

УТВЕРЖДЕН

решением Правления НКО НКЦ (АО)

от «23» марта 2021 г. (Протокол № 15)

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). Часть VI. Правила клиринга 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

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

Аукционный поставочный валютный форвардный договор	FWDOTC	Валюта платежа, входящая в валютную пару 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 ценными бумагами, заключенных в соответствии с Правилами клиринга Небанковской кредитной организации-центрального контрагента «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество). Часть II. Правила клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов:

Список предметов обязательств из Внебиржевых сделок с ценными бумагами	Код расчетов
Сделки купли-продажи ценных бумаг с расчетами в российских рублях, долларах США, евро	Y0, Y1, Y2

3. НКО НКЦ (АО) оказывает клиринговые услуги в отношении следующих обязательств из Внебиржевых сделок с иностранной валютой / драгоценными металлами (далее – Внебиржевые сделки с иностранной валютой / драгоценными металлами или Сделки с иностранной валютой / драгоценными металлами), в которых одним из конечных контрагентов является Провайдер ликвидности, заключенных в соответствии с Правилами клиринга Небанковской кредитной организации-центрального контрагента «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество) Часть III. Правила клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов:

Код Внебиржевой сделки с иностранной валютой / драгоценными металлами	Список предметов обязательств из Внебиржевой сделки с иностранной валютой / драгоценными металлами
EURUSD_SPT	Денежные средства в евро, Денежные средства в долларах США
GBPUSD_SPT	Денежные средства в фунтах стерлингов, Денежные средства в долларах США
USDTRY_TOM	Денежные средства в долларах США, Денежные средства в турецких лирах
USDCNY_SPT	Денежные средства в долларах США, Денежные средства в юанях
USDJPY_SPT	Денежные средства в долларах США, Денежные средства в иенах
XAUUSD_SPT	Золото, Денежные средства в долларах США
EURUSDTMSP	Денежные средства в евро, Денежные средства в долларах США
GBPUSDTMSP	Денежные средства в фунтах стерлингов, Денежные средства в долларах США
XAUUSDTMSP	Золото, Денежные средства в долларах США

Параметры Внебиржевых сделок с иностранной валютой / драгоценными металлами

Режим заключения Внебиржевой сделки купли-продажи ²	Код Сделки с иностранной валютой / драгоценными металлами	Код валюты лота	Наименование валюты лота	Наименование сопряженной валюты	Лот Сделки с иностранной валютой / драгоценными металлами, ед. вал. лота	Минимальный размер Предложения, кол-во лотов	Максимальный размер Предложения, кол-во лотов	Шаг цены	Дата исполнения обязательств по Сделке с иностранной валютой / драгоценными металлами (T+n)*
OTCT	EURUSD_SPT	EUR	Евро	Доллар США	1 EUR	100 000	10 000 000	0,00001 USD	T+2
OTCF ³	EURUSD_SPT	EUR	Евро	Доллар США	1 EUR	1 000 000	10 000 000	0,00001 USD	T+2
OTCT	GBPUSD_SPT	GBP	Фунт стерлингов	Доллар США	1 GBP	100 000	10 000 000	0,00001 USD	T+2
OTCT	USDTRY_TOM	USD	Доллар США	Турецкая лира	1 USD	100 000	10 000 000	0,00001 TRY	T+1
OTCT	USDCNY_SPT	USD	Доллар США	Юань	1 USD	100 000	10 000 000	0,00001 CNY	T+2
OTCT	USDJPY_SPT	USD	Доллар США	Иена	1 USD	100 000	10 000 000	0,001 JPY	T+2
OTCT	XAUUSD_SPT	XAU	Золото	Доллар США	10 унций	1	200	0,001 USD	T+2

² OTCT и OTCF – сделки с Провайдерами ликвидности;
RFSM – режим «Аукцион RFS».

³ В режиме OTCF принимаются только Предложения на заключение Внебиржевой сделки с иностранной валютой, размером 1 000 000, 2 000 000, 5 000 000 или 10 000 000 лотов, содержащие не требующего дополнительного подтверждения согласие купить определенное количество лотов по цене, не выше указанной в таком Предложении максимальной цены покупки, или продать определенное количество лотов по цене, не ниже указанной в таком Предложении минимальной цены продажи. Предложение на заключение Внебиржевой сделки с иностранной валютой в режиме OTCF исполняется полностью сразу же после его регистрации в Клиринговой системе, а при невозможности его немедленного исполнения отклоняется.

Режим заключения Внебиржевой сделки своп	Код Сделки с иностранной валютой / драгоценными металлами	Код валюты лота	Наименование валюты лота	Наименование сопряженной валюты	Лот Сделки с иностранной валютой / драгоценными металлами, ед. вал. лота	Минимальный размер Предложения, кол-во лотов	Максимальный размер Предложения, кол-во лотов	Шаг цены	Дата исполнения обязательств по Сделке с иностранной валютой / драгоценными металлами (T+n)*
RFSM	EURUSDTMSP	EUR	Евро	Доллар США	1 EUR	100 000	10 000 000	0,0000001 USD	T+1/T+2
RFSM	GBPUSDTMSP	GBP	Фунт стерлингов	Доллар США	1 GBP	100 000	10 000 000	0,0000001 USD	T+1/T+2
RFSM	XAUUSDTMSP	XAU	Золото	Доллар США	10 унций	1	200	0,00001 USD	T+1/T+2

* T+n – дата, отстоящая от даты заключения Сделки с иностранной валютой / драгоценными металлами (T) на соответствующее количество Расчетных дней (n).

Даты исполнения обязательств по Внебиржевым сделкам с иностранной валютой / драгоценными металлами могут быть изменены по решению Клирингового центра.

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

Код Внебиржевой сделки с иностранной валютой	Список предметов обязательств из Внебиржевой сделки с иностранной валютой
USDRUB_TOD	Денежные средства в долларах США, Денежные средства в российских рублях
USDRUB_TOM	Денежные средства в долларах США, Денежные средства в российских рублях
USDRUB_SPT	Денежные средства в долларах США, Денежные средства в российских рублях
EURRUB_TOD	Денежные средства в евро, Денежные средства в российских рублях
EURRUB_TOM	Денежные средства в евро, Денежные средства в российских рублях
EURRUB_SPT	Денежные средства в евро, Денежные средства в российских рублях
CNYRUB_TOD	Денежные средства в китайских юанях, Денежные средства в российских рублях
CNYRUB_TOM	Денежные средства в китайских юанях, Денежные средства в российских рублях
CNYRUB_SPT	Денежные средства в китайских юанях, Денежные средства в российских рублях
EURUSD_TOD	Денежные средства в евро, Денежные средства в долларах США
EURUSD_TOM	Денежные средства в евро, Денежные средства в долларах США
EURUSD_SPT	Денежные средства в евро, Денежные средства в долларах США

Параметры Внебиржевых сделок с иностранной валютой

Режим заключения Внебиржевой сделки ⁴	Код Сделки с иностранной валютой	Код валюты лота	Наименование валюты лота	Наименование сопряженной валюты	Лот Сделки с иностранной валютой, ед. вал. лота	Минимальный размер Предложения, ед. вал. лота	Максимальный размер Предложения, ед. вал. лота	Шаг цены	Дата исполнения обязательств по Сделке с иностранной валютой (T+n)*
RFSM	USDRUB_TOD	USD	Доллар США	Российский рубль	1 USD	5 000 000 USD	-	0,0025 руб.	T+0
RFSM	USDRUB_TOM	USD	Доллар США	Российский рубль	1 USD	5 000 000 USD	-	0,0025 руб.	T+1
RFSM	USDRUB_SPT	USD	Доллар США	Российский рубль	1 USD	5 000 000 USD	-	0,0025 руб.	T+2
RFSM	EURRUB_TOD	EUR	Евро	Российский рубль	1 EUR	5 000 000 EUR	-	0,0025 руб.	T+0
RFSM	EURRUB_TOM	EUR	Евро	Российский рубль	1 EUR	5 000 000 EUR	-	0,0025 руб.	T+1
RFSM	EURRUB_SPT	EUR	Евро	Российский рубль	1 EUR	5 000 000 EUR	-	0,0025 руб.	T+2
RFSM	CNYRUB_TOD	CNY	Китайский юань	Российский рубль	1 CNY	5 000 000 CNY	-	0,0025 руб.	T+0
RFSM	CNYRUB_TOM	CNY	Китайский юань	Российский рубль	1 CNY	5 000 000 CNY	-	0,0025 руб.	T+1
RFSM	CNYRUB_SPT	CNY	Китайский юань	Российский рубль	1 CNY	5 000 000 CNY	-	0,0025 руб.	T+2
RFSM	EURUSD_TOD	EUR	Евро	Доллар США	1 EUR	5 000 000 EUR	-	0,00001 USD	T+0
RFSM	EURUSD_TOM	EUR	Евро	Доллар США	1 EUR	5 000 000 EUR	-	0,00001 USD	T+1
RFSM	EURUSD_SPT	EUR	Евро	Доллар США	1 EUR	5 000 000 EUR	-	0,00001 USD	T+2

⁴ RFSM – режим «Аукцион RFS»;
CPCL – режим «Клиринг с ЦК».

Режим заключения Внебиржевой сделки ⁴	Код Сделки с иностранной валютой	Код валюты лота	Наименование валюты лота	Наименование сопряженной валюты	Лот Сделки с иностранной валютой, ед. вал. лота	Минимальный размер Предложения, ед. вал. лота	Максимальный размер Предложения, ед. вал. лота	Шаг цены	Дата исполнения обязательств по Сделке с иностранной валютой (T+n)*
CPCL	USDRUB_TOD	USD	Доллар США	Российский рубль	1 USD	1 ед. вал. лота	-	0,0001 руб.	T+0
CPCL	USDRUB_TOM	USD	Доллар США	Российский рубль	1 USD	1 ед. вал. лота	-	0,0001 руб.	T+1
CPCL	USDRUB_SPT	USD	Доллар США	Российский рубль	1 USD	1 ед. вал. лота	-	0,0001 руб.	T+2
CPCL	EURRUB_TOD	EUR	Евро	Российский рубль	1 EUR	1 ед. вал. лота	-	0,0001 руб.	T+0
CPCL	EURRUB_TOM	EUR	Евро	Российский рубль	1 EUR	1 ед. вал. лота	-	0,0001 руб.	T+1
CPCL	EURRUB_SPT	EUR	Евро	Российский рубль	1 EUR	1 ед. вал. лота	-	0,0001 руб.	T+2
CPCL	CNYRUB_TOD	CNY	Китайский юань	Российский рубль	1 CNY	1 ед. вал. лота	-	0,0001 руб.	T+0
CPCL	CNYRUB_TOM	CNY	Китайский юань	Российский рубль	1 CNY	1 ед. вал. лота	-	0,0001 руб.	T+1
CPCL	CNYRUB_SPT	CNY	Китайский юань	Российский рубль	1 CNY	1 ед. вал. лота	-	0,0001 руб.	T+2
CPCL	EURUSD_TOD	EUR	Евро	Доллар США	1 EUR	1 ед. вал. лота	-	0,00001 USD	T+0
CPCL	EURUSD_TOM	EUR	Евро	Доллар США	1 EUR	1 ед. вал. лота	-	0,00001 USD	T+1
CPCL	EURUSD_SPT	EUR	Евро	Доллар США	1 EUR	1 ед. вал. лота	-	0,00001 USD	T+2

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

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

Всего прошито, пронумеровано и скреплено
печатью 8/1/2016 лист 22

