

Перечень и критерии финансовых инструментов, используемых НКЦ для проведения операций в рамках деятельности центрального контрагента

1. В рамках деятельности центрального контрагента как стороны всех договоров, обязательства из которых подлежат включению в клиринговый пул, в том числе в целях урегулирования неисполненных обязательств участников клиринга (дефолт-менеджмент), НКЦ использует следующие финансовые инструменты:

1.1. Для урегулирования неисполненных обязательств участников клиринга по денежным средствам/ценным бумагам/драгоценным металлам, неисполненных маржинальных требований:

- договоры РЕПО и сделки купли-продажи ценных бумаг;
- сделки СВОП и сделки купли-продажи иностранной валюты/драгоценных металлов;
- сделки на срочном рынке (купли-продажи фьючерсов и опционов);
- договоры СПФИ;
- договоры, базисным активом которых является товар.

1.2. Для балансировки позиций НКЦ в случае прекращения допуска отдельных участников клиринга к клиринговому обслуживанию: сделки купли-продажи финансовых инструментов, обращающихся на рынках Группы «Московская Биржа» и внебиржевом рынке.

2. Обеспечение необходимого уровня ликвидности денежных средств в случае неисполнения участниками клиринга своих обязательств по итогам клиринга осуществляется с использованием финансовых инструментов, перечисленных в Приложении 1.

3. Использование иных видов финансовых инструментов допускается в случае принятия соответствующих решений Наблюдательным советом НКЦ.

4. Допускается использование финансовых инструментов, перечисленных в пункте 1 настоящего Приложения, с максимальными сроками¹ равными срокам соответствующих инструментов, обращающихся на рынках Группы «Московская Биржа» и внебиржевом рынке.

5. При реализации процедур дефолт-менеджмента на рынках Группы «Московская Биржа» устанавливаются следующие приоритеты использования финансовых инструментов:

¹ Под сроком финансового инструмента понимается срок расчетов по второй части сделки СВОП, срок расчетов по второй части договора РЕПО для РЕПО с ценными бумагами, срок расчетов по последней части сделки процентный СВОП и валютно-процентный СВОП.

- I - заключение биржевых сделок в стандартных режимах торгов ПАО Московская Биржа на основании хотя бы одной безадресной заявки (если применимо для соответствующего рынка);
- II - заключение биржевых сделок в режимах торгов «Урегулирование с ЦК» торговой системы ПАО Московская Биржа на основании хотя бы одной безадресной заявки (если применимо для соответствующего рынка);
- III - заключение биржевых сделок на торгах ПАО Московская Биржа на основании адресных заявок (если применимо для соответствующего рынка);
- IV - заключение внебиржевых сделок в режимах торгов «Урегулирование с ЦК» (если применимо для соответствующего рынка);
- V – заключение внебиржевых сделок с провайдерами ликвидности согласно правилам клиринга (если применимо для соответствующего рынка);
- VI – заключение внебиржевых сделок на рынке СПФИ (применимо только для рынка СПФИ);
- VII - заключение сделок на внебиржевых рынках.