

Специфікація позначень типових умов здійснення розрахунків в заявках/контрактах

(нова редакція)

Позначення	Сфера використання - ринок (режим/режими)	Принцип розрахунків ¹	Вимога стосовно блокування активів	Особливості виконання контракту в торговельній системі (використання «Звіту на виконання» ²)	Участь Центрального контрагенту ⁶ (ЦК) при укладанні контракту ³
Т	ринок заявок	DVP	обов'язкова наявність заблокованих активів у кліринговій установі ⁴ для виставлення заявки (при продажу - цінних паперів; при купівлі – грошових коштів)	не використовується	+
Т	ринок котировок ринок РЕПО	DVP	обов'язкова наявність заблокованих активів у кліринговій установі ⁴ для виставлення заявки (при продажу - цінних паперів; при купівлі – грошових коштів)	не використовується	ЦК бере участь виключно при укладанні контрактів за заявками одного учасника торгів
С	ринок котировок	DVP	обов'язкова наявність заблокованих активів у кліринговій установі ⁴ для виставлення заявки (при продажу - цінних паперів; при купівлі – грошових коштів)	не використовується	+
К	ринок котировок ринок РЕПО (за виключенням режиму «РЕПО з контролем ризиків») ринок одностороннього аукціону	DVP	обов'язкова наявність заблокованих активів у кліринговій установі ⁴ на момент виконання зобов'язань за контрактом відповідно до його умов (при продажу - цінних паперів; при купівлі – грошових коштів)	обов'язкове використання	ЦК бере участь виключно при укладанні контрактів за заявками одного учасника торгів
Х	ринок котировок	DVP	обов'язкова наявність заблокованих активів у кліринговій установі ⁴ на момент виконання зобов'язань за контрактом відповідно до його умов (при продажу - цінних паперів; при купівлі – грошових коштів)	обов'язкове використання	+
W	ринок РЕПО (режим «РЕПО з контролем ризиків»)	DVP	спосіб розрахунків, який не передбачає негайне виконання першої частини операції РЕПО (звичайні розрахунки): 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 ⁶ , на момент акцепту ЦК відповідної заявки РЕПО	не використовується	+

Wq	ринок РЕПО (режим «РЕПО з контролем ризиків»)	DVP	<p>спосіб розрахунків, який передбачає негайне виконання першої частини операції РЕПО (негайні розрахунки):</p> <p>обов'язкова наявність відповідного обсягу заблокованих клірингових активів⁷ 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 ЦК⁶, на момент акцепту ЦК відповідної заявки РЕПО</p>	не використовується	+
Wi	ринок РЕПО (режим «РЕПО з контролем ризиків»)	DVP	<p>спосіб розрахунків, який передбачає негайне виконання першої частини операції РЕПО з наступним блокуванням гарантійного забезпечення (негайні розрахунки з наступним блокуванням гарантійного забезпечення):</p> <p>обов'язкова наявність відповідного обсягу заблокованих клірингових активів⁷ для забезпечення виконання операцій з поставки/одержання цінних паперів та/або коштів для виконання правочинів за першою частиною операції РЕПО на рахунках, визначених ЦК⁶, в порядку, що визначені внутрішніми документами ЦК, на момент акцепту ЦК відповідної заявки РЕПО</p>	не використовується	+
Wr	ринок РЕПО (режим «РЕПО з контролем ризиків»)	DVP	<p>спосіб розрахунків, який передбачає негайне виконання першої частини операції РЕПО шляхом ролловеру⁸ (негайні розрахунки з використанням неттінгу протилежних зобов'язань):</p> <p>обов'язкова наявність відповідного обсягу заблокованих клірингових активів⁷ 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 ЦК⁶, в порядку, що визначені внутрішніми документами ЦК, на момент акцепту ЦК відповідної заявки РЕПО</p>	не використовується	+
S	БТМ деривативних контрактів (режим «Свопи з контролем ризиків»)	DVP	<p>спосіб розрахунків, який не передбачає негайне виконання першої частини деривативного контракту (звичайні розрахунки):</p> <p>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 деривативним контрактом, на рахунках та в порядку, що визначені внутрішніми документами ЦК⁶, на момент акцепту ЦК відповідної заявки</p>	не використовується	+
Sq	БТМ деривативних контрактів (режим «Свопи з контролем ризиків»)	DVP	<p>спосіб розрахунків, який передбачає негайне виконання першої частини деривативного контракту (негайні розрахунки):</p> <p>обов'язкова наявність відповідного обсягу заблокованих клірингових активів⁷ для забезпечення виконання правочинів за першою частиною деривативного контракту та вільного ліміту в розмірі, достатньому для забезпечення виконання його зобов'язань за деривативним контрактом, на рахунках та в порядку, що визначені внутрішніми документами ЦК⁶, на момент акцепту ЦК відповідної заявки</p>	не використовується	+

Si	БТМ деривативних контрактів (режим «Свопи з контролем ризиків»)	DVP	спосіб розрахунків, який передбачає негайне виконання першої частини деривативного контракту з наступним блокуванням гарантійного забезпечення (негайні розрахунки з наступним блокуванням гарантійного забезпечення): обов'язкова наявність відповідного обсягу заблокованих клірингових активів ⁷ для забезпечення виконання правочинів за першою частиною деривативного контракту на рахунках, визначених ЦК ⁶ , в порядку, що визначені внутрішніми документами ЦК, на момент акцепту ЦК відповідної заявки	не використовується	+
Sr	БТМ деривативних контрактів (режим «Свопи з контролем ризиків»)	DVP	спосіб розрахунків, який передбачає негайне виконання першої частини деривативного контракту шляхом ролловеру ⁸ (негайні розрахунки з використанням нетінгу протилежних зобов'язань): обов'язкова наявність відповідного обсягу заблокованих клірингових активів ⁷ та вільного ліміту для забезпечення виконання операцій для виконання правочинів за першою частиною деривативного контракту шляхом ролловеру на рахунках, визначених ЦК ⁶ , в порядку, що визначені внутрішніми документами ЦК, на момент акцепту ЦК відповідної заявки	не використовується	+
P	ринок одностороннього аукціону ринок котировок (переговорний режим) ⁹	FD	обов'язкове попереднє блокування цінних паперів у відповідному депозитарії на момент виконання зобов'язань за контрактом відповідно до його умов (грошові кошти не блокуються) ⁵	не використовується	-
OVER	ринок одностороннього аукціону	FD	відповідно до вимог регламенту відповідного Аукціону ⁵	не використовується	-

¹ Використовуються такі позначки:

«**DVP**» – це розрахунки за принципом «поставка проти оплати»; «**FD**» – це розрахунки без дотримання принципу «поставка проти оплати».

² «Звіт на виконання» – це функціонал торговельної системи, за допомогою якого учасники торгів (сторони контракту) ініціюють виконання контракту за рахунок заблокованих активів у кліринговій установі. Відправка «Звіту на виконання» за 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 TradeUA) після позначення учасником біржових торгів в полі «Угода №» відповідного номеру контракту /для пов'язаних контрактів - комбінації чисел, яка є спільною (однаковою) в номерах пов'язаних контрактів/ або шляхом використання послуги «Груповий звіт».

³ Укладання контрактів за участю Центрального контрагенту (ЦК)⁶ відбувається відповідно до встановлених особливостей (вимог) укладання контрактів за участю ЦК. Використовуються такі позначки участі ЦК при укладанні 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 укладенні контракту.

⁴ Функції клірингової установи виконує ПАТ «Розрахунковий центр».

⁵ Порядок та умови здійснення розрахунків, в тому числі вимога стосовно блокування активів, за контрактами, укладеними на аукціонах, регулюється регламентом проведення відповідного аукціону.

⁶ Центральним контрагентом (ЦК) виступає ПАТ «Розрахунковий центр».

⁷ 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».

⁸ Ролловер – процедура негайного виконання першої частини договору РЕПО, укладеного в режимі «РЕПО з контролем ризиків», або деривативного контракту, при якій зобов'язання за першою частиною договору РЕПО, укладеного в режимі «РЕПО з контролем ризиків» або деривативного контракту та протилежні їм зобов'язання за другою частиною договору РЕПО, укладеного в режимі «РЕПО з контролем ризиків», або деривативного контракту, дата розрахунків за якими настала, припиняються за результатами нетінгу.

⁹ Використання коду розрахунків P в переговорному режимі на ринку котировок можливе виключно при проведенні операцій в інтересах емітента щодо цінних паперів, випущених цим емітентом.