УТВЕРЖДЕНО
на заседании
Наблюдательного совета УзРВБ
30 декабря 2021 года
(Протокол №257)

С учетом внесенных изменений:
Протокол №265 от 29 сентября 2022 года

ПОЛОЖЕНИЕ О ПОРЯДКЕ ФОРМИРОВАНИЯ И ИСПОЛЬЗОВАНИЯ СРЕДСТВ ГАРАНТИЙНОГО ФОНДА АО «УЗБЕКСКАЯ РЕСПУБЛИКАНСКАЯ ВАЛЮТНАЯ БИРЖА»

1. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ

1. Настоящее Положение разработано в соответствии с Законом Республики Узбекистан «О биржах и биржевой деятельности», Уставом и иными внутренними нормативными документами АО «Узбекская республиканская валютная биржа» (далее – УзРВБ) и определяет порядок формирования и использования средств Гарантийного фонда по операциям валютного рынка (в том числе по валютным фьючерсным контрактам).

2. В целях настоящего Положения применяются следующие основные понятия:

биржевой инструмент - совокупность стандартных условий (код/вид иностранной валюты или валютного фьючерсного контракта, допущенного в установленном порядке к биржевым торгам УзРВБ, сроки осуществления клиринга и проведения расчетов и т.д.), установленных в спецификации;

Покупка и (или) продажа биржевого инструмента означает покупку и (или) продажу определенного количества иностранной валюты или валютного фьючерсного контракта;

внутренние документы УзРВБ – внутренние нормативные документы, утвержденные органами управления УзРВБ в соответствии с их компетенцией;

дефолт - неисполнение (несвоевременное или ненадлежащее исполнение) дилером своих нетто-обязательств;

деятельность (функция) центрального контрагента – клиринговая деятельность УзРВБ, которая выступает стороной для каждого продавца и каждого покупателя биржевого инструмента по сделкам, заключённым участниками торгов в торговой системе УзРВБ;

дилер - член УзРВБ, заключающий биржевые сделки на биржевых торгах по купле-продаже определенного биржевого инструмента от своего имени и за свой счет;

добросовестный дилер – дилер, своевременно и полностью исполнивший свои нетто-обязательства по итогам клиринга в соответствии с настоящим Положением;

клиринг – определение, уточнение и зачет взаимных обязательств дилеров по заключенным сделкам;

недобросовестный дилер – дилер, не исполнивший или ненадлежащим образом исполнивший свои нетто-обязательства по итогам клиринга в соответствии с настоящим Положением;

нетто-позиция – нетто-обязательство и (или) нетто-требование;

нетто-обязательство - сумма денежных средств (в сумах и (или) иностранной валюте), представляющая собой превышение обязательств над требованиями, образующееся по итогам торгов;

нетто-требование - сумма денежных средств (в сумах и (или) иностранной валюте), представляющая собой превышение требований над обязательствами, образующееся по итогам торгов;

обеспечение – денежные средства (национальная валюта/иностранная валюта), учитываемые в качестве обеспечения заключаемых дилером сделок, а также в качестве исполнения его обязательств;

торгово-клиринговая система – автоматизированная электронная система УзРВБ, осуществляющая биржевые торги по купле-продаже биржевого инструмента, регистрацию принятых заявок, автоматическое заключение биржевых сделок, обеспечивающая определение курса (котирование), осуществление клиринга и проведение расчетов, оперативное отображение текущей информации на рабочих местах трейдеров, а также протоколирование процесса торгов и формирование итоговых биржевых документов.

3. Гарантийный фонд создается решением Наблюдательного совета УзРВБ.

4. УзРВБ, принимая на себя функции центрального контрагента, гарантирует исполнение обязательств перед каждым добросовестным дилером с учетом ограничений своей ответственности в размере Гарантийного фонда в соответствии с Правилами осуществления клиринга и проведения расчетов на валютном рынке АО «Узбекская республиканская валютная биржа».

5. Максимальная доля Гарантийного фонда, которая может быть использована для урегулирования дефолта на валютном рынке для одного торгового дня, составляет не более 30%.

2. ПОРЯДОК ФОРМИРОВАНИЯ СРЕДСТВ ГАРАНТИЙНОГО ФОНДА

6. Источниками формирования средств Гарантийного фонда являются:

а) часть чистой прибыли УзРВБ;

б) взносы дилеров;

в) иные источники, не запрещенные законодательством.

3. ИСПОЛЬЗОВАНИЕ СРЕДСТВ ГАРАНТИЙНОГО ФОНДА

7. Средства Гарантийного фонда используются для покрытия неисполненных обязательств недобросовестных дилеров по сделкам с биржевыми инструментами валютного рынка при условии их возвратности.

8. Средства Гарантийного фонда не могут использоваться в качестве обеспечения исполнения каких-либо иных обязательств УзРВБ и(или) дилеров, помимо обязательств по сделкам, заключенным на валютном рынке в рамках урегулирования дефолта.

9. УзРВБ вправе размещать средства Гарантийного фонда на краткосрочные депозиты в коммерческих банках и в ликвидные ценные бумаги в установленном порядке.

10. Доходы от инвестирования средств Гарантийного фонда не начисляются и не выплачиваются дилерам.

4. ВОЗМЕЩЕНИЕ СРЕДСТВ ГАРАНТИЙНОГО ФОНДА

11. При использовании средств Гарантийного фонда для покрытия неисполненных обязательств недобросовестных дилеров УзРВБ в течение одного рабочего дня направляет недобросовестным дилерам уведомление о произведенном платеже и возврате (восстановлении) использованных средств Гарантийного фонда.

12. После получения уведомления недобросовестный дилер обязан в течение одного рабочего дня принять меры по возврату (восстановлению) использованных средств Гарантийного фонда.

13. В случае неисполнения или ненадлежащего исполнения дилером своих обязательств по возврату (восстановлению) использованных средств Гарантийного фонда в указанный срок, дилером уплачивается неустойка в размере согласно пункту 14 настоящего Положения.

14. Недобросовестный дилер, урегулирование позиций которого на валютном рынке по сделкам с центральным контрагентом проводилось более одного рабочего дня, обязан уплатить УзРВБ в отношении неисполненного нетто-обязательства по итогам клирингового дня неустойку в размере:

PLikv = min (R x 0,05% x D; R x 1%), где

PLikv - сумма неустойки;

min - математическая функция, определяющая наименьшее из указанных в скобках значений;

R - стоимость неисполненного нетто-обязательства в сумах, рассчитанная по расчетной цене биржевого инструмента, в котором выражено данное нетто-

обязательство, на момент закрытия последней торговой сессии по данному биржевому инструменту дня его возникновения;

D - количество календарных дней, в течение которых неисполненное нетто-обязательство не было исполнено.

15. Неустойки подлежат уплате недобросовестным дилером в течение пяти рабочих дней со дня предъявления УзРВБ соответствующего счета.

16. Начисление недобросовестным дилером неустоек может быть отменено по решению Исполнительного органа УзРВБ в ситуациях, когда неисполнение или ненадлежащее исполнение недобросовестным дилером своих обязательств было вызвано:

а) техническим сбоем, возникшим в работе торговой системы УзРВБ;

б) ненадлежащим исполнением своих функций УзРВБ, предусмотренных внутренними документами и(или) соответствующим договором, заключённым с УзРВБ.

5. ОТЧЕТНОСТЬ ПРИ ИСПОЛЬЗОВАНИИ СРЕДСТВ ГАРАНТИЙНОГО ФОНДА

17. Исполнительный орган УзРВБ представляет Наблюдательному совету УзРВБ отчет о формировании и использовании средств Гарантийного фонда ежеквартально.

6. ЗАКЛЮЧИТЕЛЬНЫЕ ПОЛОЖЕНИЯ

18. Лица, виновные в нарушении требований настоящего Положения, несут ответственность в соответствии с законодательством.

19. Споры, возникающие при исполнении настоящего Положения, разрешаются в порядке, установленном законодательством.

20. Настоящее Положение, а также все изменения и (или) дополнения к нему, вступают в силу после их утверждения Наблюдательным советом УзРВБ.