

**Специфікація позначень типових умов здійснення розрахунків в заявках/біржових контрактах**

(нова редакція)

Позначення	Сфера використання (ринок)	Принцип розрахунків <sup>1</sup>	Вимога стосовно блокування активів	Особливості виконання біржового контракту в торговельній системі (використання «Звіту на виконання» <sup>2</sup> )	Участь Центрального контрагенту <sup>6</sup> (ЦК) при укладанні біржового контракту <sup>3</sup>
<b>T</b>	ринок заявок	DVP	обов'язкова наявність заблокованих активів у кліринговій установі <sup>4</sup> для виставлення заявки (при продажу - цінних паперів; при купівлі – грошових коштів)	не використовується	+
<b>T</b>	ринок котировок, ринок РЕПО	DVP	обов'язкова наявність заблокованих активів у кліринговій установі <sup>4</sup> для виставлення заявки (при продажу - цінних паперів; при купівлі – грошових коштів)	не використовується	ЦК бере участь виключно при укладанні біржових контрактів за заявками одного учасника торгів
<b>C</b>	ринок котировок	DVP	обов'язкова наявність заблокованих активів у кліринговій установі <sup>4</sup> для виставлення заявки (при продажу - цінних паперів; при купівлі – грошових коштів)	не використовується	+
<b>K</b>	ринок котировок, ринок РЕПО, ринок одностороннього аукціону	DVP	обов'язкова наявність заблокованих активів у кліринговій установі <sup>4</sup> на момент виконання зобов'язань за біржовим контрактом відповідно до його умов (при продажу - цінних паперів; при купівлі – грошових коштів)	обов'язкове використання	ЦК бере участь виключно при укладанні біржових контрактів за заявками одного учасника торгів
<b>X</b>	ринок котировок	DVP	обов'язкова наявність заблокованих активів у кліринговій установі <sup>4</sup> на момент виконання зобов'язань за біржовим контрактом відповідно до його умов (при продажу - цінних паперів; при купівлі – грошових коштів)	обов'язкове використання	+
<b>W</b>	ринок РЕПО (режим «РЕПО з контролем ризиків»)	DVP	обов'язкова наявність в учасника торгів, який подає заявку для акцепту центральним контрагентом, вільного ліміту в розмірі, достатньому для забезпечення виконання його зобов'язань за договорами РЕПО, на рахунках та в порядку, що визначені внутрішніми документами ЦК <sup>6</sup> , на момент акцепту ЦК відповідної заявки РЕПО	не використовується	+
<b>Wq</b>	ринок РЕПО (режим «РЕПО з контролем ризиків»)	DVP	негайне виконання першої частини операції РЕПО без наступного блокування гарантійного забезпечення; обов'язкова наявність відповідного обсягу заблокованих клірингових активів <sup>7</sup> для забезпечення виконання операцій з поставки/одержання цінних паперів та/або коштів для виконання правочинів за першою частиною операції РЕПО та вільного ліміту у покупця цінних паперів за першою частиною договору РЕПО (кредитора) в розмірі, достатньому для забезпечення виконання його зобов'язань за договорами РЕПО, на рахунках та в порядку, що визначені внутрішніми документами ЦК <sup>6</sup> , на момент акцепту ЦК відповідної заявки РЕПО	не використовується	+

<b>Wi</b>	ринок РЕПО (режим «РЕПО з контролем ризиків»)	DVP	негайне виконання першої частини операції РЕПО з наступним блокуванням гарантійного забезпечення; обов'язкова наявність відповідного обсягу заблокованих клірингових активів <sup>7</sup> для забезпечення виконання операцій з поставки/одержання цінних паперів та/або коштів для виконання правочинів за першою частиною операції РЕПО на рахунках, визначених ЦК <sup>6</sup> , в порядку, що визначені внутрішніми документами ЦК, на момент акцепту ЦК відповідної заявки РЕПО	не використовується	+
<b>Wr</b>	ринок РЕПО (режим «РЕПО з контролем ризиків»)	DVP	ролловер (негайне виконання першої частини договору РЕПО, при якій зобов'язання за першою частиною договору РЕПО та протилежні їм зобов'язання за другою частиною договору РЕПО, укладеного в режимі «РЕПО з контролем ризиків», дата розрахунків за якими настала, припиняються за результатами неттінгу); обов'язкова наявність відповідного обсягу заблокованих клірингових активів <sup>7</sup> та вільного ліміту для забезпечення виконання операцій з поставки/одержання цінних паперів та/або коштів для виконання правочинів за першою частиною операції РЕПО шляхом ролловеру на рахунках, визначених ЦК <sup>6</sup> , в порядку, що визначені внутрішніми документами ЦК, на момент акцепту ЦК відповідної заявки РЕПО	не використовується	+
<b>P</b>	ринок одностороннього аукціону, ринку котировок (переговорний режим) <sup>8</sup>	FD	обов'язкове попереднє блокування цінних паперів у відповідному депозитарії на момент виконання зобов'язань за біржовим контрактом відповідно до його умов (грошові кошти не блокуються) <sup>5</sup>	не використовується	-
<b>OVER</b>	ринку одностороннього аукціону	FD	відповідно до вимог регламенту відповідного Аукціону <sup>5</sup>	не використовується	-

<sup>1</sup> Використовуються такі позначки: «**DVP**» – це розрахунки за принципом «поставка цінних паперів проти оплати»; «**FD**» – це розрахунки без дотримання принципу «поставка проти оплати».

<sup>2</sup> «Звіт на виконання» – це функціонал торговельної системи, за допомогою якого учасники торгів (сторони біржового контракту) ініціюють виконання біржового контракту за рахунок заблокованих активів у кліринговій установі. Відправка «Звіту на виконання» за біржовим контрактом може бути здійснена учасником біржових торгів шляхом запуску функції «Введення звіту на виконання» (вкладка «Ввести на виконання...» підпункту «Звіт» пункту «Дія» головного меню програми PFTS Trade SE) після позначення учасником біржових торгів в полі «Угода №» відповідного номеру біржового контракту /для пов'язаних біржових контрактів - комбінації чисел, яка є спільною (однаковою) в номерах пов'язаних біржових контрактів/ або шляхом використання послуги «Груповий звіт».

<sup>3</sup> Укладання біржових контрактів за участю Центрального контрагенту (ЦК)<sup>6</sup> відбувається відповідно до встановлених біржею особливостей (вимог) запровадження укладання біржових контрактів за участю ЦК. Використовуються такі позначки участі ЦК при укладанні біржового контракту на умовах розрахунків з відповідним позначенням: «+» - ЦК бере участь; «-» - ЦК не бере участі; в інших випадках зазначається, за яких умов ЦК бере участь при укладанні біржового контракту.

<sup>4</sup> Функції клірингової установи виконує ПАТ «Розрахунковий центр».

<sup>5</sup> Порядок та умови здійснення розрахунків, в тому числі вимога стосовно блокування активів, за біржовими контрактами, укладеними на аукціонах, регулюється Регламентом про проведення відповідного аукціону.

<sup>6</sup> Центральним контрагентом (ЦК) виступає ПАТ «Розрахунковий центр». Виконання зобов'язань щодо операції РЕПО, укладених в режимі «РЕПО з контролем ризиків», відбувається в розмірі, строки та порядку, що визначені внутрішніми документами ПАТ «Розрахунковий центр».

<sup>7</sup> Клірингові активи – права та зобов'язання щодо коштів та цінних паперів за деривативними контрактами / правочинами щодо цінних паперів, що обліковуються на клірингових рахунках/субрахунках учасників клірингу в системі клірингового обліку ПАТ «Розрахунковий центр».

<sup>8</sup> Використання коду розрахунків P в переговорному режимі на ринку котировок можливе виключно при проведенні операцій в інтересах емітента щодо цінних паперів, випущених цим емітентом.