

Зарегистрировано в Национальном реестре правовых актов

Республики Беларусь 15 декабря 2023 г. N 8/40822

ПОСТАНОВЛЕНИЕ ПРАВЛЕНИЯ НАЦИОНАЛЬНОГО БАНКА РЕСПУБЛИКИ БЕЛАРУСЬ

6 декабря 2023 г. N 428

ОБ УТВЕРЖДЕНИИ ИНСТРУКЦИИ О ТРЕБОВАНИЯХ ПО ОСУЩЕСТВЛЕНИЮ ОПЕРАЦИЙ С ФИНАНСОВЫМИ ИНСТРУМЕНТАМИ СРОЧНЫХ СДЕЛОК

На основании абзаца восемнадцатого статьи 26 и части первой статьи 39 Банковского кодекса Республики Беларусь, подпунктов 2.1 и 2.3 пункта 2 статьи 6 Закона Республики Беларусь от 22 июля 2003 г. N 226-З "О валютном регулировании и валютном контроле", абзаца шестого статьи 10 Закона Республики Беларусь от 21 июня 2002 г. N 110-З "О драгоценных металлах и драгоценных камнях" Правление Национального банка Республики Беларусь ПОСТАНОВЛЯЕТ:

1. Утвердить Инструкцию о требованиях по осуществлению операций с финансовыми инструментами срочных сделок (прилагается).
2. Настоящее постановление вступает в силу с 1 января 2024 г.

Председатель Правления П.В.Каллаур

СОГЛАСОВАНО
Совет Министров
Республики Беларусь

УТВЕРЖДЕНО
Постановление Правления
Национального банка
Республики Беларусь
06.12.2023 N 428

ИНСТРУКЦИЯ

О ТРЕБОВАНИЯХ ПО ОСУЩЕСТВЛЕНИЮ ОПЕРАЦИЙ С ФИНАНСОВЫМИ ИНСТРУМЕНТАМИ СРОЧНЫХ СДЕЛОК

1. Настоящая Инструкция устанавливает требования по осуществлению операций с финансовыми инструментами срочных сделок в торговой системе открытого акционерного общества "Белорусская валютно-фондовая биржа" (далее - биржа).

2. Для целей настоящей Инструкции нижеперечисленные термины используются в следующих значениях:

базисный актив - лежащий в основе финансового инструмента срочных сделок и имеющий стоимостную оценку актив, поставляемый либо используемый для расчета при исполнении срочной сделки. Базисным активом могут являться белорусские рубли,

иностранная валюта, процентные ставки, драгоценные металлы, финансовые инструменты срочных сделок, за исключением ценных бумаг, производных ценных бумаг и иных финансовых инструментов срочных сделок, регулирование которых осуществляет республиканский орган государственного управления, осуществляющий государственное регулирование рынка ценных бумаг;

вариационная маржа - сумма денежных средств, требование (обязательство) уплаты которой возникает у сторон срочной сделки по результатам переоценки стоимости приобретенных (проданных) финансовых инструментов срочных сделок, проводимой путем оценки разности текущих и расчетных цен, осуществляемой в порядке, установленном биржей;

депозитная маржа - сумма денежных средств, внесенная участниками торгов для обеспечения исполнения обязательств по срочным сделкам;

закрытие позиции - прекращение у участника торгов совокупности прав и обязанностей по ранее заключенным сделкам;

клиенты - юридические и (или) физические лица, совершающие сделки с финансовыми инструментами срочных сделок через участников торгов на основании заключенных с ними договоров;

окончательная расчетная цена - цена финансового инструмента срочных сделок, определяемая в день его исполнения в порядке, установленном биржей;

открытие позиции - возникновение у участника торгов совокупности прав и обязанностей в результате совершения им срочных сделок, влекущее возникновение требований и обязательств;

позиция - совокупность прав и обязанностей, возникших у участника торгов в результате покупки (длинная позиция) или продажи (короткая позиция) финансового инструмента срочных сделок;

расчетная цена - цена финансового инструмента срочных сделок, рассчитанная по окончании торгов в соответствии с порядком, установленным биржей, и используемая для проведения переоценки приобретенных (проданных) финансовых инструментов срочных сделок и контроля лимитов колебания цен по финансовому инструменту срочных сделок. В день исполнения финансового инструмента срочных сделок расчетная цена равна окончательной расчетной цене;

спецификация финансового инструмента срочных сделок - локальный правовой акт биржи, определяющий стандартные условия финансового инструмента срочных сделок;

срочная сделка - совершенная в торговой системе биржи сделка с финансовым инструментом срочных сделок, влекущая приобретение ее сторонами прав и обязанностей в отношении базисного актива в соответствии со спецификацией. Срочные сделки не являются сделками пари;

текущая расчетная цена - цена финансового инструмента срочных сделок, рассчитанная в определенное время в ходе торгов финансовыми инструментами срочных сделок в соответствии с порядком, установленным биржей. В день исполнения финансового инструмента срочных сделок текущая расчетная цена равна окончательной расчетной цене;

торги - процесс совершения срочных сделок в торговой системе биржи;

торговая система биржи - совокупность программно-технических средств, баз данных, телекоммуникационных средств и другого оборудования биржи, обеспечивающих проведение торгов финансовыми инструментами срочных сделок;

трейдер - работник участника торгов, совершающий срочные сделки от имени участника торгов в пределах полномочий, предоставленных ему доверенностью участника торгов;

участники торгов - допущенные к совершению срочных сделок в торговой системе биржи в соответствии с ее локальными правовыми актами и заключенными с биржей договорами юридические лица, имеющие статус квалифицированного инвестора на рынке ценных бумаг, и лизинговые организации;

чистая позиция - позиция, определяемая как разница между длинными и короткими позициями по финансовому инструменту срочных сделок у участника торгов.

Термин "финансовый инструмент срочных сделок" применяется в значении, определенном подпунктом 2.35 пункта 2 статьи 13 Налогового кодекса Республики Беларусь.

3. Участники торгов могут совершать:

срочные сделки как от своего имени и за свой счет, так от и своего имени и за счет клиентов;

срочные сделки через трейдеров и несут ответственность за все их действия.

4. Биржа разрабатывает и утверждает локальные правовые акты, регулирующие порядок торговли финансовыми инструментами срочных сделок, и спецификации финансовых инструментов срочных сделок.

5. Локальные правовые акты, регулирующие порядок торговли финансовыми инструментами срочных сделок, предусматривают:

перечень базисных активов;

порядок допуска к торгам участников торгов и исключения их из числа участников торгов;

порядок совершения срочных сделок;

порядок раскрытия информации о наименовании и обозначении финансового инструмента срочных сделок и о совершенных срочных сделках;

систему управления рисками неисполнения обязательств по срочным сделкам.

6. Порядок совершения срочных сделок предусматривает:

порядок проведения торгов, включая порядок подачи в торговую систему биржи заявок участников торгов, их изменения и отзыва;

порядок открытия и закрытия позиций участников торгов, основания и порядок принудительного закрытия позиций участников торгов;

порядок доведения до участников торгов информации об условиях и порядке совершения срочных сделок;

порядок взаимозачета позиций (определение чистых позиций) по каждому финансовому инструменту срочных сделок по каждому участнику торгов;

порядок взимания платы за услуги биржи;

порядок определения размера и расчета депозитной и вариационной маржи;

порядок расчета текущей и расчетной цены приобретенных (проданных)

финансовых инструментов срочных сделок, а также порядок расчета их разницы;

порядок проведения переоценки приобретенных (проданных) финансовых инструментов срочных сделок.

7. Спецификации финансовых инструментов срочных сделок содержат:

наименование и обозначение финансового инструмента срочных сделок;

наименование и обозначение базисного актива;

минимальный лот (объем) базисного актива;

величину ценового пункта (шаг цены);

срок исполнения срочной сделки;

порядок определения окончательной расчетной цены;

порядок передачи базисного актива либо взаиморасчета между сторонами сделки в будущем в зависимости от изменения цены базисного актива;

первый и последний дни торгов или порядок определения таких дней.

8. Локальные правовые акты, регулирующие порядок торговли финансовыми инструментами срочных сделок, размещаются на официальном сайте биржи в глобальной компьютерной сети Интернет не позднее 2 рабочих дней, следующих за днем их утверждения.

9. Биржа из средств участников торгов и других источников с целью снижения рисков неисполнения или ненадлежащего исполнения обязательств по срочным сделкам участниками торгов в соответствии с законодательными актами может создавать фонды.

10. Биржа разрабатывает систему управления рисками неисполнения обязательств по срочным сделкам, которая содержит:

порядок установления лимитов колебания цен по каждому финансовому инструменту срочных сделок и контроля за их соблюдением;

порядок контроля за обеспечением обязательств участников торгов по депозитной и вариационной марже по каждому финансовому инструменту срочных сделок;

порядок установления лимитов на объем заключенных сделок и контроля за их соблюдением;

предельное значение доли каждого участника торгов по каждому финансовому инструменту срочных сделок;

меры по предотвращению чрезвычайных ситуаций, в том числе порядок приостановки торгов, принудительного закрытия позиций участников торгов;

меры по защите интересов клиентов участников торгов, в том числе в случае перехода клиента одного участника торгов на обслуживание к другому участнику торгов;

меры, применяемые к участникам торгов в случае нарушения локальных правовых актов биржи, регулирующих порядок торговли финансовыми инструментами срочных сделок;

иные меры, направленные на управление рисками при совершении срочных сделок и осуществлении расчетов по ним.

11. Биржа ведет реестр заявок, поданных участниками торгов, реестр срочных

сделок, обеспечивает формирование выписки из них за любой период.

12. Реестр заявок, поданных участниками торгов, содержит:

идентификационный номер заявки;

дату и время регистрации заявки в торговой системе биржи;

наименование и код участника торгов, подавшего заявку;

реквизиты и условия заявки;

иные сведения, определяемые биржей.

13. Реестр срочных сделок содержит:

идентификационный номер срочной сделки;

дату и время регистрации срочной сделки в торговой системе биржи;

наименование и код участника торгов, совершившего сделку;

наименование и обозначение финансового инструмента срочных сделок;

наименование и обозначение базисного актива;

количество срочных сделок и цену одного финансового инструмента срочных сделок;

сумму срочной сделки;

иные сведения, определяемые биржей.

14. Биржа не позднее 2 рабочих дней, следующих за днем совершения срочных сделок в торговой системе биржи, раскрывает информацию о совершенных срочных сделках на своем официальном сайте в глобальной компьютерной сети Интернет с соблюдением законодательства об информации, информатизации и защите информации.

Информация о совершенных в торговой системе биржи срочных сделках включает:

дату совершения срочной сделки;

наименование и обозначение финансового инструмента срочных сделок;

количество срочных сделок;

текущую и расчетную цену финансового инструмента срочных сделок;

сумму срочной сделки;

иные сведения, подлежащие раскрытию биржей в соответствии с ее локальными правовыми актами.

15. Участники торгов вносят депозитную и вариационную маржу только денежными средствами.

16. Участники торгов, заключающие срочные сделки за счет клиентов, обеспечивают ознакомление своих клиентов с системой управления рисками неисполнения обязательств по срочным сделкам, принятой биржей.

17. Порядок диверсификации рисков, связанных с совершением срочных сделок, определяется участником торгов.
