

**Небанковская кредитная организация-центральный контрагент
«Национальный Клиринговый Центр»
(Акционерное общество)
(НКО НКЦ (АО))**

Распоряжение № 01-02/99

18 марта 2021 года

г. Москва

**О необходимости проведения дополнительных платежей
по Договорам СПФИ**

В связи с внесением изменений в Методику расчета рисков на рынке Стандартизированных ПФИ, влекущих изменение порядка определения расчетной стоимости Договора, а также на основании п. 3.6 Спецификации внебиржевых договоров процентный своп, утвержденной решением Правления НКО НКЦ (АО) от 02.03.2021 г. (Протокол № 8), п.3.6 Спецификации внебиржевых валютных форвардных договоров, утвержденной решением Правления НКО НКЦ (АО) от 02.03.2021 г. (Протокол № 8), п.3.6 Спецификации внебиржевых договоров валютный своп, утвержденной решением Правления НКО НКЦ (АО) от 02.03.2021 г. (Протокол № 8), п.3.6 Спецификации внебиржевых договоров валютно-процентный своп, утвержденной решением Правления НКО НКЦ (АО) от 02.03.2021 г. (Протокол № 8), п. 3.9 Спецификации внебиржевых валютных опционных договоров, утвержденной решением Правления НКО НКЦ (АО) от 02.03.2021 г. (Протокол № 8) (далее совместно – Спецификации):

1. Принять решение о необходимости проведения дополнительных платежей 19.04.2021 г. в отношении всех внебиржевых договоров процентный своп, внебиржевых валютных форвардных договоров, внебиржевых договоров валютный своп, внебиржевых договоров валютно-процентный своп, внебиржевых валютных опционных договоров (далее совместно – Договоры), позиции по которым учитываются Клиринговым центром по состоянию на 19.04.2021 г.
2. Сумма дополнительного платежа по каждому Договору определяется как разность¹ между расчетной стоимостью Договора, определенной на основании Методики расчета рисков на рынке Стандартизированных ПФИ², действующей до 18.04.2021 г. включительно, и расчетной стоимостью Договора, рассчитанной на основании введенного в действие измененного порядка определения расчетной стоимости, установленного Методикой расчета рисков на рынке Стандартизированных ПФИ³, действующей с 19.04.2021 г. Отрицательное значение суммы дополнительного платежа, определенной в соответствии с указанным выше порядком, означает обязательство Участника клиринга-стороны Договора по уплате дополнительного платежа, положительное значение означает требование Участника клиринга-стороны Договора по получению дополнительного платежа.

¹ Расчетные стоимости Договора определяются в ходе расчетной клиринговой сессии, проводимой в дату исполнения обязательства по дополнительному платежу, указанную в п.3 настоящего Распоряжения.

² Утверждена решением Правления НКО НКЦ (АО) от 10.09.2020 (Протокол № 40).

³ Утверждена решением Правления НКО НКЦ (АО) от 11.03.2021 (Протокол № 10).

3. Установить в качестве даты исполнения обязательств по уплате дополнительных платежей, указанных в п. 1 настоящего Распоряжения, 19.04.2021 г.
4. Установить, что исполнение обязательств по уплате дополнительных платежей осуществляется в соответствии со Спецификациями и Правилами клиринга Небанковской кредитной организации-центрального контрагента «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество). Часть VI. Правила клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ, утвержденными решением Наблюдательного совета НКО НКЦ (АО) от 26.06.2020 г. (Протокол № 22).