров «Производные финансовые инструменты, базисным активом которых являются процентные ставки»			
4.1	Процентные своп-договоры, соглашения о будущей процентной ставке	Указывается количество заключенных процентных своп-договоров, соглашений о будущей процентной ставке	Указывается общий размер обязательств из заключенных процентных своп-договоров, соглашений о будущей процентной ставке по номинальной стоимости
4.2	Опционные договоры, включая договоры, базисным активом которых является максимальная и минимальная процентная ставка	Указывается количество заключенных опционных договоров	Указывается общий размер обязательств из заключенных опционных договоров, базисным активом которых является максимальная и минимальная процентная ставка, по номинальной стоимости
4.3	Иные договоры	Указывается количество иных заключенных договоров, являющихся производными финансовыми инструментами, базисным активом которых являются процентные ставки	Указывается общий размер обязательств из иных заключенных договоров, являющихся производными финансовыми инструментами, базисным активом которых являются процентные ставки
5. Группа договоров «Производные финансовые инструменты, базисным активом которых являются ценные бумаги»			
5.1	Форвардные договоры, базисным активом которых являются облигации, форвардные договоры, базисным активом которых являются акции, своп-договоры на акции	Указывается количество заключенных форвардных договоров, базисным активом которых являются облигации, форвардных договоров, базисным активом которых являются акции, своп-договоров на акции	Указывается общий размер обязательств из заключенных форвардных договоров, базисным активом которых являются облигации, форвардных договоров, базисным активом которых являются акции, своп-договоров на акции по номинальной стоимости

5.2	Опционные договоры, базисным активом которых являются облигации (или корзина облигаций), опционные договоры, базисным активом которых являются акции	Указывается количество заключенных опционных договоров, базисным активом которых являются облигации (или корзина облигаций), опционных договоров, базисным активом которых являются акции	Указывается общий размер обязательств из заключенных опционных договоров, базисным активом которых являются акции, облигации или корзины облигаций, по номинальной стоимости
5.3	Иные договоры	Указывается количество иных заключенных договоров, являющихся производными финансовыми инструментами, базисным активом которых являются ценные бумаги	Указывается общий размер обязательств из иных заключенных договоров, являющихся производными финансовыми инструментами, базисным активом которых являются ценные бумаги
6. Группа договоров «Производные финансовые инструменты, базисным активом которых являются товары»			
6.1	Форвардные договоры, товарные своп-договоры	Указывается количество заключенных форвардных договоров, товарных своп-договоров	Указывается общий размер обязательств из заключенных форвардных договоров, товарных своп-договоров по номинальной стоимости
6.2	Опционные договоры	Указывается количество заключенных опционных договоров	Указывается общий размер обязательств из заключенных опционных договоров, базисным активом которых являются товары, по номинальной стоимости
6.3	Иные договоры	Указывается количество иных заключенных договоров, являющихся производными финансовыми инструментами, базисным активом которых являются товары	Указывается общий размер обязательств из иных заключенных договоров, являющихся производными финансовыми инструментами, базисным активом которых являются товары