

Утверждено приказом
Генерального директора
Публичного акционерного общества
«Санкт-Петербургская биржа»
№112 от «09» апреля 2018

_____ /Е.В. Сердюков

**Порядок расчета обобщенных показателей
репозитарием ПАО «Санкт-Петербургская биржа»**

Москва

1. Общие положения

1.1 Порядок расчета обобщенных показателей репозитарием ПАО «Санкт-Петербургская биржа» (далее – Порядок) определяет правила расчета Обобщенных показателей.

1.2 Изменения в Порядок вносятся Репозитарием в одностороннем порядке с соблюдением сроков и процедур, установленных нормативными актами Банка России.

1.3 Порядок и все изменения к нему подлежат опубликованию на сайте Репозитария в сети Интернет, расположенный по адресу <http://www.spbexchange.ru> (далее – Сайт).

1.4 Репозитарий размещает на Сайте:

- изменения, вносимые в Порядок, с указанием даты вступления таких изменений в силу - за 2 (два) месяца до даты вступления их в силу;

- Порядок с изменениями в новой редакции – не позднее даты вступления в силу изменений, вносимых в Порядок.

1.5 Заинтересованные в получении информации лица самостоятельно отслеживают публикацию соответствующих сообщений Репозитарием.

1.6 Репозитарий публикует Обобщенные показатели за Отчетный период на Сайте в хронологическом порядке с указанием даты их раскрытия не позднее 8 (восьмого) рабочего дня месяца после его окончания.

1.7 Обобщенные показатели публикуются в виде отчета по форме Приложения №1 к Порядку.

2. Термины и определения

Обобщенные показатели – показатели, основанные на внесенной Реестр договоров информации о заключенных не на организованных торгах договорах репо, договорах, являющихся производными финансовыми инструментами, договорах иного вида, рассчитанные Репозитарием за Отчетный период в установленном порядке, и подлежат раскрытию в соответствии с требованиями законодательства Российской Федерации и нормативных актов Банка России.

Отчетный период – календарный месяц.

Репозитарий – Публичное акционерное общество «Санкт-Петербургская биржа».

Реестр договоров - реестр, содержащий информацию о договорах, заключенных не на организованных торгах, и генеральных соглашениях (если договоры заключены на условиях генеральных соглашений), ведение которого осуществляет Репозитарий.

Термины, используемые в Порядке, и специально не определенные в настоящем разделе, используются в значении, установленном законодательством Российской Федерации, нормативными актами Банка России и Правилами осуществления репозитарной деятельности Публичного акционерного общества «Санкт-Петербургская биржа».

3. Основные принципы расчета Обобщенных показателей

3.1. Обобщенные показатели рассчитываются в отношении договоров, сведения о которых внесены в Реестр договоров Репозитария на последнюю дату Отчетного периода.

3.2. Обобщенные показатели рассчитываются по договорам, расчеты по которым осуществляются в валюте, для которой Банком России установлен официальный курс.

3.3. Обобщенные показатели рассчитываются в валюте Российской Федерации.

3.4. Репозитарием раскрываются следующие Обобщенные показатели:

3.4.1. Количество договоров, информация о которых внесена в Реестр договоров, в том числе договоров, расчеты по которым завершены, по видам договоров, составляющим следующие группы:

- договоры 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).

3.4.2. 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 указанные в пункте 3.4.1. Порядка группы договоров.

4. Правила расчета Обобщенных показателей по группам договоров

4.1. Группа договоров «Договоры репо»

Количество договоров, информация о которых внесена в Реестр договоров: указывается количество договоров репо, информация о которых внесена в Реестр договоров за Отчетный период.

Общий размер обязательств из договоров, информация о которых внесена в Реестр договоров: указывается общий размер обязательств из договоров репо, информация о которых внесена в Реестр договоров за Отчетный период, по первой части каждого договора в рублевом эквиваленте, определенном по официальному курсу, установленному Банком России на дату заключения таких договоров.

4.2. Группа договоров «Производные финансовые инструменты, базисным активом которых является наступление обстоятельства, являющегося кредитным событием»

Количество договоров, информация о которых внесена в Реестр договоров: указывается количество договоров, являющихся производными финансовыми инструментами, базисным активом которых является наступление обстоятельства, являющегося кредитным событием, информация о которых внесена в Реестр договоров за Отчетный период.

Общий размер обязательств из договоров, информация о которых внесена в Реестр договоров: указывается общий размер обязательств из договоров, информация о которых внесена в Реестр договоров за Отчетный период, являющихся производными финансовыми инструментами, базисным активом которых является наступление обстоятельства, являющегося кредитным событием, по номинальной стоимости в рублевом эквиваленте, определенном по официальному курсу, установленному Банком России на дату заключения таких договоров.

4.3. Группа договоров «Производные финансовые инструменты, базисным активом которых является валюта»

4.3.1. Конверсионные договоры, форвардные договоры, валютные своп-договоры

Количество договоров, информация о которых внесена в Реестр договоров: указывается количество конверсионных договоров, форвардных договоров, валютных своп-договоров, информация о которых внесена в Реестр договоров за Отчетный период.

Общий размер обязательств из договоров, информация о которых внесена в Реестр договоров: указывается общий размер обязательств из конверсионных договоров, форвардных договоров, валютных своп-договоров, информация о которых внесена в Реестр договоров за Отчетный период, по номинальной стоимости в рублевом эквиваленте, определенном по официальному курсу, установленному Банком России на дату заключения таких договоров.

4.3.2. Опционные договоры

Количество договоров, информация о которых внесена в Реестр договоров: указывается количество опционных договоров, информация о которых внесена в Реестр договоров за Отчетный период.

Общий размер обязательств из договоров, информация о которых внесена в Реестр договоров: указывается общий размер обязательств из опционных договоров, информация о которых внесена в Реестр договоров за Отчетный период, по номинальной стоимости в рублевом эквиваленте, определенном по официальному курсу, установленному Банком России на дату заключения таких договоров.

4.3.3. Иные договоры

Количество договоров, информация о которых внесена в Реестр договоров: указывается количество иных договоров, являющихся производными финансовыми инструментами, базисным активом которых является валюта, информация о которых внесена в Реестр договоров за Отчетный период.

Общий размер обязательств из договоров, информация о которых внесена в Реестр договоров: указывается общий размер обязательств из иных договоров, информация о которых внесена в Реестр договоров за Отчетный период, являющихся производными финансовыми инструментами, базисным активом которых является валюта, по номинальной стоимости в рублевом эквиваленте, определенном по официальному курсу, установленному Банком России на дату заключения таких договоров.

4.4. Группа договоров «Производные финансовые инструменты, базисным активом которых являются процентные ставки»

4.4.1. Процентные своп-договоры, соглашения о будущей процентной ставке

Количество договоров, информация о которых внесена в Реестр договоров: указывается количество процентных своп-договоров, соглашений о будущей процентной ставке, информация о которых внесена в Реестр договоров за Отчетный период.

Общий размер обязательств из договоров, информация о которых внесена в Реестр договоров: указывается общий размер обязательств из процентных своп-договоров, соглашений о будущей процентной ставке, информация о которых внесена в Реестр договоров за Отчетный период, по номинальной стоимости в рублевом эквиваленте, определенном по официальному курсу, установленному Банком России на дату заключения таких договоров.

4.4.2. Опционные договоры, включая договоры, базисным активом которых является максимальная и минимальная процентная ставка

Количество договоров, информация о которых внесена в Реестр договоров: указывается количество опционных договоров, информация о которых внесена в Реестр договоров за Отчетный период.

Общий размер обязательств из договоров, информация о которых внесена в Реестр договоров: указывается общий размер обязательств из опционных договоров, базисным активом которых является максимальная и минимальная процентная ставка, информация о которых внесена в Реестр договоров за Отчетный период, по номинальной стоимости в рублевом эквиваленте, определенном по официальному курсу, установленному Банком России на дату заключения таких договоров.

4.4.3. Иные договоры

Количество договоров, информация о которых внесена в Реестр договоров: указывается количество иных договоров, являющихся производными финансовыми инструментами, базисным активом которых являются процентные ставки, информация о которых внесена в Реестр договоров за Отчетный период.

Общий размер обязательств из договоров, информация о которых внесена в Реестр договоров: указывается общий размер обязательств из иных договоров, информация о которых внесена в Реестр договоров за Отчетный период, являющихся производными финансовыми инструментами, базисным активом которых являются процентные ставки, по номинальной стоимости в рублевом эквиваленте, определенном по официальному курсу, установленному Банком России на дату заключения таких договоров.

4.5. Группа договоров «Производные финансовые инструменты, базисным активом которых являются ценные бумаги»

4.5.1. Форвардные договоры, базисным активом которых являются облигации, форвардные договоры, базисным активом которых являются акции, своп-договоры на акции

Количество договоров, информация о которых внесена в Реестр договоров: указывается количество форвардных договоров, базисным активом которых являются облигации, форвардных договоров, базисным активом которых являются акции, своп-договоров на акции, информация о которых внесена в Реестр договоров за Отчетный период.

Общий размер обязательств из договоров, информация о которых внесена в Реестр договоров: указывается общий размер обязательств из форвардных договоров, базисным активом которых являются облигации, форвардных договоров, базисным активом которых являются акции, своп-договоров на акции, информация о которых внесена в Реестр договоров за Отчетный период, по номинальной стоимости в рублевом эквиваленте, определенном по официальному курсу, установленному Банком России на дату заключения таких договоров.

4.5.2. Опционные договоры, базисным активом которых являются облигации (или корзина облигаций), опционные договоры, базисным активом которых являются акции

Количество договоров, информация о которых внесена в Реестр договоров: указывается количество опционных договоров, базисным активом которых являются облигации (или корзина облигаций), опционных договоров, базисным активом которых являются акции, информация о которых внесена в Реестр договоров за Отчетный период.

Общий размер обязательств из договоров, информация о которых внесена в Реестр договоров: указывается общий размер обязательств из опционных договоров, базисным активом которых являются акции, облигации или корзины облигаций, информация о которых внесена в Реестр договоров за Отчетный период, по номинальной стоимости в рублевом эквиваленте, определенном по официальному курсу, установленному Банком России на дату заключения таких договоров.

4.5.3. Иные договоры

Количество договоров, информация о которых внесена в Реестр договоров: указывается количество иных договоров, являющихся производными финансовыми инструментами, базисным активом которых являются ценные бумаги, информация о которых внесена в Реестр договоров за Отчетный период.

Общий размер обязательств из договоров, информация о которых внесена в Реестр договоров: указывается общий размер обязательств из иных договоров, информация о которых внесена в Реестр договоров за Отчетный период, являющихся производными финансовыми инструментами, базисным активом которых являются ценные бумаги, по номинальной стоимости в рублевом эквиваленте, определенном по официальному курсу, установленному Банком России на дату заключения таких договоров.

4.6. Группа договоров «Производные финансовые инструменты, базисным активом которых являются товары»

4.6.1. Форвардные договоры, товарные своп-договоры

Количество договоров, информация о которых внесена в Реестр договоров: указывается количество форвардных договоров, товарных своп-договоров, информация о которых внесена в Реестр договоров за Отчетный период.

Общий размер обязательств из договоров, информация о которых внесена в Реестр договоров: указывается общий размер обязательств из форвардных договоров, товарных своп-договоров, информация о которых внесена в Реестр договоров за Отчетный период, по номинальной стоимости в рублевом эквиваленте, определенном по официальному курсу, установленному Банком России на дату заключения таких договоров.

4.6.2. Опционные договоры

Количество договоров, информация о которых внесена в Реестр договоров: указывается количество заключенных опционных договоров, информация о которых внесена в Реестр договоров за Отчетный период.

Общий размер обязательств из договоров, информация о которых внесена в Реестр договоров: указывается общий размер обязательств из опционных договоров, базисным активом которых являются товары, информация о которых внесена в Реестр договоров за Отчетный период, по номинальной стоимости в рублевом эквиваленте, определенном по официальному курсу, установленному Банком России на дату заключения таких договоров.

4.6.3. Иные договоры

Количество договоров, информация о которых внесена в Реестр договоров: указывается количество иных договоров, являющихся производными финансовыми инструментами, базисным активом которых являются товары, информация о которых внесена в Реестр договоров за Отчетный период.

Общий размер обязательств из договоров, информация о которых внесена в Реестр договоров: указывается общий размер обязательств из иных договоров, являющихся производными финансовыми инструментами, базисным активом которых являются товары, по номинальной стоимости в рублевом эквиваленте, определенном по официальному курсу, установленному Банком России на дату заключения таких договоров.

**Обобщенные показатели репозитария ПАО «Санкт-Петербургская биржа»
за _____ 20__ года**

№	Вид договоров	Количество договоров, информация о которых внесена в Реестр договоров, шт.	Общий размер обязательств из договоров, информация о которых внесена в Реестр договоров, тыс.руб.
1. Группа договоров «Договоры репо»			
1.1.	Все виды договоров репо		
2. Группа договоров «Производные финансовые инструменты, базисным активом которых является наступление обстоятельств, являющегося кредитным событием»			
2.1.	Все виды производных финансовых инструментов, базисным активом которых является наступление обстоятельства, являющегося кредитным событием		
3. Группа договоров «Производные финансовые инструменты, базисным активом которых является валюта»			
3.1.	Конверсионные договоры, форвардные договоры, валютные своп-договоры		
3.2.	Оptionные договоры		
3.3.	Иные договоры		
4. Группа договоров «Производные финансовые инструменты, базисным активом которых являются процентные ставки»			
4.1.	Процентные своп-договоры, соглашения о будущей процентной ставке		
4.2.	Оptionные договоры, включая договоры, базисным активом которых является максимальная и минимальная процентная ставка		
4.3.	Иные договоры		
5. Группа договоров «Производные финансовые инструменты, базисным активом которых являются ценные бумаги»			
5.1.	Форвардные договора, базисным активом которых являются облигации, форвардные договоры, базисным активом которых являются акции, своп-договоры на акции		
5.2.	Оptionные договоры, базисным активом которых являются облигации (или корзина облигаций), опционные		

	договоры, базисным активом которых являются акции		
5.3.	Иные договоры		
6. Группа договоров «Производные финансовые инструменты, базисным активом которых являются товары»			
6.1.	Форвардные договоры, товарные своп-договоры		
6.2.	Опционные договоры		
6.3.	Иные договоры		
	ИТОГО:		