



**ЦЕНТРАЛЬНЫЙ БАНК
РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
(Банк России)**

Территориальные учреждения
Банка России

ПЕРВЫЙ ЗАМЕСТИТЕЛЬ ПРЕДСЕДАТЕЛЯ

107016, Москва, ул. Неглинная, 12

от 12.12.2011 № 180-Т

на № _____ от _____

О дополнительных соглашениях к
Генеральным соглашениям об
общих условиях совершения Банком
России и кредитной организацией
сделок прямого РЕПО на рынке
государственных ценных бумаг

В целях обеспечения проведения Банком России с кредитными организациями сделок прямого РЕПО на рынке государственных ценных бумаг 30 декабря 2011 года (дата исполнения второй части сделки прямого РЕПО 3 января 2012 года), 3, 4, 5, 6 и 9 января 2012 года и с учетом письма Банка России от 02 декабря 2011 года № 176-Т об организации условий для проведения торгов на внутреннем финансовом рынке в Российской Федерации в конце 2011 года и 3, 4, 5, 6 и 9 января 2012 года территориальные учреждения Банка России с даты подписания настоящего письма и до 27 декабря 2011 года заключают с кредитными организациями дополнительные соглашения к Генеральным соглашениям об общих условиях совершения Банком России и кредитной организацией сделок прямого РЕПО на рынке государственных ценных бумаг, содержащие условия, приведенные в приложении к настоящему письму (далее – Дополнительное соглашение).

Территориальным учреждениям Банка России информировать Департамент обеспечения и контроля операций на финансовых рынках Банка России о заключении Дополнительного соглашения с кредитными организациями в срок не позднее следующего рабочего дня со дня заключения.

Настоящее письмо подлежит официальному опубликованию в «Вестнике Банка России» и на официальном сайте Банка России в сети Интернет.

Довести настоящее письмо до сведения кредитных организаций.

Приложение: Форма Дополнительного соглашения № 1 к Генеральному соглашению об общих условиях совершения Банком России и кредитной организацией сделок прямого РЕПО на рынке государственных ценных бумаг на 4 листах.



**Дополнительное соглашение № 1 к Генеральному соглашению № _____
об общих условиях совершения Банком России и Кредитной организацией сделок прямого
РЕПО на рынке государственных ценных бумаг от «__» _____**

г. _____

«__» _____ 201__ г.

Центральный банк Российской Федерации (Банк России), именуемый в дальнейшем Банк России, в лице _____, действующего (ей) на основании _____, и _____, именуемое(ый) в дальнейшем Кредитная организация, в лице _____, действующего(ей) на основании _____, именуемые в дальнейшем Стороны, заключили настоящее Дополнительное соглашение к Генеральному соглашению об общих условиях совершения Банком России и Кредитной организацией сделок прямого РЕПО на рынке государственных ценных бумаг от «__» _____ № _____ (далее – Соглашение) о нижеследующем.

1. В соответствии с настоящим Дополнительным соглашением Стороны могут заключать Сделки прямого РЕПО на рынке государственных ценных бумаг 30 декабря 2011 года (дата исполнения второй части Сделки прямого РЕПО 3 января 2012 года), 3, 4, 5, 6, и 9 января 2012 года с учетом изложенных ниже особенностей.

2. В целях настоящего Дополнительного соглашения:

под **Остаточными обязательствами Кредитной организации** следует понимать обязательства Кредитной организации перед Банком России, возникшие в результате не перечисления Кредитной организацией денежных средств Банку России по второй части Сделки прямого РЕПО и рассчитанные в порядке, установленном в приложении к Соглашению, и с учетом пункта 11 настоящего Дополнительного соглашения;

под **Рабочим днем** следует понимать день, являющийся торговым днем в Российской Федерации в соответствии с Правилами торгов;

под **Выпиской из реестра неисполненных сделок** следует понимать документ, формируемый и направляемый Сторонам в соответствии с Правилами клиринга.

3. Пункт 3.10 Соглашения применяется с учетом того, что денежные средства в иностранной валюте в соответствии с Соглашением перечисляются по Рабочим дням, являющимся также рабочими в стране-эмитенте валюты платежа, в которой находятся банки-корреспонденты Банка России.

4. В случае не поставки Ценных бумаг Кредитной организацией по первой части Сделки прямого РЕПО Банк России освобождается от обязательств по такой сделке, а Кредитная организация обязана уплатить сумму денежных средств в размере двойной ставки рефинансирования Банка России, действующей на дату первой части Сделки прямого РЕПО, начисленную за один календарный день на сумму РЕПО.

Подтверждением не поставки Ценных бумаг Кредитной организацией по первой части Сделки прямого РЕПО является предоставляемая Торговой системой Банку России и Кредитной организации Выписка из реестра неисполненных сделок.

В указанном случае Банк России не позднее Рабочего дня, следующего за днем получения подтверждения не поставки Ценных бумаг Кредитной организацией по первой части Сделки прямого РЕПО, направляет Кредитной организации уведомление, содержащее требование уплатить сумму денежных средств, указанную в абзаце 1 настоящего пункта.

5. Подтверждением не перечисления Кредитной организацией денежных средств по второй части Сделки прямого РЕПО является предоставляемая Торговой системой Банку России и Кредитной организации Выписка из реестра неисполненных сделок.

6. В случае не перечисления Кредитной организацией денежных средств по второй части Сделки прямого РЕПО Банк России начиная со дня, следующего за датой второй части Сделки прямого РЕПО, и до прекращения Остаточных обязательств Кредитной организации в полном объеме осуществляет действия, указанные в абзацах 2 - 5 пункта 6.4 Соглашения.

7. В случае не перечисления Кредитной организацией денежных средств по второй части Сделки прямого РЕПО Банк России вправе полностью или частично отказаться от реализации Ценных бумаг, являющихся предметом Сделки прямого РЕПО, и уменьшить сумму Остаточных обязательств Кредитной организации на стоимость таких Ценных бумаг, исчисленную по цене, согласованной Сторонами.

8. При не перечислении Кредитной организацией денежных средств по второй части Сделки прямого РЕПО Банк России не перечисляет (не передает) Кредитной организации полученные в соответствии с пунктами 5.1 и 5.2 Соглашения выплаты по Ценным бумагам. При этом сумма Остаточных обязательств Кредитной организации уменьшается на сумму денежных средств, полученных Банком России в качестве выплат по Ценным бумагам (денежных средств, полученных от реализации Банком России иного имущества, полученного от эмитента в качестве выплат по Ценным бумагам, за вычетом расходов, понесенных Банком России при реализации этого имущества).

9. Погашение требований Банка России по Остаточным обязательствам Кредитной организации осуществляется в следующем порядке:

в первую очередь погашается сумма Обязательств Кредитной организации по второй части Сделки прямого РЕПО;

во вторую очередь погашается сумма денежных средств, подлежащая уплате в связи с не перечислением Кредитной организацией денежных средств по второй части Сделки прямого РЕПО.

При наличии на определенную дату нескольких неисполненных Остаточных обязательств Кредитной организации, их погашение осуществляется в порядке возрастания номеров Сделок прямого РЕПО, присвоенных Торговой системой, если иное не установлено Банком России по согласованию с Кредитной организацией.

10. Банк России вправе уменьшить сумму Остаточных обязательств Кредитной организации в том числе:

- на сумму денежных средств, полученных от реализации ценных бумаг, оставшихся после погашения остаточных обязательств Кредитной организации при не перечислении ею денежных средств по второй части другой сделки прямого РЕПО, заключенной на организованном (биржевом, рынке государственных ценных бумаг) и (или) неорганизованном (внебиржевом) рынке, в том числе в соответствии с Соглашением, за вычетом расходов, понесенных Банком России при реализации ценных бумаг;

- на сумму поступившего Банку России дохода по ценным бумагам (в том числе на стоимость имущества, поступившего в качестве дохода по ценным бумагам, за вычетом расходов, понесенных Банком России при его реализации), сумму частичного погашения номинальной стоимости по ценным бумагам, являющимся предметом другой сделки прямого РЕПО, заключенной Сторонами на организованном (биржевом, рынке государственных ценных бумаг) и (или) неорганизованном (внебиржевом) рынке, в том числе в соответствии с Соглашением (при не перечислении Кредитной организацией денежных средств по второй части указанной сделки прямого РЕПО - в сумме превышения поступивших доходов по ценным бумагам над суммой остаточных обязательств Кредитной организации).

11. Величина Остаточных обязательств Кредитной организации рассчитывается со дня, следующего за датой второй части Сделки прямого РЕПО с учетом следующих особенностей:

под **I** следует понимать сумму не перечисленных Кредитной организацией Банку России предусмотренных пунктом 5.1 Соглашения денежных средств в случае неполучения Банком России выплат по Ценным бумагам, за вычетом денежных средств, списанных Банком России со счетов Кредитной организации в соответствии с пунктом 6.2 Соглашения.

под **F_i** следует понимать сумму денежных средств, подлежащую уплате за период с календарного дня, следующего за датой второй части Сделки прямого РЕПО, до дня прекращения Остаточных обязательств Кредитной организации (включая эти дни), но не более четырех календарных дней, Банку России в случае не перечисления Кредитной организацией денежных средств по второй части Сделки прямого РЕПО в соответствии с условиями Сделки прямого РЕПО в *i*-й день с даты второй части Сделки прямого РЕПО. Если $i \geq 5$ или $S_2 \leq \sum_{j=1}^i C_{j-1}$, то $F_i = 0$.

под **R^F** следует понимать ставку для расчета F_i , равную двойной ставке рефинансирования Банка России на дату второй части Сделки прямого РЕПО (% годовых).

12. Погашение Остаточных обязательств Кредитной организации, а также суммы денежных средств, указанной в пункте 4 настоящего Дополнительного соглашения, может осуществляться, в том числе по Рабочим дням, путем списания Банком России денежных средств с корреспондентского счета (субсчета (субсчетов) Кредитной организации, открытого (открытых) в подразделении (подразделениях) расчетной сети Банка России, банковских счетов Кредитной

организации, открытых в НКО ЗАО НРД, на основании инкассовых поручений Банка России без распоряжения владельца счета.

13. В период с 30 декабря 2011 года по 9 января 2012 года включительно в отношении Сделок прямого РЕПО, заключенных в соответствии с условиями настоящего Дополнительного соглашения пункт 6.1; абзац 3 пункта 6.3; абзац 1 пункта 6.4; пункт 6.5; абзац 1 пункта 6.6; пункт 6.9; абзацы 2 и 5 пункта 6.14 Соглашения; а также абзацы 5, 6 и 7 приложения к Соглашению не применяются.

14. Настоящее Дополнительное соглашение вступает в силу с 30 декабря 2011 года и действует до полного исполнения Сторонами своих обязательств по Сделкам прямого РЕПО, заключенным в соответствии с условиями настоящего Дополнительного соглашения.

15. Настоящее Дополнительное соглашение составлено на ____ листах в 2 экземплярах, имеющих одинаковую юридическую силу, по одному экземпляру для каждой из Сторон.

Центральный банк
Российской Федерации

(полное фирменное наименование кредитной организации в соответствии с учредительными документами)

Почтовый адрес: 107016, г. Москва,
ул. Неглинная, 12

Почтовый адрес:

(Ф.И.О.)

(Ф.И.О.)

М.П.

М.П.