

**Утверждено  
Приказом  
Генерального директора  
Небанковской кредитной организации –  
центрального контрагента  
«Клиринговый центр МФБ»  
(акционерное общество)  
№766 от 01.10.2020**

**МЕТОДИКА УСТАНОВЛЕНИЯ  
РИСК-ПАРАМЕТРОВ ТОВАРНОГО РЫНКА  
Небанковской кредитной организации – центрального контрагента  
«Клиринговый центр МФБ» (акционерное общество)**

## ОГЛАВЛЕНИЕ

Статья 1. Общие положения .....	2
Статья 2. Перечень риск-параметров по Договорам .....	2
Приложение 1. Форма "Значения риск-параметров товарного рынка" .....	3

### Статья 1. Общие положения

- 1.1. Настоящая Методика установления риск-параметров товарного рынка Небанковской кредитной организации – центрального контрагента «Клиринговый центр МФБ» (акционерное общество) (далее – КЦ), разработанная в соответствии с Правилами осуществления клиринговой деятельности на товарном рынке Небанковской кредитной организации – центрального контрагента «Клиринговый центр МФБ» (акционерное общество) (далее – Правила клиринга), определяет порядок установления, правила применения и значения риск-параметров.
- 1.2. Раскрытие информации о внесении изменений в Методику, в том числе принятие Методики в новой редакции, осуществляется путем размещения указанных изменений (новой редакции) на Сайте КЦ. Методика и вносимые в нее изменения вступают в силу после раскрытия информации об этом в соответствии с настоящим пунктом в дату, определяемую КЦ.
- 1.3. Термины и определения, используемые в Методике, применяются в значениях, установленных Правилами клиринга, иными внутренними документами КЦ, законодательством Российской Федерации.

### Статья 2. Перечень риск-параметров по Договорам

- 2.1. В список риск-параметров, устанавливаемых КЦ для каждой Торговой сессии (i) по согласованию с Организатором торговли на основании экспертной оценки, входят:

Обозначение	Наименование	Пояснение по установке значений риск-параметра
S,пок (i) з/дог	Ставка обеспечения заявки/договора покупателя	правила применения для расчета Обеспечения заявки и Обеспечения договора могут различаться
S,прод (i) з/дог	Ставка обеспечения заявки/договора продавца	
K (i)	Коэффициент контроля товарного лимита	устанавливается в зависимости от формы аукциона в Торговой сессии

- 2.2. С использованием риск-параметров, указанных в пункте 2.1 Методики, рассчитываются следующие величины:

Наименование	Пояснение по порядку расчета
Гарантийное обеспечение	в порядке, установленном в Правилах клиринга
Гарантийное товарное обеспечение	в порядке, установленном в Правилах клиринга

- 2.3. В список дополнительных риск-параметров, устанавливаемых КЦ для каждой Торговой сессии (i) в зависимости от требований, установленных Правилами торгов к порядку действий Участников торгов при исполнении обязательств, возникающих из заключаемых в определенных Торговых сессиях Договоров, входят:

Обозначение	Наименование
Kдо (i)	Коэффициент контроля денежного обеспечения на Дату денежного обеспечения
Kто (i)	Коэффициент контроля товарного обеспечения на Дату товарного обеспечения
Kret (i)	Коэффициент возврата денежных средств
Kpart (i)	Коэффициент частичного исполнения
Kу.пок (i)	Коэффициент контроля исполнения со стороны покупателя
Kу.прод (i)	Коэффициент контроля исполнения со стороны продавца
Kн (i)	Коэффициент выплаты неустойки

- 2.4. Значения риск-параметров, указанных в пунктах 2.1 и 2.3. Методики, и правила их применения утверждаются решением КЦ и подлежат раскрытию на Сайте КЦ по форме, указанной в Приложении 1 к Методике. Значения риск-параметров вступают в силу с начала Расчетного дня, следующего за датой их раскрытия и действуют до вступления в силу новых значений риск-параметров.

**ЗНАЧЕНИЯ РИСК-ПАРАМЕТРОВ ТОВАРНОГО РЫНКА,  
УСТАНОВЛЕННЫХ ДЛЯ ТОРГОВЫХ СЕССИЙ, ПРОВОДИМЫХ ОРГАНИЗАТОРОМ ТОРГОВЛИ**  
*<наименование организатора торговли>*

Действуют с "\_\_\_" \_\_\_\_\_ 201\_\_ г.

**1. Код торговой секции <код, наименование или перечень>**

Риск-параметр		Правила применения риск-параметра	Значение
<код>	<наименование риск параметра>		

**2. Код торговой секции <код, наименование или перечень>**

Риск-параметр		Правила применения риск-параметра	Значение
<код>	<наименование риск параметра>		