

ПОСТАНОВЛЕНИЕ МИНИСТЕРСТВА ФИНАНСОВ РЕСПУБЛИКИ БЕЛАРУСЬ

18 ноября 2016 г. № 98

Об утверждении Инструкции о порядке совершения срочных сделок в торговой системе организатора торговли ценными бумагами

На основании абзаца шестого части первой статьи 8 Закона Республики Беларусь от 5 января 2015 года «О рынке ценных бумаг», абзаца второго пункта 1 постановления Совета Министров Республики Беларусь от 10 сентября 2009 г. № 1163 «О некоторых вопросах эмиссии (выдачи), обращения и погашения ценных бумаг», пункта 10 Положения о Министерстве финансов Республики Беларусь, утвержденного постановлением Совета Министров Республики Беларусь от 31 октября 2001 г. № 1585 «Вопросы Министерства финансов Республики Беларусь», Министерство финансов Республики Беларусь ПОСТАНОВЛЯЕТ:

1. Утвердить прилагаемую Инструкцию о порядке совершения срочных сделок в торговой системе организатора торговли ценными бумагами.

2. Настоящее постановление вступает в силу после его официального опубликования.

Министр

В.В.Амарин

УТВЕРЖДЕНО

Постановление
Министерства финансов
Республики Беларусь
18.11.2016 № 98

ИНСТРУКЦИЯ

о порядке совершения срочных сделок в торговой системе организатора торговли ценными бумагами

1. Настоящая Инструкция устанавливает порядок и условия совершения срочных сделок в торговой системе организатора торговли ценными бумагами.

2. Для целей настоящей Инструкции нижеперечисленные термины используются в следующих значениях:

базисный актив – лежащий в основе финансового инструмента срочных сделок и имеющий стоимостную оценку актив, поставляемый либо используемый для расчета при исполнении срочной сделки. Базисным активом могут являться ценные бумаги (за исключением ценных бумаг Национального банка Республики Беларусь), включая производные ценные бумаги, финансовые инструменты срочных сделок;

вариационная маржа – сумма денежных средств, требование (обязательство) уплаты которой возникает у сторон срочной сделки по результатам переоценки стоимости приобретенных (проданных) финансовых инструментов срочных сделок, проводимой путем оценки разности текущих и расчетных цен по процедуре, установленной организатором торговли ценными бумагами;

депозитная маржа – сумма денежных средств, внесенная участниками торгов для обеспечения исполнения обязательств по срочным сделкам;

закрытие позиции – прекращение у участника торгов совокупности прав и обязанностей по открытой позиции, влекущее прекращение требований и обязательств;

открытие позиции – возникновение у участника торгов совокупности прав и обязанностей в результате совершения им срочных сделок, влекущее возникновение требований и обязательств;

расчетная цена – цена финансового инструмента срочных сделок, установленная организатором торговли ценными бумагами по результатам торгов предыдущего торгового дня;

срочная сделка – заключенная в торговой системе организатора торговли ценными бумагами сделка с финансовым инструментом срочных сделок, влекущая приобретение ее сторонами прав и обязанностей в отношении базисного актива, вытекающих из типовых условий финансового инструмента срочных сделок. Срочные сделки не являются сделками пари;

текущая цена – цена покупки (продажи) финансового инструмента срочных сделок, приобретенного (проданного) в текущий торговый день. Текущая цена финансового инструмента срочных сделок, приобретенного (проданного) до текущего торгового дня, равна расчетной цене;

участники торгов – профессиональные участники рынка ценных бумаг, юридические лица – нерезиденты, имеющие право осуществлять профессиональную деятельность по ценным бумагам в соответствии с иностранным правом, соответствующие требованиям, установленным республиканским органом государственного управления, осуществляющим государственное регулирование рынка ценных бумаг, допущенные к совершению срочных сделок в торговой системе организатора торговли ценными бумагами.

Иные термины используются в значениях, установленных Законом Республики Беларусь от 5 января 2015 года «О рынке ценных бумаг» (Национальный правовой Интернет-портал Республики Беларусь, 10.01.2015, 2/2229), другими актами законодательства.

Термин «финансовый инструмент срочных сделок» применяется в значении, установленном частью второй пункта 1 статьи 160 Налогового кодекса Республики Беларусь.

3. Организатор торговли ценными бумагами разрабатывает следующие локальные нормативные правовые акты, регулирующие порядок торговли финансовыми инструментами срочных сделок:

правила и (или) иной документ, регулирующий порядок торговли финансовыми инструментами срочных сделок;

порядок допуска участников к торгам и исключения из числа участников торгов.

Организатор торговли ценными бумагами в правилах и (или) ином документе, регулирующем порядок торговли финансовыми инструментами срочных сделок, утверждаемых им в установленном законодательством порядке, определяет:

типовые условия для каждого вида финансового инструмента срочных сделок;

перечень базисных активов;

порядок совершения срочных сделок;

порядок раскрытия информации о наименовании и обозначении финансового инструмента срочных сделок, принятых у организатора торговли ценными бумагами, и о совершенных срочных сделках;

систему управления рисками неисполнения обязательств по срочным сделкам.

Типовые условия для финансового инструмента срочных сделок должны содержать: наименование и обозначение финансового инструмента срочных сделок, принятые у организатора торговли ценными бумагами;

наименование и обозначение базисного актива;

минимальный лот (объем) базисного актива;

величину ценового пункта (шаг цены) финансового инструмента срочных сделок;

срок расчетов по финансовому инструменту срочных сделок;

порядок определения текущей, расчетной цены, а также цены исполнения финансового инструмента срочных сделок;

порядок определения размера депозитной и вариационной маржи по финансовому инструменту срочных сделок;

порядок передачи базисного актива либо взаиморасчета между сторонами срочной сделки в будущем в зависимости от изменения значения цены базисного актива;

первый и последний дни торгов или порядок определения таких дней.

Порядок совершения срочных сделок должен предусматривать:

порядок проведения торгов, включая порядок подачи в торговую систему организатора торговли ценными бумагами заявок участников торгов (их изменения и отзыва), порядок открытия и закрытия позиций участников торгов, основания и порядок принудительного закрытия позиций участников торгов;

порядок доведения до участников торгов информации об условиях и порядке совершения срочных сделок;

порядок определения размера и расчета депозитной и вариационной маржи;

порядок расчета текущей и расчетной цены приобретенных (проданных) финансовых инструментов срочных сделок, а также порядок расчета их разницы;

порядок ведения реестра заявок, поданных участниками торгов;

порядок ведения реестра срочных сделок;

порядок проведения переоценки приобретенных (проданных) финансовых инструментов срочных сделок.

Система управления рисками неисполнения обязательств по срочным сделкам должна содержать:

порядок установления лимитов колебания цен по каждому финансовому инструменту срочных сделок;

порядок установления размера депозитной и вариационной маржи по каждому финансовому инструменту срочных сделок;

порядок установления лимитов на объем заключенных сделок;

предельное значение доли каждого участника торгов по каждому финансовому инструменту срочных сделок;

меры по предотвращению чрезвычайных ситуаций, в том числе порядок приостановки торгов, принудительного закрытия позиций участников торгов;

меры по защите интересов клиентов участников торгов, в том числе в случае перехода клиента одного участника торгов на обслуживание к другому участнику торгов;

меры, применяемые к участникам торгов в случае нарушения правил, регулирующих порядок торговли финансовыми инструментами срочных сделок.

4. Организатор торговли ценными бумагами ведет реестр заявок, поданных участниками торгов, а также реестр срочных сделок. Организатор торговли ценными бумагами обеспечивает формирование выписки из них на любую дату и за любой период.

Реестр заявок, поданных участниками торгов, должен содержать:

идентификационный номер заявки;

дату и время регистрации заявки в торговой системе организатора торговли ценными бумагами;

наименование и код участника торгов, подавшего заявку;

реквизиты и условия заявки.

Реестр срочных сделок должен содержать:

идентификационный номер срочной сделки;

дату и время регистрации срочной сделки в торговой системе организатора торговли ценными бумагами;

наименования и коды участников торгов, совершивших сделку;

наименование и обозначение финансового инструмента срочных сделок, принятые у организатора торговли ценными бумагами;

наименование и обозначение базисного актива;

количество срочных сделок и цену одного финансового инструмента срочных сделок;

сумму срочной сделки.

5. Документы, указанные в части первой пункта 3 настоящей Инструкции, должны быть размещены организатором торговли ценными бумагами на едином информационном

ресурсе рынка ценных бумаг и на официальном сайте организатора торговли ценными бумагами в глобальной компьютерной сети Интернет не позднее 2 рабочих дней, следующих за днем их утверждения.

Организатор торговли ценными бумагами не позднее 2 рабочих дней, следующих за днем совершения срочных сделок в торговой системе организатора торговли ценными бумагами, раскрывает информацию о совершенных срочных сделках на едином информационном ресурсе рынка ценных бумаг и на своем официальном сайте в глобальной компьютерной сети Интернет.

Информация о совершенных в торговой системе организатора торговли ценными бумагами срочных сделках, размещаемая в соответствии с частью второй настоящего пункта, должна включать:

дату совершения срочной сделки;

наименование и обозначение финансового инструмента срочных сделок, принятые у организатора торговли ценными бумагами;

количество срочных сделок;

текущую и расчетную цену финансового инструмента срочных сделок.

6. Локальные нормативные правовые акты организатора торговли ценными бумагами, указанные в части первой пункта 3 настоящей Инструкции, порядок ведения реестра заявок, поданных участниками торгов, а также реестра срочных сделок помимо сведений, предусмотренных настоящей Инструкцией, могут содержать иные сведения, определенные организатором торговли ценными бумагами.

7. Участники торгов вносят депозитную и вариационную маржу только денежными средствами.

8. Участники торгов, совершающие срочные сделки за счет клиентов, обеспечивают ознакомление своих клиентов с системой управления рисками неисполнения обязательств по срочным сделкам, принятой организатором торговли ценными бумагами.

9. Порядок диверсификации рисков, связанных с совершением срочных сделок, определяется участником торгов.