

Открытое акционерное общество
«Белорусская валютно-фондовая
биржа»

(ОАО «Белорусская валютно-
фондовая биржа»)

УТВЕРЖДЕНО

Протокол заседания
Правления

23.11.2018 № 74

Правила осуществления клиринга
и расчетов по биржевым сделкам
с иностранной валютой в
ОАО «Белорусская валютно-
фондовая биржа»

(с изменениями и дополнениями,
утвержденными протоколом заседания Правления ОАО «Белорусская
валютно-фондовая биржа» от 01.03.2019 №17. Вступили в силу 12.03.2019;
утвержденными протоколом заседания Правления ОАО «Белорусская
валютно-фондовая биржа» от 16.09.2019 №56. Вступили в силу 07.10.2019)

ГЛАВА 1 ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ

1. Правила осуществления клиринга и расчетов по биржевым сделкам с иностранной валютой в ОАО «Белорусская валютно-фондовая биржа» (далее – Правила) разработаны в соответствии с Уставом ОАО «Белорусская валютно-фондовая биржа» (далее – Биржа), Инструкцией о порядке биржевой торговли иностранной валютой, утвержденной постановлением Правления Национального банка Республики Беларусь от 14.06.2016 №322 (далее – Инструкция), Правилами проведения торгов иностранными валютами в ОАО «Белорусская валютно-фондовая биржа» (далее – Правила торгов) и иными локальными правовыми актами Биржи.

2. Настоящие Правила устанавливают условия и порядок осуществления клиринга и расчетов по биржевым сделкам (далее – сделки) с иностранной валютой с использованием торговых счетов биржи и торговых счетов участников торгов.

3. Для целей настоящих Правил используются термины и их определения в следующих значениях:

добросовестный участник клиринга – участник клиринга, своевременно и надлежащим образом исполнивший нетто-обязательства в соответствии с настоящими Правилами;

клиринг по сделкам – определение подлежащих исполнению обязательств по совершенным сделкам в результате осуществления неттинга и подготовка документов (информации), являющихся основанием для прекращения и (или) исполнения таких обязательств (далее – клиринг);

клиринговый регистр – форма осуществляемого Биржей учета обязательств, допущенных к клирингу, а также средств, предназначенных для исполнения таких обязательств (в том числе средств гарантийного фонда);

корреспондентские счета Биржи – корреспондентские счета, открытые Биржей в белорусских рублях в Национальном банке Республики Беларусь, а также в иностранной валюте в банках Республики Беларусь и в банках-нерезидентах за пределами Республики Беларусь (далее все вместе и по отдельности – расчетные банки);

недобросовестный участник клиринга – участник клиринга, не исполнивший или ненадлежащим образом исполнивший нетто-обязательства в соответствии с настоящими Правилами;

расчетно-клиринговые услуги – предоставляемые Биржей участникам клиринга услуги по осуществлению клиринга и расчетов по сделкам;

расчеты по сделкам – перечисление денежных средств для исполнения обязательств по результатам клиринга (далее – расчеты).

Иные термины и определения, используемые в настоящих Правилах, понимаются в значениях, определенных для них Инструкцией и Правилами торгов.

4. Биржа осуществляет клиринг и расчеты по сделкам с финансовыми инструментами, перечень которых приведен в приложении 1 к настоящим Правилам.

5. Клиринг осуществляется без участия центрального контрагента.

Расчеты по сделкам проводятся в белорусских рублях и иностранной валюте через торговые счета биржи, открываемые Биржей на отдельных лицевых счетах балансового счета, предназначенного для учета расчетов на основе клиринга, и торговые счета участников торгов, открываемые Биржей для участников клиринга на отдельных лицевых счетах балансового счета, предназначенного для учета расчетов по операциям с иностранной валютой (далее – торговые счета участников клиринга).

6. Биржа принимает меры, направленные на снижение рисков, возникающих в процессе осуществления клиринга и расчетов по сделкам, а также предусматривает порядок урегулирования случаев неисполнения или ненадлежащего исполнения нетто-обязательств участниками клиринга.

7. Все изменения и дополнения в настоящие Правила согласовываются с Национальным банком Республики Беларусь (далее – Национальный банк), утверждаются соответствующим органом управления Биржи и доводятся до сведения участников клиринга не позднее чем за пять рабочих дней до дня вступления их в силу общим извещением посредством Системы межведомственного электронного документооборота, в форме документа по электронной почте, а также размещением пресс-релиза на официальном сайте Биржи в глобальной компьютерной сети Интернет (www.bcse.by).

8. Все приложения к настоящим Правилам являются их неотъемлемой частью.

ГЛАВА 2 УСЛОВИЯ ОСУЩЕСТВЛЕНИЯ КЛИРИНГА

9. К клирингу допускаются исключительно обязательства и требования по сделкам с кодами расчетов S-T+n и SWAP/S-REPO, совершенным участниками клиринга в торговой системе Биржи.

10. Биржей осуществляется клиринг без обеспечения, клиринг с частичным обеспечением и/или клиринг с полным обеспечением.

При осуществлении клиринга с частичным обеспечением или полным обеспечением обязательства допускаются к клирингу после процедуры контроля достаточности индивидуального клирингового обеспечения, которая осуществляется в торговой системе Биржи в режиме реального времени в соответствии с Операционным регламентом торгового дня по сделкам с иностранной валютой в ОАО «Белорусская валютно-фондовая биржа» (далее – Операционный регламент).

11. При осуществлении клиринга в клиринговый пул Биржей включаются обязательства и требования участников клиринга по сделкам с наступившей датой исполнения.

12. Для обеспечения исполнения и/или исполнения обязательств, допущенных к клирингу, Биржа может устанавливать требования о наличии у участников клиринга предварительного (до момента совершения сделок) индивидуального клирингового обеспечения в соответствии с коэффициентами обеспечения обязательств в белорусских рублях и каждой иностранной валюте, являющейся валютой лота и/или сопряженной валютой финансовых инструментов с кодами расчетов S-T+n и SWAP/S-REPO (далее – коэффициент индивидуального клирингового обеспечения), установленными на основании решения Правления Биржи.

13. Денежные средства в белорусских рублях, учитываемые в качестве индивидуального клирингового обеспечения, участники клиринга перечисляют на соответствующие торговые счета участников клиринга, открытые на балансе Биржи.

Денежные средства в иностранной валюте, учитываемые в качестве индивидуального клирингового обеспечения, участники клиринга перечисляют на соответствующие корреспондентские счета Биржи, открытые в расчетных банках (с указанием номера торгового счета, открытого на балансе Биржи для данного участника клиринга в соответствующей иностранной валюте).

14. Индивидуальное клиринговое обеспечение участников клиринга в белорусских рублях и/или иностранной валюте используется в следующей очередности:

для исполнения неисполненных нетто-обязательств с прошедшей датой исполнения (в случае совпадения валюты индивидуального клирингового обеспечения с валютой нетто-обязательства);

для обеспечения исполнения нетто-обязательств по сделкам;

для исполнения нетто-обязательств по сделкам с наступившей датой исполнения.

Индивидуальное клиринговое обеспечение по сделкам с датой исполнения, отличной от текущей, блокируется на торговом счете участника клиринга до наступления даты исполнения.

Индивидуальное клиринговое обеспечение по сделкам с наступившей датой исполнения:

используется для исполнения нетто-обязательства, если валюта индивидуального клирингового обеспечения совпадает с валютой нетто-обязательства;

блокируется на торговом счете участника клиринга до момента полного исполнения им нетто-обязательств, если валюта индивидуального клирингового обеспечения не совпадает с валютой нетто-обязательства.

15. Расчет индивидуального клирингового обеспечения, необходимого для обеспечения исполнения нетто-обязательств по сделкам, осуществляется в соответствии с приоритетом использования валют индивидуального клирингового обеспечения, установленным Биржей в торговой системе (белорусский рубль, доллар США, евро, российский рубль).

Участник клиринга посредством торговой системы может изменять установленный Биржей приоритет использования валют индивидуального клирингового обеспечения в белорусских рублях и/или иностранной валюте для обеспечения исполнения нетто-обязательств по сделкам в сроки, определенные Временным регламентом.

16. В случае принудительного закрытия нетто-позиций участника клиринга, внесшего взнос в гарантийный фонд, при неисполнении или ненадлежащем исполнении им нетто-обязательств, включенных в клиринговый пул, Биржа вправе использовать средства гарантийного фонда.

Порядок формирования, использования и учета средств гарантийного фонда определен Положением о гарантийных фондах валютного рынка ОАО «Белорусская валютно-фондовая биржа» (далее – Положение о гарантийных фондах).

ГЛАВА 3 ТОРГОВЫЕ СЧЕТА И КЛИРИНГОВЫЕ РЕГИСТРЫ

17. Для учета денежных средств, которые могут быть использованы для обеспечения исполнения нетто-обязательств и/или исполнения обязательств, допущенных к клирингу, Биржа открывает торговые счета участников клиринга в белорусских рублях и иностранной валюте по видам валют.

Для проведения расчетов Биржа открывает торговые счета биржи в белорусских рублях и иностранной валюте по видам валют.

При проведении расчетов Биржа выполняет списание денежных средств (по видам валют) с торговых счетов участников клиринга на торговые счета

биржи в размере нетто-обязательств участников клиринга и перечисление денежных средств с соответствующих торговых счетов биржи на торговые счета участников клиринга в размере нетто-требований участников клиринга.

18. Для организации системы внутреннего учета Биржи используются клиринговые регистры.

Биржа формирует клиринговые регистры в электронном виде, обеспечивая возможность представления учитываемой информации на бумажных носителях.

В клиринговых регистрах Биржей учитываются следующие данные по каждому участнику клиринга:

18.1. индивидуальное клиринговое обеспечение в белорусских рублях и/или каждой иностранной валюте;

18.2. нетто-обязательства (нетто-требования) в белорусских рублях и/или каждой иностранной валюте;

18.3. денежные средства, подлежащие возврату на условиях, предусмотренных настоящими Правилами;

18.4. денежные средства, учитываемые в качестве вноса в гарантийный фонд.

19. Значения соответствующих клиринговых регистров изменяются по мере:

зачисления участниками клиринга индивидуального клирингового обеспечения на торговые счета участников клиринга;

исполнения нетто-требований и нетто-обязательств;

осуществления возвратов денежных средств на банковские счета участников клиринга;

использования средств гарантийного фонда, возмещения взносов в гарантийный фонд, а также возврата участникам клиринга взносов (части взносов) в гарантийный фонд.

ГЛАВА 4 СИСТЕМА УПРАВЛЕНИЯ РИСКАМИ

20. Меры, применяемые в целях снижения рисков при проведении торгов иностранными валютами, приведены в Операционном регламенте.

21. В целях снижения рисков, возникающих при осуществлении клиринга и расчетов, Биржа может применять следующие меры:

21.1. устанавливать требования к участникам клиринга о наличии индивидуального клирингового обеспечения и осуществлять контроль его достаточности для совершения сделок;

21.2. формировать и использовать гарантийный фонд;

21.3. осуществлять перечисление участникам клиринга нетто-требований в белорусских рублях и/или иностранной валюте при условии выполнения участниками клиринга соответствующих нетто-обязательств;

21.4. пересчитывать размер обязательного вноса каждого участника клиринга в гарантийный фонд в порядке и сроки, установленные спецификацией гарантийного фонда валютного рынка ОАО «Белорусская валютно-фондовая биржа» (далее – спецификация гарантийного фонда);

21.5. контролировать восстановление участниками клиринга использованных средств гарантийного фонда;

21.6. представлять Национальному банку информацию о недобросовестных участниках клиринга и объемах неисполненных ими нетто-обязательств в белорусских рублях и/или иностранной валюте;

21.7. осуществлять принудительное закрытие нетто-позиций недобросовестных участников клиринга в ходе торговых сессий и/или специальных сессий в случаях неисполнения или ненадлежащего исполнения ими нетто-обязательств;

21.8. принимать решение о временном переводе недобросовестных участников клиринга, а также участников клиринга, в отношении которых введены меры воздействия со стороны Национального банка, на режим предварительного зачисления денежных средств с коэффициентом индивидуального клирингового обеспечения, равным 1.

ГЛАВА 5

РАСЧЕТНО-КЛИРИНГОВОЕ ОБСЛУЖИВАНИЕ. ТРЕБОВАНИЯ К УЧАСТНИКАМ КЛИРИНГА

22. Биржа оказывает участнику клиринга расчетно-клиринговые услуги на основании Договора об оказании расчетно-клиринговых услуг по биржевым сделкам с иностранной валютой (далее – Договор).

23. Перечень расчетно-клиринговых услуг, предоставляемых Биржей участникам клиринга, включает:

сбор, сверку, корректировку информации по сделкам;

определение нетто-требований и нетто-обязательств;

контроль наличия (достаточности) индивидуального клирингового обеспечения с учетом установленного участнику клиринга режима зачисления денежных средств;

контроль размеров обязательного вноса участника клиринга в гарантийный фонд и проведение мероприятий по использованию и/или восстановлению средств гарантийного фонда;

обеспечение гарантий завершения расчетов с добросовестными участниками клиринга в соответствии с настоящими Правилами;

подготовку документов, являющихся основанием для прекращения и/или исполнения обязательств, и представление указанных документов участникам клиринга для проведения расчетов;

открытие торговых счетов участников клиринга на балансе Биржи;

зачисление на торговые счета участников клиринга денежных средств и их учет в качестве индивидуального клирингового обеспечения;

списание по результатам клиринга нетто-обязательств участников клиринга с их торговых счетов на торговые счета биржи;

зачисление нетто-требований на торговые счета участников клиринга;

подготовку платежных документов, необходимых для осуществления возврата денежных средств при исполнении заявок, поданных участниками клиринга в ходе торгов и в виде письменных обращений;

перевод денежных средств с торговых счетов участников клиринга на счета участников клиринга в соответствии с представленными ими Бирже платежными реквизитами (далее – банковские счета участников клиринга);

иные услуги, определенные в Договоре.

24. Права и обязанности Биржи и участников клиринга, возникающие в связи с осуществлением клиринга и расчетов, определяются настоящими Правилами и Договором.

25. Биржа и участники клиринга несут ответственность за несоблюдение настоящих Правил и Договора в соответствии с законодательством Республики Беларусь, Договором, иными локальными правовыми актами Биржи.

26. Биржа вправе отказаться от исполнения Договора в случаях, предусмотренных Договором, а также в случае нарушения участником клиринга требований, предъявляемых к нему настоящими Правилами и Договором.

27. Участник клиринга обязан представить на Биржу письмо с информацией о реквизитах его банковских счетов в белорусских рублях и иностранной валюте, которые необходимо использовать для зачисления денежных средств. Информация о реквизитах банковских счетов участника клиринга оформляется в соответствии с приложением 2 к настоящим Правилам.

Участник клиринга несет ответственность за достоверность и полноту представленных реквизитов и обязан своевременно извещать Биржу об их изменении.

28. Список корреспондентских счетов Биржи приведен в приложении к Договору.

ГЛАВА 6 ОБЩИЙ ПОРЯДОК ОСУЩЕСТВЛЕНИЯ РАСЧЕТОВ

29. Сроки осуществления клиринга, представления документов Бирже (Биржей) в процессе взаимодействия с участниками клиринга при осуществлении клиринга и расчетов, а также перечисления денежных средств участниками клиринга (участникам клиринга) для исполнения обязательств в соответствии с настоящими Правилами, устанавливаются Временным регламентом осуществления клиринга и расчетов по биржевым сделкам с иностранной валютой (далее – Временной регламент), приведенным в приложении 3 к настоящим Правилам.

30. Датой и временем перечисления участниками клиринга денежных средств в белорусских рублях считаются дата и время зачисления денежных средств в белорусских рублях на торговые счета участников клиринга.

31. Датой и временем перечисления участниками клиринга денежных средств в иностранной валюте на торговые счета участников клиринга считаются дата и время получения Биржей уведомлений из расчетных банков о зачислении денежных средств в иностранной валюте на корреспондентские счета Биржи.

32. Датой и временем перечисления Биржей денежных средств в белорусских рублях и иностранной валюте участникам клиринга считаются дата и время зачисления Биржей указанных денежных средств на торговые счета участников клиринга.

33. Направление в расчетные банки участниками клиринга, имеющими обязательства в иностранной валюте, поручений на перевод иностранной валюты на корреспондентские счета Биржи с указанием предыдущей даты валютирования не допускается.

34. При определении сроков перечисления Биржей денежных средств в белорусских рублях не учитываются выходные, праздничные дни, объявленные нерабочими в Республике Беларусь.

При определении сроков перечисления Биржей денежных средств в иностранной валюте не учитываются выходные, праздничные дни, объявленные нерабочими в Республике Беларусь, стране местонахождения расчетных банков по соответствующей валюте и стране – эмитенте соответствующей валюты.

В случае, если дата исполнения по финансовому инструменту (в валюте лота и/или сопряженной валюте) приходится на нерасчетный день, то дата исполнения по этому финансовому инструменту автоматически переносится на ближайший следующий за ним расчетный день.

35. Обмен электронными документами между участниками клиринга и Биржей осуществляется посредством системы электронного документооборота (далее – СЭД) и/или системы SWIFT.

Формирование и передача электронных документов посредством СЭД осуществляется в соответствии с Положением об электронном документообороте в ОАО «Белорусская валютно-фондовая биржа» и Соглашением о применении средств криптографической защиты информации в СЭД ОАО «Белорусская валютно-фондовая биржа».

Электронные документы, направляемые посредством системы SWIFT, формируются в форматах, установленных стандартами SWIFT.

36. Межбанковские расчеты в белорусских рублях производятся через автоматизированную систему межбанковских расчетов Национального банка.

Электронные документы для проведения расчетов в иностранной валюте направляются посредством системы SWIFT.

ГЛАВА 7

РЕЖИМЫ ЗАЧИСЛЕНИЯ ДЕНЕЖНЫХ СРЕДСТВ УЧАСТНИКАМИ КЛИРИНГА

37. Участники клиринга могут производить зачисление денежных средств в следующих режимах:

37.1. в режиме срочного зачисления денежных средств – участник клиринга может совершать сделки без наличия предварительного индивидуального клирингового обеспечения. Зачисление белорусских рублей и/или иностранной валюты для исполнения нетто-обязательств участник клиринга обязан обеспечить в сроки, определенные Временным регламентом;

37.2. в режиме предварительного зачисления денежных средств – участник клиринга может совершать сделки исключительно при наличии предварительного индивидуального клирингового обеспечения в соответствии с установленным для него на основании решения Правления Биржи коэффициентом индивидуального клирингового обеспечения.

38. Национальному банку устанавливается режим срочного зачисления денежных средств.

Участникам клиринга, за исключением Национального банка, режим зачисления денежных средств устанавливается на основании решения Правления Биржи.

39. Участнику клиринга, не внесшему взнос в гарантийный фонд или внесшему указанный взнос в размере менее установленного спецификацией гарантийного фонда, может быть установлен только режим предварительного зачисления денежных средств с коэффициентом индивидуального клирингового обеспечения в соответствии с категорией, присвоенной участнику клиринга на основании Условий допуска к торгам в ОАО «Белорусская валютно-фондовая биржа».

40. Участнику клиринга, внесшему взнос в гарантийный фонд в размере не менее установленного спецификацией гарантийного фонда, может быть установлен режим срочного зачисления денежных средств или режим предварительного зачисления денежных средств с пониженным коэффициентом индивидуального клирингового обеспечения.

41. Участнику клиринга временно устанавливается режим предварительного зачисления денежных средств с коэффициентом индивидуального клирингового обеспечения (в белорусских рублях и иностранной валюте), равным 1, если для принудительного закрытия его нетто-позиций были использованы средства гарантийного фонда.

Со дня, следующего за днем возмещения недобросовестным участником клиринга использованных средств гарантийного фонда, данный участник клиринга переводится на ранее установленный на основании решения Правления Биржи режим зачисления денежных средств.

ГЛАВА 8 ОСУЩЕСТВЛЕНИЕ КЛИРИНГА И РАСЧЕТОВ

42. В сроки, установленные Временным регламентом, по результатам торгов в режиме «непрерывный двойной аукцион», на которых совершаются сделки с датой исполнения в день проведения торгов, Биржа:

42.1. формирует один или несколько клиринговых пулов, в которые включает обязательства и требования участников клиринга по сделкам с финансовыми инструментами, указанными в приложении 1 к настоящим Правилам, с наступившей датой исполнения;

42.2. осуществляет зачет включенных в клиринговый пул встречных однородных обязательств и требований участников клиринга в белорусских рублях и/или каждой иностранной валюте (в результате зачета обязательства по зачтенной части прекращаются);

42.3. определяет нетто-обязательства и/или нетто-требования каждого участника клиринга в белорусских рублях и каждой иностранной валюте (в части, в которой обязательства не были зачтены);

42.4. формирует клиринговые отчеты, в которых отражает нетто-обязательства и/или нетто-требования участников клиринга. Примерная форма клирингового отчета приведена в приложении 4 к настоящим Правилам;

42.5. осуществляет расчет и блокировку индивидуального клирингового обеспечения участников клиринга по совершенным сделкам, дата исполнения по которым отлична от текущей.

43. Клиринговый отчет подписывается уполномоченным сотрудником Биржи с использованием электронной цифровой подписи посредством СЭД. В случае невозможности использования СЭД клиринговый отчет выдается на бумажном носителе в двух экземплярах, которые подписываются уполномоченным работником Биржи, а также скрепляются печатью Биржи. Один экземпляр остается на Бирже, второй – представляется участнику клиринга.

44. Для исполнения нетто-обязательств участники клиринга обеспечивают зачисление денежных средств в соответствии с Временным регламентом:

44.1. в белорусских рублях – на торговый счет участника клиринга (с указанием номера и даты клирингового отчета);

44.2. в иностранной валюте – на корреспондентские счета Биржи в расчетных банках (с указанием торгового счета участника клиринга, номера и даты клирингового отчета).

45. В случае отсутствия в назначении платежа номера и даты клирингового отчета зачисленные участником клиринга денежные средства Биржа вправе не использовать для исполнения его нетто-обязательств до момента получения от данного участника клиринга дополнительной информации о назначении платежа.

46. В период времени, определенный Временным регламентом, участники клиринга могут зачислять на открытые для них торговые счета денежные средства, которые учитываются в качестве индивидуального клирингового обеспечения участника клиринга и используются для исполнения его нетто-обязательства в случае совпадения валюты зачисленных денежных средств с валютой нетто-обязательства.

47. Перечисление Биржей на торговые счета участников клиринга нетто-требований в белорусских рублях и/или иностранной валюте осуществляется:

47.1. при своевременном исполнении участниками клиринга нетто-обязательств в иностранной валюте и/или белорусских рублях;

47.2. в размере поступивших на корреспондентские счета Биржи денежных средств;

47.3. с использованием принципа распределения иностранной валюты между участниками клиринга, при котором осуществляется исполнение нетто-требований максимального количества участников клиринга (в порядке возрастания сумм итоговых нетто-требований в соответствующей валюте).

48. В случае исполнения участником клиринга нетто-обязательств в белорусских рублях и/или иностранной валюте не в полном объеме в сроки, определенные Временным регламентом, перечисление Биржей денежных средств на торговые счета участников клиринга осуществляется в объеме нетто-требований, уменьшенных на суммы денежных средств, эквивалентных неисполненной части нетто-обязательств.

Расчет сумм денежных средств, эквивалентных неисполненной части нетто-обязательств, выполняется по формуле:

$$V_{\text{неисп}j} = \left\{ \begin{array}{l} V_j, \text{ если } \sum_{k=1}^j V_k \times \frac{K_k^v \times r_k^v}{k_k} \leq \sum_{i=1}^n O_{\text{неисп}i} \times \frac{K_i^o \times r_i^o}{k_i} \times (1 + \gamma_i^o) - \sum_{m=1}^M S_m^{об} \times \frac{K_m^{об}}{k_m}, \\ \text{ceil} \left(\frac{\sum_{i=1}^n O_{\text{неисп}i} \times \frac{K_i^o \times r_i^o}{k_i} \times (1 + \gamma_i^o) - \sum_{k=1}^{j-1} V_k \times \frac{K_k^v \times r_k^v}{k_k} - \sum_{m=1}^M S_m^{об} \times \frac{K_m^{об}}{k_m}}{K_j^v} \right) \times k_j, \text{ если} \\ \sum_{k=1}^{j-1} V_k \times \frac{K_k^v \times r_k^v}{k_k} < \sum_{i=1}^n O_{\text{неисп}i} \times \frac{K_i^o \times r_i^o}{k_i} \times (1 + \gamma_i^o) - \sum_{m=1}^M S_m^{об} \times \frac{K_m^{об}}{k_m} < \sum_{k=1}^j V_k \times \frac{K_k^v \times r_k^v}{k_k} \\ 0, \text{ если } \sum_{k=1}^{j-1} V_k \times \frac{K_k^v \times r_k^v}{k_k} \geq \sum_{i=1}^n O_{\text{неисп}i} \times \frac{K_i^o \times r_i^o}{k_i} \times (1 + \gamma_i^o) - \sum_{m=1}^M S_m^{об} \times \frac{K_m^{об}}{k_m} \end{array} \right\},$$

где:

$V_{\text{неисп}j}$ – объем нетто-требований в валюте j , эквивалентный неисполненной участником клиринга части нетто-обязательств;

V_j – объем нетто-требований в валюте j , где j – номер валюты в сформированной последовательности валют для определения нетто-требований, которые не могут быть перечислены участнику клиринга в связи с неполным исполнением данным участником клиринга его нетто-обязательств (1 – белорусский рубль, 2 – доллар США, 3 – евро, 4 – российский рубль);

V_k – нетто-требования участника клиринга, определенные по результатам клиринга, в валюте k , где k – изменяющийся номер валюты от 1 до j ;

$S_m^{об}$ – индивидуальное клиринговое обеспечение участника клиринга в валюте m , не совпадающей с валютой нетто-обязательств;

$K_m^{об}$ – курс пересчета индивидуального клирингового обеспечения в валюте m в белорусские рубли, который устанавливается Операционным регламентом;

M – количество валют, использованных для индивидуального клирингового обеспечения участника клиринга, не совпадающих с валютой нетто-обязательств;

$O_{неисп\ i}$ – объем неисполненных участником клиринга нетто-обязательств в валюте i ;

K_k^v, K_j^v, K_i^o – установленные решением Правления Биржи курсы пересчета нетто-требований (нетто-обязательств) в валютах k, j, i в белорусские рубли;

r_k^v, r_i^o – коэффициенты корректировки курсов пересчета K_k^v и K_i^o , установленные решением Правления Биржи;

γ_i^o – коэффициент обеспечения обязательств в валюте i , установленный решением Правления Биржи;

k_k, k_i, k_j, k_m – количество единиц иностранной валюты для определения курсов пересчета K_k^v, K_j^v, K_i^o и $K_m^{об}$;

n – количество валют, в которых у участника клиринга имеются неисполненные нетто-обязательства;

ceil – функция округления вверх до целого числа.

Сформированная последовательность валют, используемая при перечислении денежных средств, может быть изменена по письменному обращению участника клиринга, направленному Бирже в период времени, установленный Временным регламентом для проведения расчетов с участниками клиринга.

49. Перечисление денежных средств с торговых счетов участников клиринга на их банковские счета, представленные в соответствии с пунктом 27 настоящих Правил, осуществляются Биржей в порядке и сроки, определенные Временным регламентом.

50. Участникам клиринга, чьи нетто-требования в иностранной валюте не могут быть перечислены на банковские счета в дату исполнения, в установленные Временным регламентом сроки посредством СЭД Биржа направляет уведомление о порядке проведения расчетов в соответствии с приложением 5 к настоящим Правилам.

В случае невозможности использования СЭД Биржа направляет уведомление о порядке проведения расчетов посредством факсимильной связи с досылкой оригинала в течение 3 рабочих дней.

Расчеты с участниками клиринга, которым было направлено уведомление о порядке проведения расчетов, производятся в соответствии с Временным регламентом.

После получения уведомления о порядке проведения расчетов участник клиринга может направить на Биржу посредством системы SWIFT заявку произвольной формы (тип сообщения – MT 999) на перечисление нетто-требований в иностранной валюте с торговых счетов участников клиринга на их банковские счета в дату исполнения (далее – заявка на перечисление иностранной валюты). Данная заявка должна содержать номер клирингового отчета и наименование иностранной валюты, а также может включать следующую дополнительную информацию:

максимально допустимую сумму иностранной валюты, подлежащую перечислению (не превышающую сумму нетто-требований);

банковский счет участника клиринга из числа представленных на Биржу, на который необходимо перечислить иностранную валюту;

предельно допустимое время в рамках Временного регламента, после наступления которого заявка не подлежит исполнению;

иные сведения, определяющие условия исполнения заявки.

Время представления заявки на перечисление иностранной валюты и время исполнения указанной заявки определено Временным регламентом.

Заявки участников клиринга на перечисление иностранной валюты исполняются Биржей последовательно в порядке их поступления и удовлетворяются в полном объеме либо частично в зависимости от наличия денежных средств на соответствующих корреспондентских счетах Биржи в расчетных банках. Временем получения Биржей заявки на перечисление иностранной валюты считается время получения Биржей по системе SWIFT соответствующего сообщения MT 999.

Биржа вправе не исполнять заявку на перечисление иностранной валюты, если указанные участником клиринга условия исполнения данной заявки противоречат требованиям локальных правовых актов Биржи или заключенным с участником клиринга договорам или соглашениям.

51. В случае неисполнения или ненадлежащего исполнения участниками клиринга нетто-обязательств в белорусских рублях и/или иностранной валюте Биржа осуществляет расчеты в порядке, установленном главами 10–12 настоящих Правил.

ГЛАВА 9

ВОЗВРАТ ВЗНОСА (ЧАСТИ ВЗНОСА) В ГАРАНТИЙНЫЙ ФОНД И ВОЗВРАТ ИНДИВИДУАЛЬНОГО КЛИРИНГОВОГО ОБЕСПЕЧЕНИЯ

52. Участники клиринга в ходе торговой сессии в период времени, установленный Временным регламентом, посредством торговой системы могут подавать распоряжения на возврат вноса (части вноса) в гарантийный фонд в белорусских рублях и/или на возврат индивидуального клирингового

обеспечения в белорусских рублях и/или иностранной валюте, не заблокированного для обеспечения исполнения нетто-обязательств в соответствии с Операционным регламентом (далее – распоряжение на возврат средств).

Распоряжение на возврат средств (приложение 6 к настоящим Правилам) подписывается трейдером участника клиринга с применением СЭД.

В случае невозможности применения СЭД распоряжение на возврат средств оформляется участником клиринга в соответствии с приложением 6 к настоящим Правилам на бумажном носителе, подписывается трейдером участника клиринга и представляется на Биржу в день проведения торгов посредством факсимильной связи в период времени, установленный Временным регламентом, с досылкой оригинала в течение 3 рабочих дней.

В случае возврата вноса (части вноса) в гарантийный фонд в распоряжении на возврат средств участник клиринга в качестве счетов для возврата может указать свои торговые счета.

Возврат денежных средств на торговые и/или банковские счета участников клиринга на основании распоряжения на возврат средств осуществляется в соответствии с Временным регламентом.

53. Предварительное индивидуальное клиринговое обеспечение в белорусских рублях и/или денежные средства, зачисленные участником клиринга в соответствии с подпунктом 44.1 пункта 44 настоящих Правил и не заблокированные для обеспечения исполнения нетто-обязательств и/или не использованные для исполнения нетто-обязательств в белорусских рублях при проведении расчетов, возвращаются на банковский счет участника клиринга в срок, определенный Временным регламентом. Представления трейдером участника клиринга распоряжения на возврат средств не требуется.

54. Предварительное индивидуальное клиринговое обеспечение в иностранной валюте и/или денежные средства, зачисленные участником клиринга в соответствии с подпунктом 44.2 пункта 44 настоящих Правил и не заблокированные для обеспечения исполнения нетто-обязательств и/или не использованные для исполнения нетто-обязательств в иностранной валюте при проведении расчетов, остаются на торговом счете участника клиринга для использования в следующих торгах.

55. Участник клиринга вправе представить на Биржу (посредством факсимильной связи с последующей досылкой оригинала в течение двух рабочих дней) письменное распоряжение на возврат средств на свои банковские счета.

ГЛАВА 10

НЕИСПОЛНЕНИЕ ИЛИ НЕНАДЛЕЖАЩЕЕ ИСПОЛНЕНИЕ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ УЧАСТНИКАМИ КЛИРИНГА

56. Неисполнением или ненадлежащим исполнением обязательств участником клиринга признаются следующие случаи:

56.1. неисполнение (частичное неисполнение) нетто-обязательств участником клиринга;

56.2. нарушение участником клиринга определенных Временным регламентом сроков исполнения нетто-обязательств;

56.3. нарушение требований об уплате неустойки за неисполнение или ненадлежащее исполнение нетто-обязательств;

56.4. несвоевременное исполнение участником клиринга обязательств по восстановлению средств гарантийного фонда;

56.5. нарушение требований об уплате неустойки за несвоевременное восстановление средств гарантийного фонда.

57. За неисполнение или ненадлежащее исполнение нетто-обязательств по сделкам участники клиринга уплачивают неустойку, размер, порядок взыскания и уплаты которой определяется Договором.

58. За неисполнение или ненадлежащее исполнение обязательств по восстановлению средств гарантийного фонда участники клиринга уплачивают неустойку, размер которой определяется спецификацией гарантийного фонда.

59. В случаях, предусмотренных подпунктами 56.1–56.2 пункта 56 настоящих Правил, недобросовестному участнику клиринга и Национальному банку посредством СЭД Биржа направляет уведомление о неисполнении или ненадлежащем исполнении нетто-обязательств (приложение 7 к настоящим Правилам), после чего осуществляется принудительное закрытие нетто-позиций недобросовестного участника клиринга, в том числе в ходе торговой сессии и/или специальной сессии, порядок проведения которых определен главами 11-12 настоящих Правил.

В случае невозможности использования СЭД уведомление о неисполнении или ненадлежащем исполнении нетто-обязательств оформляется Биржей на бумажном носителе в трех экземплярах, которые подписываются уполномоченным работником Биржи, а также скрепляются печатью Биржи. Один экземпляр остается на Бирже, второй и третий – направляются посредством факсимильной связи в период времени, установленный Временным регламентом, участнику клиринга и Национальному банку соответственно.

60. Для исполнения обязательств по сделкам, совершенным для принудительного закрытия нетто-позиций недобросовестного участника клиринга, в том числе в ходе торговой сессии и/или специальной сессии, допускается использование средств гарантийного фонда с учетом ограничений, установленных спецификацией гарантийного фонда.

В день использования средств гарантийного фонда для принудительного закрытия нетто-позиций недобросовестного участника клиринга Биржа в соответствии со спецификацией гарантийного фонда посредством СЭД направляет:

каждому недобросовестному участнику клиринга – уведомление о восстановлении средств гарантийного фонда недобросовестным участником клиринга (приложение 8 к настоящим Правилам) с указанием размера его

обязательств по восстановлению использованных средств гарантийного фонда и уплате неустойки за неисполнение или ненадлежащее исполнение нетто-обязательств;

каждому участнику клиринга (в случае использования его взноса в гарантийный фонд для принудительного закрытия нетто-позиций других участников клиринга) – уведомление об использовании и восстановлении средств гарантийного фонда добросовестным участником клиринга (приложение 9 к настоящим Правилам) с указанием суммы взноса, использованной для принудительного закрытия нетто-позиций других участников клиринга, а также порядка и условий ее восстановления.

При неисполнении или ненадлежащем исполнении недобросовестным участником клиринга требований по восстановлению средств гарантийного фонда в соответствии со спецификацией гарантийного фонда Биржа направляет добросовестным участникам клиринга уведомление об использовании и восстановлении средств гарантийного фонда добросовестным участником клиринга (приложение 9 к настоящим Правилам) с указанием суммы взноса, подлежащей восстановлению.

В случае невозможности использования СЭД уведомление о восстановлении средств гарантийного фонда недобросовестным участником клиринга и/или уведомление об использовании и восстановлении средств гарантийного фонда добросовестным участником клиринга оформляется Биржей на бумажном носителе в двух экземплярах, которые подписываются уполномоченным работником Биржи, а также скрепляются печатью Биржи. Один экземпляр остается на Бирже, второй – направляется участнику клиринга посредством факсимильной связи в период времени, установленный Временным регламентом.

ГЛАВА 11 ПРИНУДИТЕЛЬНОЕ ЗАКРЫТИЕ НЕТТО-ПОЗИЦИЙ УЧАСТНИКОВ КЛИРИНГА В БЕЛОРУССКИХ РУБЛЯХ

61. В случае неисполнения участником клиринга нетто-обязательства в белорусских рублях в срок, установленный Временным регламентом, выполняется принудительное закрытие его нетто-позиций в следующем порядке:

61.1. Биржа уведомляет участников клиринга о проведении специальной сессии с использованием СЭД (приложение 10 к настоящим Правилам) и/или информационным сообщением посредством торговой системы. Время оповещения участников клиринга и время проведения специальной сессии устанавливается Временным регламентом.

Подача заявок в ходе специальной сессии осуществляется от имени недобросовестного участника клиринга ведущим торгов. Трейдеры недобросовестного участника клиринга не могут подавать заявки в ходе специальной сессии. Претензии от недобросовестного участника клиринга по

параметрам сделки (сделок), совершенной для принудительного закрытия его нетто-позиций, Биржей не принимаются.

Добросовестные участники клиринга могут подавать заявки специальной сессии только на покупку финансового инструмента. Заявки, поданные добросовестными участниками клиринга на продажу финансового инструмента, не принимаются торговой системой;

61.2. в рамках специальной сессии по финансовым инструментам EUR/BYN_SBR, RUB/BYN_SBR, USD/BYN_SBR Биржа осуществляет продажу иностранной валюты, составляющей нетто-требования недобросовестного участника клиринга, а также его индивидуального клирингового обеспечения в иностранной валюте.

Заявки специальной сессии удовлетворяются по курсу специальной сессии, который рассчитывается по формуле:

$$K_i = K_{cpj} * k_i ,$$

где

K_i – курс специальной сессии по i -му финансовому инструменту, округленный до шага цены;

K_{cpj} – средневзвешенный курс, сложившийся по результатам торговой сессии по j -му финансовому инструменту с соответствующей валютой лота, сопряженной валютой – белорусский рубль и датой исполнения в день проведения торгов. Если в ходе торговой сессии по указанным финансовым инструментам не совершено ни одной сделки, в качестве средневзвешенного курса используется официальный курс белорусского рубля по отношению к соответствующей валюте, установленный Национальным банком на день проведения торгов;

k_i – коэффициент, установленный по i -му финансовому инструменту специальной сессии в соответствии с Операционным регламентом.

В начале специальной сессии Биржа от имени недобросовестного участника клиринга подает заявки на продажу финансовых инструментов в порядке уменьшения сумм пересчитанных в белорусские рубли нетто-требований данного участника клиринга и/или его индивидуального клирингового обеспечения в иностранной валюте, совпадающей с валютой лота финансового инструмента специальной сессии. Пересчет нетто-требований в белорусские рубли осуществляется по формуле:

$$V_{\text{треб_BYN}i} = V_{\text{треб}i} \times K_{\text{НБРБ}i} ,$$

где

$V_{\text{треб_BYN}i}$ – объем нетто-требований недобросовестного участника клиринга и/или его индивидуального клирингового обеспечения в i -й иностранной валюте, пересчитанный в белорусские рубли;

$V_{\text{треб}i}$ – объем нетто-требований недобросовестного участника клиринга и/или его индивидуального клирингового обеспечения в i -й иностранной валюте;

$K_{\text{НБРБ}i}$ – официальный курс белорусского рубля по отношению к i -й иностранной валюте, установленный Национальным банком на день проведения специальной сессии для принудительного закрытия нетто-позиций недобросовестного участника клиринга в белорусских рублях.

При наличии двух и более недобросовестных участников клиринга заявки на продажу финансовых инструментов от имени данных участников клиринга подаются в порядке возрастания сумм их нетто-обязательств в белорусских рублях, не исполненных к началу специальной сессии. При равенстве сумм неисполненных нетто-обязательств в белорусских рублях заявки подаются в порядке возрастания учетных номеров участников расчетов (далее – УНУР) недобросовестных участников клиринга.

Объем заявки на продажу финансового инструмента, подаваемой от имени недобросовестного участника клиринга, рассчитывается по формуле:

$$V_{\text{прод_sbr}i} = \text{floor}\left(\frac{\min\left(\frac{O_{\text{неисп_BYN}} - Ob_{\text{BYN}} - \frac{\sum_{i=1}^n V_{\text{прод_sbr}(i-1)} \times K_{\text{sbr}(i-1)} \times N_{(i-1)}}{k_{i-1}}}{K_{\text{sbr}i}} \times k_i V_{\text{треб}i}\right)}{N_i}\right),$$

где

$V_{\text{прод_sbr}i}$ – объем заявки в лотах на продажу i -го финансового инструмента на специальной сессии, подаваемой для принудительного закрытия нетто-позиций недобросовестного участника клиринга;

$O_{\text{неисп_BYN}}$ – сумма неисполненного нетто-обязательства недобросовестного участника клиринга в белорусских рублях;

Ob_{BYN} – индивидуальное клиринговое обеспечение недобросовестного участника клиринга в белорусских рублях;

$V_{\text{прод_sbr}(i-1)}$ – объем заявки в лотах на продажу $(i-1)$ -го финансового инструмента на специальной сессии, поданной для принудительного закрытия нетто-позиций недобросовестного участника клиринга;

$K_{\text{sbr}(i-1)}$ – курс специальной сессии по $(i-1)$ -му финансовому инструменту, округленный до шага цены;

$V_{\text{треб}i}$ – объем нетто-требований недобросовестного участника клиринга и/или его индивидуального клирингового обеспечения в иностранной валюте, совпадающей с валютой лота i -го финансового инструмента специальной сессии;

$K_{\text{sbr}i}$ – курс специальной сессии по i -му финансовому инструменту, округленный до шага цены;

$N_{(i-1)}$ – размер лота по $(i-1)$ -му финансовому инструменту;

N_i – размер лота по i -му финансовому инструменту;

k_{i-1} – количество единиц иностранной валюты для определения обменного курса $(i-1)$ -го финансового инструмента;

k_i – количество единиц иностранной валюты для определения обменного курса i -го финансового инструмента;

n – количество финансовых инструментов специальной сессии, по которым подаются заявки для принудительного закрытия нетто-позиций недобросовестного участника клиринга;

min – функция $min(A, B)$ возвращает наименьшее значение одного из двух числовых параметров A и B ;

$floor$ – функция округления вниз до целого числа.

62. По окончании специальной сессии Биржа:

62.1. включает в клиринговый пул обязательства и требования участников клиринга по сделкам, совершенным в ходе специальной сессии, а также неисполненное нетто-обязательство недобросовестного участника клиринга в белорусских рублях и его нетто-требования в иностранной валюте;

62.2. производит зачет встречных однородных обязательств и требований участников клиринга, включенных в клиринговый пул, и определяет нетто-обязательства и/или нетто-требования каждого участника клиринга в белорусских рублях и каждой иностранной валюте;

62.3. формирует клиринговые отчеты, подписывает их в соответствии с пунктом 43 настоящих Правил и передает участникам клиринга.

63. Клиринговый отчет включает информацию о сумме использованных средств гарантийного фонда при их использовании для принудительного закрытия нетто-позиций недобросовестного участника клиринга. В этом случае Биржа направляет участникам клиринга уведомления о восстановлении средств гарантийного фонда в порядке, предусмотренном пунктом 60 настоящих Правил.

64. Денежные средства в белорусских рублях, зачисленные недобросовестным участником клиринга для исполнения неисполненного нетто-обязательства, учитываются Биржей:

для исполнения неисполненного нетто-обязательства – при зачислении денежных средств до начала специальной сессии по принудительному закрытию нетто-позиций данного участника клиринга;

в качестве индивидуального клирингового обеспечения для использования в очередных торгах – при зачислении денежных средств после начала специальной сессии по принудительному закрытию нетто-позиций данного участника клиринга.

65. Расчеты по результатам специальной сессии осуществляются в сроки, определенные Временным регламентом.

66. При недостаточности средств гарантийного фонда для исполнения нетто-обязательства недобросовестного участника клиринга в полном объеме, неисполненная часть нетто-обязательства подлежит исполнению недобросовестным участником клиринга в день, следующий за днем принудительного закрытия его нетто-позиций

67. Для недобросовестного участника клиринга Биржей устанавливается режим предварительного зачисления денежных средств (белорусские рубли и иностранная валюта) с коэффициентом индивидуального клирингового обеспечения, равным 1, до дня полного

восстановления средств гарантийного фонда (при их использовании) включительно.

ГЛАВА 12 ПРИНУДИТЕЛЬНОЕ ЗАКРЫТИЕ НЕТТО-ПОЗИЦИЙ УЧАСТНИКОВ КЛИРИНГА В ИНОСТРАННОЙ ВАЛЮТЕ

68. В случае неисполнения участником клиринга нетто-обязательства в иностранной валюте в срок, установленный Временным регламентом, выполняется принудительное закрытие его нетто-позиций в следующем порядке:

68.1. в день, следующий за днем неисполнения нетто-обязательства, Биржа производит зачет неисполненного недобросовестным участником клиринга нетто-обязательства с прошедшей датой исполнения с его встречным нетто-требованием с наступившей датой исполнения в соответствующей валюте, рассчитывая новую сумму его нетто-обязательства по формуле:

$$O'_{\text{неисп_VAL}} = O_{\text{неисп_VAL}} - \text{Об_VAL} - \text{Н_треб_VAL},$$

где

$O'_{\text{неисп_VAL}}$ – сумма неисполненного в результате проведения зачета нетто-обязательства недобросовестного участника клиринга в иностранной валюте VAL;

$O_{\text{неисп_VAL}}$ – сумма неисполненного нетто-обязательства недобросовестного участника клиринга в иностранной валюте VAL с прошедшей датой исполнения;

Об_VAL – индивидуальное клиринговое обеспечение обязательств недобросовестного участника клиринга в иностранной валюте VAL;

Н_треб_VAL – сумма нетто-требования недобросовестного участника клиринга в иностранной валюте VAL с наступившей датой исполнения;

VAL – наименование иностранной валюты.

В случае, если нетто-обязательство недобросовестного участника клиринга полностью прекращено в результате проведения зачета ($O'_{\text{неисп_VAL}} \leq 0$), данный участник клиринга допускается к участию в торгах в режиме зачисления денежных средств, установленном для него на основании решения Правления Биржи.

В случае, если нетто-обязательство недобросовестного участника клиринга полностью не прекращено в результате проведения зачета ($O'_{\text{неисп_VAL}} > 0$), данному участнику клиринга Биржей устанавливается режим предварительного зачисления денежных средств (белорусские рубли и иностранная валюта) с коэффициентом индивидуального клирингового обеспечения, равным 1;

68.2. если нетто-обязательство недобросовестного участника клиринга не было полностью прекращено в соответствии с подпунктом 68.1 пункта 68 настоящих Правил, в рамках торговой сессии Биржа осуществляет покупку

иностранной валюты в объеме неисполненных нетто-обязательств недобросовестного участника клиринга ($O'_{\text{неисп_VAL}}$).

Подача заявок в ходе торговой сессии для принудительного закрытия нетто-позиций осуществляется от имени недобросовестного участника клиринга ведущим торгов. Претензии от недобросовестного участника клиринга по параметрам сделки (сделок), совершенной для принудительного закрытия его нетто-позиций, Биржей не принимаются.

В ходе торговой сессии по финансовым инструментам с датой исполнения в день проведения торгов, валюта лота которых совпадает с валютой неисполненным недобросовестным участником клиринга нетто-обязательств и сопряженной валютой является белорусский рубль, от имени недобросовестного участника клиринга Биржа подает заявки на совершение сделок, направленных на уменьшение нетто-позиций данного участника клиринга в этой иностранной валюте.

Заявки подаются по истечении 15 минут с момента открытия торговой сессии по соответствующему финансовому инструменту как делимые лимитные заявки без сохранения в котировках на покупку финансового инструмента по обменному курсу встречной заявки, находящейся в очереди первой на момент подачи заявки от имени недобросовестного участника клиринга. При наличии двух и более недобросовестных участников клиринга заявки на покупку финансового инструмента от имени данных участников клиринга подаются в порядке возрастания сумм их нетто-позиций в иностранной валюте. При равенстве сумм нетто-позиций в иностранной валюте заявки подаются в порядке возрастания УНУР недобросовестных участников клиринга. Объем заявки на покупку финансового инструмента, подаваемой от имени недобросовестного участника клиринга, рассчитывается по формуле:

$$V_{\text{поки}} = \text{ceil} \left(\frac{O'_{\text{неисп_VAL}}}{N_i} \right) - \sum_{j=1}^n V_{ij},$$

где

$V_{\text{поки}}$ – объем заявки на покупку i -го финансового инструмента, подаваемой для принудительного закрытия нетто-позиции недобросовестного участника клиринга в иностранной валюте VAL, в лотах;

$O'_{\text{неисп_VAL}}$ – сумма неисполненного в результате проведения зачета в соответствии с подпунктом 68.1 пункта 68 настоящих Правил нетто-обязательства недобросовестного участника клиринга в единицах валюты VAL, совпадающей с валютой лота i -го финансового инструмента торговой сессии;

V_{ij} – объем j -й сделки на покупку i -го финансового инструмента, совершенной от имени недобросовестного участника клиринга, в лотах;

N_i – размер лота по i -му финансовому инструменту;

VAL – наименование иностранной валюты;

n – количество сделок на покупку i -го финансового инструмента, совершенных от имени недобросовестного участника клиринга;

ceil – функция округления вверх до целого числа.

Подача заявок от имени недобросовестного участника клиринга при наличии в очереди встречных заявок и совершение сделок осуществляется в течение торговой сессии до тех пор, пока нетто-позиции недобросовестного участника клиринга в иностранной валюте не будут полностью закрыты.

Подача заявок на покупку иностранной валюты от имени недобросовестного участника клиринга может быть прекращена досрочно либо объем подаваемых заявок уменьшен, если в ходе торговой сессии участником клиринга на торговый счет перечислена иностранная валюта, совпадающая с валютой неисполненных нетто-обязательств, в сумме, достаточной для полного или частичного обеспечения исполнения неисполненных нетто-обязательств;

68.3. одновременно с совершением сделок, направленных на уменьшение нетто-позиций недобросовестного участника клиринга в иностранной валюте, по финансовым инструментам с датой исполнения в день проведения торгов, валюта лота которых совпадает с иностранной валютой нетто-требований недобросовестного участника клиринга и сопряженной валютой является белорусский рубль, от имени недобросовестного участника клиринга Биржа подает заявки на совершение сделок по продаже иностранной валюты в объеме нетто-требований недобросовестного участника клиринга и/или его индивидуального клирингового обеспечения в иностранной валюте, отличной от валюты неисполненного нетто-обязательства.

Заявки подаются как делимые лимитные заявки без сохранения в котировках на продажу финансового инструмента по обменному курсу встречной заявки, находящейся в очереди первой на момент подачи заявки от имени недобросовестного участника клиринга. При наличии двух и более недобросовестных участников клиринга заявки на продажу финансового инструмента от имени данных участников клиринга подаются в порядке возрастания сумм их нетто-требований в иностранной валюте. При равенстве сумм нетто-требований в иностранной валюте подача заявок производится в порядке возрастания УНУР недобросовестных участников клиринга. Объем заявки на продажу финансового инструмента, подаваемой от имени недобросовестного участника клиринга, рассчитывается по формуле:

$$V_{\text{прод}i} = \text{floor} \left(\frac{O'_{\text{треб_VAL}i}}{N_i} \right) - \sum_{j=1}^n V_{ij},$$

где

$V_{\text{прод}i}$ – объем заявки на продажу i -го финансового инструмента, подаваемой от имени недобросовестного участника клиринга, в лотах;

$O'_{\text{треб_VAL}i}$ – сумма нетто-требований недобросовестного участника клиринга и/или его индивидуального клирингового обеспечения в валюте VAL, совпадающей с валютой лота i -го финансового инструмента, на начало торговой сессии, в единицах валюты;

V_{ij} – объем j -й сделки на продажу i -го финансового инструмента, совершенной от имени недобросовестного участника клиринга, в лотах;

VAL – наименование иностранной валюты;

n – количество сделок на продажу i-го финансового инструмента, совершенных от имени недобросовестного участника клиринга;

floor – функция округления вниз до целого числа.

Подача заявок от имени недобросовестного участника клиринга при наличии в очереди встречных заявок и совершение сделок осуществляется в течение торговой сессии до тех пор, пока объем совершенных сделок по финансовому инструменту в валюте лота не станет равным сумме нетто-требований недобросовестного участника клиринга в иностранной валюте, совпадающей с валютой лота финансового инструмента, на начало торговой сессии;

68.4. если в ходе торговой сессии нетто-позиции недобросовестного участника клиринга в иностранной валюте не были полностью закрыты и/или объем совершенных сделок по финансовому инструменту в валюте лота не равен сумме нетто-требований недобросовестного участника клиринга и/или его индивидуального клирингового обеспечения в иностранной валюте, совпадающей с валютой лота финансового инструмента, на начало торговой сессии, Биржа уведомляет участников клиринга о проведении специальной сессии с использованием СЭД (приложение 10 к настоящим Правилам) и/или информационным сообщением посредством торговой системы. Время оповещения участников клиринга и время проведения специальной сессии устанавливается Временным регламентом.

Подача заявок в ходе специальной сессии осуществляется от имени недобросовестного участника клиринга ведущим торгов. Трейдеры недобросовестного участника клиринга не могут подавать заявки в ходе специальной сессии. Претензии от недобросовестного участника клиринга по параметрам сделки (сделок), совершенной для принудительного закрытия его нетто-позиций, Биржей не принимаются.

Заявки специальной сессии удовлетворяются по курсу специальной сессии, который рассчитывается в соответствии с подпунктом 61.2 пункта 61 настоящих Правил;

68.5. в рамках специальной сессии по финансовым инструментам EUR/BYN_SBR, RUB/BYN_SBR, USD/BYN_SBR, EUR/BYN_SC, RUB/BYN_SC, USD/BYN_SC Биржа осуществляет продажу иностранной валюты, составляющей нетто-требования недобросовестного участника клиринга и/или являющейся его индивидуальным клиринговым обеспечением, и покупку иностранной валюты, составляющей неисполненные нетто-обязательства данного участника клиринга, имеющиеся к началу специальной сессии.

После открытия специальной сессии от имени недобросовестного участника клиринга подается заявка на покупку соответствующего финансового инструмента: EUR/BYN_SC, RUB/BYN_SC, USD/BYN_SC. При наличии двух и более недобросовестных участников клиринга заявки на покупку финансового инструмента от имени данных участников клиринга

подаются в порядке возрастания сумм неисполненных ими нетто-обязательств в иностранной валюте, не прекращенных на начало специальной сессии. При равенстве сумм неисполненных нетто-обязательств в иностранной валюте, не прекращенных на начало специальной сессии, заявки подаются в порядке возрастания УНУР недобросовестных участников клиринга. Объем заявки на покупку финансового инструмента, подаваемой от имени недобросовестного участника клиринга, рассчитывается по формуле:

$$V_{\text{пок}k} = \text{ceil}\left(\frac{O'_{\text{неисп_VAL}} - \sum_{j=1}^n V_{\text{VAL}kj}}{N_k}\right),$$

где

$V_{\text{пок}k}$ – объем заявки специальной сессии на покупку k -го финансового инструмента, подаваемой для принудительного закрытия нетто-позиции недобросовестного участника клиринга в иностранной валюте VAL;

$O'_{\text{неисп_VAL}}$ – сумма неисполненного в результате проведения зачета в соответствии с подпунктом 68.1 пункта 68 настоящих Правил нетто-обязательства недобросовестного участника клиринга в единицах валюты VAL, совпадающей с валютой лота k -го финансового инструмента специальной сессии, в лотах;

$V_{\text{VAL}kj}$ – объем j -й сделки на покупку k -го финансового инструмента, совершенной от имени недобросовестного участника клиринга в ходе торговой сессии для принудительного закрытия его нетто-позиций, в единицах валюты VAL;

N_k – размер лота по k -му финансовому инструменту специальной сессии;

VAL – наименование иностранной валюты;

n – количество сделок на покупку k -го финансового инструмента, совершенных от имени недобросовестного участника клиринга в ходе торговой сессии;

ceil – функция округления вверх до целого числа.

Одновременно с заявкой на покупку финансового инструмента EUR/BYN_SC, RUB/BYN_SC, USD/BYN_SC от имени недобросовестного участника клиринга подается заявка на продажу финансового инструмента EUR/BYN_SBR, RUB/BYN_SBR, USD/BYN_SBR. При наличии двух и более недобросовестных участников клиринга заявки на продажу финансового инструмента от имени данных участников клиринга подаются в порядке возрастания сумм их нетто-требований и/или сумм их индивидуального клирингового обеспечения в иностранной валюте, имеющих к началу специальной сессии. При равенстве указанных сумм в иностранной валюте, имеющих к началу специальной сессии, заявки подаются в порядке возрастания УНУР недобросовестных участников клиринга. Объем заявки на продажу финансового инструмента, подаваемой от имени недобросовестного участника клиринга рассчитывается по формуле:

$$V_{\text{прод}k} = \text{floor}\left(\frac{O'_{\text{треб_VAL}i} - \sum_{j=1}^n V_{\text{VAL}kj}}{N_k}\right),$$

где

$V_{\text{прод}k}$ – объем заявки в лотах на продажу k -го финансового инструмента, подаваемой от имени недобросовестного участника клиринга;

$O'_{\text{треб_VAL}i}$ – сумма нетто-требований недобросовестного участника клиринга и/или его индивидуального клирингового обеспечения в i -ой валюте VAL для принудительного закрытия его нетто-позиций на начало торговой сессии, в единицах валюты;

$V_{\text{VAL}kj}$ – объем j -й сделки на продажу, совершенной по k -му финансовому инструменту от имени недобросовестного участника клиринга в ходе торговой сессии для принудительного закрытия его нетто-позиций, в единицах валюты VAL;

N_k – размер лота по k -му финансовому инструменту специальной сессии;

VAL – наименование иностранной валюты;

n – количество сделок на продажу k -го финансового инструмента, совершенных от имени недобросовестного участника клиринга в ходе торговой сессии;

floor – функция округления вниз до целого числа.

Добросовестные участники клиринга могут подавать следующие заявки специальной сессии:

по финансовым инструментам EUR/BYN_SC, RUB/BYN_SC, USD/BYN_SC – только на продажу финансового инструмента;

по финансовым инструментам EUR/BYN_SBR, RUB/BYN_SBR, USD/BYN_SBR – только на покупку финансового инструмента.

Заявки, поданные добросовестными участниками клиринга с нарушением требований, оговоренных выше, удаляются из очереди неудовлетворенных заявок;

68.6. в случае, если нетто-обязательство недобросовестного участника клиринга не было полностью прекращено в соответствии с подпунктом 68.5 пункта 68 настоящих Правил, Биржа выполняет следующие действия:

от имени недобросовестного участника клиринга подает заявку (заявки) на покупку финансового инструмента EUR/BYN_SC, RUB/BYN_SC, USD/BYN_SC в объеме его нетто-обязательств, не прекращенных в ходе торговой сессии и специальной сессии;

от имени добросовестного (недобросовестного) участника (участников) клиринга подает заявку (заявки) на продажу финансового инструмента EUR/BYN_SC, RUB/BYN_SC, USD/BYN_SC в объеме нетто-требований каждого добросовестного (недобросовестного) участника клиринга, чьи нетто-требования с прошедшей датой исполнения не могут быть перечислены на его банковские счета по результатам специальной сессии (далее – закрывающая сделка);

уведомляет добросовестного участника (участников) клиринга о совершении закрывающей сделки (сделок) с использованием СЭД

(приложение 11 к настоящим Правилам), а также информационным сообщением посредством торговой системы.

В результате совершенной закрывающей сделки (сделок) нетто-обязательство недобросовестного участника клиринга и нетто-требование добросовестного (недобросовестного) участника (участников) клиринга в иностранной валюте прекращаются. При этом у добросовестного участника (участников) клиринга возникает нетто-требование в белорусских рублях в сумме, эквивалентной неисполненной части его нетто-требований в иностранной валюте.

69. По окончании торговой сессии и/или специальной сессии Биржа в сроки, установленные Временным регламентом:

69.1. включает в клиринговый пул обязательства и требования участников клиринга по сделкам, совершенным в ходе торговой и/или специальной сессии, с наступившей датой исполнения, неисполненные нетто-обязательства недобросовестного участника клиринга в иностранной валюте и его нетто-требования в белорусских рублях и/или иностранной валюте, а также неисполненные нетто-требования добросовестного участника (участников) клиринга в иностранной валюте;

69.2. зачитывает встречные однородные обязательства и требования участников клиринга, включенные в клиринговый пул, и определяет нетто-обязательства и/или нетто-требования каждого участника клиринга в белорусских рублях и каждой иностранной валюте по результатам торговой сессии и/или специальной сессии;

69.3. формирует клиринговые отчеты, подписывает их в соответствии с пунктом 43 настоящих Правил и передает участникам клиринга.

70. Клиринговый отчет включает информацию о сумме использованных средств гарантийного фонда при их использовании для принудительного закрытия нетто-позиций недобросовестного участника клиринга. В этом случае Биржа направляет участникам клиринга уведомления о восстановлении средств гарантийного фонда в порядке, предусмотренном пунктом 60 настоящих Правил.

71. Денежные средства в иностранной валюте, зачисленные недобросовестным участником клиринга для исполнения неисполненного нетто-обязательства, учитываются Биржей:

для исполнения неисполненного нетто-обязательства – при зачислении денежных средств до начала специальной сессии по принудительному закрытию нетто-позиций данного участника клиринга;

в качестве индивидуального клирингового обеспечения для использования в очередных торгах – при зачислении денежных средств после начала специальной сессии по принудительному закрытию нетто-позиций данного участника клиринга.

72. Расчеты по результатам торговой сессии и/или специальной сессии осуществляются в сроки, определенные Временным регламентом.

73. При недостаточности средств гарантийного фонда для исполнения нетто-обязательства недобросовестного участника клиринга в полном объеме, неисполненная часть нетто-обязательства подлежит исполнению недобросовестным участником клиринга в день принудительного закрытия его нетто-позиций.

74. Недобросовестному участнику клиринга Биржей устанавливается режим предварительного зачисления денежных средств (белорусские рубли и иностранная валюта) с коэффициентом индивидуального клирингового обеспечения, равным 1, до дня полного восстановления средств гарантийного фонда (при их использовании) включительно.

ГЛАВА 13 ОТВЕТСТВЕННОСТЬ ЗА НЕИСПОЛНЕНИЕ ИЛИ НЕНАДЛЕЖАЩЕЕ ИСПОЛНЕНИЕ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ

75. За неисполнение или ненадлежащее исполнение в установленные сроки своих обязательств участник клиринга и Биржа несут ответственность в соответствии с Договором.

76. Участнику клиринга, неоднократно (два и более раза) в течение шести месяцев допустившему неисполнение или ненадлежащее исполнение нетто-обязательств, либо неисполнение обязательств по восстановлению средств гарантийного фонда, на основании решения Правления Биржи на срок до двух месяцев может быть установлен режим предварительного зачисления денежных средств (белорусские рубли и иностранная валюта) с коэффициентом индивидуального клирингового обеспечения, равным 1.

77. Ситуации, порядок урегулирования которых не описан настоящими Правилами и иными локальными правовыми актами Биржи, подлежат разрешению Правлением Биржи.

ГЛАВА 14 ЧРЕЗВЫЧАЙНЫЕ СИТУАЦИИ

78. Под чрезвычайными обстоятельствами при осуществлении клиринга и расчетов понимаются обстоятельства, которые нарушили, нарушают или могут нарушить нормальный порядок осуществления клиринга и расчетов. К таким обстоятельствам относятся:

78.1. принятие или любые изменения законодательных или иных актов государственных органов Республики Беларусь, в том числе Национального банка, либо распоряжения данных органов, инструкции, указания, которые делают или могут сделать невозможным осуществление клиринга и расчетов в порядке, установленном настоящими Правилами;

78.2. несвоевременное зачисление участником клиринга и/или Биржей денежных средств в иностранной валюте, вызванное проведением процедур

комплаенс-контроля в банках-корреспондентах, используемых участниками клиринга для осуществления расчетов, и/или расчетных банках Биржи;

78.3. сбои в работе платежных систем;

78.4. сбои в работе электроснабжения, вычислительной техники, систем связи, включая средства телекоммуникаций;

78.5. обстоятельства непреодолимой силы (пожары, аварии, стихийные бедствия), а также действия, которые могут быть приравнены к обстоятельствам непреодолимой силы (в том числе военные действия, акты террора, диверсии и саботажа, забастовки);

78.6. иные обстоятельства, препятствующие проведению клиринга и расчетов на Бирже, которые находятся вне контроля Биржи.

79. При наступлении чрезвычайных обстоятельств Биржа осуществляет мероприятия, необходимые для восстановления нормального порядка осуществления клиринга и расчетов, о чем оповещает участников клиринга доступными в данной ситуации средствами.

80. По решению Председателя Правления Биржи для урегулирования чрезвычайных обстоятельств Биржа может изменить порядок и/или сроки осуществления клиринга и расчетов.

81. Решения Биржи по урегулированию чрезвычайных обстоятельств являются обязательными для исполнения всеми участниками клиринга.

82. Биржа не несет ответственности за убытки, которые могут возникнуть у участника клиринга при наступлении чрезвычайных обстоятельств.

ГЛАВА 15

ОПЛАТА РАСЧЕТНО-КЛИРИНГОВЫХ УСЛУГ

83. За оказание расчетно-клиринговых услуг участник клиринга уплачивает Бирже клиринговый сбор по сделкам, совершенным с использованием торговой системы Биржи. Размер клирингового сбора утверждается уполномоченным органом управления Биржи.

Биржа имеет право изменять размер клирингового сбора в одностороннем порядке.

84. Сумма клирингового сбора, подлежащая уплате участником клиринга, указывается в биржевом свидетельстве, а также в клиринговом отчете. Участник клиринга обязан перечислить сумму клирингового сбора на счет Биржи, указанный в биржевом свидетельстве/клиринговом отчете.

85. При несоблюдении сроков и/или размера оплаты суммы клирингового сбора участник клиринга обязан уплатить Бирже неустойку.

86. Размер клирингового сбора и размер неустойки, а также порядок уплаты клирингового сбора и неустойки указываются в Договоре.

87. Биржа не уплачивает клиринговый сбор по сделкам, совершенным от своего имени и за свой счет.

Приложение 1
к Правилам осуществления
клиринга и расчетов по
биржевым сделкам с иностранной
валютой в ОАО «Белорусская
валютно-фондовая биржа»

Перечень финансовых инструментов, по которым осуществляется клиринг и проводятся расчеты через корреспондентские счета Биржи

1. Торговая сессия

Финансовый инструмент	Валюта лота	Сопряженная валюта
Финансовые инструменты, с которыми совершаются сделки покупки, продажи, конверсии		
EUR/BYN_TOD	Евро	Белорусский рубль
EUR/RUB_TOD	Евро	Российский рубль
EUR/USD_TOD	Евро	Доллар США
EUR/USD_TOM	Евро	Доллар США
RUB/BYN_TOD	Российский рубль	Белорусский рубль
USD/BYN_TOD	Доллар США	Белорусский рубль
USD/RUB_TOD	Доллар США	Российский рубль
Финансовые инструменты, с которыми совершаются сделки СВОП		
EUR/BYN_T0T1	Евро	Белорусский рубль
EUR/BYN_T0T2	Евро	Белорусский рубль
EUR/BYN_T0T3	Евро	Белорусский рубль
EUR/BYN_T0T4	Евро	Белорусский рубль
EUR/BYN_T0T5	Евро	Белорусский рубль
RUB/BYN_T0T1	Российский рубль	Белорусский рубль
RUB/BYN_T0T2	Российский рубль	Белорусский рубль
RUB/BYN_T0T3	Российский рубль	Белорусский рубль
RUB/BYN_T0T4	Российский рубль	Белорусский рубль
RUB/BYN_T0T5	Российский рубль	Белорусский рубль
USD/BYN_T0T1	Доллар США	Белорусский рубль
USD/BYN_T0T2	Доллар США	Белорусский рубль
USD/BYN_T0T3	Доллар США	Белорусский рубль
USD/BYN_T0T4	Доллар США	Белорусский рубль
USD/BYN_T0T5	Доллар США	Белорусский рубль

2. Специальная сессия

Финансовый инструмент	Валюта лота	Сопряженная валюта
Финансовые инструменты, с которыми совершаются сделки покупки, продажи		
EUR/BYN_SBR	Евро	Белорусский рубль
RUB/BYN_SBR	Российский рубль	Белорусский рубль
USD/BYN_SBR	Доллар США	Белорусский рубль
EUR/BYN_SC	Евро	Белорусский рубль
RUB/BYN_SC	Российский рубль	Белорусский рубль
USD/BYN_SC	Доллар США	Белорусский рубль

Приложение 2
к Правилам осуществления
клиринга и расчетов по
биржевым сделкам с иностранной
валютой в ОАО «Белорусская
валютно-фондовая биржа»

КОРРЕСПОНДЕНТСКИЕ СЧЕТА _____
(участник клиринга)
для зачисления иностранной валюты

Наименование валюты	Банк-корреспондент, его адрес и реквизиты (SWIFT, БИК, корреспондентский счет в ЦБ РФ)	Банк-посредник, его адрес и реквизиты (SWIFT, БИК, корреспондентский счет в ЦБ РФ)	Код участника клиринга (SWIFT)	Номер счета участника клиринга
EUR				
RUB				
USD				

СЧЕТА _____
(участник клиринга)
для зачисления белорусских рублей

Наименование банка-получателя	БИК банка-получателя	Номер счета участника клиринга для зачисления нетто-требований	Номер счета участника клиринга для возврата денежных средств

Руководитель участника клиринга (/его заместитель) (Ф.И.О.)

Главный бухгалтер (Ф.И.О.)

М.П. ¹

¹ В случаях, когда использование печати предусмотрено международными договорами Республики Беларусь

Приложение 3
к Правилам осуществления
клиринга и расчетов по
биржевым сделкам с иностранной
валютой в ОАО «Белорусская
валютно-фондовая биржа»

ВРЕМЕННОЙ РЕГЛАМЕНТ
осуществления клиринга и расчетов по биржевым сделкам с иностранной валютой
в ОАО «Белорусская валютно-фондовая биржа»

№ п/п	Наименование операции	Срок осуществления операции
1	Проведение зачета неисполненных участником клиринга нетто-обязательств в иностранной валюте с прошедшей датой исполнения и его встречных нетто-требований с текущей датой исполнения	С 9.40-9.55 дня проведения торгов
2	Зачисление участниками клиринга предварительного индивидуального клирингового обеспечения	До 12.50 дня проведения торгов
3	Подача участниками клиринга в ходе торговой сессии распоряжений на возврат средств	С 10.00 до 12.50 дня проведения торгов
4	Возврат денежных средств на торговые и/или банковские счета участников клиринга на основании распоряжений на возврат средств, поданных в ходе торговой сессии	Возврат индивидуального клирингового обеспечения: в течение 30 минут после подачи распоряжения – BYN; в день подачи распоряжения – EUR, RUB, USD Возврат взноса (части взноса) в гарантийный фонд – не позднее дня, следующего за днем подачи распоряжения
5	Отправка уведомления о проведении специальной сессии по принудительному закрытию нетто-позиций в иностранной валюте (при необходимости)	До 13.05 дня, следующего за датой исполнения
6	Проведение специальной сессии по принудительному закрытию нетто-позиций в иностранной валюте	13.10-13.20 дня, следующего за датой исполнения
7	Формирование и подписание клиринговых отчетов по торговой сессии и/или специальной сессии по принудительному закрытию нетто-позиций в иностранной валюте	До 13.40, если не проводится специальная сессия До 14.00 при проведении специальной сессии
8	Зачисление участниками клиринга нетто-обязательств по сделкам с финансовыми инструментами торговой сессии (пункт 1 приложения 1) и специальной сессии (пункт 2 приложения 1) по принудительному закрытию нетто-позиций в иностранной валюте	До 15.30 даты исполнения – BYN В дату исполнения – EUR, RUB, USD
9	Отправка недобросовестному участнику клиринга, Национальному банку уведомлений о неисполнении нетто-обязательств	До 15.40 даты исполнения – BYN До 9.30 дня, следующего за датой исполнения – EUR, RUB, USD
10	Отправка уведомления о проведении специальной сессии по принудительному закрытию нетто-позиций в белорусских рублях (при необходимости)	До 16.15 (до 15.35 ²) даты исполнения
11	Проведение специальной сессии по принудительному закрытию нетто-позиций в белорусских рублях, формирование и подписание клиринговых отчетов	16.20-16.40 (15.40-16.00 ²) в дату исполнения

² В пятницу и предпраздничные дни

12	Зачисление участниками клиринга нетто-обязательств по сделкам с финансовыми инструментами специальной сессии по принудительному закрытию нетто-позиций в белорусских рублях (пункт 2 приложения 1)	До 17.00 (до 16.20 ²) даты исполнения
13	Перечисление нетто-требований в белорусских рублях на торговые счета участников клиринга, исполнивших нетто-обязательства в иностранной валюте по сделкам с финансовыми инструментами (приложение 1) до 16.30 (16.00 ²) даты исполнения	В дату исполнения
14	Перечисление нетто-требований в белорусских рублях на торговые счета участников клиринга, исполнивших нетто-обязательства в иностранной валюте по сделкам с финансовыми инструментами (приложение 1) после 16.30 (16.00 ²) даты исполнения	Не позднее дня, следующего за датой исполнения
15	Перечисление нетто-требований в иностранной валюте на торговые счета участников клиринга, исполнивших нетто-обязательства в белорусских рублях и/или исполнивших нетто-обязательства в иностранной валюте по сделкам с финансовыми инструментами (приложение 1) до 16.30 (16.00 ²) даты исполнения	В дату исполнения (если нетто-обязательства исполнены всеми участниками клиринга до 16.30 (16.00 ²) даты исполнения) Не позднее дня, следующего за датой исполнения (если нетто-обязательства исполнены участниками клиринга после 16.30 (16.00 ²) даты исполнения)
16	Перечисление нетто-требований в иностранной валюте на торговые счета участников клиринга, исполнивших нетто-обязательства в иностранной валюте по сделкам с финансовыми инструментами (приложение 1) после 16.30 (16.00 ²) даты исполнения	Не позднее дня, следующего за датой исполнения
17	Отправка участникам клиринга уведомлений о порядке проведения расчетов – в случае исполнения нетто-обязательств в иностранной валюте до 16.30 (16.00 ²) даты исполнения не всеми участниками клиринга	До 16.50 (16.15 ²) даты исполнения
18	Возврат на банковские счета участников клиринга индивидуального клирингового обеспечения в белорусских рублях, не использованного для исполнения нетто-обязательств или обеспечения исполнения обязательств	До 17.00 даты исполнения
19	Отправка участникам клиринга уведомлений о восстановлении средств гарантийного фонда	До 17.30 дня использования средств гарантийного фонда
20	Возврат денежных средств на торговые и/или банковские счета участников клиринга на основании письменных распоряжений на возврат средств, поданных после окончания торгов	Возврат индивидуального клирингового обеспечения: в день подачи распоряжения, если распоряжение подано до 16.30 (16.00 ²); в день, следующий за днем подачи распоряжения, если распоряжение подано после 16.30 (16.00 ²) Возврат взноса (части взноса) в гарантийный фонд: не позднее дня, следующего за днем подачи распоряжения
21	Перечисление на торговые счета добросовестных участников клиринга денежных средств в белорусских рублях в случае совершения закрывающей сделки	До 16.30 (16.00 ²) дня принудительного закрытия нетто-позиций недобросовестного участника клиринга

22	Перечисление на торговые счета участников клиринга нетто-требований в иностранной валюте по сделкам с финансовыми инструментами специальной сессии (пункт 2 приложения 1) по принудительному закрытию нетто-позиций в белорусских рублях	Не позднее дня, следующего за датой исполнения
23	Перечисление нетто-требований в белорусских рублях и иностранной валюте с торговых счетов участников клиринга на их банковские счета в соответствии с представленными платежными реквизитами	В дату исполнения (если нетто-требования зачислены на торговый счет до 16.30 (16.00 ²) даты исполнения) Не позднее дня, следующего за датой исполнения (если нетто-требования зачислены на торговый счет после 16.30 (16.00 ²) даты исполнения)
24	Изменение приоритета использования валют индивидуального клирингового обеспечения по сделкам	С 10.00 до 13.00 дня проведения торгов
25	Изменение приоритета использования валют индивидуального клирингового обеспечения по сделкам с датой исполнения, отличной от даты совершения сделок	С 14.00 до 16.30 (16.00 ²) дня проведения торгов
26	Отправка участниками клиринга заявок на перечисление иностранной валюты	До 17.00 (16.25 ²) даты исполнения
27	Перечисление нетто-требований в иностранной валюте с торговых счетов участников клиринга на их банковские счета по заявкам на перечисление иностранной валюты	В день получения заявок на перечисление иностранной валюты до 17.30 (16.45 ²)

Приложение 4
к Правилам осуществления
клиринга и расчетов по
биржевым сделкам с иностранной
валютой в ОАО «Белорусская
валютно-фондовая биржа»

Примерная форма

Клиринговый отчет № ____ от ____ стр. ____ из ____

Открытое акционерное общество
«Белорусская валютно-фондовая биржа»

КЛИРИНГОВЫЙ ОТЧЕТ № ____

Участник клиринга _____
(наименование участника клиринга)

Дата исполнения обязательств по клиринговому отчету _____
(текущая дата)

1. Сделки с наступившей датой исполнения, включенные в клиринг:

Финансовый инструмент	№ сделки	Дата торгов	Обязательства		Требования	
			В валюте лота	В сопряж. валюте	В валюте лота	В сопряж. валюте
Итого по финансовому инструменту						

2. Неисполненные обязательства (требования), включенные в клиринг:

Наименование валюты	Дата исполнения	Номер клирингового отчета	Нетто-обязательства	Нетто-требования

3. Итоговые нетто-обязательства (нетто-требования) составляют:

Наименование валюты	Нетто-обязательства	Нетто-требования	Обеспечение обязательств		Использовано средств ГФ, бел. руб.
			валюта 1	валюта n	

3.1. Обязательства _____:
(наименование участника клиринга)

3.1.1. Обеспечить зачисление _____ на корреспондентский счет
(сумма, наименование иностранной валюты)

_____ не позднее _____
(наименование, БИК и реквизиты корреспондентского счета Биржи) (срок исполнения обязательств)

(с указанием в назначении платежа торгового счета _____,
(№ торгового счета участника клиринга)
TICKET _____ ОТ _____).
(№ клирингового отчета) (дата клирингового отчета)

3.1.2. Обеспечить зачисление _____ на торговый счет
(сумма в белорусских рублях)
_____ в _____ не позднее _____
(№ торгового счета участника клиринга) (наименование и БИК Биржи) (срок исполнения обязательств)

(с указанием в назначении платежа TICKET _____ ОТ _____).
(№ клирингового отчета) (дата клирингового отчета)

3.2. Обязательства Биржи:

3.2.1. Обеспечить зачисление _____ на торговый счет
(сумма, наименование иностранной валюты)
_____ в _____ не позднее _____
(№ торгового счета участника клиринга) (наименование и БИК Биржи) (срок исполнения обязательств)

при условии выполнения _____ подпункта 3.1.
(наименование участника клиринга)

3.2.2. Обеспечить зачисление _____ на торговый счет
(сумма в белорусских рублях)
_____ в _____ не позднее _____
(№ торгового счета участника клиринга) (наименование и БИК Биржи) (срок исполнения обязательств)

при условии выполнения _____ подпункта 3.1.
(наименование участника клиринга)

3.2.3. Не позднее дня, следующего за датой исполнения обязательств, обеспечить перечисление денежных средств с торговых счетов на банковские счета участника клиринга в соответствии со следующими реквизитами:

Наименование валюты	Реквизиты банковских счетов участника клиринга
BYN	
EUR	
RUB	
USD	

4. При определении сроков перечисления Биржей денежных средств в белорусских рублях не учитываются выходные, праздничные дни, объявленные нерабочими в Республике Беларусь.

При определении сроков перечисления Биржей денежных средств в иностранной валюте не учитываются выходные, праздничные дни, объявленные нерабочими в Республике Беларусь, стране местонахождения расчетных банков по соответствующей валюте и стране – эмитенте соответствующей валюты.

5. По результатам торгов _____ зачислить на счет _____
 (дата) (№ счета, наименование и БИК Биржи)
 биржевые и клиринговые сборы³:

№ биржевого свидетельства	Биржевой и клиринговый сборы*	Биржевой сбор*	Клиринговый сбор*
ИТОГО	Итоговая сумма биржевого и клирингового сборов (прописью)		

*Без НДС на основании пп.1.38 пункта 1 статьи 118 Особенной части Налогового кодекса Республики Беларусь

Уполномоченное лицо Биржи

(Ф.И.О.)⁴

³ Указывается в одном из клиринговых отчетов участника клиринга в случае, если по сделкам с финансовыми инструментами формируется несколько клиринговых пулов.

⁴ Ф.И.О. указывается в случае подписания клирингового отчета на бумажном носителе.

Приложение 5
к Правилам осуществления
клиринга и расчетов по
биржевым сделкам с иностранной
валютой в ОАО «Белорусская
валютно-фондовая биржа»

Примерная форма

Распечатано «___» _____ г. 00.00.00

Открытое акционерное общество
«Белорусская валютно-фондовая биржа»

УВЕДОМЛЕНИЕ № ____
о порядке проведения расчетов

с участником клиринга _____
(наименование участника клиринга)

В соответствии с Правилами осуществления клиринга и расчетов по биржевым сделкам с иностранной валютой в ОАО «Белорусская валютно-фондовая биржа» расчеты по клиринговому отчету № ____ от ____ будут осуществлены в соответствии с Временным регламентом следующим образом:

Наименование валюты	Сумма нетто-требований участника клиринга по клиринговому отчету	Сумма нетто-требований, которая будет зачислена в дату исполнения на банковский счет участника клиринга	Сумма нетто-требований, которая не будет зачислена в дату исполнения на банковский счет участника клиринга

(уполномоченное лицо Биржи)

(подпись)

(Ф.И.О.)

Приложение 6
к Правилам осуществления
клиринга и расчетов по
биржевым сделкам с иностранной
валютой в ОАО «Белорусская
валютно-фондовая биржа»

Примерная форма

РАСПОРЯЖЕНИЕ № ____ от ____
(дата)

на возврат средств

(наименование участника клиринга)

Прошу произвести возврат средств, внесенных в качестве _____
(взноса в гарантийный фонд или

_____, в сумме _____ на счет
индивидуального клирингового обеспечения) (сумма, наименование валюты)

(наименование банка, БИК и реквизиты счета для зачисления средств)

Треjder участника клиринга

(подпись)

(Ф.И.О.)⁵

⁵ Ф.И.О. указывается в случае подписания заявки на бумажном носителе.

Приложение 7
к Правилам осуществления
клиринга и расчетов по
биржевым сделкам с иностранной
валютой в ОАО «Белорусская
валютно-фондовая биржа»

Примерная форма

Распечатано «___» _____ г. 00.00.00

Открытое акционерное общество
«Белорусская валютно-фондовая биржа»

УВЕДОМЛЕНИЕ № ____
о неисполнении обязательств участником клиринга _____
(наименование участника клиринга)

В соответствии с Правилами осуществления клиринга и расчетов по биржевым сделкам с иностранной валютой в ОАО «Белорусская валютно-фондовая биржа» информируем о зачислении денежных средств по клиринговому отчету № ____ от ____:

Наименование валюты	Нетто-обязательство участника клиринга по клиринговому отчету	Исполнено участником клиринга в дату исполнения	Не исполнено участником клиринга в дату исполнения

Неисполнение (ненадлежащее исполнение) нетто-обязательств подлежит урегулированию путем осуществления принудительного закрытия нетто-позиций участника клиринга.

(уполномоченное лицо Биржи)

(подпись)

(Ф.И.О.)

Приложение 8
к Правилам осуществления
клиринга и расчетов по
биржевым сделкам с иностранной
валютой в ОАО «Белорусская
валютно-фондовая биржа»

Примерная форма

Распечатано «___» _____ г. 00.00.00

Открытое акционерное общество
«Белорусская валютно-фондовая биржа»

УВЕДОМЛЕНИЕ № ___ от _____

о восстановлении средств гарантийного фонда недобросовестным
участником клиринга

Для принудительного закрытия нетто-позиций _____
(участник клиринга)

средства гарантийного фонда использованы следующим образом:

Использование средств гарантийного фонда	Недобросовестный участник клиринга	Биржа	Добросовестные участники клиринга	Итого
Фактически использована сумма вноса (BYN)				

В соответствии с Правилами осуществления клиринга и расчетов по биржевым
сделкам с иностранной валютой в ОАО «Белорусская валютно-фондовая биржа»
информируем _____ о необходимости восстановления средств

(участник клиринга)

гарантийного фонда в сумме _____ на счет ОАО «Белорусская валютно-фондовая
(сумма)

биржа» _____ не позднее _____.

(счет гарантийного фонда)

(дата)

(уполномоченное лицо Биржи)

(подпись)

(Ф.И.О.)

Приложение 9
к Правилам осуществления
клиринга и расчетов по
биржевым сделкам с иностранной
валютой в ОАО «Белорусская
валютно-фондовая биржа»

Примерная форма

Распечатано «___» _____ г. 00.00.00

Открытое акционерное общество
«Белорусская валютно-фондовая биржа»

УВЕДОМЛЕНИЕ № ___ от _____

об использовании и восстановлении средств гарантийного фонда добросовестным
участником клиринга

Для принудительного закрытия нетто-позиций недобросовестного участника
клиринга были использованы взносы в гарантийный фонд _____
(участник клиринга)

в сумме _____.
(сумма)

В случае неисполнения или ненадлежащего исполнения недобросовестным
участником клиринга обязательств по восстановлению взносов участников клиринга в
гарантийный фонд _____ будет направлено уведомление об использовании и
(участник клиринга)
восстановлении средств гарантийного фонда с указанием суммы взноса, подлежащей
возмещению.

В соответствии с Правилами осуществления клиринга и расчетов по биржевым
сделкам с иностранной валютой в ОАО «Белорусская валютно-фондовая биржа»
информируем _____ о необходимости восстановления средств
(участник клиринга)
гарантийного фонда в сумме _____ на счет ОАО «Белорусская валютно-фондовая
(сумма)
биржа» _____ не позднее _____⁶.
(номер счета) (дата)

(уполномоченное лицо Биржи)

(подпись)

(Ф.И.О.)

⁶ Указывается в случае неисполнения или ненадлежащего исполнения недобросовестным участником клиринга обязательств по восстановлению взносов участников клиринга в гарантийный фонд

Приложение 10
к Правилам осуществления
клиринга и расчетов по
биржевым сделкам с иностранной
валютой в ОАО «Белорусская
валютно-фондовая биржа»

Примерная форма

Распечатано «__» _____ г. 00.00.00

Открытое акционерное общество
«Белорусская валютно-фондовая биржа»

УВЕДОМЛЕНИЕ № __ от _____
о проведении специальной сессии

В соответствии с Правилами осуществления клиринга и расчетов по биржевым сделкам с иностранной валютой в ОАО «Белорусская валютно-фондовая биржа» информируем о проведении специальной сессии по принудительному закрытию нетто-позиций недобросовестного участника клиринга в валюте: _____.
(наименование валюты)

(уполномоченное лицо Биржи)

(подпись)

(Ф.И.О.)

Приложение 11
к Правилам осуществления
клиринга и расчетов по
биржевым сделкам с иностранной
валютой в ОАО «Белорусская
валютно-фондовая биржа»

Примерная форма

Открытое акционерное общество
«Белорусская валютно-фондовая биржа»

УВЕДОМЛЕНИЕ № ___ от _____
о совершении закрывающей сделки
по клиринговому отчету № ___ от _____

Участник клиринга _____
(наименование участника клиринга)

В соответствии с Правилами осуществления клиринга и расчетов по биржевым сделкам с иностранной валютой в ОАО «Белорусская валютно-фондовая биржа» для принудительного закрытия нетто-позиций недобросовестного участника клиринга совершена закрывающая сделка:

Наименование валюты	Итоговые нетто-требования	Нетто-требования, которые подлежат исполнению в валюте нетто-требований	Нетто-требования, которые подлежат исполнению в белорусских рублях (по закрывающей сделке)

Уполномоченное лицо Биржи

(Ф.И.О.)⁷

⁷ Ф.И.О. указывается в случае подписания клирингового отчета на бумажном носителе.