

ОАО «Белорусская валютно-фондовая биржа»

УТВЕРЖДЕНО

ПОЛОЖЕНИЕ

Протокол Наблюдательного совета

о гарантийных фондах валютного рынка ОАО «Белорусская валютно-фондовая биржа»

29.11.2016 № 30

ГЛАВА 1 ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ

1. Положение о гарантийных фондах валютного рынка ОАО «Белорусская валютно-фондовая биржа» (далее – Положение) разработано в соответствии с Указом Президента Республики Беларусь от 18.01.2016 № 12 «Об открытом акционерном обществе «Белорусская валютно-фондовая биржа», Инструкцией Национального банка Республики Беларусь, утвержденной постановлением Правления Национального банка Республики Беларусь от 14.06.2016 № 322 «О порядке биржевой торговли иностранной валютой» (далее – Инструкция), Уставом открытого акционерного общества «Белорусская валютно-фондовая биржа», утвержденным решением Общего собрания акционеров ОАО «Белорусская валютно-фондовая биржа» от 17.03.2016 №1 (далее – Устав) и локальными нормативными правовыми актами ОАО «Белорусская валютно-фондовая биржа», регулирующими порядок осуществления клиринга и расчетов по биржевым сделкам с иностранной валютой.

2. Настоящее Положение устанавливает порядок создания, учета и использования средств гарантийных фондов валютного рынка, создаваемых ОАО «Белорусская валютно-фондовая биржа» (далее – биржа) в целях снижения рисков неисполнения обязательств участниками клиринга по совершенным на бирже сделкам. Настоящее Положение, все изменения и дополнения к нему согласовываются с Национальным банком Республики Беларусь и утверждаются Наблюдательным советом биржи.

3. В настоящем Положении применяются следующие термины и их определения:

правила клиринга и расчетов – совокупность локальных нормативных правовых актов клиринговой организации, регулирующих порядок осуществления клиринга и расчетов и согласованных в установленном порядке с Национальным банком Республики Беларусь;

клиринговая организация – ОАО «Белорусская валютно-фондовая биржа»;

участник клиринга – участник торгов, которому клиринговая организация оказывает клиринговые услуги на основании заключенного с ним договора;

клиринговый регистр – форма осуществляемого клиринговой организацией учета обязательств, допущенных к клирингу, а также средств, предназначенных для исполнения таких обязательств, в том числе средств, аккумулируемых в гарантийных фондах;

счета клиринговой организации для учета средств гарантийного фонда – отдельные лицевые счета, открываемые клиринговой организацией, на которых учитываются денежные средства, аккумулируемые в гарантийных фондах (далее – денежный счет клиринговой организации для учета средств гарантийного фонда), или отдельный счет «депо» (раздел счета «депо») клиринговой организации, на котором хранятся и учитываются ценные бумаги, аккумулируемые в гарантийных фондах (далее – счет «депо» клиринговой организации для учета средств гарантийного фонда);

недобросовестный участник клиринга – участник клиринга, допустивший неисполнение или ненадлежащее исполнение обязательств, включенных в клиринговый пул;

добросовестный участник клиринга – участник клиринга, своевременно и надлежащим образом исполнивший обязательства, включенные в клиринговый пул;

торговые активы – национальная валюта или иностранная валюта, производные финансовые инструменты и другое имущество, являющееся предметом обязательств, допущенных к клирингу.

4. Термины, не определенные в настоящем Положении, используются в значениях, установленных Инструкцией и иным законодательством, правилами клиринга и расчетов, и другими локальными нормативными правовыми актами биржи.

ГЛАВА 2 ПОРЯДОК ФОРМИРОВАНИЯ И УЧЕТА СРЕДСТВ ГАРАНТИЙНЫХ ФОНДОВ

5. В случаях, предусмотренных правилами клиринга и расчетов, с целью снижения рисков неисполнения и ненадлежащего исполнения обязательств, допущенных к клирингу, клиринговая организация создает гарантийные фонды.

6. Клиринговая организация вправе создавать несколько гарантийных фондов. Для каждого гарантийного фонда, создаваемого клиринговой организацией, разрабатывается Спецификация гарантийного фонда (далее – Спецификация). Спецификация согласовывается с

Национальным банком Республики Беларусь и утверждается Наблюдательным советом биржи.

7. Средства, аккумулируемые в гарантийном фонде, могут формироваться за счет взносов клиринговой организации и/или центрального контрагента, участников клиринга. Взаимоотношения клиринговой организации, участников клиринга, центрального контрагента в процессе создания, учета, хранения, использования и размещения средств гарантийного фонда регулируются настоящим Положением, правилами клиринга и расчетов, Спецификациями и коллективным соглашением об участии в гарантийном фонде, заключаемом клиринговой организацией, участниками клиринга и центральным контрагентом (далее – Соглашение об участии в гарантийном фонде).

8. Средства клиринговой организации, направляемые ею в качестве взносов в гарантийные фонды, могут быть внесены в один из гарантийных фондов или распределяться между несколькими созданными клиринговой организацией гарантийными фондами. Порядок распределения указанных средств клиринговой организации между гарантийными фондами определяет Наблюдательный совет биржи.

9. Клиринговая организация может производить отчисления части чистой прибыли в один или несколько созданных ею гарантийных фондов.

10. В качестве взноса в гарантийный фонд могут использоваться денежные средства в национальной или иностранной валюте, а также бездокументарные эмиссионные ценные бумаги. Перечень валют и ценных бумаг, которые могут использоваться в качестве взносов в гарантийный фонд, устанавливается Спецификацией. В случае изменения вышеуказанного перечня средства, не удовлетворяющие новым требованиям, подлежат замене в сроки и порядке, установленные Спецификацией.

11. Размер обязательного взноса в гарантийный фонд участника клиринга, центрального контрагента и клиринговой организации устанавливается Спецификацией. В сроки и порядке, установленные Спецификацией, клиринговая организация вправе:

11.1. производить перерасчет размера взноса участника клиринга в гарантийный фонд;

11.2. в одностороннем порядке пересматривать требования к размеру обязательного взноса в гарантийный фонд.

12. Министерство финансов Республики Беларусь и Национальный банк Республики Беларусь не участвуют в формировании гарантийного фонда.

13. В случае если фактический размер взноса в гарантийный фонд:

13.1. меньше размера обязательного взноса, установленного Спецификацией, – участник клиринга и/или центральный контрагент обязаны в порядке, установленном Спецификацией, довести недостающие средства в гарантийный фонд;

13.2. превысил размер обязательного взноса в гарантийный фонд – участник клиринга вправе подать клиринговой организации распоряжение на возврат части взноса в сроки и порядке, установленные Спецификацией.

14. Информация о размере каждого гарантийного фонда, сформированного клиринговой организацией, публикуется на официальном Интернет-сайте биржи (www.bcse.by).

15. Порядок внесения, особенности использования взноса в гарантийный фонд, не урегулированные настоящим Положением, а также порядок его возврата участнику клиринга устанавливаются Спецификацией и правилами клиринга и расчетов.

16. В случаях, предусмотренных настоящим Положением, Спецификацией или правилами клиринга и расчетов, участник клиринга, центральный контрагент и клиринговая организация обязаны довести средства в гарантийный фонд. При невыполнении участником клиринга/центральным контрагентом требований о доведении средств в гарантийный фонд клиринговая организация вправе:

16.1. в одностороннем порядке отказаться от исполнения своих обязательств в отношении данного участника клиринга/центрального контрагента и расторгнуть договор с участником клиринга/договор с центральным контрагентом;

16.2. требовать возмещения убытков, причиненных клиринговой организации, центральному контрагенту и другим участникам клиринга в результате неисполнения или ненадлежащего исполнения указанного требования;

16.3. удержать требуемую сумму денежных средств/количества ценных бумаг в случаях, предусмотренных правилами клиринга и расчетов, с торговых счетов участников клиринга;

16.4. требовать уплаты неустойки в пользу клиринговой организации. Размер неустойки и порядок ее уплаты определяются Спецификацией;

16.5. применить иные санкции, предусмотренные правилами клиринга и расчетов.

17. Средства гарантийных фондов должны быть обособлены от иных средств клиринговой организации, центрального контрагента, а также участников клиринга.

18. Учет средств гарантийного фонда осуществляется на счетах клиринговой организации для учета средств гарантийного фонда.

19. Клиринговая организация на клиринговых регистрах обязана вести внутренний учет лиц, которые внесли взносы в гарантийный фонд, учет средств, переданных в качестве таких взносов, использования средств для удовлетворения требований в связи с неисполнением или ненадлежащим исполнением обязательств, допущенных к клирингу, а также средств, подлежащих возврату в случае прекращения договора на оказание

клиринговых услуг, заключенного с участником клиринга, или договора, заключенного с центральным контрагентом.

20. При расторжении договора, заключенного с клиринговой организацией, сроки и порядок возврата вклада участника клиринга/центрального контрагента в гарантийный фонд определяются Спецификацией.

21. Клиринговая организация вправе размещать от своего имени денежные средства гарантийных фондов на счетах, включая счета по вкладам (депозитам) в Национальном банке Республики Беларусь и иных банках, в государственные ценные бумаги Республики Беларусь, ценные бумаги Национального банка Республики Беларусь, облигации банков и ОАО «Банк развития Республики Беларусь», в порядке, определенном по согласованию с Национальным банком. Порядок размещения денежных средств конкретного гарантийного фонда определяется Спецификацией.

ГЛАВА 3 ПОРЯДОК ИСПОЛЬЗОВАНИЯ СРЕДСТВ ГАРАНТИЙНЫХ ФОНДОВ

22. Средства гарантийного фонда используются для исполнения обязательств любого из участников клиринга и/или центрального контрагента в случае неисполнения или ненадлежащего исполнения ими обязательств, включенных в клиринговый пул. Для исполнения обязательств участника клиринга/центрального контрагента использование средств гарантийного фонда осуществляется в следующем порядке:

22.1. сначала используются средства, переданные в гарантийный фонд недобросовестным участником клиринга/центральным контрагентом, допустившим неисполнение или ненадлежащее исполнение обязательств;

22.2. в случае недостаточности вышеуказанных средств, в первоочередном порядке используются средства центрального контрагента, затем средства клиринговой организации, переданные в гарантийный фонд;

22.3. в случае недостаточности средств, переданных в гарантийный фонд недобросовестным участником клиринга, а также взносов в гарантийный фонд центрального контрагента и клиринговой организации, используются взносы других участников клиринга. Порядок расчета размера вклада добросовестного участника, используемого для исполнения обязательств недобросовестного участника, устанавливается Спецификацией.

23. Удовлетворение требований по обязательствам недобросовестного участника клиринга/центрального контрагента, не исполнившего или ненадлежащим образом исполнившего свои обязательства, осуществляется клиринговой организацией по ее выбору путем:

23.1. передачи средств гарантийного фонда кредитору;

23.2. продажи национальной, иностранной валюты или ценных бумаг, внесенных в качестве взносов в гарантийный фонд, в том числе на условиях, предусмотренных заключенным Национальным банком Республики Беларусь и биржей Соглашением о проведении валютных операций в рамках системы гарантированного исполнения сделок, с передачей вырученных от продажи денежных средств кредитору или приобретения за счет вырученных денежных средств иных торговых активов и передачей их кредитору;

23.3. приобретения за счет денежных средств гарантийного фонда торговых активов и передачи их кредитору;

23.4. заключения за счет средств гарантийного фонда сделок СВОП, сделок РЕПО, иных сделок, предусмотренных настоящим Положением, Спецификацией или правилами клиринга и расчетов, и передачи торговых активов, полученных по данным сделкам, кредитору;

23.5. использования иных механизмов, предусмотренных правилами клиринга и расчетов.

24. Порядок и условия проведения операций, указанных в пункте 23 настоящего Положения, определяются правилами клиринга и расчетов, иными локальными нормативными правовыми актами клиринговой организации, а также соглашением об участии в гарантийном фонде.

25. Удовлетворение требований за счет средств гарантийного фонда, в том числе путем его продажи, может осуществляться без предварительного уведомления участников клиринга, центрального контрагента, взносы которых составляют средства гарантийного фонда, без решения суда или иного государственного органа, местного исполнительного и распорядительного органа власти, проведения публичных торгов, за исключением случаев, когда соблюдение указанных условий предусмотрено правилами клиринга и расчетов. Правилами клиринга и расчетов могут быть предусмотрены иные условия, соблюдение которых необходимо для удовлетворения требований за счет средств гарантийного фонда.

26. Спецификацией могут быть установлены ограничения:

26.1. на использование средств гарантийного фонда для исполнения обязательств одного или нескольких недобросовестных участников клиринга/центрального контрагента;

26.2. на использование средств гарантийного фонда для исполнения обязательств недобросовестных участников клиринга/центрального контрагента, рассчитанного по итогам одного или нескольких клиринговых дней, одного или нескольких клиринговых пулов;

26.3. на использование взноса клиринговой организации для исполнения обязательств недобросовестных участников клиринга;

26.4. на использование взносов добросовестных участников клиринга для исполнения обязательств недобросовестных участников клиринга;

26.5. другие лимиты, ограничивающие использование средств гарантийного фонда.

ГЛАВА 4 ПОРЯДОК ВОССТАНОВЛЕНИЯ СРЕДСТВ ГАРАНТИЙНЫХ ФОНДОВ

27. Участник клиринга/центральный контрагент, неисполнение которым обязательств повлекло удовлетворение требований кредиторов за счет взносов в гарантийный фонд иных лиц в порядке и сроки, установленные настоящим Положением и Спецификацией, обязан возместить таким лицам стоимость использованных средств путем их доведения в гарантийный фонд, или иным способом, установленным Спецификацией и уплатить неустойку в пользу клиринговой организации, размер которой устанавливается Спецификацией.

28. Возмещение взносов иных лиц производится в порядке, обратном их использованию:

28.1. сначала возмещаются взносы добросовестных участников клиринга;

28.2. затем – взносы центрального контрагента, надлежащим образом исполнившего обязательства;

28.3. далее – взносы клиринговой организации.

29. Возмещение взносов может производиться путем доведения средств в гарантийный фонд или иным способом, установленным Спецификацией.

30. Расчет размера взноса недобросовестного и добросовестного участников клиринга, подлежащих восстановлению, производится в порядке, установленном Спецификацией.

31. В день, в который были использованы средства гарантийного фонда, клиринговая организация уведомляет участников клиринга и центрального контрагента в порядке, определенном Спецификацией, о размере использованного взноса и условиях его восстановления.

В случае неисполнения участником клиринга/центральным контрагентом требований пункта 27 настоящего Положения участник клиринга/центральный контрагент, надлежаще исполнивший свои обязательства, обязан внести дополнительные средства в гарантийный фонд до восстановления установленного для них размера взноса. Порядок возмещения убытков участника клиринга/центрального контрагента, надлежаще исполнившего свои обязательства и внесшего дополнительные средства в гарантийный фонд для восстановления установленного для них размера взноса, понесенных в связи с неисполнением участником клиринга/центральным контрагентом требований пункта 27 настоящего Положения, определяется Соглашением об участии в гарантийном фонде.

32. В случае неисполнения недобросовестным участником клиринга/центральным контрагентом требований пункта 27 настоящего Положения добросовестный участник клиринга/центральный контрагент,

надлежаще исполнивший свои обязательства, обязан внести дополнительные средства в гарантийный фонд до восстановления установленного для них размера вноса. Порядок возмещения добросовестному участнику клиринга/центральному контрагенту внесенных в гарантийный фонд дополнительных средств определяется Соглашением об участии в гарантийном фонде.

33. В случае невыполнения участниками клиринга/центральным контрагентом требований, установленных пунктами 27 и 32 настоящего Положения, к ним применяются санкции, предусмотренные пунктом 16 настоящего Положения.

СОГЛАСОВАНО

Национальный банк
Республики Беларусь

05.08.2016