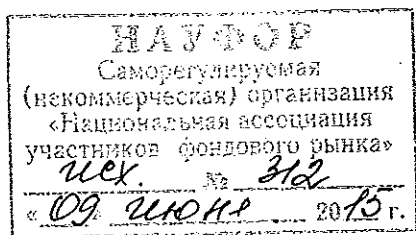


Первому заместителю
Председателя Банка России

С.А. Швецову



Уважаемый Сергей Анатольевич!

Благодарим за поддержку предложения отказаться от требования о внесении записи о заключении финансового договора в реестр репозитария как обязательного условия для включения соответствующих сумм в расчет нетто-обязательства в связи с введением процедур банкротства («ликвидационный неттинг»).

Мы понимаем, что реализация данного предложения потребует внесения изменений в законодательство (в том числе в статью 4.1 Федерального закона от 26 октября 2002 г. № 127-ФЗ «О несостоятельности (банкротстве»)). До внесения соответствующих изменений для участников рынка сохраняется проблема сверки («мэтчинга») сведений, представленных в репозитарий сторонами генерального соглашения или их информирующими лицами.

Полагаем, что предусмотренное пунктом 24 Указания Банка России от 30 апреля 2014 г. № 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) требование о «совпадении обязательных для сверки полей в сообщениях, полученных от информирующих лиц», согласно таблицам 3–8 приложения 1 и приложениям 2–7 к Указанию, не является эффективным как с точки зрения защиты от недобросовестности при банкротстве, так и с точки зрения обеспечения контроля и прозрачности на финансовом рынке.

С учетом изложенного, просим Вас рассмотреть возможность внесения в Указание следующих изменений:

1) для целей установленного пунктом 24 Указания требования о «совпадении обязательных для сверки полей в сообщениях, полученных от информирующих лиц», предусмотреть, что обязательными для сверки являются следующие поля в сообщениях:

- стороны и их роли по договору;
- даты заключения и окончательного исполнения договора;
- суммы и валюты сделки.


Впоследствии, после введения уникального идентификатора сделок (*Unique Trade Identifier, UTI*), вместо указания сторон и дат заключения и исполнения договора можно будет указывать *UTI* сделки;

2) сократить объем информации о договоре, который необходимо включать в сообщения, направляемые в репозиторий. Например, обязательное указание в сообщениях в репозиторий «базового актива» для валютнообменных сделок (форвард, валютный своп и пр.) на практике приводит к отказам репозитария во внесении записи о соответствующей сделке в реестр договоров, поскольку для сторон сделки базовой валютой могут быть разные валюты валютной пары и, соответственно, «базовый актив» в их сообщениях в репозиторий будет отличаться;

3) передать репозитарию право формировать значение для определенных полей сообщений, направляемых в репозиторий (например, код классификации производного инструмента), что в настоящее время осуществляется самими информирующими лицами. Такой подход позволит избежать неопределенности в вопросе формирования значения кода, связанной, в том числе, с разными подходами к учету договоров сторонами сделки.

С уважением,

председатель Правления



А.В. Тимофеев