

УТВЕРЖДЕН

решением Правления НКО НКЦ (АО)

от «7» декабря 2018 г. (Протокол №59)

Список предметов обязательств из договоров, заключенных не на организованных торгах, в отношении которых НКО НКЦ (АО) оказывает клиринговые услуги

1. НКО НКЦ (АО) оказывает клиринговые услуги в отношении следующих обязательств из внебиржевых Договоров, заключенных в соответствии с Правилами клиринга Небанковской кредитной организации-центрального контрагента «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество) на рынке Стандартизированных ПФИ:

Наименование Договора	Код (коды) Договора	Список предметов обязательств Договора ¹
Поставочный валютный опционный договор	FXOPTOTC	Валюта платежа, входящая в валютную пару Валюта уплаты премии Валюта уплаты депозитной маржи
Аукционный поставочный валютный опционный договор	FXOPTOTC	Валюта платежа, входящая в валютную пару Валюта уплаты премии Валюта уплаты депозитной маржи
Расчетный договор процентный своп	OISOTC IRSOTC	Валюта номинальной суммы Валюта уплаты депозитной маржи Валюта уплаты дополнительного платежа Плавающая ставка Фиксированная ставка
Аукционный расчетный договор процентный своп	OISOTC IRSOTC	Валюта номинальной суммы Валюта уплаты депозитной маржи Валюта уплаты дополнительного платежа Плавающая ставка Фиксированная ставка
Поставочный валютный форвардный договор	FWDOTC	Валюта платежа, входящая в валютную пару Валюта уплаты депозитной маржи
Аукционный	FWDOTC	Валюта платежа, входящая в валютную пару

¹ Непосредственный перечень валют и процентных ставок, являющихся предметом (предметами) обязательств по внебиржевому Договору устанавливаются спецификацией внебиржевого Договора

поставочный валютный форвардный договор		Валюта уплаты депозитной маржи
Расчетный валютный форвардный договор	FWDOTC	Валюта, входящая в валютную пару Валюта платежа и валюта уплаты депозитной маржи
Аукционный расчетный валютный форвардный договор	FWDOTC	Валюта, входящая в валютную пару Валюта платежа и валюта уплаты депозитной маржи
Поставочный договор валютный своп	FXSWAPOTC	Валюта первоначального и окончательного платежа Валюта уплаты депозитной маржи
Аукционный поставочный договор валютный своп	FXSWAPOTC	Валюта первоначального и окончательного платежа Валюта уплаты депозитной маржи
Поставочный валютно-процентный своп	XCCYOTC	Валюта номинальной суммы Валюта уплаты депозитной маржи Валюта уплаты дополнительного платежа Плавающая ставка Фиксированная ставка
Аукционный поставочный валютно-процентный своп	XCCYOTC	Валюта номинальной суммы Валюта уплаты депозитной маржи Валюта уплаты дополнительного платежа Плавающая ставка Фиксированная ставка

2. НКО НКЦ (АО) оказывает клиринговые услуги в отношении следующих обязательств из Внебиржевых сделок с иностранной валютой (далее – Внебиржевые сделки или Сделки), заключенных в соответствии с Правилами клиринга Небанковской кредитной организации-центрального контрагента «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество) на валютном рынке и рынке драгоценных металлов:

Код Внебиржевой сделки	Список предметов обязательств Внебиржевой сделки
EURUSD_SPT	Денежные средства в долларах США, Денежные средства в евро
GBPUSD_SPT	Денежные средства в фунтах стерлингов, Денежные средства в долларах США

Параметры Внебиржевых сделок

Код Сделки	Код валюты лота	Наименование валюты лота	Наименование сопряженной валюты	Лот Сделки, ед. вал. лота	Минимальный размер Предложения, ед. вал. лота	Максимальный размер Предложения, ед. вал. лота	Шаг цены	Дата исполнения обязательств по Сделке (T+n)*
EURUSD_SPT	EUR	евро	Доллар США	1 EUR	100 000	10 000 000	0,00001	T+2
GBPUSD_SPT	GBP	фунт стерлингов	Доллар США	1 GBP	100 000	10 000 000	0,00001	T+2

* T+n – дата, отстоящая от даты заключения Сделки (T) на соответствующее количество Расчетных дней (n).

Даты исполнения обязательств по Внебиржевым сделкам могут быть изменены по решению Клирингового центра.

Всего прошито, пронумеровано и скреплено
печатью 8 (мл) лист 2