

УТВЕРЖДЕНА

Решением Правления

НКО НКЦ (АО)

Протокол № 15 от «23» марта 2021 г.

Председатель Правления

НКО НКЦ (АО)



Э.В. Астанин

Спецификация Внебиржевых сделок с иностранной валютой

Настоящая Спецификация Внебиржевых сделок с иностранной валютой (далее – Спецификация) определяет стандартные условия заключения Внебиржевых сделок купли-продажи иностранной валюты и сделок своп с иностранной валютой (далее – Внебиржевые сделки), заключаемых Клиринговым центром с Участником клиринга не на организованных торгах в порядке, предусмотренном Правилами клиринга Небанковской кредитной организации – центрального контрагента «Национальный клиринговый центр» (Акционерное общество) (далее – Правила клиринга).

Спецификация совместно с Правилами клиринга определяет порядок возникновения, изменения, исполнения и прекращения обязательств по Внебиржевым сделкам, а также иные условия, предусмотренные настоящей Спецификацией.

Термины и определения, используемые в Спецификации, понимаются в соответствии с законодательством Российской Федерации и Правилами клиринга.

1. Общие положения

1.1. Формирование кода Внебиржевой сделки купли-продажи иностранной валюты осуществляется по следующим правилам:

XXXXYY_ZZZ, где

XXX – код валюты лота,

YY – код сопряженной валюты,

ZZZ – код, определяющий дату исполнения обязательств по Внебиржевой сделке купли-продажи иностранной валюты.

1.2. Формирование кода Внебиржевой сделки своп с иностранной валютой осуществляется по следующим правилам:

XXXXYYTTZZ, где

XXX – код валюты лота,

YY – код сопряженной валюты,

TT – код, определяющий дату исполнения обязательств по первой части сделки своп,

ZZ – код, определяющий дату исполнения обязательств по второй части сделки своп.

1.3. Первым днем, начиная с которого может быть заключена Внебиржевая сделка, является дата введения в действие Списка предметов обязательств из договоров, заключенных не на организованных торгах, в отношении которых НКО НКЦ (АО) оказывает клиринговые услуги (далее – Список), если иное не установлено решением Клирингового центра.

Последним днем, когда может быть заключена Внебиржевая сделка, является последний рабочий день, дата которого предшествует дате прекращения действия Списка, если иное не установлено решением Клирингового центра.

1.4. Список утверждается Клиринговым центром и содержит следующие параметры Внебиржевых сделок:

- режим заключения Внебиржевой сделки;
- код Внебиржевой сделки;
- код валюты лота;
- наименование валюты лота;
- наименование сопряженной валюты;
- лот сделки;
- минимальный и максимальный размер Предложения;
- шаг цены;
- дату исполнения обязательств по Внебиржевой сделке.

2. Обязательства по Внебиржевым сделкам купли-продажи иностранной валюты и порядок их прекращения

2.1. В дату исполнения обязательств по Внебиржевой сделке, определяемую в соответствии со Списком, продавец обязан передать покупателю иностранную валюту, являющуюся валютой лота Внебиржевой сделки, в объеме, кратном лоту Внебиржевой сделки, а покупатель обязан уплатить продавцу сумму в сопряженной валюте, равную произведению соответствующего объема иностранной валюты на курс Внебиржевой сделки, в порядке, предусмотренном Правилами клиринга.

2.2. Порядок прекращения обязательств по Внебиржевым сделкам купли-продажи иностранной валюты определяется в Правилах клиринга.

2.3. Клиринговый центр и Участники клиринга несут ответственность за неисполнение или ненадлежащее исполнение обязательств по Внебиржевым сделкам купли-продажи иностранной валюты в соответствии с законодательством Российской Федерации и Правилами клиринга.

3. Обязательства по Внебиржевым сделкам своп с иностранной валютой и порядок их прекращения

3.1. **Обязательства по первой части сделки своп с иностранной валютой.** В дату исполнения обязательств по первой части сделки своп с иностранной валютой, определяемую в соответствии со Списком, покупатель обязан передать продавцу иностранную валюту в объеме, кратном лоту сделки своп с иностранной валютой, а продавец обязан принять иностранную валюту и уплатить покупателю сумму в сопряженной валюте, равную произведению соответствующего объема иностранной

валюты на базовый курс сделки своп с иностранной валютой, в порядке, предусмотренном Правилами клиринга.

Базовый курс Внебиржевой сделки своп с иностранной валютой определяется провайдером ликвидности, являющимся стороной по такой Внебиржевой сделке своп с иностранной валютой.

3.2. Обязательства по второй части сделки своп с иностранной валютой. В дату исполнения обязательств по второй части сделки своп с иностранной валютой, определяемую в соответствии со Списком, продавец обязан передать покупателю иностранную валюту в объеме, равном объему переданной по первой части сделки своп с иностранной валютой иностранной валюты, а покупатель обязан принять иностранную валюту и уплатить продавцу сумму в сопряженной валюте, равную произведению соответствующего объема иностранной валюты на итоговый курс сделки своп с иностранной валютой, в порядке, предусмотренном Правилами клиринга.

3.3. Порядок прекращения обязательств по Внебиржевым сделкам своп с иностранной валютой определяется в Правилах клиринга.

3.4. Клиринговый центр и Участники клиринга несут ответственность за неисполнение или ненадлежащее исполнение обязательств по Внебиржевым сделкам своп с иностранной валютой в соответствии с законодательством Российской Федерации и Правилами клиринга.

4. Особые условия

4.1. В случае приостановления/прекращения заключения Внебиржевых, в том числе в связи с ограничением обращения валюты лота Внебиржевых сделок Клиринговый центр вправе принять одно или несколько из следующих решений:

4.1.1. об изменении дат исполнения обязательств по Внебиржевой сделке;

4.1.2. о прекращении обязательств по Внебиржевой сделке;

4.1.3. иные решения, предусмотренные Правилами клиринга.

4.2. Информация о решении, принятом Клиринговым центром в соответствии с пунктом 4.1 Спецификации, раскрывается путем ее опубликования на сайте Клирингового центра в сети интернет не менее чем за три рабочих дня до вступления в силу соответствующих решений, если иной срок не установлен решением Клирингового центра.

5. Внесение изменений и дополнений в Спецификацию

5.1. Клиринговый центр вправе внести изменения и дополнения в Спецификацию.

5.2. Изменения и дополнения в Спецификацию вступают в силу с момента введения Клиринговым центром в действие Спецификации, содержащей указанные изменения и дополнения.

5.3. Информация о введении в действие Спецификации, содержащей изменения и дополнения, раскрывается путем ее опубликования на сайте Клирингового центра в сети интернет не позднее чем за три рабочих дня до даты введения ее в действие.

5.4. С момента вступления в силу изменений и дополнений в Спецификацию условия существующих обязательств по ранее заключенным Внебиржевым сделкам считаются измененными с учетом таких изменений и дополнений.



Всего прошито, пронумеровано и скреплено
печатью 3 (три) лист 2

Председатель Правления

НКО НКЦ (АО)


_____ (подпись)

С.В. Астанин

