

УТВЕРЖДЕН
 приказом НКО НКЦ (АО)
 от «14» июня 2022 года
 № 01-01/182

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
Расчетный договор процентный своп	OISOTC IRSOTC	Валюта номинальной суммы: российский рубль, доллар США, евро Валюта уплаты депозитной маржи: российский рубль, доллар США, евро Валюта уплаты дополнительного платежа, платежа при изменении условий Договора, компенсации при досрочном прекращении Договора: российский рубль, доллар США, евро Плавающая ставка: Фиксированная ставка:

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

Аукционный расчетный договор процентный своп	OISOTC IRSOTC	Валюта номинальной суммы: российский рубль, доллар США, евро Валюта уплаты депозитной маржи: российский рубль, доллар США, евро Валюта уплаты дополнительного платежа, платежа при изменении условий Договора, компенсации при досрочном прекращении Договора: российский рубль, доллар США, евро Плавающая ставка: Фиксированная ставка:
Поставочный валютный форвардный договор	FWDOTC	Валюта платежа, входящая в валютную пару: российский рубль, доллар США, евро Валюта уплаты депозитной маржи: российский рубль, доллар США, евро Валюта уплаты Дополнительного платежа, платежа при изменении условий Договора, компенсации при досрочном прекращении Договора: российский рубль, доллар США, евро
Аукционный поставочный валютный форвардный договор	FWDOTC	Валюта платежа, входящая в валютную пару: российский рубль, доллар США, евро Валюта уплаты депозитной маржи: российский рубль, доллар США, евро Валюта уплаты Дополнительного платежа, платежа при изменении условий Договора, компенсации при досрочном прекращении Договора: российский рубль, доллар США, евро
Расчетный валютный форвардный договор	FWDOTC	Валюта, входящая в валютную пару: российский рубль, доллар США, евро Валюта платежа и валюта уплаты депозитной маржи: российский рубль, доллар США, евро Валюта уплаты Дополнительного платежа, платежа при изменении условий Договора, компенсации при досрочном прекращении Договора: российский рубль, доллар США, евро
Аукционный расчетный валютный форвардный договор	FWDOTC	Валюта, входящая в валютную пару: российский рубль, доллар США, евро Валюта платежа и валюта уплаты депозитной маржи: российский рубль, доллар США, евро Валюта уплаты Дополнительного платежа, платежа при изменении условий Договора, компенсации при досрочном прекращении Договора: российский рубль, доллар США, евро
Поставочный договор валютный своп	FXSWAPOTC	Валюта первоначального и окончательного платежа: российский рубль, доллар США, евро

		Валюта уплаты депозитной маржи: российский рубль, доллар США, евро Валюта уплаты Дополнительного платежа, платежа при изменении условий Договора, компенсации при досрочном прекращении Договора: российский рубль, доллар США, евро
Аукционный поставочный договор валютный своп	FXSWAPOTC	Валюта первоначального и окончательного платежа: российский рубль, доллар США, евро Валюта уплаты депозитной маржи: российский рубль, доллар США, евро Валюта уплаты Дополнительного платежа, платежа при изменении условий Договора, компенсации при досрочном прекращении Договора: российский рубль, доллар США, евро
Поставочный валютно-процентный своп	ХССУОТС	Валюта номинальной суммы: российский рубль, доллар США, евро Валюта номинальной суммы другой стороны: российский рубль, доллар США, евро Валюта уплаты депозитной маржи: российский рубль, доллар США, евро Валюта уплаты дополнительного платежа, платежа при изменении условий Договора, компенсации при досрочном прекращении Договора: российский рубль, доллар США, евро Плавающая ставка: Фиксированная ставка:
Аукционный поставочный валютно-процентный своп	ХССУОТС	Валюта номинальной суммы: российский рубль, доллар США, евро Валюта номинальной суммы другой стороны: российский рубль, доллар США, евро Валюта уплаты депозитной маржи: российский рубль, доллар США, евро Валюта уплаты дополнительного платежа, платежа при изменении условий Договора, компенсации при досрочном прекращении Договора: российский рубль, доллар США, евро 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, рынке депозитов и рынке кредитов:

Режим заключения Внебиржевых сделок с ценными бумагами	Список предметов обязательств из Внебиржевых сделок с ценными бумагами²	Код расчетов
«Сделки с ЦК»	Сделки купли-продажи ценных бумаг с расчетами в российских рублях, долларах США, евро	Y0, Y1, Y2
«Двусторонние сделки с ЦК»	Сделки купли-продажи ценных бумаг с расчетами в российских рублях, долларах США	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

² Перечень ценных бумаг, с которыми возможно заключение Внебиржевых сделок с ценными бумагами, приведен в Распоряжении «О ценных бумагах, с которыми возможно заключение Внебиржевых сделок с ценными бумагами».

Параметры Внебиржевых сделок с иностранной валютой / драгоценными металлами

Режим заключения Внебиржевой сделки купли-продажи ³	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 ⁴	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

³ OTCT и OTCF – сделки с Провайдерами ликвидности;
RFSM – режим «Аукцион RFS».

⁴ 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
USDCNY_TOD	Денежные средства в долларах США, Денежные средства в китайских юанях
USDCNY_TOM	Денежные средства в долларах США, Денежные средства в китайских юанях
USDCNY_SPT	Денежные средства в долларах США, Денежные средства в китайских юанях
GBPRUB_TOD	Денежные средства в фунтах стерлингов, Денежные средства в российских рублях

GBPRUB_TOM	Денежные средства в фунтах стерлингов, Денежные средства в российских рублях
GBPUSD_TOD	Денежные средства в фунтах стерлингов, Денежные средства в долларах США
GBPUSD_TOM	Денежные средства в фунтах стерлингов, Денежные средства в долларах США
GBPUSD_SPT	Денежные средства в фунтах стерлингов, Денежные средства в долларах США

Параметры Внебиржевых сделок с иностранной валютой

Режим заключения Внебиржевой сделки ⁵	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

⁵ RFSM – режим «Аукцион RFS»;
CPCL – режим «Клиринг с ЦК».

Режим заключения Внебиржевой сделки ⁵	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
CPCL	USDCNY_TOD	USD	Доллар США	Китайский юань	1 USD	1 ед. вал. лота	-	0,00001 CNY	T+0
CPCL	USDCNY_TOM	USD	Доллар США	Китайский юань	1 USD	1 ед. вал. лота	-	0,00001 CNY	T+1

Режим заключения Внебиржевой сделки ⁵	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	USDCNY_SPT	USD	Доллар США	Китайский юань	1 USD	1 ед. вал. лота		0,00001 CNY	T+2
CPCL	GBPRUB_TOD	GBP	фунт стерлингов	Российский рубль	1 GBP	1 ед. вал. лота		0,0001 руб.	T+0
CPCL	GBPRUB_TOM	GBP	фунт стерлингов	Российский рубль	1 GBP	1 ед. вал. лота		0,0001 руб.	T+1
CPCL	GBPUSD_TOD	GBP	фунт стерлингов	Доллар США	1 GBP	1 ед. вал. лота		0,00001 USD	T+0
CPCL	GBPUSD_TOM	GBP	фунт стерлингов	Доллар США	1 GBP	1 ед. вал. лота		0,00001 USD	T+1
CPCL	GBPUSD_SPT	GBP	фунт стерлингов	Доллар США	1 GBP	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.