

АО "ЦЕНТРАЛЬНЫЙ ДЕПОЗИТАРИЙ ЦЕННЫХ БУМАГ"

Утверждены

решением Правления
АО "Центральный депозитарий
ценных бумаг"

(протокол заседания
от 06 мая 2016 года № 26)

Введены в действие

с 26 июля 2016 года

ТРЕБОВАНИЯ

к формам отчетности для Национального Банка Республики Казахстан

**(при осуществлении деятельности
по формированию и ведению
системы реестров сделок с производными
финансовыми инструментами)**

г. Алматы

2016

Настоящие Требования определяют требования к формам отчетности, формируемым в программном обеспечении автоматизированное рабочее место "НБРК ПФИ" (далее – АРМ) АО "Центральный депозитарий ценных бумаг" (далее – Центральный депозитарий) с целью обеспечения доступа Национального Банка Республики Казахстан к базе данных системы реестров сделок с производными финансовыми инструментами.

ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ ОБ ОТЧЕТНОСТИ

1. Отчетность содержит информацию согласно приложениям 1–6 к настоящим Требованиям.
2. Данными для формирования отчетности являются данные, полученные АРМ из системы реестров сделок с производными финансовыми инструментами с использованием транспортной системы ФАСТИ.
3. Данные для формирования отчетности передаются в виде электронных сообщений, составляемых в соответствии с внутренним документом Центрального депозитария "Порядок составления операционных документов в электронном виде (при осуществлении деятельности по формированию и ведению системы реестров сделок с производными финансовыми инструментами)" (далее – Порядок).
4. Действия оператора, необходимые для формирования отчетности, определяются руководством пользователя к АРМ.

Президент

Студенина Е.В.

**Требования к формам отчетности для Национального Банка Республики Казахстан
(при осуществлении деятельности по формированию и ведению системы реестров сделок
с производными финансовыми инструментами)**

Приложение 1

к Требованиям к формам отчетности для Национального Банка Республики Казахстан (при осуществлении деятельности по формированию и ведению системы реестра сделок с производными финансовыми инструментами)

Сведения о сделках с фьючерсами, заключенным в период с "___" _____ по "___" _____ года

№	Дата заключения договора	Срок исполнения фьючерсного контракта	Тип расчетного исполнения (поставочное/беспоставочное исполнение)	Направление сделки (покупка/продажа) для информирующего лица	Базовый актив (валюта, товар, ЦБ, индекс, процентная ставка, ПФИ и др)	Наименование базового актива	Размер контракта	Количество фьючерсных контрактов	Цена за единицу базового актива по фьючерсному контракту на дату заключения	Сумма сделки по договору	Валюта котирования	Цена за единицу базового актива на дату закрытия / отчетную дату	Финансовый результат / результат от переоценки	Информирующее лицо			Контрагент			Прочие условия
														Наименование, ФИО	Категория (юр. лицо, физ. лицо)	Страна резидентства	Наименование, ФИО	Категория (юр. лицо, физ. лицо)	Страна резидентства	
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15	16	17	18	19	20	21
1																				
...																				
n																				

Порядок заполнения Сведений о сделках с фьючерсами

- В таблицу вносится последняя принятая информация о сделке, если эта информация удовлетворяет следующим условиям:
 - информация о сделке предоставлена из системы реестров сделок с производными финансовыми инструментами;
 - информация предоставлена сообщением по формату, изложенному в приложении 2 к Порядку;
 - значение тэга START_DATE ("Дата заключения договора", 1.6.5.1) в сообщении попадает в период, указанный в заголовке.
- В столбец "Дата заключения договора" (2) проставляется значение тэга START_DATE ("Дата заключения договора", 1.6.5.1).
- В столбец "Срок исполнения фьючерсного контракта" (3) проставляются следующая строка значение атрибута exe_month->EXE_DATE ("Месяц исполнения фьючерсного контракта"1.6.5.2.1) + "/" значение атрибута exe_year->EXE_DATE ("Год исполнения фьючерсного контракта", 1.6.5.2.2).

**Требования к формам отчетности для Национального Банка Республики Казахстан
(при осуществлении деятельности по формированию и ведению системы реестров сделок
с производными финансовыми инструментами)**

4. В столбец "Тип расчетного исполнения" (4) проставляется "назначение кода метода расчетов" из служебного справочника 2, соответствующее коду, указанному в тэге RECK_METHODE ("Код метода расчетов", 1.6.5.3).
5. В столбец "Направление сделки (покупка/продажа) для информирующего лица" (5) проставляется значение из тэга DEAL_TYPE ("Направление сделки", 1.6.5.4).
6. В столбец "Базовый актив" (6) проставляется "значение кода типа базового (базисного) актива" из служебного справочника 4, соответствующее коду, указанному в атрибуте ba_type->UNDRL_ASSET ("Код типа базового (базисного) актива", 1.6.5.5.1).
7. В столбец "Наименование базового актива" (7) проставляется:
 - a. код валюты, указанный в атрибуте ba_code->UNDRL_ASSET ("Код базового (базисного) актива", 1.6.5.5.2), если код типа базового актива = "1";
 - b. код ISIN, указанный в атрибуте ba_code->UNDRL_ASSET ("Код базового (базисного) актива", 1.6.5.5.2), если код типа базового актива = "2";
 - c. код НИИ, указанный в атрибуте ba_code->UNDRL_ASSET ("Код базового (базисного) актива", 1.6.5.5.2), если код типа базового актива = "3";
 - d. код процентной ставки, указанный в атрибуте ba_code->UNDRL_ASSET ("Код базового (базисного) актива", 1.6.5.5.2), если код типа базового актива = "4";
 - e. код финансового инструмента, указанный в атрибуте ba_code->UNDRL_ASSET ("Код базового (базисного) актива", 1.6.5.5.2), + наименование финансового инструмента, соответствующее данному коду из информационного справочника 2, если код типа базового актива = "5";
 - f. код товара, указанный в атрибуте ba_code->UNDRL_ASSET ("Код базового (базисного) актива", 1.6.5.5.2), если код типа базового актива = "6";
 - g. код товара, указанный в атрибуте ba_code->UNDRL_ASSET ("Код базового (базисного) актива", 1.6.5.5.2), + наименование товара на русском языке из информационного справочника 3, если код типа базового актива = "7";
 - h. код индекса, указанный в атрибуте ba_code->UNDRL_ASSET ("Код базового (базисного) актива", 1.6.5.5.2), если код типа базового актива = "8";
 - i. код индекса, указанный в атрибуте ba_code->UNDRL_ASSET ("Код базового (базисного) актива", 1.6.5.5.2) + наименование индекса из информационного справочника 5, если код типа базового актива = "9".
8. В столбец "Размер контракта" (8) проставляется значение из тэга SIZE_CONTRACT ("Размер контракта", 1.6.5.6).
9. В столбец "Количество фьючерсных контрактов" (9) проставляется значение из тэга Q_CONTRACT ("Количество фьючерсных контрактов", 1.6.5.7).
10. В столбец "Цена за единицу базового актива по фьючерсному контракту на дату заключения" (10) проставляется значение атрибута ba_price -> PRICE_BA ("Цена за единицу базового актива по фьючерсному контракту на дату заключения, 1.6.5.8.1) + значение атрибута ba_price_cur-> PRICE_BA (Код валюты цены за единицу базового актива по фьючерсному контракту на дату заключения, 1.6.5.8.2).
11. В столбец "Сумма сделки по договору" (11) проставляется значение равное произведению значений тэга SIZE_CONTRACT ("Размер контракта", 1.6.5.6)*значение тэга Q_CONTRACT ("Количество фьючерсных контрактов", 1.6.5.7)*значение атрибута ba_price -> PRICE_BA ("Цена за единицу базового

**Требования к формам отчетности для Национального Банка Республики Казахстан
(при осуществлении деятельности по формированию и ведению системы реестров сделок
с производными финансовыми инструментами)**

актива по фьючерсному контракту на дату заключения, 1.6.5.8.1) + значение атрибута `ba_price_cur->PRICE_BA` (Код валюты цены за единицу базового актива по фьючерсному контракту на дату заключения, 1.6.5.8.2).

12. В столбец "Валюта котирования" (12) проставляется значение из тэга `SUM_DEAL_CUR` ("Код валюты, в которой выражена сумма покупки по договору (валюта котирования)", 1.6.5.9).
13. В столбец "Цена за единицу базового актива на дату закрытия/отчетную дату" (13) проставляется значение из атрибута `close_price->CLOSE_PRICE` ("Цена за единицу базового актива на дату закрытия/отчетную дату, 1.6.5.10.1") + значение из атрибута `close_price_cur->CLOSE_PRICE` ("Код валюты цены за единицу базового актива на дату закрытия/отчетную дату, 1.6.5.10.2).
14. В столбец "Финансовый результат/результат от переоценки" (14) проставляется значение, вычисляемое по формуле ((значение из атрибута `close_price->CLOSE_PRICE` ("Цена за единицу базового актива на дату закрытия/отчетную дату, 1.6.5.10.1")- значение атрибута `ba_price ->PRICE_BA` ("Цена за единицу базового актива по фьючерсному контракту на дату заключения, 1.6.5.8.1))*значений тэга `SIZE_CONTRACT` ("Размер контракта", 1.6.5.6))*значение тэга `Q_CONTRACT` ("Количество фьючерсных контрактов", 1.6.5.7)).
15. В столбец "Наименование или ФИО" (15) информирующего лица проставляется (1.6.3):
 - a. полное наименование юридического лица на русском языке из информационного справочника 1, соответствующее коду, указанному в тэге `PARTICIPANT_CODE` ("Код информирующего лица");
 - b. полное наименование юридического лица на казахском языке из информационного справочника 1, соответствующее коду, указанному в тэге `PARTICIPANT_CODE` ("Код информирующего лица "), если наименование на русском языке отсутствует;
 - c. полное наименование юридического лица на английском языке из информационного справочника 1, соответствующее коду, указанному в тэге `PARTICIPANT_CODE` ("Код информирующего лица"), если данное лицо является юридическим и если наименование на русском и казахском языках отсутствуют;
 - d. полное наименование юридического лица на языке государства регистрации юридического лица из информационного справочника 1, соответствующее коду, указанному в тэге `PARTICIPANT_CODE` ("Код информирующего лица "), если данное лицо является юридическим и если наименование на русском, казахском и английском языках отсутствуют;
16. В столбец "Категория" (16) информирующего лица проставляется значение "юридическое лицо".
17. В столбец "Страна резидентства" информирующего лица (17) проставляется значение "KZ".
18. В столбец "Наименование или ФИО" (18) контрагента проставляется (1.6.5.11):
 - a. полное наименование юридического лица на русском языке из информационного справочника 1, соответствующее коду, указанному в тэге `CONTRAGENT_CODE` ("Код контрагента");
 - b. полное наименование юридического лица на казахском языке из информационного справочника 1, соответствующее коду, указанному в тэге `CONTRAGENT_CODE` ("Код контрагента"), если наименование на русском языке отсутствует;

**Требования к формам отчетности для Национального Банка Республики Казахстан
(при осуществлении деятельности по формированию и ведению системы реестров сделок
с производными финансовыми инструментами)**

- c. полное наименование юридического лица на английском языке из информационного справочника 1, соответствующее коду, указанному в тэге CONTRAGENT_CODE ("Код контрагента"), если данное лицо является юридическим и если наименование на русском и казахском языках отсутствуют;
 - d. полное наименование юридического лица на языке государства регистрации юридического лица из информационного справочника 1, соответствующее коду, указанному в тэге CONTRAGENT_CODE ("Код контрагента"), если данное лицо является юридическим и если наименование на русском, казахском и английском языках отсутствуют;
 - e. фамилия, имя и отчество (при наличии) физического лица на русском языке из информационного справочника 1, соответствующее коду, указанному в тэге CONTRAGENT_CODE ("Код контрагента"), если данное лицо является физическим;
 - f. фамилия, имя и отчество (при наличии) физического лица на казахском языке из информационного справочника 1, соответствующее коду, указанному в тэге CONTRAGENT_CODE ("Код контрагента"), если данное лицо является физическим и если фамилия, имя и отчество на русском языке отсутствуют;
 - g. фамилия, имя и отчество (при наличии) физического лица на английском языке из информационного справочника 1, соответствующее коду, указанному в тэге CONTRAGENT_CODE ("Код контрагента"), если данное лицо является физическим и если фамилия, имя и отчество на русском и казахском языках отсутствуют;
 - h. фамилия, имя и отчество (при наличии) физического лица на языке государства регистрации юридического лица из информационного справочника 1, соответствующее коду, указанному в тэге CONTRAGENT_CODE ("Код контрагента"), если данное лицо является физическим и если фамилия, имя и отчество на русском, казахском и английском языках отсутствуют.
19. В столбец "Категория" (19) контрагента проставляется:
- a. "юридическое лицо", если поле "тип участника сделки" информационного справочника 1 имеет значение "1", у участника сделки, найденного по коду, указанному в тэге CONTRAGENT_CODE ("Код контрагента");
 - b. "физическое лицо", если поле "тип участника сделки" информационного справочника 1 имеет значение "2", у участника сделки, найденного по коду, указанному в тэге CONTRAGENT_CODE ("Код контрагента");
20. В столбец "Страна резидентства" (20) проставляется значение поля "Код страны гражданства физического лица или регистрации юридического лица" информационного справочника 1, участника сделки, найденного в информационном справочнике 1 по значению тэга CONTRAGENT_CODE ("Код контрагента", 1.6.5.11).
21. В столбец "Прочие условия" (21) проставляется значение из тэга ADD_INFO ("Прочие условия", 1.6.5.24).

**Требования к формам отчетности для Национального Банка Республики Казахстан
(при осуществлении деятельности по формированию и ведению системы реестров сделок
с производными финансовыми инструментами)**

Приложение 2

к Требованиям к формам отчетности для Национального Банка Республики Казахстан (при осуществлении деятельности по формированию и ведению системы реестра сделок с производными финансовыми инструментами)

Сведения о сделках с опционами, заключенных в период с " _ " _ _ по " _ " _ _ года

№	Дата заключения договора (сделки)	Дата истечения договора (сделки)	Дата исполнения/валютирования	Тип рынка (биржевой, внебиржевой рынок)	Направление сделки (покупка/продажа) для информирующего лица	Вид опциона (колл/пут)	Тип опциона (американский, европейский)	Тип расчетного исполнения (поставочное/беспоставочное исполнение)	Базовый актив (валюта, товар, ЦБ, индекс, процентная ставка, ПФИ и др)	Наименование базового актива	Номинал базового актива (для внебиржевых) / размер контракта (для биржевых)	Количество базового актива/количество контрактов	Валюта котирования	Страйк-цена (за единицу базового актива/контракта)	Сумма по договору (сделке)	Цена (премия) опциона на дату заключения	Цена (премия) опциона на отчетную дату/дату исполнения	Финансовый результат/результат от переоценки	Информирующее лицо			Контрагент по сделке			Прочие условия
																			Наименование, ФИО	Категория (юр. лицо, физ. лицо)	Страна резидентства	Наименование, ФИО	Категория (юр. лицо, физ. лицо)	Страна резидентства	
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26
1																									
2																									

Порядок заполнения Сведений о сделках с опционами

- В таблицу вносится последняя принятая информация о сделке, если эта информация удовлетворяет следующим условиям:
 - информация о сделке предоставлена из системы реестров сделок с производными финансовыми инструментами;
 - информация предоставлена сообщением по формату, изложенному в приложении 3 к Порядку;
 - значение тэга DATE ("Дата заключения договора") в сообщении попадает в период, указанный в заголовке.
- В столбец "Дата заключения договора" (2) проставляется значение тэга DATE ("Дата заключения договора", 1.6.5.1).
- В столбец "Дата истечения договора (сделки)" (3) проставляется значение тэга DATE_EXP ("Дата истечения договора", 1.6.5.2).
- В столбец "Дата исполнения/валютирования" (4) проставляется значение тэга DATE_VAL ("Дата исполнения/валютирования", 1.6.5.3).

**Требования к формам отчетности для Национального Банка Республики Казахстан
(при осуществлении деятельности по формированию и ведению системы реестров сделок
с производными финансовыми инструментами)**

5. В столбец "Тип рынка" (5) проставляется (1.6.5.4):
 - a. значение "биржевой", если значение тэга M_TYPE="EXCH" ("Тип рынка");
 - b. значение "внебиржевой", если значение тэга M_TYPE="OTC" ("Тип рынка").
6. В столбец "Направление сделки (покупка/продажа) для информирующего лица" (6) проставляется значение из тэга DEAL_TYPE ("Вид сделки", 1.6.5.5).
7. В столбец "Вид опциона (колл/пут)" (7) проставляется значение:
 - a. "пут", если первый символ значения, указанного в тэге CLAS_CODE="P" ("Код опциона", 1.6.5.6);
 - b. "колл", если первый символ значения, указанного в тэге CLAS_CODE="C" ("Код опциона", 1.6.5.6).
8. В столбец "Тип опциона (американский, европейский)" (8) проставляется значение наименования типа опциона служебного справочника № 3-2, соответствующее второму символу значения, указанного в тэге CLAS_CODE ("Код опциона", 1.6.5.6).
9. В столбец "Тип расчетного исполнения (поставочное/беспоставочное исполнение)" (9) проставляется "назначение кода метода расчетов" из служебного справочника № 2, соответствующее коду, указанному в тэге RECK_METHODE ("Код метода расчетов", 1.6.5.7).
10. В столбец "Базовый актив (валюта, товар, ЦБ, индекс, процентная ставка, ПФИ и др)" (10) проставляется "значение кода типа базового (базисного) актива" из служебного справочника № 4, соответствующее коду, указанному в атрибуте ba_type->UNDRL_ASSET ("Базовый (базисный) актив", 1.6.5.8.1).
11. В столбец "Наименование базового актива" (11) проставляется (1.6.5.8.2):
 - a. код валюты, указанный в атрибуте ba_code->UNDRL_ASSET ("Код базового (базисного) актива"), если код типа базового актива = "1";
 - b. код ISIN, указанный в атрибуте ba_code->UNDRL_ASSET ("Код базового (базисного) актива"), если код типа базового актива = "2";
 - c. код НИИ, указанный в атрибуте ba_code->UNDRL_ASSET ("Код базового (базисного) актива"), если код типа базового актива = "3";
 - d. код процентной ставки, указанный в атрибуте ba_code->UNDRL_ASSET ("Код базового (базисного) актива"), если код типа базового актива = "4";
 - e. код финансового инструмента, указанный в атрибуте ba_code->UNDRL_ASSET ("Код базового (базисного) актива"), + наименование финансового инструмента, соответствующее данному коду из информационного справочника № 2, если код типа базового актива = "5";
 - f. код товара, указанный в атрибуте ba_code->UNDRL_ASSET ("Код базового (базисного) актива"), если код типа базового актива = "6";
 - g. код товара, указанный в атрибуте ba_code->UNDRL_ASSET ("Код базового (базисного) актива"), + наименование товара на русском языке из информационного справочника № 3, если код типа базового актива = "7";
 - h. код индекса, указанный в атрибуте ba_code->UNDRL_ASSET ("Код базового (базисного) актива"), если код типа базового актива = "8";
 - i. код индекса, указанный в атрибуте ba_code->UNDRL_ASSET ("Код базового (базисного) актива"), + наименование индекса из информационного справочника № 5, если код типа базового актива = "9".

**Требования к формам отчетности для Национального Банка Республики Казахстан
(при осуществлении деятельности по формированию и ведению системы реестров сделок
с производными финансовыми инструментами)**

12. В столбец "Номинал базового актива (для внебиржевых)/размер контракта (для биржевых)" (12) проставляется значение из атрибута `ba_price-> PRICE_BA` ("Номинал базового актива", 1.6.5.9.1).
13. В столбец "Количество базового актива/количество контрактов" (13) проставляется значение из атрибута `ba_price_q-> PRICE_BA` ("Количество базового актива/количество контрактов", 1.6.5.9.2).
14. В столбец "Валюта котирования" (14) проставляется значение из атрибута `ba_price_q_cur-> PRICE_BA` ("Валюта котирования", 1.6.5.9.3).
15. В столбец "Страйк-цена (за единицу базового актива/контракта)" (15) проставляется значение из атрибута `ba_price_str-> PRICE_BA` ("Страйк-цена (за единицу базового актива/контракта)", 1.6.5.9.4)+значение из атрибута `ba_price_str_cur-> PRICE_BA` ("Валюта страйк цены", 1.6.5.9.5).
16. В столбец "Сумма по договору (сделке)" (16) проставляется значение равное произведению значения атрибута `ba_price_q-> PRICE_BA` ("Количество базового актива/количество контрактов", 1.6.5.9.2) и атрибута `ba_price_str-> PRICE_BA` ("Страйк-цена (за единицу базового актива/контракта)", 1.6.5.9.4)+ значение из атрибута `ba_price_str_cur-> PRICE_BA` ("Валюта страйк-цены", 1.6.5.9.5).
17. В столбец "Цена (премия) опциона на дату заключения" (17) проставляется значение атрибута `price_start-> OPTION_PRICE` ("Цена (премия) опциона на дату заключения", 1.6.5.10.3)+ значение атрибута `price_cur-> OPTION_PRICE` (Код валюты цены (премии) опциона, 1.6.5.10.2).
18. В столбец "Цена (премия) опциона на отчетную дату/дату исполнения" (18) проставляется значение атрибута `price_open-> OPTION_PRICE` ("Цена (премия) опциона на отчетную дату/дату исполнения", 1.6.5.10.4) + значение атрибута `price_cur-> OPTION_PRICE` (Код валюты цены (премии) опциона, 1.6.5.10.2).
19. В столбец "Финансовый результат/результат от переоценки" (19) проставляется разница атрибута `price_start-> OPTION_PRICE` (Цена (премия) опциона на дату заключения, 1.6.5.10.3) и атрибута `price_close-> OPTION_PRICE` (Цена (премия) опциона на отчетную дату/дату исполнения, 1.6.5.10.4) + значение атрибута `price_cur-> OPTION_PRICE` (Код валюты цены (премии) опциона, 1.6.5.10.2).
20. В столбец "Наименование или ФИО" (20) информирующего лица проставляется (1.6.3):
 - a. полное наименование юридического лица на русском языке из информационного справочника 1, соответствующее коду, указанному в тэге `PARTICIPANT_CODE` ("Код информирующего лица");
 - b. полное наименование юридического лица на казахском языке из информационного справочника 1, соответствующее коду, указанному в тэге `PARTICIPANT_CODE` ("Код информирующего лица"), если наименование на русском языке отсутствует;
 - c. полное наименование юридического лица на английском языке из информационного справочника 1, соответствующее коду, указанному в тэге `PARTICIPANT_CODE` ("Код информирующего лица"), если данное лицо является юридическим и если наименование на русском и казахском языках отсутствуют;
 - d. полное наименование юридического лица на языке государства регистрации юридического лица из информационного справочника 1, соответствующее коду, указанному в тэге `PARTICIPANT_CODE` ("Код информирующего лица"), если данное лицо является юридическим и если наименование на русском, казахском и английском языках отсутствуют;
21. В столбец "Категория" (21) информирующего лица проставляется значение "юридическое лицо".

**Требования к формам отчетности для Национального Банка Республики Казахстан
(при осуществлении деятельности по формированию и ведению системы реестров сделок
с производными финансовыми инструментами)**

22. В столбец "Страна резидентства" информирующего лица (22) проставляется значение "KZ".
23. В столбец "Наименование или ФИО" (23) контрагента проставляется (1.6.5.11):
- a. полное наименование юридического лица на русском языке из информационного справочника 1, соответствующее коду, указанному в тэге CONTRAGENT_CODE ("Код контрагента");
 - b. полное наименование юридического лица на казахском языке из информационного справочника 1, соответствующее коду, указанному в тэге CONTRAGENT_CODE ("Код контрагента"), если наименование на русском языке отсутствует;
 - c. полное наименование юридического лица на английском языке из информационного справочника 1, соответствующее коду, указанному в тэге CONTRAGENT_CODE ("Код контрагента"), если данное лицо является юридическим и если наименование на русском и казахском языках отсутствуют;
 - d. полное наименование юридического лица на языке государства регистрации юридического лица из информационного справочника 1, соответствующее коду, указанному в тэге CONTRAGENT_CODE ("Код контрагента"), если данное лицо является юридическим и если наименование на русском, казахском и английском языках отсутствуют;
 - e. фамилия, имя и отчество (при наличии) физического лица на русском языке из информационного справочника 1, соответствующее коду, указанному в тэге CONTRAGENT_CODE ("Код контрагента"), если данное лицо является физическим;
 - f. фамилия, имя и отчество (при наличии) физического лица на казахском языке из информационного справочника 1, соответствующее коду, указанному в тэге CONTRAGENT_CODE ("Код контрагента"), если данное лицо является физическим и если фамилия, имя и отчество на русском языке отсутствуют;
 - g. фамилия, имя и отчество (при наличии) физического лица на английском языке из информационного справочника 1, соответствующее коду, указанному в тэге CONTRAGENT_CODE ("Код контрагента"), если данное лицо является физическим и если фамилия, имя и отчество на русском и казахском языках отсутствуют;
 - h. фамилия, имя и отчество (при наличии) физического лица на языке государства регистрации юридического лица из информационного справочника 1, соответствующее коду, указанному в тэге CONTRAGENT_CODE ("Код контрагента"), если данное лицо является физическим и если фамилия, имя и отчество на русском, казахском и английском языках отсутствуют.
24. В столбец "Категория" (24) контрагента проставляется:
- a. "юридическое лицо", если поле "тип участника сделки" информационного справочника 1 имеет значение "1", у участника сделки, найденного по коду, указанному в тэге CONTRAGENT_CODE ("Код контрагента");
 - b. "физическое лицо", если поле "тип участника сделки" информационного справочника 1 имеет значение "2", у участника сделки, найденного по коду, указанному в тэге CONTRAGENT_CODE ("Код контрагента");

**Требования к формам отчетности для Национального Банка Республики Казахстан
(при осуществлении деятельности по формированию и ведению системы реестров сделок
с производными финансовыми инструментами)**

25. В столбец "Страна резидентства" (25) проставляется значение поля "Код страны гражданства физического лица или регистрации юридического лица" информационного справочника 1, участника сделки, найденного в информационном справочнике 1 по значению тэга CONTRAGENT_CODE ("Код контрагента". 1.6.5.11).
26. В столбец "Прочие условия" (26) проставляется значение из тэга ADD_INFO ("Прочие условия", 1.6.5.28).

**Требования к формам отчетности для Национального Банка Республики Казахстан
(при осуществлении деятельности по формированию и ведению системы реестров сделок
с производными финансовыми инструментами)**

Приложение 3

к Требованиям к формам отчетности для Национального Банка Республики Казахстан (при осуществлении деятельности по формированию и ведению системы реестра сделок с производными финансовыми инструментами)

Сведения о сделках с форвардами, заключенных в период с "___" _____ по "___" _____ года

№	Дата заключения договора	Дата исполнения / валютирования / фиксинга для беспоставочных	Тип расчетного исполнения (Поставочное/беспоставочное исполнение)	Направление сделки (покупка/продажа) для информирующего лица	Базовый актив (валюта, товар, ЦБ, индекс, ПФИ и др)	Наименование базового актива	Номинал базового актива	Количество базового актива	Обменный курс или цена базового актива	Валюта котирования/контрвалюта	Сумма сделки в валюте котирования/контрвалюте	Информация о покупателе			Информация о продавце			Прочие условия
												Наименование, ФИО	Категория (юр. лицо, физ. лицо)	Страна резидентства	Наименование, ФИО	Категория (юр. лицо, физ. лицо)	Страна резидентства	
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15	16	17	18	19
1																		
...																		
n																		

Порядок заполнения Сведений о сделках с форвардами

1. В таблицу вносится последняя принятая информация о сделке, если эта информация удовлетворяет следующим условиям:
 - a. информация о сделке предоставлена из системы реестров сделок с производными финансовыми инструментами;
 - b. информация предоставлена сообщением по формату, изложенному в приложении 4 к Порядку;
 - c. значение тэга F_DATE ("Дата заключения договора") в сообщении попадает в период, указанный в заголовке.
2. В столбец "Дата заключения договора" (2) проставляется значение тэга F_DATE ("Дата заключения договора", 1.6.5.1).
3. В столбец "Дата исполнения/валютирования/фиксинга для беспоставочных" (3) проставляется значение тэга DATE_VAL ("Дата исполнения/валютирования/фиксинга для беспоставочных", 1.6.5.2.).

**Требования к формам отчетности для Национального Банка Республики Казахстан
(при осуществлении деятельности по формированию и ведению системы реестров сделок
с производными финансовыми инструментами)**

4. В столбец "Тип расчетного исполнения" (4) проставляется "назначение кода метода расчетов" из служебного справочника № 2, соответствующее коду, указанному в тэге RECK_METHODE ("Код метода расчетов", 1.6.5.3).
5. В столбец "Направление сделки (покупка/продажа) для информирующего лица" (5) проставляется значение тэга C_F_TYPE ("Направление сделки для информирующего лица", 1.6.5.4).
6. В столбец "Базовый актив (валюта, товар, ЦБ, индекс, ПФИ и др)" (6) проставляется "значение кода типа базового (базисного) актива" из служебного справочника № 4, соответствующее коду, указанному в атрибуте ba_type->UNDRL_ASSET ("Код типа базового (базисного) актива", 1.6.5.5.1).
7. В столбец "Наименование базового актива" (7) проставляется (1.6.5.5.2):
 - a. код валюты, указанный в атрибуте ba_code->UNDRL_ASSET ("Код базового (базисного) актива"), если код типа базового актива = "1";
 - b. код ISIN, указанный в атрибуте ba_code->UNDRL_ASSET ("Код базового (базисного) актива"), если код типа базового актива = "2";
 - c. код НИИ, указанный в атрибуте ba_code->UNDRL_ASSET ("Код базового (базисного) актива"), если код типа базового актива = "3";
 - d. код процентной ставки, указанный в атрибуте ba_code->UNDRL_ASSET ("Код базового (базисного) актива"), если код типа базового актива = "4";
 - e. код финансового инструмента, указанный в атрибуте ba_code->UNDRL_ASSET ("Код базового (базисного) актива"), + наименование финансового инструмента соответствующее данному коду из информационного справочника № 2, если код типа базового актива = "5";
 - f. код товара, указанный в атрибуте ba_code->UNDRL_ASSET ("Код базового (базисного) актива"), если код типа базового актива = "6";
 - g. код товара, указанный в атрибуте ba_code->UNDRL_ASSET ("Код базового (базисного) актива"), + наименование товара на русском языке из информационного справочника № 3, если код типа базового актива = "7";
 - h. код индекса, указанный в атрибуте ba_code->UNDRL_ASSET ("Код базового (базисного) актива"), если код типа базового актива = "8";
 - i. код индекса, указанный в атрибуте ba_code->UNDRL_ASSET ("Код базового (базисного) актива"), + наименование индекса из информационного справочника № 5, если код типа базового актива = "9".
8. В столбец "Номинал базового актива" (8) проставляется значение атрибута ba_price->UNDRL_ASSET ("Номинал базового актива", 1.6.5.5.4).
9. В столбец "Количество базового актива" (9) проставляется значение атрибута ba_price_q->UNDRL_ASSET ("Количество базового актива", 1.6.5.5.5).
10. В столбец "Обменный курс или цена базового актива" (10) проставляется значение атрибута exch_rate->C_RATE ("Обменный курс или цена базового актива", 1.6.5.6.1) + значение атрибута exch_rate_cur->C_RATE ("Код валюты обменного курса или цены базового актива", 1.6.5.6.2).
11. В столбец "Валюта котирования/контрвалюта" (11) проставляется значение атрибута sum_contract_cur->SUMM ("Код валюты суммы сделки в валюте котирования/контрвалюте", 1.6.5.7.2).
12. В столбец "Сумма сделки в валюте котирования/контрвалюте" (12) проставляется значение атрибута sum_contract->SUMM ("Сумма сделки в валюте котирования/контрвалюте", 1.6.5.7.1).

**Требования к формам отчетности для Национального Банка Республики Казахстан
(при осуществлении деятельности по формированию и ведению системы реестров сделок
с производными финансовыми инструментами)**

13. В столбец "Наименование или ФИО" (13) информирующего лица проставляется (1.6.3):
- a. полное наименование юридического лица на русском языке из информационного справочника 1, соответствующее коду, указанному в тэге PARTICIPANT_CODE ("Код информирующего лица");
 - b. полное наименование юридического лица на казахском языке из информационного справочника 1, соответствующее коду, указанному в тэге PARTICIPANT_CODE ("Код информирующего лица"), если наименование на русском языке отсутствует;
 - c. полное наименование юридического лица на английском языке из информационного справочника 1, соответствующее коду, указанному в тэге PARTICIPANT_CODE ("Код информирующего лица"), если данное лицо является юридическим и если наименование на русском и казахском языках отсутствуют;
 - d. полное наименование юридического лица на языке государства регистрации юридического лица из информационного справочника 1, соответствующее коду, указанному в тэге PARTICIPANT_CODE ("Код информирующего лица"), если данное лицо является юридическим и если наименование на русском, казахском и английском языках отсутствуют;
14. В столбец "Категория" (14) информирующего лица проставляется значение "юридическое лицо".
15. В столбец "Страна резидентства" информирующего лица (15) проставляется значение "KZ".
16. В столбец "Наименование или ФИО" (16) контрагента проставляется (1.6.5.8):
- a. полное наименование юридического лица на русском языке из информационного справочника 1, соответствующее коду, указанному в тэге CONTRAGENT_CODE ("Код контрагента");
 - b. полное наименование юридического лица на казахском языке из информационного справочника 1, соответствующее коду, указанному в тэге CONTRAGENT_CODE ("Код контрагента"), если наименование на русском языке отсутствует;
 - c. полное наименование юридического лица на английском языке из информационного справочника 1, соответствующее коду, указанному в тэге CONTRAGENT_CODE ("Код контрагента"), если данное лицо является юридическим и если наименование на русском и казахском языках отсутствуют;
 - d. полное наименование юридического лица на языке государства регистрации юридического лица из информационного справочника 1, соответствующее коду, указанному в тэге CONTRAGENT_CODE ("Код контрагента"), если данное лицо является юридическим и если наименование на русском, казахском и английском языках отсутствуют;
 - e. фамилия, имя и отчество (при наличии) физического лица на русском языке из информационного справочника 1, соответствующее коду, указанному в тэге CONTRAGENT_CODE ("Код контрагента"), если данное лицо является физическим;
 - f. фамилия, имя и отчество (при наличии) физического лица на казахском языке из информационного справочника 1, соответствующее коду, указанному в тэге CONTRAGENT_CODE ("Код контрагента"), если данное лицо является физическим и если фамилия, имя и отчество на русском языке отсутствуют;

**Требования к формам отчетности для Национального Банка Республики Казахстан
(при осуществлении деятельности по формированию и ведению системы реестров сделок
с производными финансовыми инструментами)**

- g. фамилия, имя и отчество (при наличии) физического лица на английском языке из информационного справочника 1, соответствующее коду, указанному в тэге CONTRAGENT_CODE ("Код контрагента"), если данное лицо является физическим и если фамилия, имя и отчество на русском и казахском языках отсутствуют;
 - h. фамилия, имя и отчество (при наличии) физического лица на языке государства регистрации юридического лица из информационного справочника 1, соответствующее коду, указанному в тэге CONTRAGENT_CODE ("Код контрагента"), если данное лицо является физическим и если фамилия, имя и отчество на русском, казахском и английском языках отсутствуют.
17. В столбец "Категория" (17) контрагента проставляется:
- a. "юридическое лицо", если поле "тип участника сделки" информационного справочника 1 имеет значение "1", у участника сделки, найденного по коду, указанному в тэге CONTRAGENT_CODE ("Код контрагента ", 1.6.5.8);
 - b. "физическое лицо", если поле "тип участника сделки" информационного справочника 1 имеет значение "2", у участника сделки, найденного по коду, указанному в тэге CONTRAGENT_CODE ("Код контрагента ", 1.6.5.8);
18. В столбец "Страна резидентства" (18) проставляется значение поля "Код страны гражданства физического лица или регистрации юридического лица" информационного справочника 1, участника сделки, найденного в информационном справочнике 1 по значению тэга CONTRAGENT_CODE ("Код контрагента". 1.6.5.8).
19. В столбец "Прочие условия" (19) проставляется значение из тэга ADD_INFO ("Прочие условия", 1.6.5.23).

**Требования к формам отчетности для Национального Банка Республики Казахстан
(при осуществлении деятельности по формированию и ведению системы реестров сделок
с производными финансовыми инструментами)**

Приложение 4

к Требованиям к формам отчетности для Национального Банка Республики Казахстан (при осуществлении деятельности по формированию и ведению системы реестра сделок с производными финансовыми инструментами)

Сведения о сделках с валютными свопами, заключенными в период с " __ " _____ по " __ " _____ года

№	Дата заключения договора (сделки)	Тип рынка (биржевой, внебиржевой рынок)	Сумма покупки/продажи (покупка) для информирующего	Ближняя сделка						Дальняя сделка						Информирующее лицо			Контрагент по сделке			Прочие условия
				Сумма покупки	Валюта покупки	Сумма продажи	Валюта продажи	Дата исполнения/валютирования	Курс по ближней сделке	Сумма покупки	Валюта покупки	Сумма продажи	Валюта продажи	Дата исполнения/валютирования	Курс по дальнейшей сделке	Наименование, ФИО	Категория (юр. лицо, физ. лицо)	Страна резидентства	Наименование, ФИО	Категория (юр. лицо, физ. лицо)	Страна резидентства	
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23
1																						
2																						
3																						
...																						
n																						

Порядок заполнения Сведений о сделках с валютными свопами

1. В таблицу вносится последняя принятая информация о сделке, если эта информация удовлетворяет следующим условиям:
 - a. информация о сделке предоставлена из системы реестров сделок с производными финансовыми инструментами;
 - b. информация предоставлена сообщением по формату, изложенному в приложении 5 к Порядку;
 - c. значение тэга DATE ("Дата заключения договора") в сообщении попадает в период, указанный в заголовке.
2. В столбец "Дата заключения договора" (2) проставляется значение тэга DATE ("Дата заключения договора", 1.6.5.1).
3. В столбец "Тип рынка" (3) проставляется (1.6.5.2):
 - a. значение "биржевой", если значение тэга M_TYPE="EXCH" ("Тип рынка");

**Требования к формам отчетности для Национального Банка Республики Казахстан
(при осуществлении деятельности по формированию и ведению системы реестров сделок
с производными финансовыми инструментами)**

- b. значение "внебиржевой", если значение тэга M_TYPE="OTC" ("Тип рынка").
4. В столбец "Направление сделки (покупка-продажа/продажа-покупка) для информирующего лица" (4) проставляется значение тэга DEAL_TYPE ("Направление сделки (покупка/продажа) для информирующего лица", 1.6.5.3).
 5. В столбец "Сумма покупки по договору" для ближней сделки (5) проставляется значение из атрибута price_buy->SHORT_LEG ("Сумма покупки по ближней сделке", 1.6.5.4.1).
 6. В столбец "Валюта покупки по договору" для ближней сделки (6) проставляется значение из атрибута currency_buy->SHORT_LEG ("Код валюты, в которой выражена сумма покупки по ближней сделке", 1.6.5.4.2).
 7. В столбец "Сумма продажи по договору" для ближней сделки (7) проставляется значение из атрибута price_sel->SHORT_LEG ("Сумма продажи по ближней сделке", 1.6.5.4.3).
 8. В столбец "Валюта продажи по договору" для ближней сделки (8) проставляется значение из атрибута currency_sel->SHORT_LEG ("Код валюты, в которой выражена сумма продажи по дальней сделке", 1.6.5.4.4).
 9. В столбец "Дата исполнения/валютирования" для ближней сделки (9) проставляется значение из атрибута val_date->SHORT_LEG ("Дата валютирования по ближней сделке", 1.6.5.4.5).
 10. В столбец "Курс по ближней сделке" для ближней сделки (10) проставляется значение из атрибута rate->SHORT_LEG ("Курс по ближней сделке", , 1.6.5.4.6).
 11. В столбец "Сумма покупки по договору" для дальней сделки (11) проставляется значение из атрибута price_buy-> LONG_LEG ("Сумма покупки по дальней сделке", 1.6.5.5.1).
 12. В столбец "Валюта покупки по договору" для дальней сделки (12) проставляется значение из атрибута currency_buy-> LONG_LEG ("Код валюты, в которой выражена сумма покупки по дальней сделке", 1.6.5.5.2).
 13. В столбец "Сумма продажи по договору" для дальней сделки (13) проставляется значение из атрибута price_sel-> LONG_LEG ("Сумма продажи по дальней сделке", 1.6.5.5.3).
 14. В столбец "Валюта продажи по договору" для дальней сделки (14) проставляется значение из атрибута currency_sel-> LONG_LEG ("Код валюты, в которой выражена сумма продажи по дальней сделке", 1.6.5.5.4).
 15. В столбец "Дата исполнения/валютирования" для дальней сделки (15) проставляется значение из атрибута val_date-> LONG_LEG ("Дата валютирования по дальней сделке", 1.6.5.5.5).
 16. В столбец "Курс по дальней сделке" для дальней сделки (16) проставляется значение из атрибута rate->LONG_LEG ("Курс по дальней сделке", 1.6.5.5.6).
 17. В столбец "Наименование или ФИО" (17) информирующего лица проставляется (1.6.3):
 - a. полное наименование юридического лица на русском языке из информационного справочника 1, соответствующее коду, указанному в тэге PARTICIPANT_CODE ("Код информирующего лица");

**Требования к формам отчетности для Национального Банка Республики Казахстан
(при осуществлении деятельности по формированию и ведению системы реестров сделок
с производными финансовыми инструментами)**

- b. полное наименование юридического лица на казахском языке из информационного справочника 1, соответствующее коду, указанному в тэге PARTICIPANT_CODE ("Код информирующего лица"), если наименование на русском языке отсутствует;
 - c. полное наименование юридического лица на английском языке из информационного справочника 1, соответствующее коду, указанному в тэге PARTICIPANT_CODE ("Код информирующего лица"), если данное лицо является юридическим и если наименование на русском и казахском языках отсутствуют;
 - d. полное наименование юридического лица на языке государства регистрации юридического лица из информационного справочника 1, соответствующее коду, указанному в тэге PARTICIPANT_CODE ("Код информирующего лица"), если данное лицо является юридическим и если наименование на русском, казахском и английском языках отсутствуют;
18. В столбец "Категория" (18) информирующего лица проставляется значение "юридическое лицо".
19. В столбец "Страна резидентства" информирующего лица (19) проставляется значение "KZ".
20. В столбец "Наименование или ФИО" (20) контрагента проставляется (1.6.5.6):
- a. полное наименование юридического лица на русском языке из информационного справочника 1, соответствующее коду, указанному в тэге CONTRAGENT_CODE ("Код контрагента");
 - b. полное наименование юридического лица на казахском языке из информационного справочника 1, соответствующее коду, указанному в тэге CONTRAGENT_CODE ("Код контрагента"), если наименование на русском языке отсутствует;
 - c. полное наименование юридического лица на английском языке из информационного справочника 1, соответствующее коду, указанному в тэге CONTRAGENT_CODE ("Код контрагента"), если данное лицо является юридическим и если наименование на русском и казахском языках отсутствуют;
 - d. полное наименование юридического лица на языке государства регистрации юридического лица из информационного справочника 1, соответствующее коду, указанному в тэге CONTRAGENT_CODE ("Код контрагента"), если данное лицо является юридическим и если наименование на русском, казахском и английском языках отсутствуют;
 - e. фамилия, имя и отчество (при наличии) физического лица на русском языке из информационного справочника 1, соответствующее коду, указанному в тэге CONTRAGENT_CODE ("Код контрагента"), если данное лицо является физическим;
 - f. фамилия, имя и отчество (при наличии) физического лица на казахском языке из информационного справочника 1, соответствующее коду, указанному в тэге CONTRAGENT_CODE ("Код контрагента"), если данное лицо является физическим и если фамилия, имя и отчество на русском языке отсутствуют;
 - g. фамилия, имя и отчество (при наличии) физического лица на английском языке из информационного справочника 1, соответствующее коду, указанному в тэге CONTRAGENT_CODE ("Код контрагента"), если данное лицо является физическим и если фамилия, имя и отчество на русском и казахском языках отсутствуют;

**Требования к формам отчетности для Национального Банка Республики Казахстан
(при осуществлении деятельности по формированию и ведению системы реестров сделок
с производными финансовыми инструментами)**

- h. фамилия, имя и отчество (при наличии) физического лица на языке государства регистрации юридического лица из информационного справочника 1, соответствующее коду, указанному в тэге CONTRAGENT_CODE ("Код контрагента"), если данное лицо является физическим и если фамилия, имя и отчество на русском, казахском и английском языках отсутствуют.
21. В столбец "Категория" (21) контрагента лица проставляется:
- a. "юридическое лицо", если поле "тип участника сделки" информационного справочника 1 имеет значение "1", у участника сделки, найденного по коду, указанному в тэге CONTRAGENT_CODE ("Код контрагента");
 - b. "физическое лицо", если поле "тип участника сделки" информационного справочника 1 имеет значение "2", у участника сделки, найденного по коду, указанному в тэге CONTRAGENT_CODE ("Код контрагента");
22. В столбец "Страна резидентства" (22) проставляется значение поля "Код страны гражданства физического лица или регистрации юридического лица" информационного справочника 1, участника сделки, найденного в информационном справочнике 1 по значению тэга CONTRAGENT_CODE ("Код контрагента". 1.6.5.6).
23. В столбец "Прочие условия" (23) проставляется значение из тэга ADD_INFO ("Прочие условия", 1.6.5.24).

**Требования к формам отчетности для Национального Банка Республики Казахстан
(при осуществлении деятельности по формированию и ведению системы реестров сделок
с производными финансовыми инструментами)**

Приложение 5

к Требованиям к формам отчетности для Национального Банка Республики Казахстан (при осуществлении деятельности по формированию и ведению системы реестра сделок с производными финансовыми инструментами)

Сведения о сделках с процентными свопами, заключенных в период с "___" _____ по "___" _____ года

№	Дата заключения договора (сделки)	Дата окончания договора (сделки)	Тип сделки (фикс-фикс/фикс-плав/плав-фикс/плав-плав) для информирующего лица	Информирующее лицо			Контрагент по сделке			Процентная ставка		Объем сделки	Валюта сделки	Способ расчета (нетто, брутто)	Амортизация номинала (да/нет) (DATE)	осуществления платежей	Прочие условия
				Наименование, ФИО	Категория (юр. лицо, физ. лицо)	Страна резидентства	Наименование, ФИО	Категория (юр. лицо, физ. лицо)	Страна резидентства	Процентная ставка информирующего лица	Процентная ставка контрагента						
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15	16	17	18
1																	

Порядок заполнения Сведений о сделках с процентными свопами

1. В таблицу вносится последняя принятая информация о сделке, если эта информация удовлетворяет следующим условиям:
 - a. информация о сделке предоставлена из системы реестров сделок с производными финансовыми инструментами;
 - b. информация предоставлена сообщением по формату, изложенному в приложении 6 к Порядку;
 - c. значение тэга DATE ("Дата заключения договора") в сообщении попадает в период, указанный в заголовке.
2. В столбец "Дата заключения договора" (2) проставляется значение тэга DATE ("Дата заключения договора", 1.6.5.1).
3. В столбец "Дата окончания договора" (3) проставляется значение тэга CLOSE_DATE ("Дата окончания срока действия договора", 1.6.5.2).
4. В столбец "Тип сделки (фикс-фикс/фикс-плав/плав-фикс/плав-плав) для информирующего лица" (4) проставляется значение тэга TYPE ("Тип сделки для информирующего лица", 1.6.5.3).
5. В столбец "Наименование или ФИО" (5) информирующего лица проставляется (1.6.3):

**Требования к формам отчетности для Национального Банка Республики Казахстан
(при осуществлении деятельности по формированию и ведению системы реестров сделок
с производными финансовыми инструментами)**

- a. полное наименование юридического лица на русском языке из информационного справочника 1, соответствующее коду, указанному в тэге PARTICIPANT_CODE ("Код информирующего лица");
 - b. полное наименование юридического лица на казахском языке из информационного справочника 1, соответствующее коду, указанному в тэге PARTICIPANT_CODE ("Код информирующего лица"), если наименование на русском языке отсутствует;
 - c. полное наименование юридического лица на английском языке из информационного справочника 1, соответствующее коду, указанному в тэге PARTICIPANT_CODE ("Код информирующего лица"), если данное лицо является юридическим и если наименование на русском и казахском языках отсутствуют;
 - d. полное наименование юридического лица на языке государства регистрации юридического лица из информационного справочника 1, соответствующее коду, указанному в тэге PARTICIPANT_CODE ("Код информирующего лица"), если данное лицо является юридическим и если наименование на русском, казахском и английском языках отсутствуют;
6. В столбец "Категория" (6) информирующего лица проставляется значение "юридическое лицо".
7. В столбец "Страна резидентства" информирующего лица (7) проставляется значение "KZ".
8. В столбец "Наименование или ФИО" (8) контрагента проставляется (1.6.5.4):
- a. полное наименование юридического лица на русском языке из информационного справочника 1, соответствующее коду, указанному в тэге CONTRAGENT_CODE ("Код контрагента");
 - b. полное наименование юридического лица на казахском языке из информационного справочника 1, соответствующее коду, указанному в тэге CONTRAGENT_CODE ("Код контрагента"), если наименование на русском языке отсутствует;
 - c. полное наименование юридического лица на английском языке из информационного справочника 1, соответствующее коду, указанному в тэге CONTRAGENT_CODE ("Код контрагента"), если данное лицо является юридическим и если наименование на русском и казахском языках отсутствуют;
 - d. полное наименование юридического лица на языке государства регистрации юридического лица из информационного справочника 1, соответствующее коду, указанному в тэге CONTRAGENT_CODE ("Код контрагента"), если данное лицо является юридическим и если наименование на русском, казахском и английском языках отсутствуют;
 - e. фамилия, имя и отчество (при наличии) физического лица на русском языке из информационного справочника 1, соответствующее коду, указанному в тэге CONTRAGENT_CODE ("Код контрагента"), если данное лицо является физическим;
 - f. фамилия, имя и отчество (при наличии) физического лица на казахском языке из информационного справочника 1, соответствующее коду, указанному в тэге CONTRAGENT_CODE ("Код контрагента"), если данное лицо является физическим и если фамилия, имя и отчество на русском языке отсутствуют;

**Требования к формам отчетности для Национального Банка Республики Казахстан
(при осуществлении деятельности по формированию и ведению системы реестров сделок
с производными финансовыми инструментами)**

- g. фамилия, имя и отчество (при наличии) физического лица на английском языке из информационного справочника 1, соответствующее коду, указанному в тэге CONTRAGENT_CODE ("Код контрагента"), если данное лицо является физическим и если фамилия, имя и отчество на русском и казахском языках отсутствуют;
 - h. фамилия, имя и отчество (при наличии) физического лица на языке государства регистрации юридического лица из информационного справочника 1, соответствующее коду, указанному в тэге CONTRAGENT_CODE ("Код контрагента"), если данное лицо является физическим и если фамилия, имя и отчество на русском, казахском и английском языках отсутствуют.
9. В столбец "Категория" (9) контрагента проставляется:
- a. "юридическое лицо", если поле "тип участника сделки" информационного справочника 1 имеет значение "1", у участника сделки, найденного по коду, указанному в тэге CONTRAGENT_CODE ("Код контрагента");
 - b. "физическое лицо", если поле "тип участника сделки" информационного справочника 1 имеет значение "2", у участника сделки, найденного по коду, указанному в тэге CONTRAGENT_CODE ("Код контрагента");
10. В столбец "Страна резидентства" (10) проставляется значение поля "Код страны гражданства физического лица или регистрации юридического лица" информационного справочника 1, участника сделки, найденного в информационном справочнике 1 по значению тэга CONTRAGENT_CODE ("Код контрагента". 1.6.5.4).
11. В столбец "Процентная ставка информирующего лица" (11) проставляется значение атрибута perc_rate_part ->PERC ("Процентная ставка информирующего лица ", 1.6.5.5.1).
12. В столбец "Процентная ставка контрагента" (12) проставляется значение атрибута perc_rate_contr->PERC ("Процентная ставка контрагента", 1.6.5.5.2).
13. В столбец "Объем сделки" (13) проставляется значение атрибута volume -> VOLUME ("Объем сделки", 1.6.5.6.1).
14. В столбец "Валюта номинала" (14) проставляется значение атрибута volume_cur > VOLUME ("Валюта сделки", 1.6.5.6.2).
15. В столбец "Способ расчета" (15) проставляется:
- a. значение "нетто", если значение тэга PAY_METHOD="1" ("Метод расчета", 1.6.5.7);
 - b. значение "брутто", если значение тэга PAY_METHOD="2" ("Метод расчета", 1.6.5.7).
16. В столбец "Амортизация номинала" (16) проставляется:
- a. значение "да", если значение тэга AMORTIZATION ="1" ("Амортизация номинала"1.6.5.8);
 - b. значение "нет", если значение тэга AMORTIZATION ="2" ("Амортизация номинала"1.6.5.8).
17. В столбец "Даты осуществления платежей" (17) проставляются разделенные запятой значения всех тэгов PAY_DATES ("Дата осуществления платежа", 1.6.5.9).
18. В столбец "Прочие условия" (18) проставляется значение из тэга ADD_INFO ("Прочие условия", 1.6.5.28).

**Требования к формам отчетности для Национального Банка Республики Казахстан
(при осуществлении деятельности по формированию и ведению системы реестров сделок
с производными финансовыми инструментами)**

Приложение 6

к Требованиям к формам отчетности для Национального Банка Республики Казахстан (при осуществлении деятельности по формированию и ведению системы реестра сделок с производными финансовыми инструментами)

Сведения о сделках с валютно-процентными свопами, заключенных в период с " _ " _ _ _ _ по " _ " _ _ _ _ года

№	Дата заключения договора (сделки)	Дата валютирования ближней сделки	Дата валютирования дальней сделки	Тип расчетного исполнения (поставочное/беспоставочное)	Направление сделки (покупка-продажа, продажа-покупка) для информирующего лица	Информирующее лицо			Контрагент			Объем сделки в базовой валюте	Наименование базовой валюты	Объем сделки в контравалюте	Наименование контравалюты	Курс сделки	Процентная ставка по базовой валюте	Процентная ставка по контравалюте	Даты осуществления платежей	Прочие условия
						Наименование, ФИО	Категория (юр. лицо, физ. лицо)	Страна резидентства	Наименование, ФИО	Категория (юр. лицо, физ. лицо)	Страна резидентства									
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15	16	17	18	19	20	21
1																				

Порядок заполнения Сведений о сделках с валютно-процентными свопами

1. В таблицу вносится последняя принятая информация о сделке, если эта информация удовлетворяет следующим условиям:
 - a. информация о сделке предоставлена из системы реестров сделок с производными финансовыми инструментами;
 - b. информация предоставлена сообщением по формату, изложенному в приложении 7 к Порядку;
 - c. значение тэга DATE ("Дата заключения договора") в сообщении попадает в период, указанный в заголовке.
2. В столбец "Дата заключения договора" (2) проставляется значение тэга DATE ("Дата заключения договора" 1.6.5.1).
3. В столбец "Дата валютирования ближней сделки" (3) проставляется значение тэга DATA_V_SHORT ("Дата валютирования ближней сделки", 1.6.5.2).
4. В столбец "Дата валютирования дальней сделки" (4) проставляется значение тэга DATA_V_LONG ("Дата валютирования дальней сделки", 1.6.5.3).
5. В столбец "Тип расчетного исполнения (поставочное/беспоставочное)" (5) проставляется "назначение кода метода расчетов" из служебного справочника № 2, соответствующее коду, указанному в тэге RECK_METHODODE ("Код метода расчетов", 1.6.5.4).

**Требования к формам отчетности для Национального Банка Республики Казахстан
(при осуществлении деятельности по формированию и ведению системы реестров сделок
с производными финансовыми инструментами)**

6. В столбец "Направление сделки (покупка-продажа, продажа-покупка) для информирующего лица" (6) проставляется значение тэга DEAL_TYPE ("Направление сделки (покупка/продажа, продажа/покупка) для информирующего лица", 1.6.5.5).
7. В столбец "Наименование или ФИО" (7) информирующего лица проставляется (1.6.3):
 - a. полное наименование юридического лица на русском языке из информационного справочника 1, соответствующее коду, указанному в тэге PARTICIPANT_CODE ("Код информирующего лица");
 - b. полное наименование юридического лица на казахском языке из информационного справочника 1, соответствующее коду, указанному в тэге PARTICIPANT_CODE ("Код информирующего лица "), если наименование на русском языке отсутствует;
 - c. полное наименование юридического лица на английском языке из информационного справочника 1, соответствующее коду, указанному в тэге PARTICIPANT_CODE ("Код информирующего лица"), если данное лицо является юридическим и если наименование на русском и казахском языках отсутствуют;
 - d. полное наименование юридического лица на языке государства регистрации юридического лица из информационного справочника 1, соответствующее коду, указанному в тэге PARTICIPANT_CODE ("Код информирующего лица "), если данное лицо является юридическим и если наименование на русском, казахском и английском языках отсутствуют;
8. В столбец "Категория" (8) информирующего лица проставляется значение "юридическое лицо".
9. В столбец "Страна резидентства" информирующего лица (9) проставляется значение "KZ".
10. В столбец "Наименование или ФИО" (10) контрагента проставляется (1.6.5.6):
 - a. полное наименование юридического лица на русском языке из информационного справочника 1, соответствующее коду, указанному в тэге CONTRAGENT_CODE ("Код контрагента");
 - b. полное наименование юридического лица на казахском языке из информационного справочника 1, соответствующее коду, указанному в тэге CONTRAGENT_CODE ("Код контрагента"), если наименование на русском языке отсутствует;
 - c. полное наименование юридического лица на английском языке из информационного справочника 1, соответствующее коду, указанному в тэге CONTRAGENT_CODE ("Код контрагента"), если данное лицо является юридическим и если наименование на русском и казахском языках отсутствуют;
 - d. полное наименование юридического лица на языке государства регистрации юридического лица из информационного справочника 1, соответствующее коду, указанному в тэге CONTRAGENT_CODE ("Код контрагента"), если данное лицо является юридическим и если наименование на русском, казахском и английском языках отсутствуют;
 - e. фамилия, имя и отчество (при наличии) физического лица на русском языке из информационного справочника 1, соответствующее коду, указанному в тэге CONTRAGENT_CODE ("Код контрагента"), если данное лицо является физическим;

**Требования к формам отчетности для Национального Банка Республики Казахстан
(при осуществлении деятельности по формированию и ведению системы реестров сделок
с производными финансовыми инструментами)**

- f. фамилия, имя и отчество (при наличии) физического лица на казахском языке из информационного справочника 1, соответствующее коду, указанному в тэге CONTRAGENT_CODE ("Код контрагента"), если данное лицо является физическим и если фамилия, имя и отчество на русском языке отсутствуют;
 - g. фамилия, имя и отчество (при наличии) физического лица на английском языке из информационного справочника 1, соответствующее коду, указанному в тэге CONTRAGENT_CODE ("Код контрагента"), если данное лицо является физическим и если фамилия, имя и отчество на русском и казахском языках отсутствуют;
 - h. фамилия, имя и отчество (при наличии) физического лица на языке государства регистрации юридического лица из информационного справочника 1, соответствующее коду, указанному в тэге CONTRAGENT_CODE ("Код контрагента"), если данное лицо является физическим и если фамилия, имя и отчество на русском, казахском и английском языках отсутствуют.
11. В столбец "Категория" (11) контрагента проставляется:
- a. "юридическое лицо", если поле "тип участника сделки" информационного справочника 1 имеет значение "1", у участника сделки, найденного по коду, указанному в тэге CONTRAGENT_CODE ("Код контрагента");
 - b. "физическое лицо", если поле "тип участника сделки" информационного справочника 1 имеет значение "2", у участника сделки, найденного по коду, указанному в тэге CONTRAGENT_CODE ("Код контрагента");
12. В столбец "Страна резидентства" (12) проставляется значение поля "Код страны гражданства физического лица или регистрации юридического лица" информационного справочника 1, участника сделки, найденного в информационном справочнике 1 по значению тэга CONTRAGENT_CODE ("Код контрагента". 1.6.5.6).
13. В столбец "Объем сделки в базовой валюте" (13) проставляется значение атрибута vol_baza -> VOLUME ("Объем сделки в базовой валюте ", 1.6.5.7.1).
14. В столбец "Наименование базовой валюты " (14) проставляется значение атрибута vol_baza_cur -> VOLUME ("Код базовой валюты", 1.6.5.7.2).
15. В столбец "Объем сделки в контрвалюте" (15) проставляется значение атрибута vol_contr -> VOLUME ("Объем сделки в контрвалюте ", 1.6.5.7.3).
16. В столбец " Наименование контрвалюты" (16)) проставляется значение атрибута vol_contr_cur-> VOLUME ("Код контрвалюты", 1.6.5.7.4).
17. В столбец "Курс сделки " (17) проставляется значение тэга RATE ("Курс сделки ", 1.6.5.8).
18. В столбец "Процентная ставка по базовой валюте" (18) проставляется значение атрибута perc_baza -> PERC ("Процентная ставка по базовой валюте", 1.6.5.9.1).
19. В столбец "Процентная ставка по контрвалюте" (19) проставляется значение атрибута perc_contr -> PERC ("Процентная ставка по контрвалюте", 1.6.5.9.2).
20. В столбец "Даты осуществления платежей" (20) проставляется значение тэга проставляются разделенные запятой значения всех тэгов PAY_DATES ("Дата осуществления платежа" 1.6.5.10).
21. В столбец "Прочие условия" (21) проставляется значение из тэга ADD_INFO ("Прочие условия", 1.6.5.29).