

УТВЕРЖДЕНА

решением Правления НКО НКЦ (АО)
«21» октября 2021 года (Протокол № 65)

**МЕТОДИКА
ВЫБОРА И ОЦЕНКИ ИНОСТРАННЫХ ВАЛЮТ,
ПРИНИМАЕМЫХ В КАЧЕСТВЕ ОБЕСПЕЧЕНИЯ НА СРОЧНОМ РЫНКЕ
ПАО МОСКОВСКАЯ БИРЖА**

г. Москва
2021 год

Оглавление

Статья 1. Общие положения.....	3
Статья 2. Иностранные валюты, принимаемые в качестве Обеспечения.....	3
Статья 3. Максимальная сумма Иностранной валюты обеспечения одного Участника клиринга	3
Статья 4. Внесение изменений в Перечень	3
Статья 5. Оценочная стоимость Иностранной валюты обеспечения	4
Статья 6. Порядок изменения и вступления в силу настоящей Методики.....	4

Статья 1. Общие положения

- 1.1. В соответствии с настоящей Методикой выбора и оценки иностранных валют, принимаемых в качестве обеспечения на Срочном рынке ПАО Московская Биржа (далее – Методика), НКО НКЦ (АО) (далее - Клиринговый центр) производит выбор иностранных валют, принимаемых в качестве Обеспечения на Срочном рынке ПАО Московская Биржа, а также определяет максимальную сумму каждой иностранной валюты, учитываемой в качестве Обеспечения одного Участника клиринга.
- 1.2. Термины, специально не определенные в Методике, используются в значениях, установленных законодательством Российской Федерации, нормативными актами Банка России, а также документами Клирингового центра, включая Правила клиринга.

Статья 2. Иностранные валюты, принимаемые в качестве Обеспечения

- 2.1. Иностранные валюты, принимаемые в качестве Обеспечения (далее – Иностранные валюты обеспечения), должны удовлетворять требованиям Банка России, включая требования Банка России к качеству управления кредитной организации, осуществляющей функции центрального контрагента.
- 2.2. Перечень иностранной валюты, принимаемой в качестве Обеспечения на срочном рынке (далее – Перечень) с указанием максимальной суммы каждой Иностранной валюты обеспечения одного Участника клиринга публикуется на Сайте Клирингового центра (далее – Сайт).

Статья 3. Максимальная сумма Иностранной валюты обеспечения одного Участника клиринга

Иностранная валюта обеспечения учитывается на разделах денежного регистра обеспечения без ограничения на максимальную сумму, если иное не установлено решением Клирингового центра.

Статья 4. Внесение изменений в Перечень

- 4.1. В случае внесения изменений в Перечень, указанные изменения в Перечень (новый Перечень) размещаются (размещается) на Сайте, а также информация об изменениях рассылается Участникам клиринга посредством ЭДО. Изменения в Перечне учитываются в рассылаемых Участникам клиринга клиринговых отчетах.
- 4.2. Внесение в Перечень новых Иностранных валют обеспечения осуществляется на основании решения Клирингового центра. Указанное решение вступает в силу в дату, определенную решением Клирингового центра.
- 4.3. Клиринговый центр ежеквартально производит пересмотр текущего Перечня и, если Иностранная валюта обеспечения не удовлетворяет требованиям Статьи 2 настоящей Методики, принимает решение о ее исключении из Перечня. Указанное решение вступает в силу в дату, определенную решением Клирингового центра.
- 4.4. В случае необходимости в связи с изменившимися рыночными условиями Клиринговый центр имеет право для обеспечения ликвидности Обеспечения

провести внеплановый пересмотр Перечня и принять решение об исключении из него Иностранной валюты обеспечения. Указанное решение вступает в силу в дату, определённую решением Клирингового центра.

- 4.5. Изменение максимальной суммы Иностранной валюты обеспечения осуществляется на основании решения Клирингового центра. Указанное решение вступает в силу в дату, определённую решением Клирингового центра.
- 4.6. По решению Клирингового центра в Перечень могут быть внесены изменения в иных случаях, не предусмотренных Методикой. Указанные изменения в Перечень (новый Перечень) начинают (начинает) действовать не ранее, чем через 5 (пять) дней после даты их (его) опубликования на Сайте, если иное не определено решением Клирингового центра.

Статья 5. Оценочная стоимость Иностранной валюты обеспечения

- 5.1. Оценочная стоимость единицы Иностранной валюты обеспечения вычисляется по следующей формуле:

$$\text{Цоц} = \text{Цр} * (1 - \text{MR1})$$

где:

Цоц	оценочная стоимость единицы Иностранной валюты обеспечения;
Цр	Расчетная цена базового актива фьючерсного контракта, определенная по итогам клиринговой сессии в соответствии с Методикой определения НКО НКЦ (АО) риск-параметров срочного рынка ПАО Московская Биржа (Spot(i,БА)), приведенная к размерности единицы базового актива;
MR1	ставка дисконта, равная Минимальному ограничительному уровню Ставок обеспечения первого уровня (MR(БА,1)), установленному для базового актива – Иностранной валюты обеспечения. Устанавливается в соответствии с Методикой определения НКО НКЦ (АО) риск-параметров срочного рынка ПАО Московская Биржа.

Статья 6. Порядок изменения и вступления в силу настоящей Методики

- 6.1. Изменения и дополнения в настоящую Методику вносятся по решению Клирингового центра.
- 6.2. Изменения и дополнения в настоящую Методику вступают в силу в дату утверждения или иную дату, определённую решением Клирингового центра.