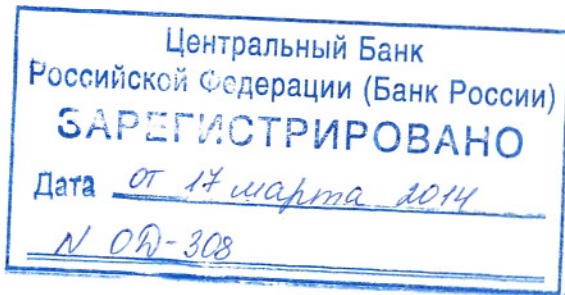


**УТВЕРЖДЕНЫ**

Советом директоров РДК (ЗАО)  
Протокол № СД-1/2014 от «06» февраля 2014 года  
Председатель Совета директоров  
В.В. Таций



**ИЗМЕНЕНИЯ В ПРАВИЛА ОСУЩЕСТВЛЕНИЯ КЛИРИНГОВОЙ ДЕЯТЕЛЬНОСТИ  
ЗАКРЫТОГО АКЦИОНЕРНОГО ОБЩЕСТВА «РАСЧЕТНО-ДЕПОЗИТАРНАЯ  
КОМПАНИЯ» НА СРОЧНОМ РЫНКЕ ЗАО «СПБМТСБ»**

Внести в Правила осуществления клиринговой деятельности Закрытого акционерного общества «Расчетно-депозитарная компания» на срочном рынке ЗАО «СПБМТСБ», утвержденные Советом директоров РДК (ЗАО) (Протокол № СД-9/2013 от 19 ноября 2013г.) (далее – Правила клиринга), следующие изменения и дополнения:

1. Подпункт в) пункта 5 Статьи 07.13 Раздела 7 Правил клиринга изложить в следующей редакции:

«в) нетто-обязательство / нетто-требование Участника клиринга определяется по следующей формуле:

$$НО = \sum_{j=1}^K \left\{ \sum_{i=1}^N \left[ \sum_{ii=1}^B \langle (C_{\min} - C_T) * CI_M / I_M \rangle + \sum_{iii=1}^S \langle -(C_{\max} - C_T) * CI_M / I_M \rangle \right] \right\} - \sum_{p=1}^P z_p$$

где:

НО - нетто-обязательство / нетто-требование Участника клиринга. Отрицательное значение означает обязательство Участника клиринга перед Клиринговой организацией, положительное – требование Участника клиринга;

$\sum_{j=1}^K$  - сумма, определенная по заключенной в скобки формуле по всем позиционным регистрам Участника клиринга;

$\sum_{i=1}^N$  - сумма, определенная по заключенной в скобки формуле по всем сериям срочных контрактов, позиции по которым учитываются на j-ом позиционном регистре Участника клиринга;

- $\sum_{ii=1}^B$  - сумма, определенная по заключенной в скобки формуле по всем позициям на покупку Участника клиринга, учитываемым на j-ом позиционном регистре по i-ой серии срочных контрактов;
- $\sum_{ii=1}^S$  - сумма, определенная по заключенной в скобки формуле по всем позициям на продажу Участника клиринга, учитываемым на j-ом позиционном регистре по i-ой серии срочных контрактов;
- $\sum_{p=1}^P Z_p$  - сумма непогашенных задолженностей Участника клиринга по вариационной марже по всем портфелям Участника клиринга, определенных в соответствии со статьей 07.08 Правил клиринга в ходе клиринговой сессии по итогам предыдущего торгового дня;
- $C_{\min}$  - минимальная допустимая цена по i-ой серии срочных контрактов, установленная в соответствии с пунктом 3 статьи 05.02 Правил клиринга;
- $C_{\max}$  - максимальная допустимая цена по i-ой серии срочных контрактов, установленная в соответствии с пунктом 3 статьи 05.02 Правил клиринга;
- $C_T$  - текущая цена данной позиции на момент окончания торговой сессии в день расчета нетто-обязательства / нетто-требования;
- $I_m$  - минимальное изменение цены, установленное Спецификацией срочного контракта, по которому открыта данная позиция;
- $СИ_m$  - стоимостная оценка минимального изменения цены, установленная Спецификацией срочного контракта, по которому открыта данная позиция.»