

УТВЕРЖДЕНА

Приказом ПАО Московская Биржа
От 18 июня 2021 года № МБ-П-2021-1600

Спецификация поставочных фьючерсных контрактов на иностранную валюту и драгоценные металлы (в новой редакции)

Настоящая Спецификация поставочных фьючерсных контрактов на иностранную валюту и драгоценные металлы (далее – Спецификация) определяет стандартные условия заключения поставочных фьючерсных контрактов на иностранную валюту и драгоценные металлы (далее – фьючерсные контракты) на валютном рынке и рынке драгоценных металлов ПАО Московская Биржа.

Спецификация совместно с правилами клиринга Небанковской кредитной организации-центрального контрагента «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество), регулирующими порядок осуществления клиринга по сделкам, заключенным на валютном рынке и рынке драгоценных металлов ПАО Московская Биржа (далее – Правила клиринга), правилами, регулирующими порядок проведения торгов на валютном рынке и рынке драгоценных металлов ПАО Московская Биржа (далее – Правила торгов), определяет порядок возникновения, изменения, исполнения и прекращения обязательств по фьючерсным контрактам, а также иные условия фьючерсных контрактов в соответствии с нормативными актами Банка России.

Термины и определения, используемые в Спецификации, понимаются в соответствии с законодательством Российской Федерации, Правилами торгов, Правилами клиринга.

1. Общие положения

1.1. Вид договоров, являющихся производными финансовыми инструментами, которые будут заключаться на условиях Спецификации - поставочные фьючерсные контракты.

1.2. Формирование кода фьючерсного контракта осуществляется по следующим правилам:

Код фьючерсного контракта с возможностью выбора даты исполнения обязательств:

XXXRUB_LTV, где

XXX – код базисного актива,

LTV – код, определяющий фьючерсный контракт.

1.3. Базисным активом фьючерсного контракта является иностранная валюта или драгоценный металл.

1.4. Биржа утверждает Список параметров поставочных фьючерсных контрактов на иностранную валюту / драгоценные металлы с возможностью выбора даты исполнения обязательств на валютном рынке и рынке драгоценных металлов ПАО Московская Биржа, который содержит:

- код фьючерсного контракта;

- код базисного актива;
- наименование базисного актива;
- лот фьючерсного контракта;
- шаг цены;
- минимально возможную дату исполнения обязательств по фьючерсному контракту, которая может быть указана в заявке;
- максимально возможную дату исполнения обязательств по фьючерсному контракту, которая может быть указана в заявке.

1.5. Первым днем торгов, на которых может быть заключен фьючерсный контракт с возможностью выбора даты исполнения обязательств, является дата введения в действие Спецификации, если иное не установлено решением Биржи.

Последним днем торгов, на которых может быть заключен фьючерсный контракт с возможностью выбора даты исполнения обязательств, является последний рабочий день, дата которого предшествует дате прекращения действия Спецификации, если иное не установлено решением Биржи.

2. Обязательства по фьючерсным контрактам и порядок их прекращения

2.1. Стороны фьючерсного контракта обязаны периодически уплачивать друг другу денежные средства в российских рублях (вариационную маржу) в сумме, размер которой зависит от изменения цены базисного актива. Вариационная маржа рассчитывается и уплачивается в период с расчетного дня, следующего за датой заключения фьючерсного контракта, до даты исполнения обязательств по фьючерсному контракту, указанной в заявке на заключение фьючерсного контракта, включительно. Порядок расчета и уплаты вариационной маржи определяется Правилами клиринга.

2.2. В дату исполнения обязательств по фьючерсному контракту продавец обязан передать покупателю иностранную валюту / драгоценный металл, являющийся базисным активом фьючерсного контракта, в объеме сделки, а покупатель обязан принять базисный актив и уплатить продавцу сумму в российских рублях в объеме и порядке, определяемыми в соответствии с Правилами клиринга.

2.3. Дата исполнения обязательств по фьючерсному контракту с возможностью выбора даты исполнения обязательств, указываемая участником торгов в заявке, определяется как $T+n$, где T – первый расчетный день, следующий за датой заключения фьючерсного контракта, а n – количество календарных дней, следующих за днем T .

2.4. В случае если дата исполнения обязательств по фьючерсному контракту приходится на день, не являющийся расчетным днем по соответствующему базисному активу, исполнение обязательств переносится на ближайший следующий расчетный день.

2.5. Порядок прекращения обязательств по фьючерсным контрактам определяется Правилами клиринга.

2.6. Стороны несут ответственность за неисполнение или ненадлежащее исполнение обязательств по фьючерсным контрактам в соответствии с законодательством Российской Федерации и Правилами клиринга.

3. Особые условия

3.1. В случае приостановления / прекращения заключения фьючерсных контрактов, в том числе в связи с ограничением обращения базисного актива фьючерсного контракта, Биржа и/или Клиринговый центр вправе по согласованию друг с другом принять одно или несколько из следующих решений:

3.1.1. об изменении даты исполнения обязательств по фьючерсному контракту;

3.1.2. о прекращении обязательств по фьючерсному контракту;

3.1.3. об изменении порядка расчета и перечисления вариационной маржи;

3.1.4. иные решения, предусмотренные Правилами торгов.

3.2. Информация о решении, принятом Биржей и/или Клиринговым центром в соответствии с пунктом 3.1 Спецификации, раскрывается путем ее опубликования на сайтах Биржи и/или Клирингового центра в сети интернет не менее чем за три рабочих дня до вступления в силу соответствующих решений, если иной срок не установлен решением Биржи и/или Клирингового центра.

4. Внесение изменений и дополнений в Спецификацию

4.1. Биржа вправе по согласованию с Клиринговым центром внести изменения и дополнения в Спецификацию.

4.2. Изменения и дополнения в Спецификацию вступают в силу с момента введения Биржей в действие Спецификации, содержащей указанные изменения и дополнения.

4.3. Информация о введении в действие Спецификации, содержащей изменения и дополнения, раскрывается путем ее опубликования на сайте Биржи в сети интернет не позднее чем за три рабочих дня до даты введения ее в действие.

4.4. С момента вступления в силу изменений и дополнений в Спецификацию условия существующих обязательств по ранее заключенным фьючерсным контрактам считаются измененными с учетом таких изменений и дополнений.