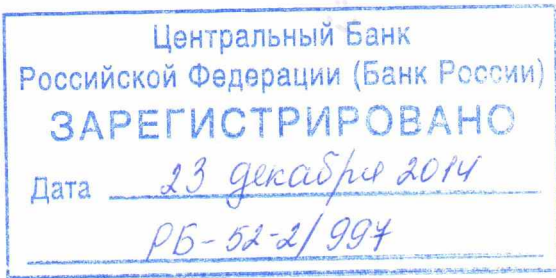


УТВЕРЖДЕНЫ



решением Наблюдательного совета  
ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр»

от «20» ноября 2014 года (Протокол № 8)

Председатель Наблюдательного совета  
ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр»



  
Лыков С.П.

**ПРАВИЛА КЛИРИНГА  
ЗАО АКБ «НАЦИОНАЛЬНЫЙ КЛИРИНГОВЫЙ ЦЕНТР»  
НА РЫНКЕ СТАНДАРТИЗИРОВАННЫХ ПФИ**

Москва, 2014 г.

## СОДЕРЖАНИЕ

РАЗДЕЛ I	ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ	4
Статья 1.	Термины и определения	4
Статья 2.	Общие положения	9
Статья 3.	Права и обязанности Участников клиринга и Клирингового центра	12
Статья 4.	Конфиденциальность	13
Статья 5.	Порядок использования Аналога собственноручной подписи	14
РАЗДЕЛ II	ТРЕБОВАНИЯ К УЧАСТНИКАМ КЛИРИНГА	16
Статья 6.	Требования к Участникам клиринга	16
Статья 7.	Условия клирингового обслуживания. Порядок предоставления допуска к клиринговому обслуживанию	17
Статья 8.	Порядок регистрации Участников клиринга и их Клиентов	19
Статья 9.	Клиринговые регистры	20
Статья 10.	Порядок закрепления за Участником клиринга Участника торгов, имеющего право на заключение биржевых Договоров от имени Участника клиринга	24
Статья 11.	Порядок приостановления и прекращения допуска к клиринговому обслуживанию	25
РАЗДЕЛ III	МЕРЫ, НАПРАВЛЕННЫЕ НА УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ ПРИ ОСУЩЕСТВЛЕНИИ КЛИРИНГА	30
Статья 12.	Перечень мер, направленных на управление рисками при осуществлении клиринга	30
РАЗДЕЛ IV	ПОРЯДОК И УСЛОВИЯ ДОПУСКА ОБЯЗАТЕЛЬСТВ К КЛИРИНГУ	31
Статья 13.	Возможность заключения внебиржевых Договоров	31
Статья 14.	Порядок заключения внебиржевых Договоров	31
Статья 15.	Порядок взаимодействия с Биржей	34
Статья 16.	Порядок взаимодействия с Биржей при подаче и отзыве Заявок в секторе Навигатор	36
Статья 17.	Порядок изменения условий Договора	37
Статья 18.	Порядок досрочного прекращения Договора	39
Статья 19.	Порядок определения и учета обязательств	40
Статья 20.	Порядок изменения учета обязательств по Договорам	42
Статья 21.	Предоставление возможности Участнику клиринга заключения биржевых Договоров в секторе Спектра	42
РАЗДЕЛ V	ПОРЯДОК ПРОВЕДЕНИЯ КЛИРИНГА	44
ПОДРАЗДЕЛ V-I	ПОРЯДОК ВНЕСЕНИЯ И ВОЗВРАТА СРЕДСТВ ОБЕСПЕЧЕНИЯ И ВЗНОСА В ГАРАНТИЙНЫЙ ФОНД	44
Статья 22.	Порядок внесения Средств обеспечения	44
Статья 23.	Порядок возврата Средств обеспечения	44
Статья 24.	Порядок изменения учета Средств обеспечения	48
Статья 25.	Порядок внесения и возврата взноса в Гарантийный фонд	49
ПОДРАЗДЕЛ V-II	КЛИРИНГОВЫЕ СЕССИИ	52
Статья 26.	Порядок проведения клиринговых сессий	52
ПОДРАЗДЕЛ V-III	ПОРЯДОК ОПРЕДЕЛЕНИЯ И ИСПОЛНЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ, ВКЛЮЧЕННЫХ В КЛИРИНГОВЫЙ ПУЛ КЛИРИНГОВОЙ СЕССИИ	53
Статья 27.	Определение и учет обязательств вне клиринговой сессии	53
Статья 28.	Порядок определения и учета обязательств в ходе клиринговой сессии	53

Статья 29.	Порядок исполнения обязательств допущенных к клирингу	53
Статья 30.	Условия договоров с Недобросовестным Участником	56
Статья 31.	Порядок возникновения и исполнения Маржинального требования по расчетному коду и Задолженности по расчетному коду	57
Статья 32.	Порядок урегулирования неисполненных обязательств	58
Статья 33.	Порядок использования и возмещения средств Гарантийного фонда	63
ПОДРАЗДЕЛ V-IV ПОРЯДОК ИСПОЛНЕНИЯ ОПЦИОННЫХ ДОГОВОРОВ		67
Статья 34.	Порядок осуществления Права на исполнение по внебиржевым опционным Договорам	67
Статья 35.	Особенности исполнения внебиржевых опционных Договоров, базовым активом которых являются иностранные валюты или индексы	68
ПОДРАЗДЕЛ V-V ПОРЯДОК ВЗАИМОДЕЙСТВИЯ С РАСЧЕТНОЙ ОРГАНИЗАЦИЕЙ		69
Статья 36.	Порядок взаимодействия с Расчетной организацией	69
РАЗДЕЛ VI ПОРЯДОК ОПЛАТЫ УСЛУГ. ОТЧЕТЫ ПО ИТОГАМ КЛИРИНГА		70
Статья 37.	Порядок оплаты услуг Клирингового центра и Биржи	70
Статья 38.	Порядок представления отчетов по итогам клиринга	70
РАЗДЕЛ VII ПРОЧИЕ УСЛОВИЯ		72
Статья 39.	Перевод обязательств и Средств обеспечения	72
Статья 40.	Порядок действий в случае включения Участника клиринга в перечень организаций, в отношении которых имеются сведения об их причастности к экстремистской деятельности или терроризму	74
Статья 41.	Порядок урегулирования обязательств в случае прекращения допуска к клиринговому обслуживанию	76
Статья 42.	Взаимодействие с Биржей при возникновении обстоятельств, которые могут повлиять на возможность проведения Торгов	87
Статья 43.	Чрезвычайные ситуации	87
Статья 44.	Порядок разрешения споров	89
Приложение № 1		90
Приложение № 2		91
Приложение № 3		97
Приложение № 4		98
Приложение № 5		104
Приложение № 6		107

## РАЗДЕЛ I ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ

Настоящие Правила клиринга ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр» на рынке Стандартизированных ПФИ (далее – Правила клиринга) регулируют отношения, связанные с заключением и исполнением договоров, являющихся производными финансовыми инструментами, заключаемых на организованных торгах ОАО Московская Биржа на рынке Стандартизированных ПФИ или не на организованных торгах в соответствии с Правилами клиринга.

### Статья 1. Термины и определения

**Активное предложение** – зарегистрированное в Клиринговой системе Предложение или Предложение «Стратегия», которое не исполнено и не удалено / не отозвано.

**Аналог собственноручной подписи / АСП** – реквизит электронного сообщения, направляемого с использованием Клиринговой системы, подтверждающий идентификацию направившего электронное сообщение лица, целостность и неизменность электронных сообщений за счет использования специализированных программно-технических средств и организационных мероприятий, полученный в результате присвоения Участнику клиринга / Клиринговому центру Имени, Пароля, кода, закрепленного за Участником клиринга в Системе Блумберг / Системе Томсон Рейтер, и позволяющий идентифицировать Участника клиринга / Клиринговый центр, а также установить отсутствие искажения информации в Предложении или ином электронном документе.

**Анкета FATCA** – Анкета идентификации юридического лица в соответствии с нормами и положениями закона FATCA.

**Аукционная заявка** – Предложение Участника клиринга, содержащее оферты, направленные на аукционе ликвидации на заключение всех Аукционных договоров, составляющих лот аукциона ликвидации.

**Аукционный договор** – Парный Договор для Договора, входящего в Парный портфель Дефолтера, или для Хеджирующего договора.

**Аукционный портфель** – все Аукционные договоры.

**Аутентификация** – процедура подтверждения принадлежности АСП Участнику клиринга / Клиринговому центру.

**Биржа** – Открытое акционерное общество «Московская Биржа ММВБ-РТС», являющаяся организатором торговли на рынке Стандартизированных ПФИ.

**Гарантийный фонд** – имущество, являющееся предметом коллективного клирингового обеспечения обязательств, допущенных к клирингу в соответствии с Правилами клиринга.

**Дефолтер** – Участник клиринга, к которому применена процедура урегулирования неисполнения обязательств (дефолта) в соответствии с Правилами клиринга.

**Договор биржевой** - Договор биржевой сектора Навигатор или Договор биржевой сектора Спектра.

**Договор биржевой сектора Навигатор** – биржевой договор, заключаемый в секторе Навигатор рынка Стандартизированных ПФИ ОАО Московская Биржа.

**Договор биржевой сектора Спектра** – биржевой договор, заключаемый в секторе Спектра рынка Стандартизированных ПФИ ОАО Московская Биржа.

**Договор внебиржевой** - договор, являющийся в соответствии с Федеральным законом от 22.04.1996 №39-ФЗ «О рынке ценных бумаг» производным финансовым инструментом, заключаемый не на организованных торгах в соответствии с Правилами клиринга на условиях внебиржевой Спецификации и Правил клиринга.

**Договор дефолтера** – Договор, учитываемый на регистре учета позиций Дефолтера.

**Договор** – биржевой Договор и (или) внебиржевой Договор.

**Задолженность по расчетному коду** – Задолженность по расчетному коду перед Клиринговым центром и/или Задолженность по расчетному коду перед Биржей.

**Задолженность по расчетному коду перед Клиринговым центром** – неисполненные обязательства Участника клиринга с наступившей датой исполнения, не включенные в клиринговый пул, учитываемые на регистре учета позиций Участника клиринга, код которого соответствует данному расчетному коду, или на денежном регистре обеспечения с данным расчетным кодом.

**Задолженность по расчетному коду перед Биржей** - неисполненные обязательства Участника клиринга с наступившей датой исполнения по оплате комиссионного вознаграждения Биржи, учитываемые на регистре учета позиций Участника клиринга, код которого соответствует данному расчетному коду.

**Закон о клиринге** - Федеральный закон от 07.02.2011 №7-ФЗ «О клиринге и клиринговой деятельности».

**Закон FATCA** – Федеральный закон от 28.06.2014 № 173-ФЗ "Об особенностях осуществления финансовых операций с иностранными гражданами и юридическими лицами, о внесении изменений в Кодекс Российской Федерации об административных правонарушениях и признании утратившими силу отдельных положений законодательных актов Российской Федерации".

**Идентификатор Клирингового центра** – уникальный буквенно-цифровой код, который присваивается Техническим центром Клиринговому центру в целях его идентификации при взаимодействии с Участниками клиринга.

**Идентификатор Участника клиринга** – уникальный буквенно-цифровой код, который присваивается Участнику клиринга Техническим центром в целях его идентификации при взаимодействии с Клиринговым центром.

**Имя** – уникальная последовательность символов, однозначно определяющая Участника клиринга или Клиринговый центр, присвоенная Участнику клиринга / Клиринговому центру Техническим центром для доступа к Клиринговой системе.

**Клиент Участника клиринга (Клиент)** – юридическое или физическое лицо, зарегистрированное Клиринговым центром в качестве клиента Участника клиринга.

**Клиринговая система** – совокупность программно-технических средств, баз данных, телекоммуникационных средств, иного оборудования и программного обеспечения, предназначенных для осуществления клиринговой деятельности в соответствии с Правилами клиринга.

**Клиринговый Идентификатор** – Идентификатор Участника клиринга или Клирингового центра.

**Клиринговый центр, Центральный контрагент** – Акционерный Коммерческий Банк «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое акционерное общество), действующий в соответствии с Законом о клиринге.

**Код клирингового регистра (код регистра)** – уникальная последовательность символов, идентифицирующая клиринговый регистр.

**Кредитная организация** – юридическое лицо, которое имеет действующую лицензию на осуществление банковских операций, выданную Банком России.

**Кредитная организация-нерезидент** - юридическое лицо, являющееся нерезидентом в соответствии с законодательством Российской Федерации о валютном регулировании и валютном контроле, которое на основании специального разрешения (лицензии или иного основания) компетентного органа государства учреждения имеет право осуществлять банковские операции, предусмотренные национальным законодательством государства учреждения Кредитной организации – нерезидента.

**Маржинальное требование по расчетному коду** – требование Клирингового центра к Участнику клиринга, предъявляемое в порядке и случае, определенных Правилами клиринга, о приведении Средств обеспечения, учитываемых на денежных регистрах обеспечения во всех валютах с данным расчетным кодом, и Договоров, учитываемых на регистрах учета позиций, коды которых соответствуют данному расчетному коду, в состояние, при котором Требование к обеспечению по данному расчетному коду не будет превосходить Оценку средств обеспечения по данному расчетному коду (Уровень обеспеченности по расчетному коду является неотрицательным).

**Методика** – Методика расчета рисков на рынке Стандартизированных ПФИ, утвержденная Клиринговым центром.

**Недобросовестный участник** – Недобросовестный Участник как он определен в пункте 29.5 Правил клиринга.

**Некредитная организация** - юридическое лицо, являющееся резидентом в соответствии с законодательством Российской Федерации о валютном регулировании и валютном контроле, не имеющее действующей лицензии на осуществление банковских операций, выданной Банком России.

**Обязательства по Договорам** – обязательства, определенные условиями Договора, заключенного на основании Спецификации, в соответствии с Правилами клиринга и (или) Правилами торгов, в том числе обязательства, возникающие в связи с изменением условий Договора или его досрочным прекращением.

**Оценка средств обеспечения по расчетному коду** – сумма, выраженная в российских рублях, рассчитываемая Клиринговым центром для определения Уровня обеспеченности по расчетному коду на основании стоимости Средств обеспечения, учитываемых на денежных регистрах обеспечения с данным расчетным кодом, в соответствии с Правилами клиринга и Методикой.

**Парные Договоры** – Договоры, имеющие идентичные условия, в которых Клиринговый центр занимает противоположные стороны. Каждый из таких Договоров именуется парным по отношению к другому.

**Парный портфель Дефолтера** – Парные по отношению к Договорам дефолтера Договоры, одной стороной которых является Клиринговый центр, а другой - Участники клиринга, не являющиеся Дефолтерами.

**Пароль** – уникальная последовательность символов, используемая для аутентификации Участника клиринга / Клирингового центра, присвоенная Участнику клиринга / Клиринговому центру Техническим центром для доступа к Клиринговой системе.

**Подсистема ЭДО НКЦ** - Подсистема Системы электронного документооборота Биржи, организатором которой является Клиринговый центр и которая используется Клиринговым центром для взаимодействия с участниками Подсистемы ЭДО НКЦ и

Биржей. Подсистема ЭДО НКЦ представляет собой совокупность программного, информационного и аппаратного обеспечения Клирингового центра, Биржи и участников Подсистемы ЭДО НКЦ.

**Портфель дефолтера** – Договоры, учитываемые на всех регистрах учета позиций Дефолтера.

**Порядок предоставления информации и отчетности** – Порядок предоставления информации и отчетности Участниками клиринга Акционерного Коммерческого Банка «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое акционерное общество).

**Правила клиринга срочного рынка** - Правила клиринга ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр» на срочном рынке.

**Правила торгов** – Правила организованных торгов на рынке Стандартизированных ПФИ ОАО Московская Биржа.

**Правила допуска** – Правила допуска к участию в торгах на рынке Стандартизированных ПФИ ОАО Московская Биржа.

**Предложение о заключении внебиржевого Договора (Предложение)** – оферта, направляемая Участником клиринга или Клиринговым центром на заключение внебиржевого Договора, содержащая условия внебиржевого Договора и иную информацию, предусмотренную Правилами клиринга и Спецификацией, и (или) Аукционная заявка.

**Предложение «Стратегия»** – оферта, направляемая Участником клиринга или Клиринговым центром на одновременное заключение нескольких внебиржевых Договоров, содержащая условия, необходимые для определения условий внебиржевых Договоров и иную информацию, предусмотренную Правилами клиринга и Спецификацией.

**Предложения допустимые встречные** – два Предложения, одновременно удовлетворяющие следующим условиям:

- оба Предложения поданы по Договору с одним кодом;
- в Предложениях указаны идентичные условия Договора;
- при совпадении Клирингового идентификатора лица, которое направило одно Предложение, с Клиринговым идентификатором лица, с которым будет заключен Парный договор.

**Предложения «Стратегия» допустимые встречные** – два Предложения «Стратегия», одновременно удовлетворяющие следующим условиям:

- оба Предложения «Стратегия» поданы с указанием одного кода стратегии;
- в Предложениях «Стратегия» указаны идентичные условия;
- при совпадении Клирингового идентификатора лица, которое направило одно Предложение «Стратегия», с Клиринговым идентификатором лица, с которым будут заключены Парные договоры.

**Рабочий день** – день, в том числе выходной или праздничный нерабочий день, в который Клиринговый центр проводит клиринговую сессию.

**Рабочее место Участника клиринга** - совокупность программно-технических средств, предназначенных для использования Участником клиринга в целях получения технического доступа к Клиринговой системе. В целях Правил клиринга определяются следующие виды Рабочих мест:

- РМ УРМ;
- РМ Блумберг;

- РМ Томсон Рейтер.

**Расчетная организация** – Небанковская кредитная организация закрытое акционерное общество «Национальный расчетный депозитарий».

**РМ Блумберг** – Рабочее место Участника клиринга, получающего технический доступ к Клиринговой системе с использованием Системы Блумберг.

**РМ Томсон Рейтер** - Рабочее место Участника клиринга, получающего технический доступ к Клиринговой системе с использованием Системы Томсон Рейтер.

**РМ УРМ** – Рабочее место Участника клиринга, получающего технический доступ к Клиринговой системе с использованием удаленного рабочего места.

**Сайт Клирингового центра** – сайт Клирингового центра в сети Интернет по адресу [www.nkcbank.ru](http://www.nkcbank.ru), на котором осуществляется раскрытие информации Клиринговым центром.

**Сектор Навигатор** – форма организации Торгов на рынке Стандартизированных ПФИ ОАО Московская Биржа, обеспечивающая предоставление Биржей Участникам торгов услуг, способствующих заключению договоров, являющихся производными финансовыми инструментами, на основании адресных Заявок.

**Сектор Спектра** – форма организации Торгов на рынке Стандартизированных ПФИ ОАО Московская Биржа, обеспечивающая предоставление Биржей Участникам торгов услуг, способствующих заключению договоров, являющихся производными финансовыми инструментами, на основании безадресных Заявок.

**Система Блумберг (Блумберг)** – программно-аппаратный комплекс, предоставляемый компанией «Блумберг», предназначенный для передачи информационных сообщений в ходе заключения Договоров Участниками клиринга.

**Система Томсон Рейтер (Рейтер)** – программно-аппаратный комплекс, предоставляемый компанией «Томсон Рейтер», предназначенный для передачи информационных сообщений в ходе заключения Договоров Участниками клиринга.

**Система ЭДО** – Система электронного документооборота Биржи.

**Спецификация** – биржевая Спецификация и (или) внебиржевая Спецификация.

**Спецификация биржевая** – документ, совместно с Правилами торгов и Правилами клиринга определяющий стандартные условия, на которых будет заключен биржевой Договор и порядок его исполнения.

**Спецификация внебиржевая** – документ Клирингового центра, совместно с Правилами клиринга определяющий стандартные условия, на которых будет заключен внебиржевой Договор и порядок его исполнения.

**Средства обеспечения** – имущество, предоставленное Участником клиринга (Клиентом), являющееся предметом индивидуального клирингового обеспечения исполнения обязательств, предусмотренных Правилами клиринга.

**Требование к обеспечению по расчетному коду** – размер Средств обеспечения, необходимый для обеспечения исполнения обязательств, предусмотренных Правилами клиринга и учитываемых на регистрах учета позиций с кодами, соответствующими расчетному коду, или денежных регистрах обеспечения с расчетным кодом, рассчитываемый в российских рублях в соответствии с Методикой, в том числе с учетом подачи Участником клиринга или Участником торгов от имени Участника клиринга Заявок/ Предложений/ Предложений «Стратегия», поданных с указанием регистров учета позиций с кодами, соответствующими расчетному коду, исполнения / изменения/



прекращения Обязательств по Договорам, учитываемым на регистрах учета позиций с кодами, соответствующими данному расчетному коду. Требование к обеспечению рассчитывается Клиринговым центром индивидуально для каждого Участника клиринга.

**Технический центр** – организация, обеспечивающая Участникам клиринга и Клиринговому центру поддержку и функционирование Клиринговой системы и предоставляющее Участникам клиринга и Клиринговому центру интегрированный технологический сервис на основании соответствующего договора.

**Уровень обеспеченности по расчетному коду** – разность между Оценкой средств обеспечения по расчетному коду и Требованиям к обеспечению по расчетному коду.

**Участник клиринга** – юридическое лицо, которому Клиринговый центр оказывает клиринговые услуги на основании заключенного с ним Договора об оказании клиринговых услуг.

**Хеджирующий договор** – Договор, заключенный Клиринговым центром с Участником клиринга, не являющимся Дефолтером, в результате заключения которого Требование к обеспечению, рассчитанное по Парному портфелю Дефолтера и Хеджирующему Договору, будет меньше Требования к обеспечению, рассчитанного только по Парному портфелю Дефолтера.

**Цена аукционной заявки (Плата за заключение Аукционных договоров, Плата)** – величина со знаком, определяющая сумму денежных средств, уплачиваемую за заключение всех Аукционных договоров, составляющих лот аукциона ликвидации. Если Плата является положительной величиной, то плательщиком указанной Платы является Участник клиринга, заключивший Аукционные договоры, а получателем указанной Платы - Клиринговый центр. Если Плата является отрицательной величиной, то плательщиком является Клиринговый центр, а получателем указанной Платы - Участник клиринга, заключивший Аукционные договоры.

Термины, специально не определенные в Правилах клиринга, используются в значениях, установленных иными внутренними документами Клирингового центра, Правилами торгов, Правилами клиринга срочного рынка, Правилами допуска, Спецификациями Договоров, законами, нормативными актами Банка России и иными нормативными актами Российской Федерации.

## **Статья 2. Общие положения**

- 2.1. Клиринговый центр осуществляет клиринг по Договорам и договорам, заключенным с Участником клиринга в соответствии со статьей 30 Правил клиринга, выполняя функции центрального контрагента.
- 2.2. Участники клиринга вправе заключать внебиржевые Договоры в соответствии с Правилами клиринга от своего имени и за свой счет либо от своего имени и за счет Клиента.  
Участники клиринга, являющиеся Участниками торгов, вправе заключать биржевые Договоры от своего имени и за свой счет либо от своего имени и за счет Клиента.  
Биржевой договор может быть также заключен от имени Участника клиринга, не являющегося Участником торгов, за счет такого Участника клиринга, в порядке, установленном настоящими Правилами клиринга и Правилами торгов.
- 2.3. Способы обеспечения исполнения Участниками клиринга Обязательств по Договорам, обязательств по договорам, заключенным с Участником клиринга в соответствии со статьей 30 Правил клиринга, иных обязательств, предусмотренных пунктом 9.17 Правил клиринга, допущенных к клирингу,

- являются индивидуальное клиринговое обеспечение, а также коллективное клиринговое обеспечение.
- 2.4. Средства обеспечения используются для исполнения Обязательств по Договорам, обязательств по договорам, заключенным с Участником клиринга в соответствии со статьей 30 Правил клиринга, обязательств по уплате комиссионных вознаграждений Биржи и Клирингового центра, а также иных обязательств, предусмотренных пунктом 9.17 Правил клиринга.
- 2.5. Денежные средства, являющиеся Средствами обеспечения, учитываются на клиринговых банковских счетах Клирингового центра, открытых в Расчетной организации и предназначенных для учета денежных Средств обеспечения в соответствующей валюте (далее – клиринговый счет Средств обеспечения).
- 2.6. Денежные средства, составляющие Гарантийный фонд, учитываются на клиринговых банковских счетах Клирингового центра, открытых в Расчетной организации и предназначенных для учета денежных средств Гарантийного фонда в соответствующей валюте (далее – клиринговый счет Гарантийного фонда).
- 2.7. Информация о реквизитах клиринговых счетов Клирингового центра, предназначенных для учета индивидуального и коллективного клирингового обеспечения, размещается на Сайте Клирингового центра.  
Об изменениях реквизитов указанных счетов Клиринговый центр извещает Участников клиринга путем направления им новых реквизитов в форме электронного документа и путем размещения соответствующей информации на Сайте Клирингового центра не позднее, чем за 3 (три) Рабочих дня до введения этих изменений в действие.
- 2.8. Клиринговый центр вправе использовать в своих интересах денежные средства, являющиеся Средствами обеспечения, и денежные средства, составляющие Гарантийный фонд, с учетом ограничений, установленных внутренним документом Клирингового центра, определяющим критерии формирования инвестиционных активов Клирингового центра.
- 2.9. Доходы от такого использования денежных средств не включаются в состав Средств обеспечения или Гарантийного фонда.
- 2.10. За использование денежных средств, составляющих Средства обеспечения Участника клиринга, Клиринговый центр выплачивает Участнику клиринга проценты (далее – Проценты за использование).  
Уплата Клиринговым центром Процентов за использование осуществляется в срок, в порядке и в размере, определяемые Клиринговым центром с учетом положений Правил клиринга и раскрываемые на Сайте Клирингового центра. Обязательство Клирингового центра по уплате Процентов за использование учитывается на соответствующем денежном регистре обеспечения и считается исполненным Клиринговым центром в момент изменения Клиринговым центром значения денежного регистра обеспечения.  
Размер денежных средств, составляющих Средства обеспечения, на которые начисляются и уплачиваются Проценты за использование, не может превышать размера, достаточного для обеспечения исполнения обязательств Участника клиринга, определенного Клиринговым центром в соответствии с Правилами клиринга и внутренними документами.  
Размер Процентов за использование в соответствующей валюте определяется на основании следующих процентных ставок:
- RUONIA- spread<sub>1</sub> - для российских рублей;

- Fed Funds–spread<sub>2</sub> - для долларов США;
- EONIA–spread<sub>3</sub> - для евро,

где,

RUONIA или Ruble OverNight Index Average означает индикативную взвешенную ставку однодневных рублевых кредитов (депозитов) в рублях на московском межбанковском рынке, рассчитываемую Банком России по методике, разработанной Национальной валютной ассоциацией совместно с Банком России, и публикуемую на странице RUONIA= в системе Reuters и/или в сети Интернет на официальном сайте Банка России и/или на странице <http://www.ruonia.ru>;

Fed Funds означает ставку, установленную в еженедельном выпуске H.15(519) Федеральной резервной системы США на соответствующую дату под заголовком «EFFECT», публикуемую на странице FEDFUNDS1 в системе Reuters;

EONIA или Euro OverNight Index Average означает индикативную взвешенную ставку однодневных кредитов (депозитов) в евро на межбанковском рынке государств еврозоны, публикуемую около 12 часов по брюссельскому времени на странице EONIA= или EONIARECAP в системе Reuters;

значения spread<sub>1</sub>, spread<sub>2</sub>, spread<sub>3</sub> устанавливаются решением Клирингового центра.

Правила настоящего пункта применяются, если иное не предусмотрено решением Клирингового центра.

- 2.11. Обмен документами между Участником клиринга и Клиринговым центром может осуществляться в бумажной или электронной форме. Если Правилами клиринга не установлена форма документа, документ может быть предоставлен в любой форме.
  - 2.11.1. Обмен электронными документами между Участником клиринга и Клиринговым центром может осуществляться посредством Клиринговой системы, Подсистемы ЭДО НКЦ и системы SWIFT (в случаях, установленных Правилами клиринга).
  - 2.11.2. Порядок формирования и передачи электронных документов посредством Подсистемы ЭДО НКЦ предусмотрен Порядком организации электронного документооборота ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр». Электронные документы, направляемые посредством SWIFT, формируются в форматах, установленных стандартами SWIFT, с учетом особенностей, установленных внутренними документами Клирингового центра.
  - 2.11.3. Документы, направляемые Участником клиринга Клиринговому центру с использованием Клиринговой системы, являются электронными сообщениями, подписанными АСП Участника клиринга.
  - 2.11.4. Документы и информация, получаемые Участником клиринга из Клиринговой системы, являются электронными сообщениями, подписанными АСП Клирингового центра.
  - 2.11.5. Формы и форматы документов, предоставляемых Участниками клиринга Клиринговому центру и Клиринговым центром Участнику клиринга в соответствии с Правилами клиринга, установлены документом «Формы и форматы документов, предоставляемых Участниками клиринга и Клиринговым центром в соответствии с Правилами клиринга ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр» на рынке Стандартизированных ПФИ», раскрываемом на Сайте Клирингового центра.

- 2.12. Обмен электронными документами между Биржей и Клиринговым центром может осуществляться посредством Системы торгов в секторе Навигатор, Системы торгов в секторе Спектра и Подсистемы ЭДО НКЦ в соответствии с Правилами клиринга и Правилами торгов.
- 2.13. Сроки передачи Участниками клиринга документов Клиринговому центру и сроки получения документов от Клирингового центра в процессе взаимодействия устанавливаются Правилами клиринга. Если Правилами клиринга не установлены сроки предоставления документов, документы предоставляются в течение одного Рабочего дня с момента наступления события, повлекшего направление соответствующего документа.
- 2.14. Клиринговый центр вправе принять решение о непроведении клиринговой сессии в установленный в соответствии с законодательством Российской Федерации рабочий день и (или) о проведении клиринговой сессии в установленный в соответствии с законодательством Российской Федерации выходной или нерабочий праздничный день.
- 2.15. Клиринговый центр осуществляет прием и передачу документов, а также выполнение иных действий в соответствии с Правилами клиринга в Рабочие дни.

### **Статья 3. Права и обязанности Участников клиринга и Клирингового центра**

- 3.1. Права и обязанности Участников клиринга и Клирингового центра при осуществлении Клиринговым центром клиринга по Договорам определяются Договором об оказании клиринговых услуг и Правилами клиринга.  
При заключении Договора об оказании клиринговых услуг Участник клиринга приобретает права и обязанности, возникающие из правил клиринга ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр», связанные с предоставлением допуска к клиринговому обслуживанию.  
Права и обязанности, возникающие из Правил клиринга, непосредственно связанные с клиринговым обслуживанием, Участник клиринга приобретает после получения допуска к клиринговому обслуживанию в соответствии с Правилами клиринга.
- 3.2. Форма Договора об оказании клиринговых услуг установлена приложением № 1 к Правилам клиринга.
- 3.3. Заключение Договора об оказании клиринговых услуг осуществляется путем присоединения к договору, условия которого определены Правилами клиринга.
- 3.4. Размер оплаты клиринговых услуг, оказываемых Клиринговым центром Участникам клиринга в соответствии с Правилами клиринга, определен Тарифами Клирингового центра, являющимися приложением № 2 к Правилам клиринга (далее – Тарифы Клирингового центра).
- 3.5. Порядок оплаты клиринговых услуг Клирингового центра определен в статье 37 Правил клиринга.
- 3.6. Клиринговые услуги Клирингового центра считаются оказанными надлежащим образом, если в течение 5 (пяти) Рабочих дней после окончания месяца, в течение которого оказывались услуги, Участник клиринга письменно не заявит об обратном.
- 3.7. Участник клиринга вправе отказаться от исполнения Договора об оказании клиринговых услуг только при отсутствии у него имущественных обязательств по указанному договору, а также неисполненных им обязательств, допущенных к клирингу, письменно уведомив об этом Клиринговый центр не позднее, чем за 5

- (пять) дней до даты прекращения действия Договора об оказании клиринговых услуг.
- 3.8. Клиринговый центр вправе отказаться от исполнения Договора об оказании клиринговых услуг с Участником клиринга в случае нарушения Участником клиринга требований, предъявляемых к нему Правилами клиринга.
- 3.9. Клиринговый центр вправе отказаться от исполнения Договора об оказании клиринговых услуг с Участником клиринга в случае, если в течение 6 (шести) месяцев подряд Участник клиринга не имел допуска к клиринговому обслуживанию на основании ни одних правил клиринга, утвержденных Клиринговым центром, в связи с приостановлением / прекращением / неполучением им допуска к клиринговому обслуживанию.
- 3.10. Действие Договора об оказании клиринговых услуг прекращается в следующих случаях:
- прекращения допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию в соответствии со всеми правилами клиринга, на основании которых Участник клиринга был допущен к клиринговому обслуживанию;
  - ликвидации Участника клиринга, а также в случае реорганизации Участника клиринга при условии, что деятельность Участника клиринга в результате реорганизации прекращается;
  - отзыва (аннулирования) лицензии на осуществление банковских операций у Участника клиринга (для Кредитных организаций);
  - отзыва (аннулирования) специального разрешения (лицензии или иного основания) компетентного органа государства учреждения Кредитной организации-нерезидента, в соответствии с которым Кредитная организация-нерезидент имеет право осуществлять банковские операции.
- 3.11. Прекращение действия Договора об оказании клиринговых услуг не освобождает Участника клиринга и Клиринговый центр от исполнения обязательств, возникших до прекращения действия Договора об оказании клиринговых услуг.
- 3.12. Клиринговый центр вправе на своем Сайте раскрывать информацию о нарушениях Участниками клиринга требований Правил клиринга, в том числе, о фактах неисполнения ими обязательств в порядке, предусмотренном Правилами клиринга.

#### **Статья 4. Конфиденциальность**

- 4.1. Участник клиринга и Клиринговый центр обязуются рассматривать содержание Договора об оказании клиринговых услуг и условия заключенных Договоров и договоров, заключенных с Участником клиринга в соответствии со статьей 30 Правил клиринга, как конфиденциальную информацию и не будут раскрывать ее третьим лицам (за исключением аудиторов Участника клиринга или Клирингового центра, уполномоченных органов, Клиентов Участников клиринга, в интересах которых заключены указанные договоры, а также случаев раскрытия информации в соответствии с требованиями действующего законодательства Российской Федерации), если иное не будет специально согласовано между Участником клиринга и Клиринговым центром.
- 4.2. Любые документы, предоставленные и подготовленные Участником клиринга и/или Клиринговым центром для исполнения Договора об оказании клиринговых услуг, заключенных Договоров и договоров, заключенных с Участником клиринга в соответствии со статьей 30 Правил клиринга, будут рассматриваться как конфиденциальные.

- 4.3. Участники клиринга соглашаются с тем, что Клиринговый центр на основании договора, заключенного с Банком России, передает Банку России по его запросу информацию о ходе и итогах клиринга.

## **Статья 5. Порядок использования Аналога собственноручной подписи**

- 5.1. Аналог собственноручной подписи используется при подаче (направлении) с использованием Клиринговой системы электронных сообщений, предусмотренных Правилами клиринга. Электронное сообщение, подписанное АСП, признается электронным документом, равнозначным документу на бумажном носителе, подписанному Участником клиринга.
- 5.2. Электронное сообщение считается подписанным АСП, с момента отправки Участником клиринга / Клиринговым центром в Клиринговую систему такого электронного сообщения при условии успешного прохождения Участником клиринга / Клиринговым центром процедуры аутентификации в порядке, предусмотренном настоящей статьей Правил клиринга.
- 5.3. Присвоение Имени и Пароля Участнику клиринга / Клиринговому центру осуществляется Техническим центром посредством внесения указанных Имени и Пароля в базу данных Клиринговой системы.
- 5.4. Процедура аутентификации осуществляется Техническим центром с использованием Клиринговой системы при осуществлении технического доступа Участника клиринга / Клирингового центра в Клиринговую систему посредством РМ УРМ путем сопоставления введенных Имени и Пароля соответствующим Имени и Паролю Участника клиринга / Клирингового центра, информация о которых содержится в базе данных Клиринговой системы.
- 5.5. Процедура аутентификации Участников клиринга, направляющих электронные сообщения посредством РМ Блумберг / РМ Томсон Рейтер, производится при осуществлении технического доступа Участника клиринга в Клиринговую систему посредством РМ Блумберг / РМ Томсон Рейтер путем проверки Клиринговым центром соответствия кода Участника клиринга в Системе Блумберг / Системе Томсон Рейтер, указанного в электронном сообщении, коду, закрепленному за Участником клиринга в Системе Блумберг / Системе Томсон Рейтер, информация о котором содержится в базе данных Клиринговой системы.
- 5.6. В случае успешного прохождения процедуры аутентификации Участник клиринга / Клиринговый центр получает возможность доступа к Клиринговой системе.
- 5.7. Участник клиринга/ Клиринговый центр соглашается с тем, что Техническим центром могут быть изготовлены (распечатаны) копии электронных сообщений (подписанных АСП) на бумажном носителе, которые удостоверяются подписью уполномоченного лица Технического центра и являются доказательством факта направления электронного сообщения с использованием Клиринговой системы, а также подтверждают соответствие электронного сообщения содержанию копии электронного сообщения, изготовленного (распечатанного) на бумажном носителе.
- 5.8. Участник клиринга обязуется хранить в тайне присвоенный ему Имя (Имена) и Пароль (Пароли) и несет риск последствий, вызванных нарушением их тайны. В случае нарушения тайны Имени и Пароля Участник клиринга обязан незамедлительно уведомить об этом Технический центр.

- 5.9. Участник клиринга и Клиринговый центр соглашаются с тем, что все возникшие конфликтные ситуации, связанные с использованием АСП, будут стремиться решить в досудебном порядке.
- 5.10. В случае возникновения конфликтных ситуаций в связи с использованием АСП разрешение разногласий проводится в соответствии с приложением № 3 к Правилам клиринга.

## РАЗДЕЛ II ТРЕБОВАНИЯ К УЧАСТНИКАМ КЛИРИНГА

### Статья 6. Требования к Участникам клиринга

- 6.1. Для заключения Договора об оказании клиринговых услуг юридическое лицо предоставляет Клиринговому центру:
- Договор об оказании клиринговых услуг по форме, предусмотренной приложением № 1 к Правилам клиринга, в 2 (двух) экземплярах, подписанный уполномоченным лицом юридического лица и скрепленный печатью юридического лица;
  - комплект документов в соответствии с перечнем, приведенным в разделе I приложения № 4 к Правилам клиринга (в случае подписания Договора об оказании клиринговых услуг между Клиринговым центром и Кредитной организацией или Некредитной организацией);
  - комплект документов в соответствии с перечнем, приведенным в разделе II приложения № 4 к Правилам клиринга (в случае подписания Договора об оказании клиринговых услуг между Клиринговым центром и Кредитной организацией – нерезидентом);
- В случае если какой-либо из документов, указанных в приложении № 4 к Правилам клиринга, ранее уже предоставлялся Клиринговому центру и имеется в наличии у Клирингового центра, то юридическое лицо по предварительному согласованию с Клиринговым центром может быть освобождено от обязанности повторного предоставления этого документа.
- 6.2. Клиринговый центр вправе требовать от юридического лица предоставления дополнительных документов. При этом юридическое лицо обязано предоставить данные документы в срок, указанный в запросе, а если такой срок не указан, то в течение 5 (пяти) рабочих дней со дня получения им запроса Клирингового центра.
- 6.3. В целях получения информации о юридическом лице Клиринговый центр имеет право использовать сведения (информацию) о юридическом лице из официальных источников, в том числе электронного сервиса Федеральной налоговой службы.
- 6.4. В случае если между юридическим лицом и Клиринговым центром уже заключен Договор об оказании клиринговых услуг по форме, установленной приложением № 1 к Правилам клиринга, для осуществления клирингового обслуживания в соответствии с иными правилами клиринга Клирингового центра, то заключение нового Договора об оказании клиринговых услуг в соответствии с Правилами клиринга не требуется.
- 6.5. Участник клиринга обязан ежегодно предоставлять Клиринговому центру Анкету Участника клиринга (клиента) (Регистрационную карточку) (далее – Анкета Участника клиринга) в форме электронного документа. В случае изменения сведений, содержащихся в Анкете Участника клиринга или в иных представленных Клиринговому центру документах, Участник клиринга обязан в течение 5 (пяти) Рабочих дней после таких изменений предоставить Клиринговому центру Анкету Участника клиринга с обновленной информацией в форме электронного документа и соответствующие документы, подтверждающие такие изменения. Форматы предоставления Участником клиринга Анкеты Участника клиринга определены Порядком предоставления информации и отчетности.



- 6.6. Одновременно с ежегодным предоставлением Клиринговому центру Анкеты Участника клиринга Участник клиринга обязан предоставлять Клиринговому центру Отзывы о деловой репутации, заверенные подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица их выдавшего.  
Участник клиринга предоставляет Отзывы о деловой репутации от других Участников клиринга Клирингового центра, имеющих с ним деловые отношения, или Отзывы о деловой репутации от кредитных организаций, у которых Участник клиринга находится или ранее находился на обслуживании. Списки Участников клиринга раскрываются на сайте Клирингового центра. В случае невозможности получения отзывов о деловой репутации Участник клиринга направляет Клиринговому центру письмо об отсутствии возможности его получения.
- 6.7. Для подтверждения своего финансового состояния Участники клиринга обязаны в течение всего срока действия Договора об оказании клиринговых услуг предоставлять Клиринговому центру отчетность в соответствии с приложением № 5 к Правилам клиринга.  
В целях оценки финансового состояния Участника клиринга Клиринговый центр вправе затребовать от Участника клиринга дополнительную информацию и отчетность, не указанную в приложении № 5 к Правилам клиринга.  
В случае если какой-либо из документов, указанных в приложении № 5 к Правилам клиринга, ранее уже предоставлялся Клиринговому центру в данном периоде, определенном в соответствии с приложением № 5 к Правилам клиринга, и имеется в наличии у Клирингового центра, то Участник клиринга по предварительному согласованию с Клиринговым центром может быть освобожден от обязанности повторного предоставления этого документа.
- 6.8. Участник клиринга предоставляет Клиринговому центру Анкету FATCA в форме электронного документа, а также иные прилагаемые к Анкете FATCA документы и сведения, предоставляемые для целей Закона FATCA, необходимость предоставления которых следует из Анкеты FATCA и (или) действующего законодательства, в том числе согласие на передачу информации в иностранный налоговый орган.  
В случае изменения сведений, содержащихся в Анкете FATCA, Участник клиринга обязан в течение 30 (тридцати) дней после таких изменений предоставить Клиринговому центру Анкету FATCA с обновленной информацией и прилагаемыми к Анкете FATCA документами и сведениями в форме электронного документа.  
Форма заполнения Анкеты FATCA Участниками клиринга размещается на сайте Клирингового центра. При этом документы и сведения, прилагаемые к Анкете FATCA, заполняются Участником клиринга и предоставляются в Клиринговый центр в виде PDF файлов, содержащих скан-копии этих документов.

## **Статья 7. Условия клирингового обслуживания. Порядок предоставления допуска к клиринговому обслуживанию**

- 7.1. Допуск к клиринговому обслуживанию в соответствии с Правилами клиринга предоставляется Участнику клиринга, который соответствует следующим требованиям:
- имеет действующий Договор об оказании клиринговых услуг, заключенный с Клиринговым центром;
  - имеет действующую лицензию на осуществление брокерской деятельности и/или дилерской деятельности и/или деятельности по управлению ценными бумагами (для Некредитных организаций);

- имеет действующую лицензию на осуществление банковских операций, выданную Банком России (для Кредитных организаций);
- имеет специальное разрешение (лицензию или иное основание), выданное компетентным органом государства учреждения Кредитной организации - нерезидента, на основании которого Кредитная организация-нерезидент имеет право осуществлять банковские операции (для Кредитных организаций-нерезидентов);
- имеет доступ к Подсистеме ЭДО НКЦ;
- имеет технический доступ к Клиринговой системе на основании договора с Техническим центром;
- выполняет требования Клирингового центра по предоставлению информации и отчетности, предусмотренные пунктами 6.5 и 6.7 Правил клиринга;
- выполняет требования Клирингового центра к финансовой устойчивости Участника клиринга, предусмотренные пунктом 7.2 Правил клиринга;
- внес взнос в Гарантийный фонд в установленном размере в соответствии со статьей 25 Правил клиринга;
- в деятельности Участника клиринга отсутствуют факты ухудшения его финансового состояния и/или отсутствует информация, дающая основания считать возможными ухудшение финансового состояния Участника клиринга и/или неспособность Участника клиринга своевременно и в полном объеме исполнять свои Обязательства по Договорам и обязательства по договорам, заключенным с Участником клиринга в соответствии со статьей 30 Правил клиринга, Маржинальные требования и/или иные обязательства Участника клиринга, возникающие из Правил клиринга.

7.2. Участники клиринга должны соответствовать следующим требованиям к финансовой устойчивости:

- Кредитные организации - соблюдать обязательные нормативы Банка России, установленные для кредитных организаций;
- Кредитные организации - в деятельности Участников клиринга должны отсутствовать основания для отзыва Банком России лицензии на осуществление банковских операций в соответствии с законодательством Российской Федерации о банковской деятельности;
- Кредитные организации-нерезиденты - соблюдать обязательные нормативы, установленные компетентным органом государства учреждения, в случае если в соответствии с национальным законодательством государства учреждения Кредитной организации-нерезидента такие обязательные нормативы устанавливаются;
- Кредитные организации-нерезиденты - в деятельности Участников клиринга должны отсутствовать основания для отзыва в соответствии с национальным законодательством государства учреждения Кредитной организации-нерезидента специального разрешения (лицензии или иного основания), выданного компетентным органом государства учреждения Кредитной организации-нерезидента, на основании которого Кредитная организация -нерезидент имеет право осуществлять банковские операции;
- Кредитные организации-нерезиденты - иметь:
  - собственные средства (капитал) не менее 50 000 000 000 (пятидесяти миллиардов) российских рублей по текущему курсу Банка России;или

- собственные средства (капитал) не менее 20 000 000 000 (двадцати миллиардов) российских рублей по текущему курсу Банка России и рейтинг по международной шкале долгосрочной кредитоспособности по обязательствам в российских рублях или в иностранной валюте какого-либо из следующих рейтинговых агентств: Standard & Poor's, Moody's Investors Service, Fitch Ratings не ниже:
  - MAX(Standard & Poor's «BB-», S);
  - MAX(Moody's Investors Service «Ba3», S);
  - MAX (Fitch Ratings «BB-», S), гдеS – рейтинг, устанавливаемый в соответствии с Методикой.
- Некредитные организации - иметь собственные средства (капитал) не менее 300 000 000 (трехсот миллионов) российских рублей.

В деятельности Участников клиринга должны отсутствовать основания для осуществления мер по предупреждению банкротства в соответствии с законодательством Российской Федерации о несостоятельности (банкротстве) или в соответствии с национальным законодательством государства учреждения Участника клиринга.

7.3. Участники клиринга должны соответствовать требованиям к финансовой устойчивости, приведенным в пункте 7.2 Правил клиринга, в течение всего времени допуска к клиринговому обслуживанию в соответствии с Правилами клиринга.

Участники клиринга обязаны незамедлительно уведомлять Клиринговый центр о своем несоответствии указанным требованиям.

7.4. Клиринговый центр вправе не предоставлять допуск к клиринговому обслуживанию в соответствии с Правилами клиринга Участникам клиринга, не соответствующим требованию:

- Кредитные организации – наличие по балансу на последнюю отчетную дату положительного финансового результата текущего года, определяемого как разница между суммой остатков, числящихся на балансовых счетах по учету доходов текущего года, и суммой остатков, числящихся на балансовых счетах по учету расходов текущего года;
- Кредитные организации-нерезиденты - наличие по финансовой отчетности на последнюю отчетную дату положительного финансового результата деятельности, определяемого как прибыль после налогообложения;
- Некредитные организации – наличие по балансу на последнюю отчетную дату положительного финансового результата деятельности, определяемого как прибыль после налогообложения.

7.5. О факте предоставления Участнику клиринга допуска к клиринговому обслуживанию в соответствии с Правилами клиринга Клиринговый центр извещает Участника клиринга и Биржу, если Участник клиринга является Кандидатом в Участники торгов, не позднее Рабочего дня, следующего за днем предоставления допуска к клиринговому обслуживанию в соответствии с Правилами клиринга, направляя соответствующие уведомления в форме электронного документа.

## **Статья 8. Порядок регистрации Участников клиринга и их Клиентов**

8.1. Клиринговый центр осуществляет регистрацию Участников клиринга и присваивает уникальный код Участника клиринга при заключении Участником клиринга с Клиринговым центром Договора об оказании клиринговых услуг. По заявлению Участника клиринга Клиринговый центр осуществляет регистрацию

- Клиентов Участника клиринга и присваивает каждому Клиенту Участника клиринга уникальный код Клиента Участника клиринга.
- 8.2. Регистрация Участника клиринга / Клиента Участника клиринга и присвоение им уникального кода Участника клиринга / уникального кода Клиента Участника клиринга осуществляется Клиринговым центром в соответствии с требованиями нормативных актов Банка России.
- 8.3. Регистрация Участника клиринга / Клиента Участника клиринга осуществляется на основании информации, полученной от Участника клиринга. Технологические особенности присвоения кодов Участникам клиринга и Клиентам Участника клиринга раскрываются на Сайте Клирингового центра.
- 8.4. Для предоставления технического доступа к клиринговому обслуживанию в соответствии с Правилами клиринга Технический центр присваивает Участнику клиринга Имя и Пароль, а также присваивает Идентификатор Участника клиринга.

## **Статья 9. Клиринговые регистры**

- 9.1. Клиринговый центр осуществляет внутренний учет на клиринговых регистрах. Клиринговые регистры ведутся Клиринговым центром в Клиринговой системе.
- 9.2. При предоставлении Участнику клиринга допуска к клиринговому обслуживанию в соответствии с Правилами клиринга Клиринговый центр открывает основные собственные денежные регистры обеспечения Участника клиринга и основной собственный регистр учета позиций Участника клиринга. Клиринговые регистры учета средств Гарантийного фонда в каждой валюте, принимаемой в качестве средств Гарантийного фонда, открываются Участнику клиринга при присвоении ему Идентификатора Участника клиринга.
- 9.3. Клиринговый центр на основании соответствующего заявления Участника клиринга открывает для Участника клиринга следующие виды денежных регистров обеспечения (в зависимости от того, за чей счет действует Участник клиринга):
- дополнительные собственные денежные регистры обеспечения;
  - обособленные клиентские денежные регистры обеспечения;
  - необособленные клиентские денежные регистры обеспечения;
  - денежные регистры обеспечения ДУ.
- Заявление Участника клиринга на открытие соответствующих денежных регистров обеспечения направляется в виде электронного документа.
- 9.4. Клиринговый центр осуществляет открытие денежных регистров обеспечения в каждой валюте, принимаемой в качестве Средств обеспечения, с указанным видом, и информирует Участника клиринга о присвоенном указанному регистру уникальном расчетном коде не позднее Рабочего дня, следующего за днем получения заявления на открытие соответствующих денежных регистров обеспечения, посредством Подсистемы ЭДО НКЦ.
- 9.5. Клиринговый центр открывает для Участника клиринга на основании соответствующего заявления Участника клиринга следующие виды регистров учета позиций:
- дополнительный собственный регистр учета позиций;
  - обособленный клиентский регистр учета позиций;
  - необособленный клиентский регистр учета позиций;
  - регистр учета позиций ДУ.

- Участник клиринга, являющийся Участником торгов, вправе подавать Заявки с указанием всех регистров учета позиций, открытых для него Клиринговым центром.
- 9.6. В заявлении Участника клиринга на регистрацию Клиента и открытие регистра учета позиций соответствующего вида должны быть указаны:
- информация, необходимая для регистрации Клиента;
  - код регистра учета позиций и вид регистра учета позиций;
  - расчетный код денежных регистров обеспечения, которому соответствует указанный код регистра учета позиций.
- 9.7. В случае открытия обособленного клиентского регистра позиций, Участник клиринга предоставляет следующую информация в отношении Клиента:
- наименование, ИНН для юридического лица, имеющего ИНН;
  - фамилию, имя и отчество номер паспорта для физического лица;
  - адрес и регистрационный номер в стране регистрации для юридического лица, являющегося Кредитной организацией-нерезидентом и не имеющего ИНН.
- 9.8. Соответствие между расчетным кодом денежных регистров обеспечения и кодом регистра учета позиций должно удовлетворять следующим требованиям:
- вид расчетного кода денежных регистров обеспечения должен совпадать с видом кода регистра учета позиций;
  - код регистра учета позиций может соответствовать только одному расчетному коду денежных регистров обеспечения;
  - расчетный код обособленных клиентских денежных регистров обеспечения может соответствовать только одному коду обособленного клиентского регистра учета позиций.
- 9.9. При условии выполнения требований пунктов 9.6-9.8 Правил клиринга, Клиринговый центр осуществляет открытие регистра учета позиций с указанным кодом и видом и информирует Участника клиринга не позднее Рабочего дня, следующего за днем получения заявления на открытие соответствующего регистра учета позиций, посредством Подсистемы ЭДО НКЦ.
- 9.10. Клиент, для которого Клиринговый центр открывает на основании соответствующего заявления Участника клиринга обособленный клиентский денежный регистр обеспечения и обособленный клиентский регистр учета позиций, именуется Обособленным клиентом. Обособленный клиентский денежный регистр обеспечения и обособленный клиентский регистр учета позиций предоставляют Клиенту возможность воспользоваться в будущем переводом обязательств Клиента и Средств обеспечения Клиента, в порядке определенном в статье 39 Правил клиринга.
- 9.11. Участник клиринга несет ответственность за достоверность информации о Клиенте, включая Обособленного клиента, предоставленной Клиринговому центру в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга.
- 9.12. Клиринговый центр осуществляет в соответствии с пунктом 9.17 Правил клиринга учет Обязательств по Договорам, а также иных обязательств, возникших на основании Правил клиринга, и Средств обеспечения, являющихся предметом обеспечения указанных обязательств, на регистрах учета позиций и денежных регистрах обеспечения, открытых Участнику клиринга.
- 9.13. Участник клиринга обязан информировать своих Клиентов о предусмотренном Правилами клиринга порядке и формах учета Клиринговым центром
-

обязательств по Договорам, заключенным в интересах и (или) за счет Клиентов Участников клиринга, и Средств обеспечения, являющихся предметом обеспечения указанных обязательств, в том числе, о видах регистров учета позиций и о видах денежных регистров обеспечения, об их соответствии, а также о возможности и порядке открытия обособленных клиентских денежных регистров обеспечения и обособленных клиентских регистров учета позиций, для которых существует возможность Перевода обязательств и Перевода обеспечения по основаниям и в порядке, установленным в статье 39 Правил клиринга.

9.14. Вид денежного регистра обеспечения определяет, какие денежные средства учитываются на данном денежном регистре обеспечения:

- на основном и дополнительном собственном денежном регистре обеспечения учитываются Средства обеспечения, предоставленные Участником клиринга;
- на обособленном и необособленном клиентском денежном регистре обеспечения учитываются Средства обеспечения, предоставленные Участником клиринга для целей исполнения или обеспечения исполнения обязательств по Договорам, заключённым за счет Клиентов;
- на денежном регистре обеспечения ДУ учитываются Средства обеспечения, предоставленные Участником клиринга для целей исполнения или обеспечения исполнения обязательств по Договорам, заключённым за счет средств, находящихся в доверительном управлении у Участника клиринга.

Вид регистра учета позиций определяет вид денежного регистра обеспечения, на котором учитываются Средства обеспечения, за счет которых будут исполняться обязательства по договорам, учитываемым на данном регистре учета позиций.

9.15. В случае заключения Договоров за счет Клиентов, Участник клиринга обязан открыть обособленные и (или) необособленные клиентские регистры учета позиций, на которых будут учитываться такие Договоры. Для учета Средств обеспечения Клиентов Участник клиринга обязан открыть обособленные и (или) необособленные клиентские денежные регистры обеспечения.

9.16. В случае заключения Договоров за счет денежных средств, находящихся в доверительном управлении Участника клиринга, Участник клиринга обязан открыть отдельный регистр учета позиций ДУ для учета денежных средств, находящихся в доверительном управлении этого Участника клиринга и обязательств Участника клиринга по Договорам, заключенным за счет денежных средств, находящихся в доверительном управлении этого Участника клиринга. Для учета Средств обеспечения, находящихся в доверительном управлении Участника клиринга, Участник клиринга обязан открыть денежные регистры обеспечения ДУ.

9.17. Клиринговый центр осуществляет на клиринговых регистрах следующий учет:

- на денежном регистре обеспечения учитываются:
  - денежные средства в соответствующей валюте, являющиеся Средствами обеспечения.
  - обязательство по возврату учитываемых Средств обеспечения;
  - обязательство / требование Дефолтера, определенное в соответствии с пунктом 32.6 Правил клиринга;
  - нетто-обязательство / нетто-требование, определенное в соответствии с пунктом 40.1 Правил клиринга;
  - обязательство / требование Участника клиринга, определенное в соответствии с пунктом 23.11 Правил клиринга;

- обязательства по внесению Платы за заключение Аукционных договоров по расчетному коду, определенные в соответствии с пунктом 32.10 Правил клиринга;
- обязательство по уплате Процентов за использование в соответствии с пунктом 2.10 Правил клиринга;
- обязательство по уплате неустоек (штрафов, пени) в соответствии с Правилами клиринга.

На денежном регистре обеспечения в российских рублях учитывается Маржинальное требование по расчетному коду.

- на регистре учета позиций учитываются:
  - Договоры, заключенные Участником клиринга, и Договоры, заключенные Участником торгов от имени Участника клиринга;
  - обязательства по Договорам, в том числе с учетом Соглашений об изменении условий Договора и Соглашений о досрочном прекращении Договора;
  - договоры, заключенные с Участником клиринга в соответствии со статьей 30 Правил клиринга;
  - обязательства по договорам, заключенным с Участником клиринга в соответствии со статьей 30 Правил клиринга;
  - обязательство по уплате расчетной стоимости Договора в соответствии с пунктом 17.8 Правил клиринга;
  - обязательства по уплате депозитной маржи в соответствии с пунктом 17.9 Правил клиринга;
  - обязательство по уплате комиссионного вознаграждения Биржи;
  - обязательство по уплате комиссионного вознаграждения Клирингового центра;
- на регистре учета средств Гарантийного фонда учитывается взнос Участника клиринга в Гарантийный фонд в соответствующей валюте и обязательство по его возврату.

Учет и изменение клиринговых регистров осуществляется в порядке, установленном Правилами клиринга.

- 9.18. Для закрытия регистров учета позиций и денежных регистров обеспечения (за исключением основного собственного денежного регистра обеспечения и основного собственного регистра учета позиций), Участник клиринга предоставляет в Клиринговый центр Заявление на закрытие указанных регистров, которое должно содержать код / расчетный код указанных регистров, подлежащих закрытию и дату закрытия. Указанное заявление предоставляется в форме электронного документа.
- 9.19. Закрытие регистра учета позиций возможно только при отсутствии непрекращенных Договоров и договоров, заключенных с Участником клиринга в соответствии со статьей 30 Правил клиринга, и непрекращённых обязательств, учитываемых на соответствующем регистре учета позиций.
- 9.20. Закрытие денежных регистров обеспечения возможно при соблюдении следующих условий:
- закрытию подлежат денежные регистры обеспечения во всех валютах с соответствующим расчетным кодом;
  - отсутствуют регистры учета позиций, код которых соответствует расчетному коду соответствующих денежных регистров обеспечения;
  - отсутствуют Средства обеспечения и обязательства, учитываемые на соответствующих денежных регистрах обеспечения.

**Статья 10. Порядок закрепления за Участником клиринга Участника торгов, имеющего право на заключение биржевых Договоров от имени Участника клиринга**

- 10.1. Для возможности заключения Участником торгов биржевого Договора от имени своего клиента - Участника клиринга (далее – Договор по поручению) в секторе Навигатор, этот Участник клиринга должен предоставить в Клиринговый центр доверенность установленной формы на Участника торгов, предоставляющую этому Участнику торгов право на заключение Договоров по поручению.
- 10.2. Для получения возможности становиться стороной Договоров по поручению Участник клиринга предоставляет в Клиринговый центр заявление, содержащее следующую информацию:
- код собственного регистра учета позиций, открытый для этого Участника клиринга Клиринговым центром, с указанием которого Участником торгов будут подаваться Заявки на заключение Договоров по поручению;
  - наименование / Идентификатор Участника торгов, который вправе подавать Заявки на заключение Договоров по поручению с указанием этого регистра учета позиций.
- Указанный Участник торгов далее именуется уполномоченным.
- 10.2.1. Для одного регистра учета позиций может быть указан только один уполномоченный Участник торгов.  
Участник клиринга вправе указывать в заявлении только код собственного регистра учета позиций.
- 10.2.2. Участник клиринга вправе изменить Участника торгов, который вправе подавать Заявки на заключение Договоров по поручению с указанием регистра учета позиций, открытого для данного Участника клиринга, путем подачи в Клиринговый центр соответствующего заявления и доверенности на нового уполномоченного Участника торгов. Указание нового Участника торгов аннулирует предыдущее заявление Участника клиринга и соответствующее указание ранее уполномоченного Участника торгов.
- 10.2.3. Участник клиринга также вправе аннулировать ранее направленное заявление и соответствующее указание ранее уполномоченного Участника торгов, который вправе подавать Заявки на заключение Договоров по поручению с указанием регистра учета позиций данного Участника клиринга, путем подачи в Клиринговый центр соответствующего заявления.
- 10.3. Подача доверенности, указанной в пункте 10.1 Правил клиринга, и заявления, указанного в пункте 10.2 Правил клиринга, считается согласием Участника клиринга на указание его в Заявках с соответствующим регистром учета позиций в качестве стороны Договора, на заключение которого направлена Заявка.
- 10.4. Для предоставления возможности заключения Договоров по поручению Биржа предоставляет в Клиринговый центр полученную от Участника торгов следующую информацию:
- наименование / Идентификатор Участника торгов;
  - код регистра учета позиций, указанный Участником торгов, с указанием которого Участник торгов вправе подавать Заявки на заключение Договоров по поручению;
  - наименование / Идентификатор Участника клиринга – клиента Участника торгов, который будет являться стороной по Договору по поручению, заключенному на основании Заявки, поданной этим Участником торгов с



указанием этого регистра учета позиций, открытого для данного Участника клиринга.

- 10.5. Для прекращения возможности заключения Договоров по поручению Биржа предоставляет в Клиринговый центр полученную от Участника торгов информацию об аннулировании информации, предоставленной в соответствии с пунктом 10.4 Правил клиринга.
- 10.6. Клиринговый центр передает на Биржу информацию о регистре учета позиций Участника клиринга – клиента Участника торгов и об уполномоченном Участнике торгов при выполнении следующих условий:
- при наличии у Клирингового центра действующей доверенности, указанной в пункте 10.1 Правил клиринга, выданной Участником клиринга, для которого открыт этот регистр учета позиций, на соответствующего Участника торгов;
  - наличие по такому регистру учета позиций действующего заявления, предусмотренного пунктом 10.2 Правил клиринга, и действующей информации, предусмотренной пунктом 10.4 Правил клиринга;
  - по такому регистру учета позиций совпадает наименование / Идентификатор Участника торгов, указанного в заявлении Участника клиринга, предоставленном в соответствии с пунктом 10.2 Правил клиринга, и наименование / Идентификатор Участника торгов, указанный в предоставленной Биржей в соответствии с пунктом 10.4 Правил клиринга информации;
  - по такому регистру учета позиций совпадает наименование / Идентификатор Участника клиринга, предоставившего заявление в соответствии с пунктом 10.2 Правил клиринга, и наименование / Идентификатор Участника клиринга, указанный в информации, предоставленной Биржей в соответствии с пунктом 10.4 Правил клиринга.
- 10.7. В целях передачи на Биржу информации, указанной в пункте 10.6 Правил клиринга, в текущий Рабочий день, Клиринговый центр обрабатывает документы и информацию, указанные в пунктах 10.1, 10.2, 10.4 Правил клиринга, полученные не позднее, чем за 60 (шестьдесят) минут до начала проведения клиринговой сессии текущего Рабочего дня.  
Документы и информацию, указанные в пунктах 10.1, 10.2, 10.4 Правил клиринга, полученные позднее, чем за 60 (шестьдесят) минут до начала проведения клиринговой сессии текущего Рабочего дня подлежат обработке в ходе следующего Рабочего дня.

## **Статья 11. Порядок приостановления и прекращения допуска к клиринговому обслуживанию**

- 11.1. Клиринговый центр вправе частично или полностью приостановить допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию по любому из следующих оснований:
- 11.1.1. при поступлении в Клиринговый центр информации от Биржи, которая свидетельствует (по заключению Клирингового центра) о необходимости приостановления допуска Участнику клиринга к клиринговому обслуживанию;
- 11.1.2. при нарушении Участником клиринга требований, установленных Правилами клиринга;

- 11.1.3. при применении Банком России к Участнику клиринга – Кредитной организации санкций за нарушение банковского законодательства, в том числе: введение запрета на осуществление Участником клиринга отдельных банковских операций, если это приведет к невозможности заключения и/или исполнения Участником клиринга Договоров и назначение временной администрации по управлению Кредитной организацией – Участником клиринга в рамках мер по предупреждению банкротства кредитной организации;
- 11.1.4. при приостановлении действия/аннулировании у Участника клиринга-Некредитной организации лицензий профессионального участника рынка ценных бумаг на осуществление брокерской деятельности и/или дилерской деятельности и/или деятельности по управлению ценными бумагами;
- 11.1.5. при применении к Участнику клиринга санкций уполномоченных органов за нарушение законодательства Российской Федерации, в том числе при применении административных наказаний;
- 11.1.6. по результатам рассмотрения Клиринговым центром предоставленных Участником клиринга в соответствии с пунктами 6.5-6.7 Правил клиринга информации и документов, а также в случае их непредставления в надлежащий срок;
- 11.1.7. в случае отсутствия в отчетности Участника клиринга положительного финансового результата, предусмотренного пунктом 7.4 Правил клиринга;
- 11.1.8. при получении Клиринговым центром письменного сообщения от компетентного органа государства учреждения Кредитной организации-нерезидента в отношении Кредитной организации-нерезидента, из которого следует невозможность дальнейшего осуществления клирингового обслуживания Кредитной организации-нерезидента и/или размещении соответствующей информации на сайте вышеуказанного компетентного органа в сети Интернет;
- 11.1.9. при наличии Маржинального требования по расчетному коду и / или Задолженности по расчетному коду;
- 11.1.10. в случае невыполнения Участником клиринга требования о доведении имущества в качестве взноса в Гарантийный фонд в соответствии со статьей 25 Правил клиринга или требования о восполнении взноса в Гарантийный фонд в соответствии со статьей 33 Правил клиринга;
- 11.1.11. в случае возврата Клиринговым центром Участнику клиринга его взноса в Гарантийный фонд в соответствии с пунктом 25.9 Правил клиринга;
- 11.1.12. при наличии фактов ухудшения финансового состояния Участника клиринга и/или информации, дающей основания считать возможными ухудшение финансового состояния Участника клиринга и/или неспособность Участника клиринга своевременно и в полном объеме исполнять свои Обязательства по Договорам, обязательства по договорам, заключенным с Участником клиринга в соответствии со статьей 30 Правил клиринга, Маржинальные требования и/или иные обязательства Участника клиринга, возникающие из Правил клиринга;
- 11.1.13. в случае снижения международного рейтинга Кредитной организации-нерезидента ниже уровня, установленного пунктом 7.2 Правил клиринга или в случае отзыва соответствующего рейтинга;
- 11.1.14. при наличии фактов неисполнения или ненадлежащего исполнения Участником клиринга обязательств, допущенных к клирингу в соответствии с правилами

- клиринга, утвержденными Клиринговым центром и регламентирующими различные направления клиринговой деятельности.
- 11.2. Частичное приостановление допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию осуществляется при наличии учитываемых Клиринговым центром на регистрах учета позиций, открытых данному Участнику клиринга, непрекращенных Договоров или непрекращенных договоров, заключенных в соответствии со статьей 30 Правил клиринга, или непрекращенных обязательств Участника клиринга, возникших в результате заключения Договоров. Полное приостановление допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию осуществляется при отсутствии учитываемых Клиринговым центром на регистрах учета позиций, открытых данному Участнику клиринга, непрекращенных Договоров, непрекращенных договоров, заключенных в соответствии со статьей 30 Правил клиринга, и непрекращенных обязательств Участника клиринга, возникших в результате заключения Договоров.
- 11.3. При частичном приостановлении допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию Клиринговый центр направляет Участнику клиринга соответствующее уведомление и осуществляет следующие действия:
- 11.3.1. направляет на Биржу уведомление о необходимости удаления всех Заявок, поданных с указанием регистров учета позиций, открытых для данного Участника клиринга в секторе Навигатор до момента направления Клиринговым центром на Биржу указанного уведомления;
- 11.3.2. удаляет Предложения и Предложения «Стратегия», поданные данным Участником клиринга до приостановления допуска данного Участника клиринга к клиринговому обслуживанию;
- 11.3.3. отказывает в акцепте всех полученных оферт, предусмотренных Правилами клиринга, направленных на изменение или прекращение Договоров, поданных данным Участником клиринга.
- 11.4. При частичном приостановлении допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию Клиринговый центр осуществляет расчет Уровня обеспеченности по каждому расчетному коду с учетом осуществленных Клиринговым центром в соответствии с пунктом 11.3 Правил клиринга действий.
- 11.5. В случае частичного приостановления допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию Клиринговый центр осуществляет проверки, предусмотренные Правилами клиринга, с целью запрета выполнения действий, в результате которых Уровень обеспеченности по расчетному коду станет меньше Уровня обеспеченности по расчетному коду, определенного в соответствии с пунктом 11.4 Правил клиринга. В случае частичного приостановления допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию Клиринговый центр вправе в любой момент направить на Биржу уведомление о необходимости удаления всех Активных заявок, поданных данным Участником клиринга в секторе Спектра, и запрете выставления новых заявок в секторе Спектра.
- 11.6. При полном приостановлении допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию Клиринговый центр направляет Участнику клиринга соответствующее уведомление и осуществляет следующие действия:
- 11.6.1. направляет на Биржу уведомление о необходимости приостановления допуска к Торгам в секторе Навигатор и в секторе Спектра данного Участника клиринга, если данный Участник клиринга является Участником торгов;

- 11.6.2. направляет на Биржу уведомление о запрете выставления Участниками торгов Заявок с указанием регистров учета позиций, открытых для данного Участника клиринга;
- 11.6.3. устанавливает запрет на подачу Предложений/ Предложений «Стратегия» данным Участником клиринга;
- 11.6.4. выполняет действия, указанные в подпунктах 11.3.1-11.3.3 Правил клиринга.
- 11.7. В случае частичного приостановления допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию Клиринговый центр вправе в любой момент до принятия решения о возобновлении допуска к клиринговому обслуживанию в соответствии с пунктом 11.8 Правил клиринга, применить к Участнику клиринга процедуру урегулирования ситуации неисполнения (дефолта) Участника клиринга в соответствии со статьей 32 Правил клиринга.
- 11.8. Если по усмотрению Клирингового центра допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию может быть возобновлен, Клиринговый центр вправе принять решение о возобновлении допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию. Клиринговый центр извещает Участника клиринга о принятом решении не позднее Рабочего дня, следующего за днем принятия указанного решения. Не позднее Рабочего дня, следующего за днем принятия указанного решения, Клиринговый центр уведомляет Биржу об отмене ограничений, установленных при приостановлении допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга.
- 11.9. Клиринговый центр прекращает допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию в соответствии с Правилами клиринга по любому из следующих оснований:
- прекращения действия Договора об оказании клиринговых услуг;
  - отзыва (аннулирования) Банком России лицензии на осуществление банковских операций у Участника клиринга – Кредитной организации;
  - назначения временной администрации или принятия арбитражным судом решения о введении в отношении Участника клиринга - Некредитной организации, одной из процедур банкротства;
  - отзыва (аннулирования) специального разрешения (лицензии или иного основания) компетентного органа государства учреждения Кредитной организации-нерезидента, в соответствии с которым Кредитная организация-нерезидент имеет право осуществлять банковские операции;
  - ликвидации Участника клиринга, а также в случае реорганизации Участника клиринга при условии, что деятельность Участника клиринга в результате реорганизации прекращается;
  - получения от Участника клиринга заявления о прекращении допуска к клиринговому обслуживанию в соответствии с Правилами клиринга, при условии отсутствия учитываемых Клиринговым центром на регистрах учета позиций и денежных регистрах обеспечения Участника клиринга непрекращенных Договоров, непрекращенных договоров, заключенных в соответствии со статьей 30 Правил клиринга, и непрекращенных обязательств Участника клиринга, возникших в результате заключения Договоров;
  - размещение в сети Интернет на официальном сайте уполномоченного органа информации о включении Участника клиринга в перечень организаций, в отношении которых имеются сведения об их причастности к

экстремистской деятельности или терроризму, либо размещение в сети Интернет на официальном сайте уполномоченного органа решения о применении мер по замораживанию (блокированию) денежных средств или иного имущества, принадлежащих Участнику клиринга, в отношении которого имеются достаточные основания подозревать его причастность к террористической деятельности (в том числе к финансированию терроризма) при отсутствии оснований для включения в указанный перечень.

11.9.1. Клиринговый центр вправе принять решение о прекращении допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию в соответствии с Правилами клиринга по любому из следующих оснований:

- применения к Участнику клиринга процедуры урегулирования ситуации неисполнения (дефолта) Участника клиринга в соответствии со статьей 32 Правил клиринга;
- неоднократного (два и более раза) в течение одного года неисполнения Участником клиринга своих обязательств, допущенных к клирингу, и/или иных денежных обязательств Участника клиринга, возникающих на основании Правил клиринга;
- неоднократного (два и более раза) в течение одного года нарушения Участником клиринга установленных Правилами клиринга требований.

11.10. Если на дату принятия Клиринговым центром решения о прекращении допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию в соответствии с Правилами клиринга на денежном регистре обеспечения / регистре учета средств Гарантийного фонда учитываются денежные средства, составляющие Средства обеспечения / взнос Участника клиринга в Гарантийный фонд, Клиринговый центр возвращает указанные денежные средства не позднее 3 (трех) рабочих дней с даты прекращения допуска к клиринговому обслуживанию, за исключением случаев, предусмотренных статьей 41 Правил клиринга, путем:

- перевода указанных денежных средств на соответствующий Счет для возврата денежных средств, зарегистрированных в Клиринговом центре в соответствии с пунктом 23.2 Правил клиринга / на любой Счет для возврата денежных средств;
- в случае невозможности указанных переводов денежных средств, внесения указанных денежных средств в депозит нотариуса.

### **РАЗДЕЛ III                    МЕРЫ, НАПРАВЛЕННЫЕ НА УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ ПРИ ОСУЩЕСТВЛЕНИИ КЛИРИНГА**

#### **Статья 12. Перечень мер, направленных на управление рисками при осуществлении клиринга**

- 12.1. В целях снижения рисков, связанных с осуществлением клиринга по Договорам, Клиринговый центр:
- предъявляет требования к финансовой устойчивости Участников клиринга в соответствии со статьей 7 Правил клиринга;
  - предъявляет к Участникам клиринга требование о внесении Средств обеспечения до заключения Договоров, обязательства из которых обеспечиваются Средствами обеспечения;
  - осуществляет расчет Требования к обеспечению по расчетным кодам по Договорам, учитываемым на регистрах учета позиций, коды которых соответствуют данному расчетному коду, и определяет Уровень обеспеченности по расчетным кодам Участника клиринга;
  - предъявляет к Участникам клиринга Маржинальное требование по расчетному коду в соответствии со статьей 31 Правил клиринга;
  - формирует Гарантийный фонд.
- 12.2. В качестве Средств обеспечения могут быть приняты денежные средства в российских рублях и иностранной валюте. Список иностранных валют, принимаемых в качестве Средств обеспечения, максимальное количество (предельная доля) каждой иностранной валюты, порядок расчета Оценки средств обеспечения по расчетному коду на основании Средств обеспечения, учитываемых на денежных регистрах обеспечения с данным расчетным кодом, устанавливаются Методикой.
- 12.3. Имущество, принимаемое в Гарантийный фонд, порядок определения размера взноса Участника клиринга в Гарантийный фонд устанавливаются Правилами клиринга.  
Порядок оценки указанного имущества и максимальное количество (предельная доля) каждого вида указанного имущества устанавливается Методикой.
- 12.4. Методика, а также изменения и дополнения в нее утверждаются Клиринговым центром и раскрываются на Сайте Клирингового центра. Методика, а также изменения и дополнения в нее вступают в силу в срок, установленный решением Клирингового центра, но не ранее 5 (пяти) дней с момента раскрытия на Сайте Клирингового центра.
- 12.5. Информация о текущем размере Гарантийного фонда раскрывается на Сайте Клирингового центра.
- 12.6. В случае изменения размера Гарантийного фонда информация об измененном размере Гарантийного фонда раскрывается на Сайте Клирингового центра не позднее 3 (трех) Рабочих дней с момента изменения размера Гарантийного фонда.

## **РАЗДЕЛ IV                    ПОРЯДОК И УСЛОВИЯ ДОПУСКА ОБЯЗАТЕЛЬСТВ К КЛИРИНГУ**

### **Статья 13.    Возможность заключения внебиржевых Договоров**

- 13.1.    Клиринговый центр составляет и утверждает список предметов обязательств из договоров, заключенных не на организованных торгах (далее - Список).
- 13.2.    Список содержит для каждого внебиржевого Договора:
- код Договора;
  - предмет обязательств по Договору;
  - предмет обязательств по заключению Аукционных договоров.
- 13.3.    С момента вступления в силу Списка допускается заключение внебиржевых Договоров, входящих в Список, и осуществление клиринга по указанным Договорам на основании внебиржевых Спецификаций и Правил клиринга.
- 13.4.    Список и внебиржевые Спецификации публикуются на Сайте Клирингового центра.

### **Статья 14.    Порядок заключения внебиржевых Договоров**

- 14.1.    В целях заключения внебиржевого Договора Участник клиринга или Клиринговый центр направляет с помощью Клиринговой системы Предложение. В целях заключения нескольких внебиржевых Договоров Участник клиринга или Клиринговый центр направляет с помощью Клиринговой системы Предложение «Стратегия».
- 14.2.    Клиринговый центр заключает внебиржевые Договоры с Участниками клиринга исключительно для целей осуществления клиринга по Договорам.
- 14.3.    Предложение или Предложение «Стратегия» формируется как электронный документ, подписанный АСП, и направляется посредством Клиринговой системы.
- 14.4.    Предложения или Предложения «Стратегия» могут подаваться в Рабочий день до 12:00 по московскому времени, если иное время не установлено решением Клирингового центра.
- 14.5.    Поданное в целях заключения внебиржевого Договора Предложение должно содержать:
- код внебиржевого Договора;
  - условия, установленные формой Предложения, предусмотренной Спецификацией, за исключением условий, которые в соответствии со Спецификацией могут быть указаны по волеизъявлению сторон, с учетом ограничений, определенных Списком;
  - код регистра учета позиций, на котором будет учитываться внебиржевой Договор;
  - Клиринговый идентификатор Участника клиринга, который будет являться стороной Парного договора.
- 14.6.    Поданное в целях заключения нескольких внебиржевых Договоров Предложение «Стратегия» должно содержать:
- код стратегии;
  - условия, установленные формой Предложения «Стратегия», предусмотренной Спецификацией для стратегии с указанным кодом;

- код регистра учета позиций, на котором будут учитываться все внебиржевые Договоры, заключаемые в соответствии с данным Предложением «Стратегия»;
- Клиринговый идентификатор Участника клиринга, который будет являться стороной Парных договоров.

Коды внебиржевых Договоров, заключаемые в соответствии с данным Предложением «Стратегия», и их условия определяются на основании информации, указанной в Предложении «Стратегия» в соответствии со Спецификацией.

14.7. Клиринговый центр осуществляет следующие проверки поданного Участником клиринга Предложения:

- соответствие условий, указанных в Предложении, ограничениям, установленным Списком для данного внебиржевого Договора и условиям, установленным формой Предложения, предусмотренной Спецификацией;
- проверки, аналогичные проверкам, установленным статьей 16 Правил клиринга для Заявок.

При положительном результате проверок первого этапа Клиринговый центр фиксирует полученное Предложение до момента получения встречного Предложения.

Клиринговый центр регистрирует в Клиринговой системе Предложение, поданное Участником клиринга, при положительном результате всех проверок.

14.8. Клиринговый центр осуществляет проверки поданного Участником клиринга Предложения «Стратегия» в два этапа.

14.8.1. При получении Предложения «Стратегия» Клиринговый центр осуществляет следующие проверки:

- соответствие условий каждого Договора, заключаемого на основании данного Предложения «Стратегия», ограничениям, установленным Списком для данного внебиржевого Договора и условиям, установленным формой Предложения, предусмотренной Спецификацией;
- проверку на соответствие расчетной стоимости всех Договоров, заключаемых на основании данного Предложения «Стратегия», лимиту колебаний стоимости всех Договоров, заключаемых на основании данного Предложения «Стратегия», в соответствии с Методикой.

При положительном результате указанных в настоящем пункте Правил клиринга проверок Клиринговый центр фиксирует полученное Предложение «Стратегия» до момента получения встречного Предложения «Стратегия». При отрицательном результате хотя бы одной проверки, указанной в настоящем пункте Правил клиринга, Клиринговый центр удаляет Предложение «Стратегия» из Клиринговой системы.

14.8.2. При фиксации встречных Предложений «Стратегия», Клиринговый центр осуществляет следующие проверки каждого из встречных Предложений «Стратегия»:

- при наличии у Участника клиринга Маржинального требования по расчетному коду, которому соответствует код регистра учета позиций, с указанием которого подано Предложение «Стратегия» - проверку неуменьшения Уровня обеспеченности по данному расчетному коду с учетом поданного Предложения «Стратегия»;
- при отсутствии у Участника клиринга Маржинального требования по расчетному коду, которому соответствует код регистра учета позиций, с указанием которого подано Предложение «Стратегия» - проверку того, что



Уровень обеспеченности по данному расчетному коду не станет меньше нуля с учетом поданного Предложения «Стратегия»;

- при отсутствии у Участника клиринга Маржинального требования по расчетному коду, которому соответствует код регистра учета позиций, с указанием которого подано Предложение «Стратегия» (если на момент подачи Предложения «Стратегия» допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию приостановлен частично) - проверку того, что Уровень обеспеченности по данному расчетному коду с учетом поданного Предложения «Стратегия» не станет меньше величины Уровня обеспеченности по данному расчетному коду, определенной при приостановлении допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию в соответствии с пунктом 11.4 Правил клиринга;
- у Участника клиринга не приостановлен полностью допуск к клиринговому обслуживанию.

Клиринговый центр регистрирует в Клиринговой системе Предложение «Стратегия», поданное Участником клиринга, при положительном результате всех проверок.

- 14.9. Предложение или Предложение «Стратегия», поданное Клиринговым центром, считается зарегистрированным в Клиринговой системе без осуществления проверок.
- 14.10. Предложению, зафиксированному в соответствии с пунктом 14.7 Правил клиринга, или Предложению «Стратегия», зафиксированному в соответствии с пунктом 14.8.1 Правил клиринга, Клиринговой системой присваивается идентификационный номер, информация о котором посредством Клиринговой системы направляется лицу, подавшему Предложение или Предложение «Стратегия».
- 14.11. Предложение или Предложение «Стратегия», действует до момента их удаления Клиринговым центром непосредственно перед началом клиринговой сессии или в порядке, установленном настоящей статьей Правил клиринга, до его отзыва или заключения на его основании внебиржевого Договора (внебиржевых Договоров).
- 14.12. Участник клиринга или Клиринговый центр могут отозвать Предложение или Предложение «Стратегия», поданное им, путем направления сообщения посредством Клиринговой системы.
- 14.13. В случае невозможности отзыва Предложений или Предложений «Стратегия» посредством Клиринговой системы, Участник клиринга может предоставить Клиринговому центру заявление на отзыв поданных им Предложений или Предложений «Стратегия» посредством телефонной или факсимильной связи. Для идентификации Участника клиринга Клиринговый центр запрашивает Идентификатор Участника клиринга, Имя и Пароль Участника клиринга. Для идентификации Предложений или Предложений «Стратегия» Клиринговый центр запрашивает их идентификационные номера. В случае успешной идентификации Участника клиринга и поданных им Предложений или Предложений «Стратегия», подлежащих отзыву, Клиринговый центр отзывает их из Клиринговой системы при наличии технической возможности. При рассмотрении споров, связанных с отзывом Предложений или Предложений «Стратегия» посредством телефонной связи, Клиринговый центр и Участник клиринга вправе использовать запись телефонных переговоров.

- 14.14. При фиксации допустимых встречных Активных предложений Клиринговый центр осуществляет проверку соответствия нормативов Клирингового центра требованиям Банка России в случае заключения внебиржевых Договоров на основании этих Активных предложений.  
С момента фиксации допустимых встречных Активных предложений отзыв допустимых встречных Активных предложений не допускается.
- 14.15. Внебиржевой Договор (внебиржевые Договоры) заключается (заключаются) на основании допустимых встречных Активных предложений в момент акцепта Клиринговым центром оферт, содержащихся в Активных предложениях, путем направления сообщения в Клиринговой системе Участникам клиринга-оферентам при положительном результате проверки, указанной в пункте 14.14 Правил клиринга. Момент отображения указанного сообщения в Клиринговой системе считается моментом получения Участником клиринга-оферентом акцепта Клирингового центра.  
При отрицательном результате проверки, указанной в пункте 14.14 Правил клиринга, Клиринговый центр удаляет допустимые встречные Активные предложения.
- 14.16. Внебиржевые Договоры (внебиржевой Договор) заключаются (заключается) Центральным контрагентом при наличии двух допустимых встречных Активных предложений. Если допустимые встречные Активные предложения поданы Участниками клиринга, то Центральный контрагент заключает внебиржевой Договор с каждым из них. Если допустимые встречные Активные предложения поданы Участником клиринга и Центральным контрагентом, то Центральный контрагент в целях осуществления клиринга заключает внебиржевой Договор с данным Участником клиринга.
- 14.17. При заключении внебиржевого Договора Клиринговый центр присваивает ему идентификационный номер.
- 14.18. Заключенный Участником клиринга внебиржевой Договор учитывается Клиринговым центром на регистре учета позиций с кодом, указанным при подаче Предложения или Предложения «Стратегия», на основании которого заключен внебиржевой Договор.

## **Статья 15. Порядок взаимодействия с Биржей**

- 15.1. Взаимодействие Клирингового центра с Биржей осуществляется на основании договора о взаимодействии при проведении операций на рынке Стандартизированных ПФИ, неотъемлемой частью которого являются Правила клиринга, Правила торгов и Правила допуска.
- 15.2. В целях проведения Торгов в секторе Навигатор каждый Рабочий день по итогам клиринговой сессии Клиринговый центр передает Бирже посредством Системы торгов в секторе Навигатор следующую информацию в отношении Участников клиринга, являющихся Участниками торгов:
- список зарегистрированных Клиентов;
  - список кодов открытых регистров учета позиций;
  - список биржевых Договоров, учитываемых на каждом регистре учета позиций;
  - значения Требования к обеспечению по расчетному коду по всем биржевым Договорам, учитываемым на регистрах учета позиций, коды которых соответствуют данному расчетному коду, по всем расчетным кодам;

- значения Оценки средств обеспечения по расчетному коду по всем расчетным кодам;
- объем обязательств по биржевым Договорам, учитываемых на каждом регистре учета позиций;
- сумму денежных средств в российских рублях, учитываемых в качестве Средств обеспечения, на каждом денежном регистре обеспечения в российских рублях;
- сумму иностранной валюты, учитываемой в качестве Средств обеспечения, на каждом денежном регистре обеспечения в иностранной валюте.

В отношении Участников клиринга, не являющихся Участниками торгов, намеревающихся становиться стороной Договоров по поручению в секторе Навигатор, каждый Рабочий день по итогам клиринговой сессии Клиринговый центр передает Бирже посредством Системы торгов в секторе Навигатор информацию о регистрах учета позиций и о наименованиях/Идентификаторах уполномоченных Участников торгов, которые имеют право подавать Заявки с указанием этих регистров учета позиций от имени Участников клиринга.

- 15.3. В случае изменения значений Оценки средств обеспечения по расчетному коду и / или значений Требования к обеспечению по расчетному коду в ходе Торгов в секторе Навигатор Клиринговый центр незамедлительно передает Бирже указанные измененные значения.
- 15.4. В случае необходимости изменения в ходе Торгов в секторе Навигатор риск-параметров, используемых при расчете Требования к обеспечению по расчетному коду и/или Оценки средств обеспечения по расчетному коду, Клиринговый центр направляет Бирже уведомление о необходимости приостановления Торгов в секторе Навигатор и удаления всех Заявок, поданных в секторе Навигатор. При этом, Клиринговый центр удаляет все Предложения и Предложения «Стратегия» и отказывает в акцепте всех полученных оферт, предусмотренных Правилами клиринга, направленных на изменение или прекращение Договоров.
- 15.5. Клиринговый центр посредством Системы торгов в секторе Навигатор направляет Бирже уведомление о необходимости удаления Заявки (Заявок), в секторе Навигатор, в случаях, установленных Правилами клиринга.
- 15.6. Биржа посредством Системы торгов в секторе Навигатор незамедлительно сообщает Клиринговому центру об отзыве / удалении Заявки (Заявок), поданных в секторе Навигатор.
- 15.7. После регистрации Договора (Договоров) в Системе торгов в секторе Навигатор Биржа посредством Системы торгов в секторе Навигатор передает Клиринговому центру информацию о заключенном (заключенных) Договоре (Договорах).  
Указанная информация, содержит следующие сведения:
- код Договора;
  - условия Договора;
  - код регистра учета позиций, на котором должен учитываться Договор.
- 15.8. Договор, заключенный в Системе торгов в секторе Навигатор, учитывается на регистре учета позиций с кодом, указанным при подаче Заявки, на основании которой заключен Договор.
- 15.9. В целях исполнения Обязательств по Договорам Клиринговый центр вправе подавать в Систему торгов в секторе Навигатор и в Систему торгов в секторе

Спектра Заявки от своего имени и за свой счет и от имени Участника клиринга в отношении себя лично.

- 15.10. Возможность заключения Договоров в секторе Спектра устанавливается решением Биржи, в котором указывается:
- код Договора в соответствии со Спецификацией;
  - код Договора в Системе торгов сектора Спектра;
  - параметры Договора, устанавливаемые решением Биржи в соответствии со Спецификацией;
  - первый Торговый день, в который может быть заключен Договор в Системе торгов сектора Спектра.
- 15.11. В целях проведения Торгов в секторе Спектра Клиринговый центр передает на Биржу в сроки, установленные Правилами клиринга срочного рынка, следующую информацию:
- перечень разделов регистра учета позиций, с указанием которых допускается заключение Договоров в Системе торгов сектора Спектра. Указанный перечень включает разделы регистра учета позиций, определяемые в соответствии со статьей 21 Правил клиринга;
  - Лимит колебаний цен сделок для каждого Договора, который определяется в соответствии с Методикой;
  - Нижний и Верхний лимиты колебаний цен сделок для каждого Договора, которые определяются в соответствии с Методикой.
- 15.12. Взаимодействие Клирингового центра и Биржи в ходе проведения торгов в секторе Спектра регулируются Правилами клиринга срочного рынка и Правилами торгов.
- 15.13. По окончании основной торговой сессии в секторе Спектра Биржа передает в Клиринговый центр информацию о заключенных биржевых Договорах. Указанная информация, содержит следующие сведения:
- код Договора в Системе торгов сектора Спектра;
  - цена Договора;
  - код раздела регистра учета позиций, с указанием которого заключен Договор.
- 15.14. Клиринговый центр осуществляет учет биржевого Договора, информация о котором получена от Биржи по окончании основной торговой сессии в секторе Спектра, на регистре учета позиций с кодом, соответствующим коду раздела регистра учета позиций, указанному в информации передаваемой Биржей в соответствии с пунктом 15.13 Правил клиринга.
- 15.15. Для исполнения обязательств по Договорам, а также обеспечения исполнения обязательств по Договорам используются Средства обеспечения, а также Средства гарантийного обеспечения, являющиеся индивидуальным клиринговым обеспечением в соответствии с Правилами клиринга срочного рынка.

## **Статья 16. Порядок взаимодействия с Биржей при подаче и отзыве Заявок в секторе Навигатор**

- 16.1. При подаче Участником торгов Заявки в секторе Навигатор Биржа посредством Системы торгов в секторе Навигатор направляет Клиринговому центру информацию о поданной в секторе Навигатор Заявке, включая информацию о наличии встречной Заявки.

- 16.2. При получении информации о поданной Участником торгов в секторе Навигатор Заявке Клиринговый центр осуществляет проверки в два этапа.
- 16.2.1. При получении информации о поданной в секторе Навигатор Заявке Клиринговый центр осуществляет проверку на соответствие расчетной стоимости Договора, который может быть заключен на основании данной Заявки, лимиту колебаний стоимости Договора в соответствии с Методикой.
- 16.2.2. При получении информации о наличии в секторе Навигатор встречных Заявок, Клиринговый центр осуществляет следующие проверки каждой из встречных Заявок:
- при наличии у Участника клиринга Маржинального требования по расчетному коду, которому соответствует код регистра учета позиций, с указанием которого подана Заявка - проверку неуменьшения Уровня обеспеченности по данному расчетному коду с учетом поданной Заявки;
  - при отсутствии у Участника клиринга Маржинального требования по расчетному коду, которому соответствует код регистра учета позиций, с указанием которого подана Заявка - проверку того, что Уровень обеспеченности по данному расчетному коду не станет меньше нуля с учетом поданной Заявки;
  - при отсутствии у Участника клиринга Маржинального требования по расчетному коду, которому соответствует код регистра учета позиций, с указанием которого подана Заявка (если на момент подачи Заявки допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию приостановлен частично) - проверку того, что Уровень обеспеченности по данному расчетному коду с учетом поданной Заявки не станет меньше величины Уровня обеспеченности по данному расчетному коду, определенной при приостановлении допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию в соответствии с пунктом 11.4 Правил клиринга;
  - у Участника клиринга не приостановлен полностью допуск к клиринговому обслуживанию.

Клиринговый центр направляет Бирже уведомление о невозможности регистрации Заявки (Заявок) при отрицательном результате хотя бы одной проверки.

Клиринговый центр направляет Бирже информацию о возможности регистрации обеих встречных Заявок при положительном результате всех проверок для каждой из встречных Заявок.

## **Статья 17. Порядок изменения условий Договора**

- 17.1. Участник клиринга вправе изменить условия внебиржевого Договора и биржевого Договора, заключенного в секторе Навигатор, в порядке, установленном настоящей статьей Правил клиринга. Условия Договора, которые могут быть изменены, устанавливаются Спецификацией данного Договора.
- 17.2. В целях изменения условий Договора Участник клиринга направляет Клиринговому центру оферту на изменение условий Договора (Заявление об изменении условий Договора). Указанное заявление направляется в виде электронного документа.
- 17.3. Поданное Заявление об изменении условий Договора должно содержать:
- идентификационный номер Договора;
  - условия Договора, подлежащие изменению;
  - Идентификатор Участника клиринга, являющегося стороной Парного договора.

По письменному запросу Участника клиринга Клиринговый центр может предоставить информацию об Идентификаторе Участника клиринга - контрагента по Парному договору, заключенному Центральным контрагентом, при условии получения от контрагента письменного согласия на предоставление такой информации.

- 17.4. В ходе клиринговой сессии до выполнения действий, указанных в статьях 28, 29 Правил клиринга, при наличии двух встречных поданных Заявлений об изменении условий Договора Клиринговый центр осуществляет проверку каждого Заявления об изменении условий Договора аналогично проверкам Заявки, указанным в пункте 16.2 Правил клиринга. Встречными являются Заявления об изменении условий Договора, удовлетворяющие следующим требованиям:
- Заявления направлены на изменение Парных договоров;
  - условия Договоров, подлежащие изменению, указанные в таких заявлениях, являются идентичными;
  - для каждого заявления: Идентификатор лица, подавшего одно такое заявление, совпадает с Идентификатором лица, указанного в другом таком заявлении в качестве стороны Парного договора.
- При положительном результате указанных проверок Клиринговый центр осуществляет регистрацию Соглашения об изменении условий Договора. Исполнение обязательств по Соглашению об изменении условий Договора осуществляется в ходе текущей клиринговой сессии.
- 17.5. При наличии нескольких Договоров, по которым поданы встречные Заявления об изменении условий Договора, Клиринговый центр осуществляет проверки, указанные в пункте 17.4 Правил клиринга, в порядке времени подачи встречных Заявлений об изменении условий Договора, начиная с самого раннего. При этом временем подачи встречных Заявлений об изменении условий Договора является время подачи более позднего из двух встречных Заявлений об изменении условий Договора.
- 17.6. Участник клиринга вправе отозвать Заявление об изменении условий Договора, поданное им, путем направления в Клиринговый центр электронного документа до начала ближайшей клиринговой сессии.
- 17.7. Поданные Заявления об изменении условий Договора удаляются Клиринговым центром после окончания ближайшей клиринговой сессии.
- 17.8. При изменении условий биржевого Договора, предусматривающего изменение валюты уплаты вариационной маржи, у Участника клиринга и Клирингового центра возникают обязательства уплатить текущую расчетную стоимость Договора, определенную в последнюю клиринговую сессию, предшествующую дню изменения валюты уплаты вариационной маржи:
- если указанная расчетная стоимость Договора в валюте уплаты вариационной маржи до ее изменения является положительной для Клирингового центра, то:
    - Клиринговый центр должен уплатить Участнику клирингу указанную расчетную стоимость в валюте уплаты вариационной маржи до ее изменения;
    - Участник клиринга должен уплатить Клиринговому центру текущую расчетную стоимость Договора в измененной валюте уплаты вариационной маржи;

- если указанная расчетная стоимость Договора в валюте уплаты вариационной маржи до ее изменения является отрицательной для Клирингового центра, то:
  - Участник клиринга должен уплатить Клиринговому центру указанную расчетную стоимость в валюте уплаты вариационной маржи до ее изменения;
  - Клиринговый центр должен уплатить Участнику клиринга текущую расчетную стоимость Договора в измененной валюте уплаты вариационной маржи.

Указанные обязательства по уплате текущей расчетной стоимости Договора подлежат исполнению в ходе текущей клиринговой сессии.

Указанные обязательства по уплате текущей расчетной стоимости Договора учитываются на регистре учета позиций, на котором учитывается Договор.

17.9. При изменении условий внебиржевого Договора, предусматривающего изменение валюты уплаты депозитной маржи:

- срок исполнения обязательства по возврату накопленной депозитной маржи в валюте депозитной маржи до ее изменения считается наступившим;
- у стороны Договора, которой возвращается накопленная депозитная маржа, возникает обязательство по уплате другой стороне Договора депозитной маржи в валюте депозитной маржи после ее изменения. Сумма уплачиваемой депозитной маржи равна абсолютной величине расчетной стоимости Договора, определенной в последнюю клиринговую сессию, предшествующую дню изменения валюты уплаты депозитной маржи.

Указанные обязательства по возврату депозитной маржи и по уплате депозитной маржи подлежат исполнению в ходе текущей клиринговой сессии.

Указанное обязательство по уплате депозитной маржи учитывается на регистре учета позиций, на котором учитывается Договор.

## **Статья 18. Порядок досрочного прекращения Договора**

18.1. Участник клиринга вправе направить в Клиринговый центр оферту на досрочное прекращение внебиржевого Договора или биржевого Договора, заключенного в секторе Навигатор (Заявление о досрочном прекращении Договора), если с даты заключения указанного Договора прошло не менее трех Рабочих дней. Указанное заявление направляется в виде электронного документа.

18.2. Поданное Заявление о досрочном прекращении Договора должно содержать:

- идентификационный номер Договора;
- сумму компенсации, подлежащую уплате, учитывающую все издержки, связанные с досрочным прекращением Договора;
- Идентификатор Участника клиринга, являющегося стороной Парного договора.

По письменному запросу Участника клиринга Клиринговый центр может предоставить информацию об Идентификаторе Участника клиринга - контрагента по Парному договору, заключенному Центральным контрагентом, при условии получения от контрагента письменного согласия на предоставление такой информации.

18.3. Клиринговый центр осуществляет проверки поданного Заявления о досрочном прекращении Договора, аналогичные проверкам, установленным статьей 16 Правил клиринга для Заявок.

При положительном результате указанных проверок Клиринговый центр принимает Заявление о досрочном прекращении Договора.

18.4. В ходе клиринговой сессии до выполнения действий, указанных в статьях 28, 29 Правил клиринга, при наличии двух встречных принятых Заявлений о досрочном прекращении Договора Клиринговый центр осуществляет проверку каждого Заявления о досрочном прекращении Договора аналогично проверкам Заявки, указанным в пункте 16.2.2 Правил клиринга.

Встречными являются Заявления о досрочном прекращении Договора, удовлетворяющие следующим условиям:

- заявления направлены на прекращение Парных договоров;
- для каждого заявления: Идентификатор лица, подавшего одно такое заявление, совпадает с Идентификатором лица, указанного в другом таком заявлении в качестве стороны Парного договора.

При положительном результате указанных проверок Клиринговый центр осуществляет регистрацию Соглашения о досрочном прекращении Договора.

Исполнение обязательств по Соглашению о досрочном прекращении Договора осуществляется в ходе текущей клиринговой сессии.

18.5. При наличии нескольких Договоров, по которым поданы встречные Заявления о досрочном прекращении Договора, Клиринговый центр осуществляет проверки, указанные в пункте 17.4 Правил клиринга, в порядке времени подачи встречных Заявлений о досрочном прекращении Договора, начиная с самого раннего. При этом временем подачи встречных Заявлений о досрочном прекращении Договора является время подачи более позднего из двух встречных Заявлений о досрочном прекращении Договора.

18.6. Участник клиринга вправе отозвать Заявление о досрочном прекращении Договора, поданное им, путем направления в Клиринговый центр электронного документа до начала ближайшей клиринговой сессии.

18.7. Поданные Заявления о досрочном прекращении Договора удаляются Клиринговым центром после окончания ближайшей клиринговой сессии.

## **Статья 19. Порядок определения и учета обязательств**

19.1. Определение Обязательств по Договорам осуществляется Клиринговым центром в следующем порядке:

- в соответствии с порядком, изложенном в Спецификации Договора, - при наличии в такой Спецификации прямого указания на порядок определения обязательств;
- в соответствии с Правилами клиринга - при отсутствии в Спецификации Договора прямого указания на порядок определения обязательств или при наличии в такой Спецификации ссылки на порядок, изложенный в Правилах клиринга.

Определение обязательств по договорам, заключенным с Участником клиринга в соответствии со статьей 30 Правил клиринга, осуществляется Клиринговым центром в соответствии с Правилами клиринга и Методикой.

19.2. В случае заключения Соглашений об изменении условий Договора, Соглашений о досрочном прекращении Договора Обязательства по Договору определяются с учетом данных соглашений в соответствии со Спецификацией и Правилами клиринга.

В результате заключения Соглашения об изменении условий Договора Обязательства по Договору, допущенные к клирингу, определенные в



соответствии с условиями такого Договора до его изменения, прекращаются, и возникают и допускаются к клирингу обязательства по такому Договору в соответствии с измененными условиями.

В результате заключения Соглашения о досрочном прекращении Договора Обязательства по Договору, за исключением обязательств с наступившей датой исполнения, допущенные к клирингу, определенные в соответствии с условиями такого Договора до его прекращения, прекращаются и возникают и допускаются к клирингу обязательства по такому Договору, возникшие в связи с его досрочным прекращением.

19.3. Обязательства по Договорам, обязательства по договорам, заключенным с Участником клиринга в соответствии со статьей 30 Правил клиринга, иные обязательства, указанные в пункте 9.17 Правил клиринга, допускаются Клиринговым центром к клирингу с момента их возникновения.

19.4. Вариационная маржа по биржевому Договору рассчитывается в соответствии со Спецификацией для каждой стороны Договора. Если вариационная маржа по Договору, рассчитанная для Клирингового центра, является положительной, то Участник клиринга – другая сторона такого Договора должен уплатить Клиринговому центру вариационную маржу. Если вариационная маржа по Договору, рассчитанная для Клирингового центра, является отрицательной, то Клиринговый центр должен уплатить Участнику клиринга – другой стороне такого Договора абсолютное значение данной вариационной маржи. Обязательства по уплате вариационной маржи носят безвозвратный характер.

19.5. Депозитная маржа по внебиржевому Договору, рассчитанная в соответствии со Спецификацией внебиржевого Договора для каждой стороны такого Договора, подлежит уплате в следующем порядке:

- если депозитная маржа по внебиржевому Договору, рассчитанная для Клирингового центра, является положительной, то Участник клиринга – другая сторона такого Договора должен уплатить Клиринговому центру данную депозитную маржу;
- если депозитная маржа по внебиржевому Договору, рассчитанная для Клирингового центра, является отрицательной, то Клиринговый центр должен уплатить Участнику клиринга – другой стороне такого Договора абсолютное значение данной депозитной маржи.

Депозитная маржа по внебиржевому Договору, рассчитанная в соответствии с Правилами клиринга, подлежит уплате в соответствии с Правилами клиринга.

19.6. Накопленная депозитная маржа по внебиржевому Договору, рассчитанная в соответствии со Спецификацией внебиржевого Договора для каждой стороны такого Договора, подлежит возврату в следующем порядке:

- если накопленная депозитная маржа по внебиржевому Договору, рассчитанная для Клирингового центра, является положительной, то Клиринговый центр должен уплатить Участнику клиринга – другой стороне такого Договора данную накопленную депозитную маржу;
- если накопленная депозитная маржа по внебиржевому Договору, рассчитанная для Клирингового центра, является отрицательной, то Участник клиринга – другая сторона такого Договора должен уплатить Клиринговому центру абсолютное значение данной депозитной маржи.

Накопленная депозитная маржа по внебиржевому Договору, рассчитанная в соответствии с Правилами клиринга, подлежит уплате в соответствии с Правилами клиринга.

19.7. Проценты на накопленную депозитную маржу по внебиржевому Договору рассчитываются в соответствии со Спецификацией внебиржевого Договора для каждой стороны такого Договора. Если проценты на накопленную депозитную маржу по внебиржевому Договору, рассчитанные для Клирингового центра, являются положительной величиной, то Участник клиринга – другая сторона такого Договора должен уплатить Клиринговому центру проценты на накопленную депозитную маржу. Если проценты на накопленную депозитную маржу по внебиржевому Договору, рассчитанные для Клирингового центра являются отрицательной величиной, то Клиринговый центр должен уплатить Участнику клиринга - другой стороне такого Договора проценты на накопленную депозитную маржу.

## **Статья 20. Порядок изменения учета обязательств по Договорам**

- 20.1. Участник клиринга имеет право потребовать от Клирингового центра изменить учет Договоров на регистрах учета позиций при условии, что оба регистра учета позиций открыты для одного лица, т.е. либо оба регистра являются собственными, либо оба регистра являются клиентскими, открытыми для одного и того же Клиента.
- 20.2. Изменение учета Договоров осуществляется Клиринговым центром на основании заявления, подаваемого Участником клиринга в Клиринговый центр.
- 20.3. При изменении учета Договоры перестают учитываться Клиринговым центром на регистре учета позиций с одним кодом и начинают учитываться на регистре учета позиций с другим кодом.  
При этом непрекращенные Обязательства по Договорам, возникшие до момента получения Клиринговым центром заявления, указанного в пункте 20.2 Правил клиринга, продолжают учитываться Клиринговым центром на регистре учета позиций, на котором Клиринговый центр осуществлял их учет до получения заявления от Участника клиринга.
- 20.4. Изменение учета Договора на регистрах учета позиций, коды которых соответствуют разным расчетным кодам, осуществляется Клиринговым центром при положительном результате следующих проверок:
- выполняются проверки, указанные в пункте 16.2 Правил клиринга, в предположении, что подана Заявка на заключение данного Договора с указанием регистра учета позиций, на котором должен учитываться Договор;
  - выполняется проверки, указанные в пункте 18.3 Правил клиринга, в предположении, что подано Заявление о досрочном прекращении данного Договора.
- 20.5. Изменение учета Договоров осуществляется Клиринговым центром в ходе ближайшей клиринговой сессии после получения Клиринговым центром заявления, указанного в пункте 20.2 Правил клиринга.

## **Статья 21. Предоставление возможности Участнику клиринга заключения биржевых Договоров в секторе Спектра**

- 21.1. Для возможности заключения биржевых Договоров в секторе Спектра Участник клиринга должен подать заявление в Клиринговый центр, в котором указать раздел регистра учета позиций, с указанием которого допускается заключение Договоров в Системе торгов сектора Спектра, и соответствующий ему регистр учета позиций, на котором будут учитываться заключенные Договоры.

- Указанные раздел регистра учета позиций, с указанием которых допускается заключение Договоров в Системе торгов сектора Спектра, и регистр учета позиций являются соответствующими, а также соответствующими являются код раздела регистра учета позиций, с указанием которых допускается заключение Договоров в Системе торгов сектора Спектра, и код регистра учета позиций.
- 21.2. Соответствующие раздел регистра учета позиций, с указанием которых допускается заключение Договоров в Системе торгов сектора Спектра, и регистр учета позиций должны удовлетворять следующим требованиям:
- раздел регистра учета позиций и регистр учета позиций должны быть открыты для одного и того же лица;
  - одному разделу регистра учета позиций может соответствовать только один регистр учета позиций.
- 21.3. Клиринговый центр устанавливает соответствие между разделом регистра учета позиций, с указанием которых допускается заключение Договоров в Системе торгов сектора Спектра, и регистром учета позиций при выполнении требований пункта 21.2 Правил клиринга не позднее Рабочего дня, следующего за днем получения соответствующего заявления от Участника клиринга. Заключение Договоров в Системе торгов сектора Спектра допускается только с указанием разделов регистра учета позиций, для которых Клиринговым центром установлено указанное соответствие.
- 21.4. Участник клиринга вправе аннулировать установленное соответствие между разделом регистра учета позиций, с указанием которых допускается заключение Договоров в Системе торгов сектора Спектра, и регистром учета позиций, подав заявление в Клиринговый центр.
- 21.5. Клиринговый центр аннулирует установленное соответствие между разделом регистра учета позиций, с указанием которых допускается заключение Договоров в Системе торгов сектора Спектра, и регистром учета позиций при закрытии раздела регистра учета позиций, с указанием которых допускается заключение Договоров в Системе торгов сектора Спектра, или при закрытии регистра учета позиций.

## **РАЗДЕЛ V ПОРЯДОК ПРОВЕДЕНИЯ КЛИРИНГА**

### **ПОДРАЗДЕЛ V-1 ПОРЯДОК ВНЕСЕНИЯ И ВОЗВРАТА СРЕДСТВ ОБЕСПЕЧЕНИЯ И ВЗНОСА В ГАРАНТИЙНЫЙ ФОНД**

#### **Статья 22. Порядок внесения Средств обеспечения**

- 22.1. Денежные средства в соответствующей валюте, предоставляемые в качестве Средств обеспечения, перечисляются на клиринговый счет Средств обеспечения по реквизитам, размещенным на Сайте Клирингового центра.  
В назначении платежа должен быть указан расчетный код денежного регистра обеспечения, на котором должны учитываться данные денежные средства. Правила указания назначения платежа в платежных документах при перечислении денежных Средств обеспечения в российских рублях и иностранной валюте на клиринговые счета Средств обеспечения раскрываются на Сайте Клирингового центра.
- 22.2. В случае неверного указания назначения платежа, правильное назначение платежа может быть доведено до Клирингового центра двумя способами:
- путем подачи плательщиком в банк плательщика надлежащим образом оформленного письма с указанием правильного назначения платежа;
  - путем подачи надлежащим образом оформленного письма непосредственно в Клиринговый центр.
- 22.2.1. В случае подачи письма непосредственно в Клиринговый центр плательщики должны оформить письмо на фирменном бланке организации, заверив его подписями руководителя и главного бухгалтера организации и печатью организации. Если при этом плательщик не является Участником клиринга, то он обязан приложить к письму нотариально заверенную копию карточки с образцами подписей и оттиском печати организации (по форме 0401026 ОКУД).
- 22.2.2. Если в течение 5 (пяти) Рабочих дней с даты, следующей за датой зачисления денежных средств на клиринговый счет Клирингового центра, плательщик не предоставит правильное назначение платежа, Клиринговый центр возвращает указанные денежные средства по реквизитам плательщика.
- 22.2.3. Клиринговый центр учитывает поступившие денежные средства только после получения надлежащим образом оформленного документа, содержащего правильное назначение платежа.
- 22.3. Информация о поступлении денежных средств на клиринговый счет Средств обеспечения передается Расчетной организацией в Клиринговый центр в соответствии с условиями договора между ними. Клиринговый центр осуществляет обработку указанной информации и осуществляет учет денежных средств, поступивших на клиринговый счет Средств обеспечения, в течение не более чем 15 (пятнадцати) минут с момента получения указанной информации при условии правильного указания назначения платежа.
- 22.4. Клиринговый центр учитывает поступившие на клиринговый счет Средств обеспечения денежные средства на денежном регистре обеспечения с расчетным кодом, указанным в назначении платежа, увеличивая значение данного регистра. Участник клиринга вправе изменить учет денежных Средств обеспечения в соответствии со статьей 24 Правил клиринга.

#### **Статья 23. Порядок возврата Средств обеспечения**

- 23.1. Клиринговый центр обязан по требованию Участника клиринга перечислить денежные Средства обеспечения, в соответствии с условиями, указанными в настоящей статье Правил клиринга.
- 23.2. Возврат денежных Средств обеспечения, учитываемых на денежном регистре обеспечения, может быть осуществлен при условии регистрации Клиринговым центром банковского счета, на который перечисляются указанные денежные Средства обеспечения (далее – Счет для возврата денежных средств). Регистрация Счетов для возврата денежных средств осуществляется Клиринговым центром в соответствии со следующими условиями.
- 23.2.1. Счет для возврата денежных средств регистрируется Клиринговым центром на основании заявления на регистрацию Счета для возврата денежных средств, подаваемого Участником клиринга.
- 23.2.2. Для каждого расчетного кода и для каждой из валют допускается регистрация только одного Счета для возврата денежных средств. Регистрация Счета для возврата денежных средств аннулирует регистрацию Счета для возврата денежных средств в той же валюте, осуществленную ранее.
- 23.2.3. Владельцем Счета для возврата денежных средств должен являться Участник клиринга, подавший заявление на его регистрацию.
- 23.3. Аннулирование регистрации Счета для возврата денежных средств осуществляется Клиринговым центром на основании заявления Участника клиринга, за исключением случая, предусмотренного подпунктом 23.2.2 Правил клиринга.
- 23.4. Для возврата денежных Средств обеспечения Участник клиринга подает в Клиринговый центр сообщение по системе SWIFT (далее в настоящей статье - Заявление на возврат).
- 23.4.1. В Заявлении на возврат должен быть указан расчетный код денежного регистра обеспечения, на котором учитываются денежные средства, подлежащие возврату. Правила заполнения полей в Заявлении на возврат раскрываются на Сайте Клирингового центра.
- 23.4.2. Клиринговый центр осуществляет прием Заявлений на возврат и осуществляет обработку полученных Заявлений на возврат с текущей датой валютирования со времени начала основной торговой сессии текущего дня в секторе Навигатор до времени начала клиринговой сессии текущего дня, уменьшенного на 60 (шестьдесят) минут.
- 23.4.3. В случае невозможности подачи Участником клиринга сообщения по системе SWIFT, Клиринговый центр вправе принять от Участника клиринга заявление на возврат денежных Средств обеспечения в виде электронного документа, переданного посредством Подсистемы ЭДО НКЦ.
- 23.5. Возврат Средств обеспечения, указанных в Заявлении на возврат, осуществляется при одновременном выполнении следующих условий:
- соблюдены правила заполнения полей Заявления на возврат, указанные на Сайте Клирингового центра;
  - у Участника клиринга отсутствуют Маржинальное требование и Задолженность по расчетному коду, указанному в Заявлении на возврат;
  - сумма Средств обеспечения, указанная в Заявлении на возврат, не превышает сумму Средств обеспечения, обязательство по возврату которых

- учитывается Клиринговым центром на денежном регистре обеспечения, с расчетным кодом, указанным в Заявлении на возврат;
- в результате уменьшения Средств обеспечения на сумму, указанную в Заявлении на возврат, Уровень обеспеченности по расчетному коду, указанному в Заявлении на возврат, не станет отрицательным;
  - в результате уменьшения Средств обеспечения на сумму, указанную в Заявлении на возврат, Уровень обеспеченности по расчетному коду, указанному в Заявлении на возврат, не станет меньше величины Уровня обеспеченности по расчетному коду, указанному в Заявлении на возврат, определенной при приостановлении допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию в соответствии с пунктом 11.4 Правил клиринга (если на момент получения Клиринговым центром Заявления на возврат допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию был приостановлен частично).
- 23.6. Возврат Средств обеспечения осуществляется путем направления Клиринговым центром в Расчетную организацию платежного документа на перечисление суммы денежных средств, указанных в Заявлении на возврат, на соответствующий Счет для возврата денежных средств. Указанный платежный документ подлежит отправке Клиринговым центром в Расчетную организацию не позднее 30 (тридцати) минут с момента получения Клиринговым центром Заявления на возврат.  
Обязательство Клирингового центра по возврату денежных средств Участнику клиринга считается исполненным с момента списания Расчетной организацией денежных средств с клирингового счета Средств обеспечения в сумме, равной минимальной из (а) суммы, указанной в соответствующем Заявлении на возврат, и (б) максимально возможной суммы, которая может быть возвращена Участнику клиринга с соблюдением условий пункта 23.5 Правил клиринга, определяемой каждый Рабочий день в 12.00 и в 19.00 по московскому времени.
- 23.7. При возврате Участнику клиринга денежных средств в соответствующей валюте размер Средств обеспечения Участника клиринга в этой валюте, учитываемых на соответствующем денежном регистре обеспечения, уменьшается на сумму возвращаемых денежных средств.
- 23.8. Клиринговый центр вправе осуществить в любое время зачет денежных требований Участника клиринга по возврату ему денежных средств с денежными требованиями Клирингового центра к этому Участнику клиринга.
- 23.9. Клиринговый центр осуществляет ежегодную сверку остатков Средств обеспечения Участника клиринга в российских рублях и иностранной валюте путем направления соответствующего уведомления Участнику клиринга не позднее десятого рабочего дня года, следующего за отчетным годом.  
Если в течение десяти рабочих дней после направления Участнику клиринга указанного уведомления, Участник клиринга не уведомит Клиринговый центр о наличии расхождений, остатки Средств обеспечения Участника клиринга в российских рублях и/или иностранной валюте считаются подтвержденными.
- 23.10. В случае если Клиринговый центр не исполнил в соответствии с пунктом 23.6 Правил клиринга обязательство по возврату денежных средств Участнику клиринга, подавшему Заявление на возврат, Участник клиринга вправе подать в Клиринговый центр уведомление о прекращении всех обязательств по Договорам, стороной по которым является данный Участник клиринга (далее – Уведомление о дефолте). Уведомление о дефолте направляется в виде электронного документа.

В целях настоящей статьи Правил клиринга под Договорами понимаются договоры, являющиеся производными финансовыми инструментами, а также сделки типа своп, заключенные в соответствии с Правилами клиринга.

Если в течение 30 дней с даты подачи Уведомления о дефолте (далее – Срок для возврата) и до исполнения Клиринговым центром обязательства по возврату денежных средств Участнику клиринга у Участника клиринга возникает Задолженность и/или Маржинальное требование по какому-либо расчетному коду, обязательство Клирингового центра по возврату денежных средств Участнику клиринга уменьшается на сумму указанной Задолженности и/или Маржинального требования Участника клиринга. В случае если размер указанной Задолженности и/или Маржинального требования Участника клиринга превышает размер обязательства Клирингового центра по возврату денежных средств Участнику клиринга, указанное обязательство Клирингового центра считается исполненным, а Уведомление о дефолте – аннулированным.

23.11. Если в течение Срока для возврата Клиринговый центр не исполнит обязательство по возврату денежных средств Участнику клиринга в соответствии с поданным Заявлением на возврат (дефолт Клирингового центра в отношении Участника клиринга), все обязательства по Договорам, стороной по которым является данный Участник клиринга, полностью прекращаются возникновением обязательства / требования Участника клиринга в отношении Клирингового центра, рассчитываемого в следующем порядке на дату окончания Срока для возврата (дефолт Клирингового центра в отношении Участника клиринга). Участник клиринга рассчитывает величину, равную сумме с учетом знака рассчитанных в соответствующих валютах:

- сумм неисполненных обязательств Клирингового центра по Договорам с наступившим сроком исполнения, рассчитанных на конец последнего дня Срока возврата (учитываются со знаком «плюс»);
- расчетной стоимости каждого Договора, учитываемого на регистре учета позиций Участника клиринга, рассчитанной на конец последнего дня Срока возврата. При определении расчетной стоимости Договора Участник клиринга может принимать во внимание, действуя разумно и добросовестно, стоимость привлечения заемных средств и расходы или доходы, связанные с прекращением или исполнением хеджирующих или связанных договоров или заключением замещающих договоров с третьими лицами (в случае, если расчетная стоимость Договора подлежала бы выплате Клиринговым центром Участнику клиринга, такая стоимость учитывается для целей расчета обязательства / требования в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга со знаком плюс, а если расчетная стоимость Договора подлежала бы выплате Участником клиринга Клиринговому центру - со знаком минус).

При этом значения в иностранной валюте, рассчитанные в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга, пересчитываются в российские рубли по курсу, установленному Банком России на Рабочий день, следующий за последним днем Срока для возврата.

Если величина, рассчитанная в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга, положительная это означает наличие требования Участника клиринга по отношению к Клиринговому центру, если отрицательная – обязательство Участника клиринга по отношению к Клиринговому центру.

Указанное требование / обязательство учитывается на основном собственном денежном регистре обеспечения в российских рублях и подлежит исполнению в ходе ближайшей клиринговой сессии.

Участник клиринга вправе представить величину, рассчитанную в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга, в виде нескольких сумм, указав для каждой из них денежный регистр обеспечения. В этом случае Клиринговый центр осуществляет учет обязательств / требований в размере указанных сумм на указанных денежных регистрах обеспечения.

- 23.12. Обязательство Клирингового центра по возврату Средств обеспечения в сумме, равной минимальной из (а) суммы, указанной в соответствующем Заявлении на возврат, и (б) максимально возможной суммы, которая может быть возвращена Участнику клиринга с соблюдением условий пункта 23.5 Правил клиринга, подлежит исполнению в течение 3 (трех) Рабочих дней со дня истечения Срока возврата.

В случае отзыва лицензии на осуществление банковских операций у Клирингового центра определение обязательств и возврат денежных средств осуществляются с учетом положений статьи 41 Правил клиринга и действующего законодательства РФ.

- 23.13. В целях создания условий для исполнения Обязательств по Договорам Клиринговый центр выполняет действия, аналогичные действиям, указанным в пунктах 32.10 - 32.11 Правил клиринга.

#### **Статья 24. Порядок изменения учета Средств обеспечения**

- 24.1. Участник клиринга имеет право потребовать от Клирингового центра изменить учет Средств обеспечения на денежных регистрах обеспечения при условии, что оба денежных регистра обеспечения открыты для учета Средств обеспечения в одной валюте.

- 24.2. Изменение учета денежных Средств обеспечения осуществляется Клиринговым центром на основании заявления, подаваемого Участником клиринга (далее – Заявление на перевод).

- 24.3. Клиринговый центр изменяет учет денежных Средств обеспечения путем уменьшения суммы денежных Средств обеспечения, учитываемых на денежном регистре обеспечения с одним расчетным кодом, и соответствующего увеличения суммы денежных Средств обеспечения, учитываемых на денежном регистре обеспечения с другим расчетным кодом. При этом общая сумма денежных Средств обеспечения Участника клиринга, учитываемая на всех денежных регистрах обеспечения, не изменяется.

- 24.4. Изменение учета денежных Средств обеспечения осуществляется Клиринговым центром при одновременном выполнении следующих условий:

- у Участника клиринга отсутствует Маржинальное требование по расчетному коду, который имеет денежный регистр обеспечения, по которому осуществляется уменьшение денежных средств;
- сумма Средств обеспечения, указанная в Заявлении на перевод, не превосходит сумму Средств обеспечения, обязательство по возврату которых учитывается Клиринговым центром на денежном регистре обеспечения, по которому осуществляется уменьшение денежных средств;
- в результате уменьшения Средств обеспечения на сумму, указанную в Заявлении на перевод, Уровень обеспеченности по расчетному коду, который имеет денежный регистр обеспечения, по которому осуществляется уменьшение денежных средств, не станет меньше нуля;
- в результате уменьшения Средств обеспечения на сумму, указанную в Заявлении на перевод, Уровень обеспеченности по расчетному коду,



который имеет денежный регистр обеспечения, по которому осуществляется уменьшение денежных средств, не станет меньше величины Уровня обеспеченности по расчетному коду, определенной при приостановлении допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию в соответствии с пунктом 11.4 Правил клиринга (если на момент получения Клиринговым центром Заявления на перевод допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию был приостановлен частично).

- 24.5. Изменение учета денежных Средств обеспечения осуществляется Клиринговым центром в ходе ближайшей клиринговой сессии после получения Клиринговым центром Заявления на перевод.

## **Статья 25. Порядок внесения и возврата взноса в Гарантийный фонд**

- 25.1. Все Участники клиринга, для допуска к клиринговому обслуживанию на рынке Стандартизированных ПФИ, обязаны внести взнос в Гарантийный фонд в размере, установленном Клиринговым центром в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга.
- 25.2. Денежные средства в соответствующей валюте, предоставляемые Участником клиринга в качестве взноса в Гарантийный фонд, перечисляются на клиринговый счет Гарантийного фонда по реквизитам, размещенным на Сайте Клирингового центра.
- 25.3. Правила указания назначения платежа в платежных документах при перечислении взноса в Гарантийный фонд на клиринговый банковский счет Клирингового центра раскрываются на Сайте Клирингового центра.
- 25.4. В случае отсутствия указания в назначении платежа необходимой информации, дальнейшие действия осуществляются в порядке, указанном в пункте 22.2 Правил клиринга.
- 25.5. Информация о поступлении денежных средств на клиринговый счет Гарантийного фонда передается Расчетной организацией в Клиринговый центр в соответствии с условиями договора между ними.
- 25.6. Клиринговый центр учитывает поступившие на клиринговый счет Гарантийного фонда в соответствующей валюте денежные средства на регистре учета средств Гарантийного фонда Участника клиринга в соответствующей валюте, увеличивая значение данного регистра.
- 25.7. В случае внесения в Гарантийный фонд денежных средств в сумме, превышающей установленный Клиринговым центром размер взноса в Гарантийный фонд, в качестве взноса в Гарантийный фонд данного Участника клиринга учитываются денежные средства в сумме, равной установленному Клиринговым центром размеру взноса в Гарантийный фонд. Денежные средства Участника клиринга, перечисленные на клиринговый счет Гарантийного фонда в сумме, превышающей установленный Клиринговым центром размер взноса в Гарантийный фонд, учитываются в качестве кредиторской задолженности Участника клиринга и возвращаются Клиринговым центром Участнику клиринга по письменному требованию Участника клиринга.
- 25.8. Клиринговый центр учитывает на регистре учета средств Гарантийного фонда Участника клиринга в соответствующей валюте обязательство по возврату Участнику клиринга денежных средств в размере взноса Участника клиринга в Гарантийный фонд в соответствующей валюте.

- 25.9. Возврат взноса в Гарантийный фонд при отсутствии непрекращенных Договоров и непрекращенных обязательств, учитываемых Клиринговым центром на регистрах учета позиций Участника клиринга, осуществляется Клиринговым центром на основании поданного Участником клиринга заявления о возврате взноса в Гарантийный фонд. Указанное заявление подается Участником клиринга в Клиринговый центр в виде сообщения по системе SWIFT. В случае невозможности подачи Участником клиринга сообщения по системе SWIFT, Клиринговый центр вправе принять от Участника клиринга указанное заявление в виде электронного документа, переданного посредством Подсистемы ЭДО НКЦ.
- 25.10. Возврат взноса в Гарантийный фонд в соответствующей валюте осуществляется на Счет для возврата денежных средств для основного собственного денежного регистра обеспечения, зарегистрированный Участником клиринга в соответствии с пунктом 23.2 Правил клиринга в течение 1 (одного) рабочего дня с момента получения указанного заявления. При возврате Участнику клиринга взноса в Гарантийный фонд в соответствующей валюте значение регистра учета средств Гарантийного фонда уменьшается на сумму возвращаемых денежных средств.
- 25.11. Клиринговый центр вправе осуществить в любое время зачет денежных требований Участника клиринга по возврату ему денежных средств, учитываемых в качестве взноса в Гарантийный фонд, с денежными требованиями Клирингового центра к этому Участнику клиринга.
- 25.12. Размер требуемого взноса Участника клиринга в Гарантийный фонд рассчитывается Клиринговым центром не реже чем 1 (один) раз в квартал в порядке, установленном настоящей статьёй Правил клиринга и приложением № 6 к Правилам клиринга.  
По итогам указанного расчета Клиринговый центр уведомляет об этом Участников клиринга в день проведения указанных расчетов в Отчете о взносе в Гарантийный фонд.  
Рассчитанный размер требуемого взноса Участника клиринга в Гарантийный фонд начинает действовать через 5 (пять) Рабочих дней после проведения указанных расчетов.
- 25.13. В качестве взноса в Гарантийный фонд могут быть предоставлены денежные средства в российских рублях и иностранной валюте.  
Список иностранных валют, принимаемых в качестве взноса в Гарантийный фонд устанавливается Методикой.
- 25.14. Клиринговый центр осуществляет ежедневную оценку имущества, внесенного Участником клиринга в качестве взноса в Гарантийный фонд, в соответствии с Методикой.  
Оценочная стоимость имущества, внесенного в качестве взноса в Гарантийный фонд, и требуемый размер взноса в Гарантийный фонд указываются в Отчете о взносе в Гарантийный фонд, формируемом в соответствии с пунктом 38.3 Правил клиринга.
- 25.15. Если по результатам ежедневной оценки имущества, внесенного Участником клиринга в качестве взноса в Гарантийный фонд, в соответствии с пунктом 25.14 Правил клиринга и/или в случае изменения требуемого размера взноса в Гарантийный фонд Участника клиринга в соответствии с пунктом 25.12 Правил клиринга его оценочная стоимость становится меньше требуемого размера взноса в Гарантийный фонд Участника клиринга, установленного согласно

Правилам клиринга, такой Участник клиринга должен довести имущество в качестве взноса в Гарантийный фонд.

Указанное требование о доведении имущества в качестве взноса в Гарантийный фонд считается исполненным в момент, когда оценочная стоимость имущества, внесенного в качестве взноса в Гарантийный фонд, становится эквивалентной или превышает установленный в соответствии с Правилами клиринга требуемый размер взноса в Гарантийный фонд.

- 25.16. Участник клиринга обязан исполнить требование о доведении имущества в качестве взноса в Гарантийный фонд, указанное в пункте 25.15 Правил клиринга, в течение 1 (одного) Рабочего дня с момента получения от Клирингового центра Отчета о взносе в Гарантийный фонд, в котором зафиксировано условие, указанное в пункте 25.15 Правил клиринга.
- 25.17. В случае невыполнения Участником клиринга требования, установленного пунктом 25.15 или пунктом 33.15 Правил клиринга, Клиринговый центр вправе:
- перевести во взнос в Гарантийный фонд денежные средства, составляющие Средства обеспечения Участника клиринга, путем уменьшения значения собственных денежных регистров обеспечения и соответствующего увеличения значения регистра учета средств Гарантийного фонда;
  - принять решение о приостановлении допуска к клиринговому обслуживанию Участника клиринга в порядке, установленном статьей 11 Правил клиринга.
- 25.18. Клиринговый центр осуществляет ежегодную сверку остатков взноса в Гарантийный фонд Участника клиринга в российских рублях и иностранной валюте путем направления соответствующего уведомления Участнику клиринга не позднее десятого Рабочего дня года, следующего за отчетным годом.
- 25.19. Если в течение десяти рабочих дней после направления Участнику клиринга указанного уведомления, Участник клиринга не уведомит Клиринговый центр о наличии расхождений, остатки взноса в Гарантийный фонд Участника клиринга в российских рублях и/или иностранной валюте считаются подтвержденными.

## ПОДРАЗДЕЛ V-II КЛИРИНГОВЫЕ СЕССИИ

### Статья 26. Порядок проведения клиринговых сессий

- 26.1. Клиринговые сессии проводятся Клиринговым центром в дни, в которые проводится основная торговая сессия в секторе Навигатор или основная торговая сессия в секторе Спектра. Клиринговая сессия проводится с момента окончания основной торговой сессии в секторе Навигатор до момента начала дополнительной торговой сессии в секторе Навигатор. В случае если в текущий Рабочий день какая-либо торговая сессия не проводится, время проведения клиринговой сессии устанавливается решением Клирингового центра.
- 26.2. В ходе клиринговой сессии Клиринговый центр осуществляет, в частности, следующие действия:
- определяет объем обязательств, учитываемых на каждом регистре учета позиций и денежном регистре обеспечения Участника клиринга;
  - проводит исполнение обязательств, включенных в клиринговый пул текущей клиринговой сессии;
  - учитывает прекращение Обязательств по Договорам на регистрах учета позиций Участников клиринга;
  - проводит исполнение обязательств Участников клиринга по уплате комиссионных вознаграждений Клирингового центра, Биржи;
  - изменяет учет Договоров на регистрах учета позиций на основании заявления Участника клиринга;
  - изменяет учет Средств обеспечения на денежных регистрах обеспечения на основании заявления Участника клиринга;
  - для каждого расчетного кода рассчитывает Требование к обеспечению по расчетному коду по Договорам, учитываемым на всех регистрах учета позиций, коды которых соответствуют данному расчетному коду;
  - для каждого расчетного кода рассчитывает Оценку средств обеспечения по расчетному коду на основании Средств обеспечения, учитываемых на всех денежных регистрах обеспечения с данным расчетным кодом;
  - рассчитывает Маржинальное требование по расчетному коду в соответствии со статьей 31 Правил клиринга и определяет наличие Задолженности по расчетному коду в соответствии со статьей 29 Правил клиринга;
  - осуществляет ежедневную оценку имущества, внесенного Участником клиринга в качестве взноса в Гарантийный фонд и проверку на соответствие фактически внесенного Участником клиринга взноса в Гарантийный фонд (его оценочной стоимости) требуемому размеру взноса в Гарантийный фонд, установленному согласно Правилам клиринга;
  - осуществляет перевод денежных средств, составляющих Средства обеспечения, в Гарантийный фонд в соответствии со статьей 25 Правил клиринга.

## **ПОДРАЗДЕЛ V-III ПОРЯДОК ОПРЕДЕЛЕНИЯ И ИСПОЛНЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ, ВКЛЮЧЕННЫХ В КЛИРИНГОВЫЙ ПУЛ КЛИРИНГОВОЙ СЕССИИ**

### **Статья 27. Определение и учет обязательств вне клиринговой сессии**

27.1. Вне рамок клиринговой сессии Клиринговый центр осуществляет определение и учет:

- заключенных вне клиринговой сессии Договоров и Соглашений;
- поступивших и возвращенных Средств обеспечения и средств Гарантийного фонда, а также обязательств по их возврату.

### **Статья 28. Порядок определения и учета обязательств в ходе клиринговой сессии**

28.1. Клиринговый центр определяет и осуществляет учет:

- прекращения Договоров на основании Соглашений о досрочном прекращении Договора;
- прекращения в одностороннем порядке Договоров при применении к Участнику клиринга процедуры урегулирования неисполнения обязательств (дефолте);
- изменения условий Договоров на основании Соглашений об изменении условий Договора.

При прекращении Договора неисполненные обязательства по такому Договору, срок исполнения которых наступил до прекращения Договора, не прекращаются.

### **Статья 29. Порядок исполнения обязательств допущенных к клирингу**

29.1. Обязательства, указанные в пункте 19.3 Правил клиринга, с наступившей датой исполнения (далее – обязательства, подлежащие исполнению), включаются в клиринговый пул и прекращаются зачетом или надлежащим исполнением в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга. Для текущей клиринговой сессии формируется один клиринговый пул.

29.2. Обязательства, подлежащие исполнению, по которым Участник клиринга имеет обязанность по уплате, включаются в клиринговый пул в следующей последовательности:

- неисполненные Обязательства по Договорам, обязательства по договорам, заключенным в соответствии с пунктом 29.10 Правил клиринга, и иные обязательства, предусмотренные Правилами клиринга, за исключением обязательств по уплате вариационной маржи, по уплате депозитной маржи, по возврату накопленной депозитной маржи, по уплате процентов на накопленную депозитную маржу, по уплате комиссионного вознаграждения, неустоек (штрафов, пени);
- неисполненные обязательства по уплате вариационной маржи;
- неисполненные обязательства по уплате депозитной маржи;
- неисполненные обязательства по возврату накопленной депозитной маржи;
- неисполненные обязательства по уплате процентов на накопленную депозитную маржу;
- неисполненные обязательства по уплате комиссионного вознаграждения Клирингового центра и Биржи;
- Обязательства по Договорам, обязательства по договорам, заключенным в соответствии с пунктом 29.10 Правил клиринга, и иные обязательства, предусмотренные Правилами клиринга, за исключением обязательств по

- уплате вариационной маржи, по уплате депозитной маржи, по возврату накопленной депозитной маржи, по уплате процентов на накопленную депозитную маржу, по уплате комиссионного вознаграждения, неустоек (штрафов, пени);
- обязательства по уплате вариационной маржи;
  - обязательство по уплате депозитной маржи;
  - обязательства по возврату накопленной депозитной маржи;
  - обязательство по уплате процентов на накопленную депозитную маржу;
  - обязательства по уплате комиссионного вознаграждения Клирингового центра и Биржи;
  - неисполненные обязательства по уплате неустоек (штрафов, пени) Клиринговому центру;
  - обязательства по уплате неустоек (штрафов, пени) Клиринговому центру.
- 29.3. Обязательства, подлежащие исполнению, включаются в клиринговый пул в соответствии со следующими условиями:
- 29.3.1. для каждой валюты обязательств и для каждого расчетного кода разность между суммой всех обязательств в данной валюте, учитываемых на регистрах учета позиций с кодами, соответствующими данному расчетному коду, и на денежном регистре обеспечения в данной валюте с данным расчетным кодом (далее – обязательства по расчетному коду), в которых Участник клиринга имеет обязанность по уплате, и суммой всех обязательств по расчетному коду в данной валюте, в которых Участник клиринга имеет право требования по уплате, не превосходит сумму денежных Средств обеспечения в данной валюте, учитываемую на денежном регистре обеспечения в данной валюте с данным расчетным кодом;
- 29.3.2. разность между суммой всех обязательств по всем расчетным кодам, в которых Клиринговый центр имеет обязанность по уплате, и суммой всех обязательств по всем расчетным кодам, в которых Клиринговый центр имеет право требования по уплате, не превосходит суммы максимального убытка, определяемого в соответствии с пунктом 33.11 Правил клиринга, и суммы Гарантийного фонда. При этом сумма обязательства, выраженного в иностранной валюте, переводится в российские рубли по курсу, установленному в соответствии с Методикой.
- 29.4. Обязательство может быть включено в клиринговый пул частично.
- 29.5. В случае наличия обязательств по расчетному коду Участника клиринга, подлежащих исполнению и не включенных в клиринговый пул из-за нарушения условия, указанного в подпункте 29.3.1 Правил клиринга, выраженных в одной валюте, Клиринговый центр вправе удовлетворить требования за счет Средств обеспечения такого Участника клиринга в другой валюте, учитываемых на денежном регистре обеспечения с данным расчетным кодом, путем заключения с таким Участником клиринга договоров в соответствии со статьей 30 Правил клиринга. Указанные договоры учитываются на регистре учета позиций, код которого соответствует данному расчетному коду. При наличии нескольких таких регистров учета позиций, выбор определенных регистров учета позиций для учета определенных указанных договоров осуществляется по решению Клирингового центра.
- При этом Клиринговый центр удовлетворяет требования за счет Средств обеспечения Недобросовестного Участника в другой валюте, если является положительной величина суммы Средств обеспечения в данной валюте, учитываемых на денежном регистре обеспечения с указанным расчетным кодом,

увеличенная на сумму обязательств по указанному расчетному коду в данной валюте, включенных в клиринговый пул, которые являются правом требования Участника клиринга, и уменьшенную на сумму обязательств по указанному расчетному коду в данной валюте, включенных в клиринговый пул, которые являются обязанностью Участника клиринга.

Договоры, заключаемые в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга, заключаются Клиринговым центром без согласия Участника клиринга.

При этом Участник клиринга, неисполнение или ненадлежащее исполнение обязательств которым привело к необходимости заключения договоров в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга, признается Недобросовестным Участником.

- 29.6. Обязательства по заключенным в соответствии с пунктом 29.5 Правил клиринга договорам с текущей датой исполнения и неисполненные Обязательства по Договорам, для удовлетворения требований по которым были заключены данные договоры, подлежат включению в клиринговый пул в соответствии с условиями, указанными в пункте 29.3 Правил клиринга.
- 29.7. Превышение суммы всех обязательств по всем расчетным кодам, включенных в клиринговый пул, в которых Клиринговый центр имеет обязанность по уплате, над суммой всех обязательств по всем расчетным кодам, включенных в клиринговый пул, в которых Клиринговый центр имеет право требования по уплате, именуется убытком. Сумма убытка равна разности суммы всех обязательств по всем расчетным кодам, включенных в клиринговый пул, в которых Клиринговый центр имеет обязанность по уплате, и суммы всех обязательств по всем расчетным кодам, включенных в клиринговый пул, в которых Клиринговый центр имеет право требования по уплате.
- 29.8. Обязательство по расчетному коду, подлежащее исполнению, не включенное в клиринговый пул из-за нарушения условия, указанного в подпункте 29.3.2 Правил клиринга, прекращается полностью или частично.  
При этом Клиринговый центр осуществляет учет суммы прекращенного обязательства в отношении Участника клиринга, являющегося стороной такого обязательства, на денежном регистре обеспечения с данным расчетным кодом.  
В случае уменьшения суммы Задолженностей по всем расчетным кодам всех Участников клиринга (далее - погашение Задолженности) и наличия учитываемых Клиринговым центром на каком-либо денежном регистре обеспечения суммы прекращенных обязательств, Клиринговый центр осуществляет перечисление Участникам клиринга, которые являлись стороной таких обязательств, денежных средств, исходя из суммы погашенной Задолженности, в максимально возможном размере, не превосходящем учитываемую сумму прекращенных обязательств. На сумму перечисленных денежных средств Клиринговый центр уменьшает сумму учитываемых прекращенных обязательств.
- 29.9. Обязательство по расчетному коду, подлежащее исполнению, не включенное в клиринговый пул из-за нарушения условия, указанного в подпункте 29.3.1 Правил клиринга, признается неисполненным и учитывается как Задолженность по данному расчетному коду.  
Если стороной такого обязательства является Клиринговый центр, то у Участника клиринга возникает Задолженность по расчетному коду перед Клиринговым центром.  
Если стороной такого обязательства является Биржа, то у Участника клиринга возникает Задолженность по расчетному коду перед Биржей.

- 29.10. По обязательствам, включенным в клиринговый пул, Клиринговый центр изменяет значения денежных регистров обеспечения в соответствующей валюте в следующем порядке:
- по обязательству по расчетному коду, по которому Участник клиринга имеет право требования, значение денежного регистра обеспечения с данным расчетным кодом увеличивается на сумму обязательства;
  - по обязательству по расчетному коду, по которому Участник клиринга имеет обязанность, значение денежного регистра обеспечения с данным расчетным кодом уменьшается на сумму обязательства.
- 29.11. Обязательство по расчетному коду, включенное в клиринговый пул, считается прекращенным (исполненным) полностью или частично в момент изменения Клиринговым центром значения денежного регистра обеспечения с данным расчетным кодом.

### **Статья 30. Условия договоров с Недобросовестным Участником**

- 30.1. Удовлетворение требований Недобросовестного Участника в случае, предусмотренном пунктом 29.5 Правил клиринга, осуществляется Клиринговым центром по его выбору любым из следующих способов:
- 30.1.1. Путем заключения с данным Недобросовестным Участником договора купли-продажи иностранной валюты, днем исполнения обязательств по которому является день заключения договора, на условиях, установленных настоящей статьей Правил клиринга;
- 30.1.2. Путем заключения с данным Недобросовестным Участником договора (сделки) типа своп, по которому одна сторона (продавец) обязуется в день заключения договора передать в собственность другой стороне (покупателю) иностранную валюту, а покупатель обязуется принять иностранную валюту и уплатить за нее определенную денежную сумму, а также по которому покупатель обязуется на следующий Рабочий день после дня заключения договора передать иностранную валюту в собственность продавца, а продавец обязуется принять иностранную валюту и уплатить за них определенную денежную сумму.
- 30.2. Условия, в том числе сумма договоров, указанных в настоящей статье Правил клиринга, устанавливаются Клиринговым центром таким образом, чтобы при включении в клиринговый пул обязательств по данным договорам и неисполненных Недобросовестным Участником Обязательств по Договорам, для удовлетворения требований по которым были заключены договоры, предусмотренные настоящей статьей Правил клиринга, не были нарушены условия, указанные в пункте 29.3 Правил клиринга.
- 30.3. Договоры, предусмотренные настоящей статьей Правил клиринга, заключаются на сумму, эквивалентную сумме неисполненных обязательств Недобросовестного Участника в соответствующей валюте.
- 30.4. В случае если на денежных регистрах обеспечения Недобросовестного Участника отсутствуют Средства обеспечения, или Средства обеспечения недостаточно для исполнения неисполненных обязательств Недобросовестного Участника, договоры, предусмотренные настоящей статьей Правил клиринга, заключаются на сумму, определяемую в соответствии с Методикой.
- 30.5. Базовый курс договора (сделки) типа своп, курс конвертации и иные параметры договоров (сделок), предусмотренных настоящей статьей Правил клиринга, определяются Клиринговым центром в соответствии с Методикой.



**Статья 31. Порядок возникновения и исполнения Маржинального требования по расчетному коду и Задолженности по расчетному коду**

- 31.1. Наличие у Участника клиринга Маржинального требования по расчетному коду определяется в ходе клиринговой сессии на основании Требования к обеспечению по расчетному коду и Оценки средств обеспечения по расчетному коду после исполнения (прекращения) обязательств в соответствии со статьей 29 Правил клиринга.  
Маржинальное требование подлежит исполнению в течение одного Рабочего дня с момента его возникновения.
- 31.2. Если Требование к обеспечению по расчетному коду превосходит Оценку средств обеспечения по расчетному коду, у Участника клиринга возникает Маржинальное требование по расчетному коду.
- 31.3. Маржинальное требование по расчетному коду может быть исполнено Участником клиринга путем выполнения следующих действий:
- увеличения Средств обеспечения, учитываемых на данном расчетном коде, в результате которого увеличивается Оценка средств обеспечения по данному расчетному коду;
  - заключения Договоров, досрочного прекращения Договоров, изменения условий Договоров, в результате которых уменьшается Требование к обеспечению по данному расчетному коду.
- Клиринговый центр осуществляет проверку исполнения Маржинального требования по расчетному коду после выполнения Участником клиринга каждого из перечисленных выше действий.  
Маржинальное требование по расчетному коду прекращается в момент, когда Требование к обеспечению по расчетному коду не будет превосходить Оценку средств обеспечения по расчетному коду.
- 31.4. Наличие у Участника клиринга Задолженности по расчетному коду определяется в ходе клиринговой сессии.
- 31.5. В случае наличия у Участника клиринга Задолженности по расчетному коду перед Клиринговым центром, Участник клиринга обязан уплатить Клиринговому центру неустойку, рассчитанную по формуле:  
$$\text{Fine} = D \times 2 \times S \times n / 365$$
, где  
Fine – сумма неустойки, в российских рублях,  
D – сумма Задолженности по расчетному коду перед Клиринговым центром в российских рублях. Задолженность по расчетному коду перед Клиринговым центром, выраженная в иностранной валюте, переводится в российские рубли по курсу, установленному в соответствии с Методикой,  
S – ставка рефинансирования, установленная Банком России на дату расчета суммы неустойки,  
n - количество календарных дней между датой расчета суммы неустойки (датой текущей клиринговой сессии) и следующим Рабочим днем.  
Сумма неустойки, рассчитанная в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга, не облагается НДС.  
Обязательство по уплате Клиринговому центру указанной неустойки подлежит исполнению в ходе следующей клиринговой сессии.
- 31.6. Если Задолженность по расчетному коду перед Клиринговым центром / Маржинальное требование по расчетному коду не погашена / не исполнено, Клиринговый центр не ранее 1 (одного) Рабочего дня и не позднее 3 (трех) Рабочих дней со дня возникновения Задолженности по расчетному коду перед

Клиринговым центром / Маржинального требования по расчетному коду, применяет к Участнику клиринга процедуру урегулирования неисполнения обязательств (дефолта) в порядке, установленном статьей 32 Правил клиринга.

- 31.6.1. Если непогашение/ неисполнение Задолженности по расчетному коду перед Клиринговым центром / Маржинального требования по расчетному коду Участником клиринга вызвано обстоятельствами непреодолимой силы, Участник клиринга обязан незамедлительно уведомить Клиринговый центр любыми доступными средствами связи. В случае признания Клиринговым центром причин непогашения / неисполнения Задолженности по расчетному коду перед Клиринговым центром / Маржинального требования по расчетному коду обстоятельствами непреодолимой силы, Клиринговый центр вправе продлить максимальный срок, в течение которого в отношении Участника клиринга, имеющего Задолженность по расчетному коду перед Клиринговым центром / Маржинальное требование по расчетному коду, должна быть применена процедура урегулирования неисполнения обязательств (дефолта) до 5 (пяти) Рабочих дней со дня возникновения у Участника клиринга Задолженности по расчетному коду перед Клиринговым центром / Маржинального требования по расчетному коду.
- 31.6.2. Участник клиринга обязан предоставить Клиринговому центру документы, подтверждающие обстоятельства непреодолимой силы, в течение 2 (двух) дней с момента уведомления Клирингового центра в соответствии с подпунктом 31.6.1 Правил клиринга об обстоятельствах непреодолимой силы. В случае непредоставления Участником клиринга Клиринговому центру таких документов в указанный срок или отсутствия в таких документах достаточных (по мнению Клирингового центра) подтверждений указанных обстоятельств с Участника клиринга, имеющего Задолженность по расчетному коду перед Клиринговым центром, по решению Клирингового центра взыскивается неустойка, рассчитанная в соответствии с пунктом 31.5 Правил клиринга в расчете на количество календарных дней между датой возникновения Задолженности перед Клиринговым центром и датой расчета неустойки.
- 31.7. Если в течение одного Рабочего дня у Участника клиринга возникла Задолженность по расчетному коду перед Клиринговым центром, и было прекращено Маржинальное требование по расчетному коду, сроки, указанные в пункте 31.6 Правил клиринга, исчисляются с момента возникновения Маржинального требования по расчетному коду.  
Если в течение одного Рабочего дня у Участника клиринга возникло Маржинальное требование по расчетному коду, и была погашена Задолженность по расчетному коду перед Клиринговым центром, сроки, указанные в пункте 31.6 Правил клиринга, исчисляются с момента возникновения Задолженности по расчетному коду перед Клиринговым центром.

## **Статья 32. Порядок урегулирования неисполненных обязательств**

- 32.1. Положения настоящей статьи Правил клиринга применяются в случае непогашения Участником клиринга Задолженности по расчетному коду перед Клиринговым центром и (или) неисполнения Маржинального требования по расчетному коду, и (или) в случае частичного приостановления допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию в соответствии с Правилами клиринга.
- 32.2. При частичном приостановлении допуска к клиринговому обслуживанию в соответствии со статьей 11 Правил клиринга Клиринговый центр вправе в любой

момент с учетом положений пунктов 31.6 и 31.7 Правил клиринга применить к Участнику клиринга процедуру урегулирования неисполнения обязательств (дефолта).

- 32.3. В случае принятия решения о применении к Участнику клиринга процедуры урегулирования неисполнения обязательств, Клиринговый центр:
- направляет Бирже уведомление о необходимости приостановить Допуск к торгам на рынке Стандартизированных ПФИ в секторе Навигатор и в секторе Спектра данному Участнику клиринга, об удалении всех Заявок, поданных в секторе Навигатор с указанием регистров учета позиций, открытых для данного Участника клиринга, и поданных в секторе Спектра, о запрете выставления в секторе Навигатор Участниками торгов Заявок с указанием регистров учета позиций, открытых для данного Участника клиринга, и получает от Биржи информацию о Договорах, стороной по которым является данный Участник клиринга, заключённых до момента приостановления Допуска к торгам;
  - направляет Участнику клиринга уведомление о принятом решении и о прекращении возможности подачи Предложений/Предложений «Стратегия» и иных оферт, предусмотренных Правилами клиринга, направленных на изменение или прекращение Договоров;
  - удаляет все Предложения и Предложения «Стратегия», поданные данным Участником клиринга, отказывает в акцепте всех полученных оферт, предусмотренных Правилами клиринга, направленных на изменение или прекращение Договоров, поданных данным Участником клиринга.
- 32.4. За неисполнение обязательств Участником клиринга, повлекшее применение процедуры урегулирования неисполнения обязательств, с такого Участника клиринга взимается штраф в размере, установленном приложением № 2 к Правилам клиринга.  
Обязательство Участник клиринга по уплате указанного штрафа учитывается на основном собственном денежном регистре обеспечения в российских рублях.  
Порядок исполнения обязательства Участника клиринга по уплате указанного штрафа определен в статье 29 Правил клиринга.
- 32.5. Клиринговый центр вправе заключать Хеджирующие договоры, в том числе, путем подачи в Систему торгов в секторе Навигатор и в секторе Спектра Заявок.
- 32.6. Обязательства Дефолтера по Договорам, за исключением неисполненных обязательств Дефолтера с наступившим сроком исполнения, прекращаются в день принятия Клиринговым центром решения о применении процедуры урегулирования неисполнения обязательств (дефолта) в одностороннем порядке возникновением обязательства / требования Дефолтера, рассчитываемого в следующем порядке.  
Клиринговый центр рассчитывает величину, равную сумме с учетом знака рассчитанных в соответствующих валютах:
- суммы расходов Клирингового центра, связанных с прекращением Обязательств по Договорам Дефолтера, в том числе затрат, связанных с заключением Хеджирующих и Аукционных договоров, затрат, связанных с удовлетворением требований за счет Средств обеспечения Дефолтера (учитывается со знаком «минус»);
  - расчетной стоимости каждого Договора, учитываемого на регистре учета позиций Дефолтера, рассчитанной для Дефолтера на конец дня, в который принято решение о применении процедуры урегулирования неисполнения

обязательств (дефолта) (учитывается с обратным знаком, который имеет расчетная стоимость).

При этом значения в иностранной валюте, рассчитанные в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга, пересчитываются в российские рубли по курсу, установленному в соответствии с Методикой, на день принятия решения о применении процедуры урегулирования неисполнения обязательств (дефолта).

32.6.1. Если величина, рассчитанная в соответствии с пунктом 32.6 Правил клиринга, положительная (далее – Положительная исходная величина), то для денежных регистров обеспечения Дефолтера определяются соответствующие им величины в следующем порядке:

- денежные регистры обеспечения Дефолтера выбираются в следующей последовательности:
  - денежные регистры обеспечения Дефолтера, не являющиеся собственными;
  - собственные денежные регистры обеспечения Дефолтера;
- для выбранного денежного регистра обеспечения Дефолтера определяется соответствующая величина по формуле  $\text{MIN}(\text{ЗД}, \text{ПИВ})$ , где ЗД – величина Задолженности по расчетному коду, который имеет данный денежный регистр обеспечения; ПИВ – значение Положительной исходной величины, выраженное в валюте выбранного денежного регистра обеспечения Дефолтера. Если на выбранном денежном регистре обеспечения Дефолтера учитываются денежные средства в иностранной валюте, то значение Положительной исходной величины пересчитывается в иностранную валюту по курсу, установленному в соответствии с Методикой, на день принятия решения о применении процедуры урегулирования неисполнения обязательств (дефолта);
- значение Положительной исходной величины уменьшается на значение определенной для выбранного денежного регистра обеспечения Дефолтера соответствующей величины, выраженное в российских рублях. Если соответствующая величина выражена в иностранной валюте, она пересчитывается в российские рубли по курсу, установленному в соответствии с Методикой, на день принятия решения о применении процедуры урегулирования неисполнения обязательств (дефолта);
- определение соответствующих величин прекращается, если значение Положительной исходной величины становится равным нулю. Если после выбора всех денежных регистров обеспечения Дефолтера значение Положительной исходной величины не равно нулю, то значение соответствующей основному денежному регистру обеспечения в российских рублях величины увеличивается на значение Положительной исходной величины.

Отличная от нуля величина, соответствующая денежному регистру обеспечения Дефолтера, означает требование Дефолтера по отношению к Клиринговому центру в размере данной величины в валюте денежного регистра обеспечения Дефолтера, которому она соответствует. Указанное обязательство учитывается на данном денежном регистре обеспечения Дефолтера.

32.6.2. Если величина, рассчитанная в соответствии с пунктом 32.6 Правил клиринга, отрицательная (далее – Отрицательная исходная величина), то для денежных регистров обеспечения и регистров учета средств Гарантийного фонда Дефолтера (далее – регистры Дефолтера) определяются соответствующие им величины в следующем порядке:

- регистры Дефолтера выбираются в следующей последовательности:
    - собственные денежные регистры обеспечения Дефолтера;
    - денежные регистры обеспечения Дефолтера, не являющиеся собственными, с расчетным кодом, по которому непогашение Задолженности и (или) неисполнение Маржинального требования явилось основанием для применения процедуры дефолта;
    - регистры учета средств Гарантийного фонда;
    - денежные регистры обеспечения Дефолтера, не являющиеся собственными;
  - для выбранного регистра Дефолтера определяется соответствующая величина по формуле  $MIN(ДС, MOD(ИБ))$ , где  
ДС – Средства обеспечения, учитываемые на денежном регистре обеспечения, или взнос в Гарантийный фонд, учитываемый на регистре учета средств Гарантийного фонда;  
MOD(ИБ) – абсолютное значение Отрицательной исходной величины, выраженное в валюте выбранного регистра Дефолтера. Если на выбранном регистре Дефолтера учитываются денежные средства в иностранной валюте, то абсолютное значение Отрицательной исходной величины пересчитывается в иностранную валюту по курсу, установленному в соответствии с Методикой, на день принятия решения о применении процедуры урегулирования неисполнения обязательств (дефолта);
  - значение Отрицательной исходной величины увеличивается на значение определенной для выбранного регистра Дефолтера соответствующей величины, выраженное в российских рублях. Если соответствующая величина выражена в иностранной валюте, она пересчитывается в российские рубли по курсу, установленному в соответствии с Методикой, на день принятия решения о применении процедуры урегулирования неисполнения обязательств (дефолта);
  - определение соответствующих величин прекращается, если значение Отрицательной исходной величины становится равным нулю. Если после выбора всех регистров Дефолтера значение Отрицательной исходной величины не равно нулю, то значение соответствующей основному денежному регистру обеспечения в российских рублях величины увеличивается на абсолютное значение Отрицательной исходной величины. Отличная от нуля величина, соответствующая регистру Дефолтера, означает обязательство Дефолтера по отношению к Клиринговому центру в размере данной величины в валюте регистра Дефолтера, которому она соответствует. Указанное обязательство учитывается на данном регистре Дефолтера.
- 32.6.3. Обязательство / требование Дефолтера подлежит исполнению в порядке, установленном статьей 29 Правил клиринга, в ходе ближайшей клиринговой сессии.
- 32.7. При наличии у Участника клиринга непогашенной Задолженности по расчетному коду и при отсутствии непрекращенных Договоров и договоров, заключенных с Участником клиринга в соответствии со статьей 30 Правил клиринга, учитываемых на всех регистрах учета позиций, Клиринговый центр изменяет учет денежных Средств обеспечения на денежных регистрах обеспечения, открытых для Участника клиринга, путем уменьшения значения денежных регистров обеспечения, имеющих положительное значение, и соответствующего увеличения значения денежных регистров обеспечения, по которым имеется непогашенная Задолженность по расчетному коду.

При этом денежные средства в одной валюте могут быть пересчитаны в денежные средства в другой валюте по курсу, установленному в соответствии с Методикой. При указанном изменении учета денежных Средств обеспечения в первую очередь подлежат уменьшению значения собственных денежных регистров обеспечения и подлежат увеличению значения денежных регистров обеспечения, не являющихся собственными.

32.8. В целях создания условий для исполнения Обязательств по Договорам Клиринговый центр проводит аукцион ликвидации между Участниками клиринга.

32.9. В аукционе ликвидации могут принимать участие все Участники клиринга за исключением Дефолтера.

32.10. Аукцион ликвидации проводится в следующем порядке.

32.10.1. Клиринговый центр посредством Подсистемы ЭДО НКЦ направляет Участникам клиринга приглашение подавать Аукционные заявки, содержащее:

- информацию о дате и времени проведения процедуры аукциона ликвидации;
- информацию об условиях Аукционных договоров;
- информацию о Стартовой цене аукциона. При этом Стартовая цена аукциона рассчитывается Клиринговым центром исходя из оценки справедливой стоимости Аукционного портфеля, общего размера максимально допустимого убытка Клирингового центра, определенного в статье 33 Правил клиринга, и размера Гарантийного фонда. Отрицательное значение Стартовой цены означает внесение Платы за заключение Аукционных договоров в размере абсолютного значения Стартовой цены Клиринговым центром, положительное – получение Платы в указанном размере Клиринговым центром.

32.10.2. В ходе проведения аукциона ликвидации Участники клиринга направляют Клиринговому центру Аукционные заявки, каждая из которых должна содержать:

- для каждого Аукционного договора - код регистра учета позиций, на котором должен учитываться Аукционный договор;
- цена по каждому расчетному коду, которому соответствует хотя бы один из указанных кодов регистров учета позиций (цена за заключение Аукционных договоров по расчетному коду).

Ценой аукционной заявки (Платой за заключение Аукционных договоров) является сумма всех указанных цен за заключение Аукционных договоров по расчетным кодам.

При этом Цена аукционной заявки не может быть меньше Стартовой Цены аукциона, указанной Клиринговым центром в соответствии с подпунктом 32.10.1 Правил клиринга. Отрицательное значение Цены аукционной заявки означает внесение Платы за заключение Аукционных договоров в размере абсолютного значения Цены аукционной заявки Клиринговым центром, положительное – получение Платы в указанном размере Клиринговым центром.

Каждый Участник клиринга может отправлять Аукционные заявки неограниченное количество раз до окончания аукциона ликвидации. Направление каждой последующей Аукционной заявки рассматривается как отзыв ранее направленной Аукционной заявки и подача новой Аукционной заявки.

- 32.10.3. После сбора Аукционных заявок в отношении каждой Аукционной заявки Клиринговый центр осуществляет проверку Уровней обеспеченности по каждому расчетному коду, указанному в Аукционной заявке, для заключения указанных Аукционных договоров с учетом внесения Платы за заключение Аукционных договоров по расчетному коду в порядке, установленном Правилами клиринга.
- 32.10.4. Клиринговый центр после проведения проверок, предусмотренных подпунктом 32.10.3 Правил клиринга, определяет Лучшую Аукционную заявку среди Аукционных заявок, для которых результат проверки Уровней обеспеченности по расчетным кодам является положительным.
- 32.10.5. Лучшей Аукционной Заявкой признается Аукционная заявка, содержащая максимальную Цену аукционной заявки за заключение всех Аукционных договоров.
- 32.10.6. После определения Лучшей Аукционной заявки Клиринговый центр заключает Аукционные договоры с Участником клиринга, направившим Лучшую Аукционную заявку. При этом между Участником клиринга и Клиринговым центром в соответствии с условиями Лучшей Аукционной заявки возникают обязательства по внесению/получению Платы за заключение Аукционных договоров по расчетному коду, которые учитываются на денежных регистрах обеспечения с соответствующим расчетным кодом. При этом данный Участник клиринга не уплачивает комиссионное вознаграждение Клирингового центра за осуществление клиринга по заключенным Аукционным договорам.
- 32.11. В случае если во время проведения аукциона ликвидации Участники клиринга не направили ни одной Аукционной заявки, либо на основании полученных Клиринговым центром Аукционных заявок не были заключены Аукционные договоры, аукцион ликвидации признается несостоявшимся, и Клиринговый центр вправе осуществить одно или несколько из следующих действий:
- разделить Аукционный портфель на лоты и провести несколько аукционов ликвидации, на каждом из которых будут заключены Аукционные договоры, составляющие лот, определенный Клиринговым центром.
  - заключить Аукционные договоры из Аукционного портфеля в равном объеме с каждым Участником клиринга, за исключением тех Участников клиринга, допуск к клиринговому обслуживанию которых был приостановлен. При этом суммарная Плата за заключение Аукционных договоров равна Стартовой цене аукциона, указанной Клиринговым центром в соответствии с подпунктом 32.10.1 Правил клиринга.

### **Статья 33. Порядок использования и возмещения средств Гарантийного фонда**

- 33.1. Клиринговый центр использует средства Гарантийного фонда в случае наличия у Участника клиринга непогашенной Задолженности по расчетному коду перед Клиринговым центром (далее - Должник) и при отсутствии непрекращенных Договоров и договоров, заключенных с Участником клиринга в соответствии со статьей 30 Правил клиринга, учитываемых на всех регистрах учета позиций, в порядке, установленном настоящей статьей Правил клиринга.
- 33.2. Для погашения Задолженности по расчетному коду перед Клиринговым центром в определенной валюте в первую очередь используется средства Гарантийного фонда в той же валюте. При недостаточности средств Гарантийного фонда в той же валюте для погашения Задолженности по расчетному коду перед

- Клиринговым центром используются средства Гарантийного фонда в другой валюте.
- 33.3. В случае использования взносов Участников клиринга в Гарантийный фонд, выраженных в одной валюте, Клиринговый центр использует такие денежные средства для удовлетворения требований Клирингового центра по Задолженности по расчетному коду Должника перед Клиринговым центром, выраженных в другой валюте, путем заключения Клиринговым центром конверсионной сделки по курсу, установленному в соответствии с Методикой. Сумма, полученная по указанной конверсионной сделке, засчитывается Клиринговым центром в счет погашения Задолженности по расчетному коду Должника перед Клиринговым центром.
- 33.4. В первую очередь для удовлетворения требований Клирингового центра по непогашенной Задолженности по расчетному коду Должника перед Клиринговым центром используется взнос в Гарантийный фонд Должника.
- 33.5. Взнос в Гарантийный фонд Должника используется для удовлетворения требований Клирингового центра по непогашенной Задолженности по расчетному коду Должника перед Клиринговым центром путем передачи денежных средств, составляющих взнос в Гарантийный фонд Должника Клиринговому центру в счет погашения указанной Задолженности по расчетному коду перед Клиринговым центром. Удовлетворение требований за счет взноса в Гарантийный фонд Должника осуществляется Клиринговым центром без предварительного уведомления Должника. Взнос в Гарантийный фонд Должника и сумма непогашенной Задолженности по расчетному коду перед Клиринговым центром уменьшается на сумму использованных средств Гарантийного фонда из взноса Должника.
- 33.6. Во вторую очередь, используются взносы в Гарантийный фонд Добросовестных участников клиринга в размере превышения суммы Задолженностей по расчетным кодам Должников перед Клиринговым центром, величины, эквивалентной 10 000 000 (десяти миллионам) долларов США, пересчитанной в российские рубли по курсу, установленному в соответствии с Методикой.
- 33.7. Суммы денежных средств, используемых из взносов в Гарантийный фонд каждого из Добросовестных участников клиринга для погашения Задолженности по расчетному коду перед Клиринговым центром, определяются Клиринговым центром пропорционально размеру взноса в Гарантийный фонд каждого Добросовестного участника клиринга. В случае применения Клиринговым центром к Должнику процедуры урегулирования неисполнения обязательств в соответствии со статьей 32 Правил клиринга суммы денежных средств, используемых из взносов в Гарантийный фонд каждого из Добросовестных участников клиринга, используются Клиринговым центром для погашения Задолженности по расчетному коду перед Клиринговым центром в следующей очередности:
- 1) Взносы в Гарантийный фонд Участников клиринга, не подававших Аукционные заявки, - пропорционально количеству таких Участников клиринга в сумме, необходимой для погашения Задолженности по расчетному коду Должника перед Клиринговым центром;
  - 2) Взносы в Гарантийный фонд Участников клиринга, подававших Аукционные заявки, на основании которых не были заключены Аукционные договоры, в сумме, необходимой для погашения Задолженности по расчетному коду Должника перед Клиринговым центром



- после использования взносов в Гарантийный фонд в соответствии с подпунктом 1) настоящего пункта Правил клиринга, пропорционально количеству таких Участников клиринга;
- 3) Взносы в Гарантийный фонд Участников клиринга, заключивших Аукционные договоры, в сумме, необходимой для погашения Задолженности по расчетному коду Должника перед Клиринговым центром после использования взносов в Гарантийный фонд в соответствии с подпунктом 2) настоящего пункта Правил клиринга, пропорционально количеству таких Участников клиринга.
- 33.8. Взнос в Гарантийный фонд Добросовестного участника клиринга используется для удовлетворения требований Клирингового центра по непогашенной Задолженности по расчетному коду Должника перед Клиринговым центром, путем передачи денежных средств, составляющих взнос в Гарантийный фонд Добросовестного участника клиринга Клиринговому центру в счет погашения Задолженности по расчетному коду Должника перед Клиринговым центром.
- 33.9. Удовлетворение требований за счет взноса в Гарантийный фонд Добросовестного участника клиринга осуществляется Клиринговым центром без предварительного уведомления Добросовестного участника клиринга.
- 33.10. Взнос в Гарантийный фонд Добросовестного участника клиринга и сумма непогашенной Задолженности по расчетному коду перед Клиринговым центром уменьшается на сумму использованных средств Гарантийного фонда из взноса Добросовестного участника клиринга.
- 33.11. Максимальный убыток определяется в следующем порядке;
- первоначально устанавливается равным величине, эквивалентной 50 000 000 (пятидесяти миллионам) долларов США, пересчитанной в российские рубли по курсу, установленному в соответствии с Методикой (первоначальное значение);
  - уменьшается на сумму убытка, определяемого в соответствии с пунктом 29.7 Правил клиринга;
  - увеличивается на сумму погашенной Задолженности за счет использования средств Гарантийного фонда в соответствии с пунктом 33.6 Правил клиринга до величины, не превосходящей первоначальное значение;
  - увеличивается на сумму погашенной Задолженности, уменьшенной на сумму денежных средств, перечисляемых в соответствии с пунктом 29.8 Правил клиринга, до величины, не превосходящей первоначальное значение;
  - восстанавливает первоначальное значение по истечении 3 (трех) месяцев с момента уменьшения величины при условии ее равенства первоначальному значению.
- 33.12. В случае использования взноса в Гарантийный фонд Участника клиринга Клиринговый центр уведомляет об этом Участника клиринга путем направления Отчета о взносе в Гарантийный фонд в соответствии со статьей 38 Правил клиринга.
- Отчет о взносе в Гарантийный фонд, содержащий информацию об использовании взноса в Гарантийный фонд Участника клиринга, направляется Участнику клиринга не позднее Рабочего дня, следующего за датой использования средств Гарантийного фонда.

- 33.13. В случае использования взносов в Гарантийный фонд Добросовестных Участников клиринга Должник обязан в течение 3 (трех) Рабочих дней возместить использованные средства Гарантийного фонда.  
В случае невозмещения Должником средств Гарантийного фонда Клиринговый центр вправе требовать от Должника этого возмещения в судебном порядке.
- 33.14. После возмещения Должником использованных средств Гарантийного фонда, Клиринговый центр возмещает использованные взносы в Гарантийный фонд Добросовестных участников клиринга.  
Если полученных от Должника денежных средств недостаточно для полного возмещения взносов в Гарантийный фонд Добросовестных участников клиринга, осуществляется частичное возмещение таких взносов в размере, пропорциональном сумме использованных средств Гарантийного фонда из взноса каждого Участника клиринга.  
При этом размер взноса в Гарантийный фонд Добросовестного участника клиринга и размер обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга взноса в Гарантийный фонд увеличиваются на сумму возмещенных денежных средств.
- 33.15. В случае использования взносов в Гарантийный фонд Добросовестных участников клиринга и невозмещения Должником использованных средств Гарантийного фонда в течение 3 (трех) Рабочих дней после их использования, Добросовестные участники клиринга обязаны в течение 3 (трех) Рабочих дней после направления Клиринговым центром соответствующих уведомлений восполнить свои взносы в Гарантийный фонд до размера взноса в Гарантийный фонд, определённого в соответствии со статьей 25 Правил клиринга. Указанная обязанность по восполнению взноса в Гарантийный фонд не может возникать у Добросовестного участника клиринга чаще, чем один раз в Рабочий день и 3 (трех) раз в течение квартала.
- 33.16. В случае невыполнения Добросовестным Участником клиринга требования, указанного в пункте 33.15 Правил клиринга, в указанный срок, Клиринговый центр вправе удержать необходимую сумму из Средств обеспечения такого Участника клиринга в соответствии с пунктом 25.17 **Ошибка! Источник ссылки не найден.** Правил клиринга.

## ПОДРАЗДЕЛ V-IV ПОРЯДОК ИСПОЛНЕНИЯ ОПЦИОННЫХ ДОГОВОРОВ

### Статья 34. Порядок осуществления Права на исполнение по внебиржевым опционным Договорам

- 34.1. Настоящая статья Правил клиринга устанавливает порядок осуществления Права на исполнение для любого внебиржевого опционного Договора (далее в настоящей статье – Опционный договор).
- 34.2. Для осуществления Права на исполнение по Опционному договору Участник клиринга – Покупатель по Опционному договору направляет в сроки, установленные Спецификацией Опционного договора в Клиринговый центр Требование об исполнении по Опционному договору по установленной форме в виде электронного документа. Направленное Участником клиринга – Покупателем указанное Требование об исполнении не подлежит отзыву.
- 34.3. При наличии полученного от Участника клиринга – Покупателя Требования об исполнении по Опционному договору Клиринговый центр осуществляет во Время закрытия, определяемое в соответствии с условиями заключенного Опционного договора на основании Спецификации, проверки возможности осуществления Права на исполнение. Указанные проверки осуществляются в следующем порядке:
- 34.3.1. По всем Опционным договорам, имеющим одно Время закрытия, учитываемым на регистрах учета позиций, код которых соответствует одному расчетному коду, открытому Участнику клиринга – Покупателю (далее в настоящей статье – Опционные договоры по расчетному коду), и по которым Участником клиринга – Покупателем подано Требование об исполнении, осуществляются следующие проверки:
- при наличии у Участника клиринга Маржинального требования по данному расчетному коду - проверку не�меньшения Уровня обеспеченности по данному расчетному коду с учетом обязательств при осуществлении Права на исполнение (далее в настоящей статье – Обязательства по исполнению) по всем Опционным договорам по расчетному коду;
  - при отсутствии у Участника клиринга Маржинального требования по данному расчетному коду - проверку того, что Уровень обеспеченности по данному расчетному коду не станет меньше нуля с учетом Обязательств по исполнению по всем Опционным договорам по расчетному коду;
  - при отсутствии у Участника клиринга Маржинального требования по расчетному коду (если на момент проверки допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию приостановлен частично) - проверку того, что Уровень обеспеченности по данному расчетному коду с учетом Обязательств по исполнению по всем Опционным договорам по расчетному коду не станет меньше величины Уровня обеспеченности по данному расчетному коду, определенной при приостановлении допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию в соответствии с пунктом 11.4 Правил клиринга;
- Право на исполнение осуществляется по всем Опционным договорам по расчетному коду при положительном результате всех проверок.
- 34.3.2. При отрицательном результате хотя бы одной проверки, указанной в подпункте 34.3.1 Правил клиринга, Клиринговый центр осуществляет по каждому Опционному договору по расчетному коду в порядке подачи Требований, начиная с самого раннего, следующие проверки:

- при наличии у Участника клиринга Маржинального требования по данному расчетному коду - проверку не�меньшения Уровня обеспеченности по данному расчетному коду с учетом Обязательств по исполнению по данному Опционному договору по расчетному коду;
- при отсутствии у Участника клиринга Маржинального требования по данному расчетному коду - проверку того, что Уровень обеспеченности по данному расчетному коду не станет меньше нуля с учетом Обязательств по исполнению по данному Опционному договору по расчетному коду;
- при отсутствии у Участника клиринга Маржинального требования по расчетному коду (если на момент проверки допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию приостановлен частично) - проверку того, что Уровень обеспеченности по данному расчетному коду с учетом Обязательств по исполнению по данному Опционному договору по расчетному коду не станет меньше величины Уровня обеспеченности по данному расчетному коду, определенной при приостановлении допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию в соответствии с пунктом 11.4 Правил клиринга;

Право на исполнение осуществляется по данному Опционному договору по расчетному коду при положительном результате всех проверок.

- 34.4. При осуществлении Участником клиринга – Покупателем Права на исполнение по Опционному договору, Клиринговый центр направляет Требование об исполнении Участнику клиринга – Продавцу по Парному договору для такого Опционного договора. Указанное Требование об исполнении направляется в виде электронного документа. Право на исполнение при направлении указанного Требования об исполнении осуществляется без осуществления проверок.
- 34.5. При отсутствии Парного договора для Опционного договора, в котором Клиринговый центр является Покупателем, Клиринговый центр вправе направить Требование об исполнении по такому Опционному договору Участнику клиринга – Продавцу по такому Опционному договору. Указанное Требование об исполнении направляется в виде электронного документа во Время закрытия, определяемое в соответствии с условиями данного Опционного договора на основании Спецификации. Право на исполнение при направлении указанного Требования об исполнении осуществляется без осуществления проверок.

### **Статья 35. Особенности исполнения внебиржевых опционных Договоров, базовым активом которых являются иностранные валюты или индексы**

- 35.1. При осуществлении Права на исполнение по Опционному договору, базовым активом которого являются иностранные валюты или индексы, в соответствии со статьей 34 Правил клиринга Клиринговый центр допускает к клирингу Обязательства по исполнению по данному Опционному договору. Указанные обязательства подлежат исполнению в порядке, установленном Правилами клиринга.

## **ПОДРАЗДЕЛ V-V ПОРЯДОК ВЗАИМОДЕЙСТВИЯ С РАСЧЕТНОЙ ОРГАНИЗАЦИЕЙ**

### **Статья 36. Порядок взаимодействия с Расчетной организацией**

- 36.1. Взаимодействие Клирингового центра и Расчетной организации осуществляется на основании договоров банковского счета, заключаемых для открытия Расчетной организацией Клиринговому центру клиринговых банковских счетов, предназначенных для учета денежных Средств обеспечения и денежных средств Гарантийного фонда.
- 36.2. Расчетная организация передает информацию о поступлении денежных средств на клиринговые банковские счета Клирингового центра, предназначенные для учета денежных Средств обеспечения и денежных средств Гарантийного фонда, в соответствии с заключенными договорами. Клиринговый центр принимает и обрабатывает полученную информацию в течение Рабочего дня, за исключением периода времени, в течение которого проводится клиринговая сессия.
- 36.3. Клиринговый центр направляет в Расчетную организацию платежные документы на возврат денежных Средств обеспечения и денежных средств Гарантийного фонда в соответствии с заключенными договорами банковского счета в течение Рабочего дня, за исключением периода времени, в течение которого проводится клиринговая сессия.

## **РАЗДЕЛ VI ПОРЯДОК ОПЛАТЫ УСЛУГ. ОТЧЕТЫ ПО ИТОГАМ КЛИРИНГА**

### **Статья 37. Порядок оплаты услуг Клирингового центра и Биржи**

- 37.1. Клиринговый центр взымает с Участников клиринга следующие комиссионные вознаграждения:
- комиссионное вознаграждение за оказание клиринговых услуг в пользу Клирингового центра;
  - комиссионное вознаграждение в пользу Биржи за услуги по проведению организованных торгов (по биржевым Договорам);
- 37.2. Размер комиссионного вознаграждения за оказание клиринговых услуг, подлежащего уплате Участником клиринга, рассчитывается Клиринговым центром в соответствии с Тарифами Клирингового центра на рынке Стандартизированных ПФИ (приложение № 2 к Правилам клиринга).
- 37.3. Комиссионное вознаграждение Биржи за услуги по проведению организованных торгов на рынке Стандартизированных ПФИ взымаются Клиринговым центром в соответствии с действующими тарифами Биржи (далее – Тарифы Биржи) на основании договора, заключенного с Биржей.
- 37.3.1. Комиссионное вознаграждение Биржи по биржевым Договорам, заключенным Участником торгов как от своего имени, если Участник торгов является Участником клиринга, так и от имени другого лица – Участника клиринга – клиента данного Участника торгов, взымается Клиринговым центром за счет Средств обеспечения Участника клиринга.  
В случае заключения Участником торгов биржевого Договора от имени Участника клиринга – клиента данного Участника торгов, этот Участник клиринга обязуется уплачивать комиссионное вознаграждение Биржи по такому биржевому Договору в порядке, установленном настоящей статьей Правил клиринга.
- 37.4. Обязательства по уплате комиссионных вознаграждений Клирингового центра, Биржи включаются в клиринговый пул и прекращаются взаимозачетом или надлежащим исполнением в порядке, установленном Правилами клиринга.

### **Статья 38. Порядок представления отчетов по итогам клиринга**

- 38.1. Формы и форматы отчетов, предоставляемых Участникам клиринга, определяются документом «Формы и форматы документов, предоставляемых Участниками клиринга и Клиринговым центром в соответствии с Правилами клиринга ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр» на рынке Стандартизированных ПФИ», утверждаемым Клиринговым центром и раскрываемом на Сайте Клирингового центра.
- 38.2. Отчеты направляются Участнику клиринга в форме электронных документов с использованием Подсистемы ЭДО НКЦ.  
Отчеты в форме электронных документов направляются Участнику клиринга не позднее одного часа после окончания клиринговой сессии.  
Участнику клиринга на основании его письменного запроса могут быть изготовлены (распечатаны) копии электронных документов на бумажном носителе либо предоставлены копии отчетов в форме электронных документов.  
Копии электронных документов на бумажном носителе подписываются уполномоченным лицом Клирингового центра и передаются представителю

Участника клиринга либо направляются Участнику клиринга по почте заказным письмом с уведомлением.

Указанные копии отчетов предоставляются Клиринговым центром в течение 3 (трех) Рабочих дней после получения запроса.

38.3. Клиринговый центр формирует следующие отчеты по итогам клиринга для Участников клиринга:

- Отчет о сделках, содержащий информацию о заключенных биржевых и внебиржевых Договорах, и договорах, заключенных в соответствии со статьей 30 Правил клиринга;
- Отчет о позициях и платежах, содержащий информацию об обязательствах, допущенных к клирингу и обязательствах, определенных по итогам клиринга;
- Отчет о Средствах обеспечения, содержащий информацию об использовании индивидуального клирингового обеспечения, в том числе о его использовании для исполнения обязательств, допущенных к клирингу, и (или) обязательств, определенных по итогам клиринга;
- Отчет о взносе в Гарантийный фонд, содержащий информацию об оценке имущества, отраженной на регистре учета взноса Участника клиринга в Гарантийный фонд, и размере требуемого взноса Участника клиринга в Гарантийный фонд.

38.4. В случае обнаружения ошибок Клиринговый центр имеет право сформировать и направить Участникам клиринга исправленные отчеты. При этом правильным отчетом считается отчет, имеющий более позднюю дату и время формирования отчета.

## РАЗДЕЛ VII ПРОЧИЕ УСЛОВИЯ

### Статья 39. Перевод обязательств и Средств обеспечения

- 39.1. Клиринговый центр осуществляет перевод долга и уступку требований одного Участника клиринга (далее – Базовый Участник клиринга) по обязательствам, допущенным к клирингу, учитываемым на обособленном клиентском регистре учета позиций, открытом для Обособленного клиента (далее – Перевод обязательств), другому Участнику клиринга (далее – Участник клиринга – реципиент) при наличии заявления на перевод обязательств и обеспечения (далее в настоящей статье Правил клиринга – Заявление), предоставляемого Обособленным клиентом. В Заявлении должны быть указаны наименование Участника клиринга – реципиента, которому Клиринговый центр должен осуществить Перевод обязательств, а также не менее чем одно из следующих оснований в отношении Базового Участника клиринга для осуществления Перевода обязательств:
- 39.1.1. основания, предусмотренные подпунктами 11.1.2, 11.1.4-11.1.10, 11.1.12, 11.1.13, пунктом 11.9 Правил клиринга;
  - 39.1.2. наличие дела о банкротстве в отношении Базового Участника клиринга в производстве арбитражного суда более 2 (двух) месяцев с момента подачи соответствующего заявления;
  - 39.1.3. нарушение Базовым Участником клиринга правил российских или иностранных организатора торгов или клиринговой организации;
  - 39.1.4. включение в повестку дня органов управления Базового Участника клиринга вопроса о ликвидации Базового Участника клиринга либо принятие решения органами управления Базового Участника клиринга о ликвидации Базового Участника клиринга;
  - 39.1.5. принятие органами управления Базового Участника клиринга решения о реорганизации Базового Участника клиринга (за исключением случаев реорганизации, которые не влекут прекращения деятельности Базового Участника клиринга);
  - 39.1.6. судебного акта о взыскании, наложении ареста либо ином обременении в отношении имущества Базового Участника клиринга;
  - 39.1.7. наличие задолженности Базового Участника клиринга по расчетному коду, не погашенной в установленные настоящими Правилами клиринга сроки.
- 39.2. Заявление об открытии обособленного клиентского денежного регистра обеспечения, предоставленное Базовым участником клиринга Клиринговому центру в порядке, предусмотренном пунктом 9.3 Правил клиринга, является основанием для перевода денежных средств в каждой валюте, составляющих Средства обеспечения, и учитываемых на обособленном клиентском денежном регистре обеспечения Базового Участника клиринга (далее – Перевод обеспечения) при подаче Обособленным клиентом Заявления в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга. Перевод обеспечения осуществляется одновременно с Переводом обязательств в порядке и на условиях, предусмотренных в настоящей статье Правил клиринга (далее – Перевод обязательств и обеспечения).
- 39.3. Перевод обязательств и обеспечения не осуществляется:



- 39.3.1. в случае принятия решения арбитражного суда о введении в отношении Базового Участника клиринга – некредитной организации одной из процедур банкротства;
- 39.3.2. в случае отзыва (аннулирования) Банком России лицензии на осуществление банковских операций у Базового Участника клиринга – кредитной организации;
- 39.3.3. при отсутствии согласия Участника клиринга – реципиента, предусмотренного в пункте 39.7 Правил клиринга.
- 39.4. Заявление предоставляется Обособленным клиентом на бумажном носителе вместе с копией документа, подтверждающего полномочия лица, подписавшего Заявление (в случае если такой документ не был предоставлен Клиринговому центру ранее).  
В случае если между Обособленным клиентом и Клиринговым центром предусмотрен обмен сообщениями с использованием Подсистемы ЭДО НКЦ или по системе SWIFT, Обособленный клиент вправе направить Заявление в форме сообщения с использованием Подсистемы ЭДО НКЦ или по системе SWIFT.  
Клиринговый центр не осуществляет проверку достоверности оснований для Перевода обязательств и обеспечения, указанных Обособленным клиентом в Заявлении. При этом Клиринговый центр вправе отказать Обособленному клиенту в исполнении Заявления при наличии информации об отсутствии указанных в Заявлении оснований. Клиринговый центр не несет ответственности за убытки, понесенные Базовым Участником клиринга/Обособленным клиентом в случае исполнения/неисполнения Клиринговым центром Заявления, поданного Обособленным клиентом в соответствии с пунктом 39.1 Правил клиринга.
- 39.5. В случае если между Обособленным клиентом и Клиринговым центром предусмотрен обмен сообщениями с использованием Подсистемы ЭДО НКЦ или по системе SWIFT, и Клиринговому центру стало известно о наступлении в отношении Базового Участника клиринга одного или нескольких оснований для Перевода обязательств и обеспечения, предусмотренных пунктом 39.1 Правил клиринга, а Заявление от Обособленного клиента не получено, Клиринговый центр вправе сообщить Обособленному клиенту о наличии таких оснований путем направления сообщения с использованием Подсистемы ЭДО НКЦ или по системе SWIFT.
- 39.6. При получении от Обособленного клиента Заявления и при отсутствии у Клирингового центра оснований для отказа в исполнении Заявления, Клиринговый центр передает с использованием Подсистемы ЭДО НКЦ Участнику клиринга – реципиенту сообщение о размере обязательств / требований Базового Участника клиринга, учитываемых на обособленном клиентском регистре учета позиций, и Средствах обеспечения в каждой валюте, учитываемых на обособленном клиентском денежном регистре обеспечения Обособленного клиента, подавшего Заявление.
- 39.7. Участник клиринга – реципиент обязан предоставить Клиринговому центру согласие на прием обязательств / требований Базового Участника клиринга по обязательствам, определенным в пункте 39.6 Правил клиринга (далее – Согласие на прием), не позднее 20:00 по московскому времени Рабочего дня получения информации от Клирингового центра в соответствии с пунктом 39.6 Правил клиринга. Указанное согласие направляется с использованием Подсистемы ЭДО НКЦ.  
Получение Клиринговым центром Согласия на прием предоставляет Участнику клиринга – реципиенту право требовать от Клирингового центра перевода Средств обеспечения в каждой валюте, учитываемых на обособленном

клиентском денежном регистре обеспечения Базового Участника клиринга, открытом для Обособленного клиента.

39.8. Для исполнения Заявления Клиринговый центр:

39.8.1. Незамедлительно после получения в соответствии с пунктом 39.7 Правил клиринга Согласия на прием уведомляет Биржу о необходимости установления запрета на подачу Базовым Участником клиринга заявок на заключение Договоров с указанием кода обособленного клиентского регистра учета позиций в Системе торгов Навигатор и с указанием соответствующих им разделов регистра учета позиций Обособленного клиента, с указанием которых допускается заключение Договоров в Системе торгов сектора Спектра, а также о необходимости снятия Заявок, поданных Базовым Участником клиринга с использованием указанных регистров учета позиций, и Активных заявок, поданных Базовым Участником клиринга с использованием разделов регистра учета позиций, с указанием которых допускается заключение Договоров в Системе торгов сектора Спектра.

39.8.2. После получения от Участника клиринга - реципиента Согласия на прием в соответствии с пунктом 39.7 Правил клиринга и до начала клиринговой сессии следующего Рабочего дня:

- открывает Участнику клиринга - реципиенту обособленные клиентские денежные регистры обеспечения и обособленный клиентский регистр учета позиций для Обособленного клиента, предоставившего Заявление;
- прекращает учет обязательств / требований, определенных в пункте 39.6 Правил клиринга, как обязательств и требований Базового Участника клиринга в отношении Клирингового центра;
- начинает учитывать обязательства / требования, определенные в пункте 39.6 Правил клиринга, как обязательства и требования Участника клиринга – реципиента в отношении Клирингового центра.

39.9. Обособленный клиент вправе до получения Клиринговым центром от Участника клиринга – реципиента Согласия на прием отозвать свое Заявление путем направления Клиринговому центру соответствующего заявления (далее – Заявление об отзыве). Заявление об отзыве предоставляется Обособленным клиентом на бумажном носителе вместе с копией документа, подтверждающего полномочия лица, подписавшего Заявление об отзыве (в случае если такой документ не был предоставлен Клиринговому центру ранее).

В случае если между Обособленным клиентом и Клиринговым центром предусмотрен обмен сообщениями с использованием Подсистемы ЭДО НКЦ или по системе SWIFT, Обособленный клиент вправе направить Заявление об отзыве в форме сообщения с использованием Подсистемы ЭДО НКЦ или по системе SWIFT.

39.10. Обособленный клиент вправе до получения Клиринговым центром от Участника клиринга – реципиента Согласия на прием заменить первоначально указанного Участника клиринга – реципиента на другого Участника клиринга – реципиента путем направления Клиринговому центру Заявления с указанием наименования нового Участника клиринга – реципиента. Такое Заявление должно содержать сведения, предусмотренные в пункте 39.1 Правил клиринга и предоставляться в порядке, предусмотренном настоящей статьей Правил клиринга.

**Статья 40. Порядок действий в случае включения Участника клиринга в перечень организаций, в отношении которых имеются сведения об их причастности к экстремистской деятельности или терроризму**

- 40.1. В дату включения Участника клиринга в перечень организаций, указанных в пункте 11.9 Правил клиринга (далее – Перечень), незамедлительно осуществляются следующие действия:
- 40.1.1. Клиринговый центр осуществляет действия, предусмотренные пунктом 32.3 Правил клиринга.
- 40.1.2. Обязательства указанного Участника клиринга, включая обязательства по Договорам, прекращаются в одностороннем порядке возникновением нетто-обязательства / нетто-требования указанного Участника клиринга, рассчитываемого в следующем порядке:  
Клиринговый центр рассчитывает величину, равную сумме с учетом знака рассчитанных в соответствующих валютах:
- суммы расходов Клирингового центра, связанных с прекращением Обязательств по Договорам Дефолтера, в том числе затрат, связанных с заключением Хеджирующих и Аукционных договоров, затрат, связанных с удовлетворением требований за счет Средств обеспечения Дефолтера (учитывается со знаком «минус»);
  - расчетной стоимости каждого Договора, учитываемого на регистре учета позиций Дефолтера, рассчитанной для Дефолтера на конец дня, в который принято решение о применении процедуры урегулирования неисполнения обязательств (дефолта) (учитывается с обратным знаком, который имеет расчетная стоимость).
  - Задолженностей по всем расчетным кодам (учитывается со знаком «минус»).
- При этом значения в иностранной валюте, рассчитанные в соответствии с настоящим подпунктом Правил клиринга, пересчитываются в российские рубли по курсу, установленному в соответствии с Методикой, на текущую дату.  
Если рассчитанная величина имеет отрицательный знак, это означает нетто-обязательство указанного Участника клиринга по отношению к Клиринговому центру в размере абсолютного значения данной величины. Если рассчитанная величина имеет положительный знак, это означает нетто-требование указанного Участника клиринга по отношению к Клиринговому центру в размере данной величины. Указанное нетто-обязательство / нетто-требование учитывается Клиринговым центром на основном собственном денежном регистре обеспечения в российских рублях. Указанное нетто-обязательство учитывается Клиринговым центром как Задолженность. Указанное нетто-обязательство / нетто-требование не подлежит включению в клиринговый пул в ходе проведения клиринговой сессии до исключения указанного Участника клиринга из Перечня.
- 40.1.3. Клиринговый центр изменяет учет денежных Средств обеспечения указанного Участника клиринга путем одновременного уменьшения значения всех денежных регистров обеспечения, не являющихся основными собственными денежными регистрами обеспечения, до нуля и соответствующего увеличения значения основных собственных денежных регистров обеспечения в тех же валютах;
- 40.1.4. Клиринговый центр блокирует (замораживает) денежные средства, учитываемые на счетах Клирингового центра в качестве Средств обеспечения Участника клиринга, денежные средства, учитываемые на счетах Клирингового центра в качестве взноса в Гарантийный фонд Участника клиринга, а также приостанавливает операции с указанными средствами и иные операции такого Участника клиринга, предусмотренные Правилами клиринга.
- 40.2. После исключения Участника клиринга из перечня:

- разблокирует (размораживает) денежные средства, учитываемые на счетах Клирингового центра в качестве Средств обеспечения Участника клиринга, денежные средства, учитываемые на счетах Клирингового центра в качестве вноса в Гарантийный фонд Участника клиринга, а также возобновляет операции с указанными средствами и иные операции такого Участника клиринга, предусмотренные Правилами клиринга;
- нетто-обязательство / нетто-требование данного Участника клиринга, определенное в соответствии с подпунктом 40.1.2 Правил клиринга и учитываемое на основном собственном денежном регистре обеспечения в российских рублях, подлежит включению в клиринговый пул и исполняется (прекращается) в порядке, установленном Правилами клиринга;
- Клиринговый центр прекращает допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию.

#### **Статья 41. Порядок урегулирования обязательств в случае прекращения допуска к клиринговому обслуживанию**

- 41.1. В случае отзыва (аннулирования) Банком России у Участника клиринга – Кредитной организации лицензии на осуществление банковских операций, допуск к клиринговому обслуживанию Участника клиринга - Кредитной организации прекращается с даты отзыва (аннулирования) Банком России у такого Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций, за исключением расчета Клиринговым центром нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга – Кредитной организации в соответствии с пунктом 41.4 Правил клиринга.
- 41.1.1. Подтверждением факта отзыва (аннулирования) лицензии на осуществление банковских операций у Участника клиринга - Кредитной организации является письменное уведомление Банка России, направленное Клиринговому центру (в том числе, посредством факсимильной связи) и/или размещенная Пресс-центром Банка России на сайте Банка России в сети Интернет информация о решении Банка России об отзыве (аннулировании) выданной Участнику клиринга - Кредитной организации лицензии на осуществление банковских операций и/или направленное Пресс-центром Банка России по электронному адресу Клирингового центра электронное сообщение, содержащее информацию об отзыве (аннулировании) у Участника клиринга - Кредитной организации лицензии на осуществление банковских операций.
- 41.1.2. В случае отзыва (аннулирования) лицензии на осуществление банковских операций у Участника клиринга – Кредитной организации, обязательства по Договорам, заключенным до даты отзыва (аннулирования) такой лицензии, прекращаются полностью на дату, предшествующую дате отзыва (аннулирования) лицензии на осуществление банковских операций у Участника клиринга – Кредитной организации. В целях настоящей статьи Правил клиринга под Договорами понимаются договоры, являющиеся производными финансовыми инструментами, договоры купли-продажи иностранной валюты, сделки типа своп, заключенные в соответствии с Правилами клиринга и (или) Правилами торгов.
- 41.1.3. Указанные обязательства прекращаются возникновением нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга – Кредитной организации, рассчитанного в соответствии с пунктом 41.4 Правил клиринга.

- 41.1.4. В случае отзыва (аннулирования) лицензии на осуществление банковских операций у Участника клиринга – Кредитной организации, Договоры, заключенные в дату отзыва (аннулирования) такой лицензии и (или) после нее, являются недействительными.  
Клиринговый центр вправе предъявить к Участнику клиринга – Кредитной организации требование о взыскании убытков, связанных с недействительностью указанных Договоров, а также неустоек (штрафов, пеней) и комиссионных вознаграждений, подлежащих уплате в соответствии с Правилами клиринга, в общем порядке, предусмотренном законодательством о несостоятельности (банкротстве).
- 41.1.5. Клиринговый центр направляет Участнику клиринга - Кредитной организации, у которого отозвана (аннулирована) лицензия на осуществление банковских операций, в форме электронного документа уведомление о прекращении обязательств по Договорам не позднее Рабочего дня, следующего за датой отзыва (аннулирования) такой лицензии.  
Клиринговый центр направляет такому Участнику клиринга - Кредитной организации в форме электронного документа уведомление о прекращении действия Договора об оказании клиринговых услуг.
- 41.1.6. Клиринговый центр в порядке, предусмотренном пунктом 41.4 Правил клиринга, рассчитывает сумму нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга – Кредитной организации и направляет такому Участнику клиринга в форме электронного документа уведомление о рассчитанной в соответствии с пунктом 41.4 Правил клиринга сумме нетто-обязательства или нетто-требования такого Участника клиринга.
- 41.1.7. Возврат денежных средств Участнику клиринга – Кредитной организации осуществляется Клиринговым центром не позднее 3 (трех) рабочих дней с даты прекращения Договора об оказании клиринговых услуг по реквизитам Счета для возврата в соответствующей валюте Участника клиринга, или по реквизитам, указанным в письме о возврате денежных средств, в случае если это письмо получено Клиринговым центром от уполномоченного органа Участника клиринга до момента перечисления Участнику клиринга денежных средств в соответствии с настоящим подпунктом Правил клиринга.  
Совместно с письмом о возврате денежных средств Клиринговому центру должны быть предоставлены документы, подтверждающие полномочия указанного органа Кредитной организации (если они ранее не были переданы Клиринговому центру).  
Возврат денежных средств в российских рублях Участнику клиринга – Кредитной организации осуществляется Клиринговым центром в сумме нетто-требования Участника клиринга, рассчитанного в порядке, предусмотренном пунктом 41.4 Правил клиринга, возврат денежных средств в иностранной валюте - в размере обязательств Клирингового центра по возврату Средств обеспечения / взноса в Гарантийный фонд Участника клиринга в соответствующей валюте, оставшихся после определения нетто-обязательства/ нетто-требования Участника клиринга в порядке, предусмотренном пунктом 41.4 Правил клиринга.
- 41.1.8. Клиринговый центр вправе предъявить к Участнику клиринга – Кредитной организации требование о взыскании нетто-обязательства Участника клиринга, рассчитанного в порядке, предусмотренном пунктом 41.4 Правил клиринга, в общем порядке, предусмотренном законодательством о несостоятельности (банкротстве).

- 41.2. В случае назначения временной администрации или принятия арбитражным судом решения о введении в отношении Участника клиринга – Некредитной организации одной из процедур банкротства, допуск к клиринговому обслуживанию Участника клиринга - Некредитной организации прекращается с даты назначения временной администрации или даты принятия арбитражным судом решения о введении в отношении Участника клиринга одной из процедур банкротства, в зависимости от того, какая дата наступила ранее, за исключением расчета Клиринговым центром нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга – Некредитной организации в соответствии с пунктом 41.5 или пунктом 41.6 Правил клиринга.
- 41.2.1. В случае назначения временной администрации или принятия арбитражным судом решения о введении в отношении Участника клиринга – Некредитной организации одной из процедур банкротства обязательства по Договорам прекращаются полностью в дату прекращения допуска к клиринговому обслуживанию или на дату, предшествующую дате принятия арбитражным судом решения о признании Участника клиринга банкротом и об открытии конкурсного производства, в зависимости от того, какая из указанных дат наступила ранее.
- 41.2.2. В случае введения в отношении Участника клиринга – Некредитной организации конкурсного производства, обязательства по Договорам прекращаются полностью в дату прекращения допуска к клиринговому обслуживанию или в дату, предшествующую дате введения конкурсного производства в зависимости от того, какая дата наступила ранее.  
Указанные обязательства по Договорам прекращаются возникновением нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга – Некредитной организации, рассчитанных в соответствии с пунктом 41.5 или пунктом 41.6 Правил клиринга.
- 41.2.3. Клиринговый центр направляет такому Участнику клиринга – Некредитной организации в форме электронного документа уведомление о прекращении обязательств по Договорам не позднее Рабочего дня, следующего за датой прекращения обязательств по указанным Договорам.  
Клиринговый центр направляет такому Участнику клиринга - Некредитной организации в форме электронного документа уведомление о прекращении действия Договора об оказании клиринговых услуг.
- 41.2.4. Клиринговый центр в порядке, предусмотренном пунктом 41.5 или пунктом 41.6 Правил клиринга, рассчитывает сумму нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга – Некредитной организации и направляет такому Участнику клиринга в форме электронного документа уведомление о рассчитанной в соответствии с пунктом 41.5 или пунктом 41.6 Правил клиринга сумме нетто-обязательства или нетто-требования Участника клиринга.
- 41.2.5. Возврат денежных средств Участнику клиринга – Некредитной организации осуществляется Клиринговым центром не позднее 3 (трех) рабочих дней с даты прекращения Договора об оказании клиринговых услуг по реквизитам Счета для возврата в соответствующей валюте Участника клиринга, или по реквизитам, указанным в письме о возврате денежных средств, в случае если это письмо получено Клиринговым центром от уполномоченного органа Участника клиринга до момента перечисления Участнику клиринга денежных средств в соответствии с настоящим подпунктом Правил клиринга.  
Совместно с письмом о возврате денежных средств Клиринговому центру должны быть предоставлены документы, подтверждающие полномочия

указанного органа Участника клиринга (если они ранее не были переданы Клиринговому центру).

Возврат денежных средств в российских рублях Участнику клиринга – Некредитной организации осуществляется Клиринговым центром в сумме нетто-требования Участника клиринга, рассчитанного в порядке, предусмотренном пунктом 41.5 или пунктом 41.6 Правил клиринга, возврат денежных средств в иностранной валюте - в размере обязательств Клирингового центра по возврату Средств обеспечения / взноса в Гарантийный фонд Участника клиринга в соответствующей валюте, оставшихся после определения нетто-обязательства/ нетто-требования Участника клиринга в порядке, предусмотренном пунктом 41.5 или пунктом 41.6 Правил клиринга.

- 41.2.6. Клиринговый центр вправе предъявить к Участнику клиринга – Некредитной организации требование о взыскании нетто-обязательства Участника клиринга, рассчитанного в порядке, предусмотренном пунктом 41.5 Правил клиринга, а также неустоек (штрафов, пеней), и комиссионных вознаграждений, подлежащих уплате в соответствии с Правилами клиринга, в общем порядке, предусмотренном законодательством о несостоятельности (банкротстве).
- 41.3. В случае отзыва (аннулирования) специального разрешения (лицензии или иного основания) компетентного органа государства учреждения Кредитной организации-нерезидента, в соответствии с которым Кредитная организация-нерезидент имеет право осуществлять банковские операции допуск к клиринговому обслуживанию Участника клиринга – Кредитной организации-нерезидента прекращается со дня, когда Клиринговый центр узнал об отзыве (аннулировании) специального разрешения (лицензии или иного основания) компетентного органа государства учреждения Кредитной организации-нерезидента, в соответствии с которым Кредитная организация-нерезидент имеет право осуществлять банковские операции, за исключением расчета Клиринговым центром нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга – Кредитной организации-нерезидента в соответствии с пунктом 41.7 Правил клиринга.
- 41.3.1. Подтверждением факта отзыва (аннулирования) указанного специального разрешения (лицензии или иного основания) компетентного органа государства учреждения Кредитной организации-нерезидента является письменное уведомление компетентного органа государства учреждения Кредитной организации-нерезидента, направленное Клиринговому центру (в том числе, посредством факсимильной связи) и/или размещенная компетентным органом государства учреждения Кредитной организации -нерезидента на сайте вышеуказанного компетентного органа в сети Интернет информация о принятом решении об отзыве (аннулировании) выданного Кредитной организации-нерезиденту специального разрешения (лицензии или иного основания), в соответствии с которым Кредитная организация -нерезидент имеет право осуществлять банковские операции, и/или направленное компетентным органом по электронному адресу Клирингового центра соответствующее электронное сообщение.
- 41.3.2. В случае отзыва (аннулирования) специального разрешения (лицензии или иного основания) компетентного органа государства учреждения Кредитной организации-нерезидента, в соответствии с которым Кредитная организация-нерезидент имеет право осуществлять банковские операции, обязательства Кредитной организации-нерезидента по Договорам прекращаются полностью в дату, в которую Клиринговый центр узнал об отзыве (аннулировании)

- компетентным органом государства учреждения Кредитной организации-нерезидента соответствующего специального разрешения (лицензии или иного основания).
- 41.3.3. Указанные обязательства прекращаются возникновением нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга – Кредитной организации-нерезидента, рассчитанных в соответствии с пунктом 41.7 Правил клиринга.  
Клиринговый центр направляет такому Участнику клиринга – Кредитной организации-нерезиденту в форме электронного документа уведомление о прекращении обязательств по Договорам не позднее Рабочего дня, следующего за датой прекращения обязательств по Договорам.  
Клиринговый центр направляет такому Участнику клиринга - кредитной организации в форме электронного документа уведомление о прекращении действия Договора об оказании клиринговых услуг.
- 41.3.4. Клиринговый центр в порядке, предусмотренном пунктом 41.7 Правил клиринга, рассчитывает сумму нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга – Кредитной организации-нерезидента и направляет такому Участнику клиринга в форме электронного документа уведомление о рассчитанной в соответствии с пунктом 41.7 Правил клиринга сумме нетто-обязательства или нетто-требования Участника клиринга.
- 41.3.5. Возврат денежных средств Участнику клиринга – Кредитной организации-нерезиденту осуществляется Клиринговым центром не позднее 3 (трех) рабочих дней с даты прекращения Договора об оказании клиринговых услуг по реквизитам Счета для возврата в соответствующей валюте Участника клиринга, или по реквизитам, указанным в письме о возврате денежных средств, в случае если это письмо получено Клиринговым центром от уполномоченного (в соответствии с национальным законодательством страны учреждения Кредитной организации-нерезидента) органа Кредитной организации-нерезидента до момента перечисления Участнику клиринга денежных средств в соответствии с настоящим подпунктом Правил клиринга.  
Возврат денежных средств в российских рублях Участнику клиринга – Кредитной организации-нерезиденту осуществляется Клиринговым центром в сумме нетто-требования Участника клиринга, рассчитанного в порядке, предусмотренном пунктом 41.7 Правил клиринга, возврат денежных средств в иностранной валюте - в размере обязательств Клирингового центра по возврату Средств обеспечения / взноса в Гарантийный фонд Участника клиринга в соответствующей валюте, оставшихся после определения нетто-обязательства Участника клиринга в порядке, предусмотренном пунктом 41.7 Правил клиринга.
- 41.3.6. Клиринговый центр вправе предъявить Участнику клиринга - Кредитной организации-нерезиденту требование об уплате денежных средств в сумме нетто-обязательства Участника клиринга в российских рублях, рассчитанного в соответствии с пунктом 41.7 Правил клиринга, в судебном порядке.
- 41.4. В случае отзыва (аннулирования) Банком России у Участника клиринга – кредитной организации лицензии на осуществление банковских операций Клиринговый центр рассчитывает размер нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в российских рублях в порядке, установленном подпунктами 41.4.1 - 41.4.2 Правил клиринга.
- 41.4.1. Клиринговый центр рассчитывает величину, равную сумме с учетом знака рассчитанных в соответствующих валютах:



- а) для каждого расчетного кода Требования к обеспечению по расчетному коду, рассчитанного на конец дня, предшествующего дате отзыва (аннулирования) у Кредитной организации лицензии на осуществление банковских операций (учитывается со знаком «минус»);
- б) сумм неисполненных обязательств Клирингового центра по Договорам, определенных на конец дня, предшествующего дате отзыва (аннулирования) у Кредитной организации лицензии на осуществление банковских операций (учитываются со знаком «плюс»);
- в) для каждого расчетного кода Задолженности по расчетному коду Участника клиринга перед Клиринговым центром, возникшей до даты отзыва (аннулирования) у Участника клиринга указанной лицензии, за исключением Задолженности по расчетному коду перед Клиринговым центром, возникшей в связи с неисполнением Участником клиринга обязательств по уплате комиссионного вознаграждения и неустоек (штрафов, пени) (учитывается со знаком «минус»);
- г) расчетной стоимости каждого Договора, учитываемого на регистре учета позиций Участника клиринга, рассчитанной на конец дня, предшествующего дате отзыва (аннулирования) у Кредитной организации лицензии на осуществление банковских операций (учитывается с обратным знаком, который имеет расчетная стоимость);
- д) расходов, связанных с прекращением или исполнением хеджирующих или связанных договоров или заключением замещающих договоров с третьими лицами (учитываются со знаком «минус»).

При этом значения в иностранной валюте, рассчитанные в соответствии с настоящим подпунктом Правил клиринга, пересчитываются в российские рубли по курсу, установленному Банком России на день отзыва у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций.

Если величина, рассчитанная в соответствии с настоящим подпунктом Правил клиринга, положительная это означает наличие нетто-требования Участника клиринга по отношению к Клиринговому центру, при этом расчет нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга прекращается, в ином случае расчет нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга продолжается в соответствии с подпунктом 41.4.2 Правил клиринга.

41.4.2. Клиринговый центр рассчитывает сумму с учетом знака отрицательной величины, рассчитанной в соответствии с подпунктом 41.4.1 Правил клиринга, и следующих величин, учитываемых на конец дня, предшествующего дате отзыва (аннулирования) у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций, в следующей очередности и размере:

- а) величины обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга его Средств обеспечения в российских рублях (учитывается со знаком «плюс»);
- б) величины обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга его взноса в Гарантийный фонд в российских рублях (учитывается со знаком «плюс»);
- в) величины, равной пересчитанной в российские рубли по курсу, установленному Банком России на день отзыва у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций, минимальной из следующих величин: (1) величины обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга его Средств обеспечения в иностранной валюте, и (2) абсолютного значения суммы, рассчитанной с учетом подпунктов а) и б) настоящего пункта, пересчитанной в соответствующую

иностранную валюту по курсу, установленному Банком России на день отзыва у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций (учитывается со знаком «плюс»);

- г) величины, равной пересчитанной в российские рубли по курсу, установленному Банком России на день отзыва у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций, минимальной из следующих величин: (1) величины обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга его взноса в Гарантийный фонд в иностранной валюте, и (2) абсолютного значения суммы, рассчитанной с учетом подпунктов а) - в) настоящего пункта, пересчитанной в соответствующую иностранную валюту по курсу, установленному Банком России на день отзыва у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций (учитывается со знаком «плюс»).

Расчет нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга прекращается, если в результате последовательного выполнения любого из действий, предусмотренных подпунктами а) - г) настоящего пункта Правил клиринга, полученная сумма является неотрицательной величиной.

Если сумма, рассчитанная в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга отрицательная, это означает наличие нетто-обязательства Участника клиринга по отношению к Клиринговому центру, если положительная - наличие нетто-требования Участника клиринга по отношению к Клиринговому центру.

Каждое из перечисленных выше обязательств, включенное в расчет нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга, в соответствующей части прекращается.

- 41.4.3. Информация о размере нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в российских рублях в отношении Клирингового центра, определенных в соответствии с подпунктами 41.4.1 - 41.4.2 Правил клиринга направляется Клиринговым центром Участнику клиринга в форме электронного документа.

- 41.5. В случае назначения временной администрации или принятия арбитражным судом решения о введении в отношении Участника клиринга - Некредитной организации одной из процедур банкротства (за исключением конкурсного производства), Клиринговый центр рассчитывает размер нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в российских рублях по состоянию на конец дня, в который назначена временная администрация или принято арбитражным судом решение о введении в отношении Участника клиринга - Некредитной организации одной из процедур банкротства (за исключением конкурсного производства), в зависимости от того, какая из указанных дат наступила ранее, в порядке, аналогичном порядку, предусмотренному пунктом 41.4 Правил клиринга.

В случае назначения временной администрации при расчете размера нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга учитываются комиссионные вознаграждения, подлежащие уплате Участником клиринга в соответствии с Правилами клиринга.

- 41.6. В случае принятия арбитражным судом решения о признании Участника клиринга – Некредитной организации банкротом и об открытии конкурсного производства, Клиринговый центр рассчитывает размер нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в российских рублях по состоянию на конец дня, предшествующего дате принятия арбитражным судом решения о признании Участника клиринга банкротом и об открытии конкурсного производства, в порядке, аналогичном порядку, предусмотренному пунктом 41.4 Правил клиринга.

41.7. В случае отзыва (аннулирования) специального разрешения (лицензии или иного основания) компетентного органа государства учреждения Кредитной организации-нерезидента, в соответствии с которым Кредитная организация-нерезидент имеет право осуществлять банковские операции, Клиринговый центр рассчитывает размер нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в порядке, установленном подпунктами 41.7.1 - 41.7.2 Правил клиринга.

41.7.1. Клиринговый центр рассчитывает величину, равную сумме с учетом знака рассчитанных в соответствующих валютах:

- а) для каждого расчетного кода Требования к обеспечению по расчетному коду, рассчитанного на конец дня, в который Клиринговый центр узнал об отзыве (аннулировании) у Кредитной организации-нерезидента специального разрешения (лицензии или иного основания) компетентного органа государства учреждения Кредитной организации-нерезидента, в соответствии с которым Кредитная организация-нерезидент имеет право осуществлять банковские операции (учитывается со знаком «минус»);
- б) сумм неисполненных обязательств Клирингового центра по Договорам, рассчитанных на конец дня, в который Клиринговый центр узнал об отзыве (аннулировании) у Кредитной организации-нерезидента специального разрешения (лицензии или иного основания) компетентного органа государства учреждения Кредитной организации-нерезидента, в соответствии с которым Кредитная организация-нерезидент имеет право осуществлять банковские операции (учитываются со знаком «плюс»);
- в) для каждого расчетного кода Задолженности по расчетному коду Участника клиринга перед Клиринговым центром, возникшей до дня, в который Клиринговый центр узнал об отзыве (аннулировании) у Участника клиринга специального разрешения (лицензии или иного основания) компетентного органа государства учреждения Кредитной организации-нерезидента, в соответствии с которым Кредитная организация-нерезидент имеет право осуществлять банковские операции, за исключением Задолженности по расчетному коду перед Клиринговым центром, возникшей в связи с неисполнением Участником клиринга обязательств по уплате комиссионного вознаграждения и неустоек (штрафов, пени) (учитывается со знаком «минус»);
- г) расчетной стоимости каждого Договора, учитываемого на регистре учета позиций Участника клиринга, рассчитанной на конец дня, в который Клиринговый центр узнал об отзыве (аннулировании) у Участника клиринга специального разрешения (лицензии или иного основания) компетентного органа государства учреждения Кредитной организации-нерезидента, в соответствии с которым Кредитная организация-нерезидент имеет право осуществлять банковские операции (учитывается с обратным знаком, который имеет расчетная стоимость);
- д) расходов, связанных с прекращением или исполнением хеджирующих или связанных договоров или заключением замещающих договоров с третьими лицами (учитываются со знаком «минус»).

При этом значения в иностранной валюте, рассчитанные в соответствии с настоящим подпунктом Правил клиринга, пересчитываются в российские рубли по курсу, установленному Банком России на день отзыва у Участника клиринга лицензии отзыва (аннулирования) специального разрешения (лицензии или иного основания) компетентного органа государства учреждения Кредитной

организации-нерезидента, в соответствии с которым Кредитная организация-нерезидент имеет право осуществлять банковские операции.

Если величина, рассчитанная в соответствии с настоящим подпунктом Правил клиринга, положительная, это означает наличие нетто-требования Участника клиринга по отношению к Клиринговому центру, при этом расчет нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга прекращается, если отрицательная – расчет нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга продолжается в соответствии с подпунктом 41.7.2 Правил клиринга.

- 41.7.2. Клиринговый центр рассчитывает сумму с учетом знака отрицательной величины, рассчитанной в соответствии с подпунктом 41.7.1 Правил клиринга, и следующих величин, учитываемых на конец дня, в который Клиринговый центр узнал об отзыве (аннулировании) у Кредитной организации-нерезидента специального разрешения (лицензии или иного основания) компетентного органа государства учреждения Кредитной организации-нерезидента, в следующей очередности и размере:
- а) величины обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга его Средств обеспечения в российских рублях (учитывается со знаком «плюс»);
  - б) величины обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга его взноса в Гарантийный фонд в российских рублях (учитывается со знаком «плюс»);
  - в) величины, равной пересчитанной в российские рубли по курсу, установленному Банком России на день, в который Клиринговый центр узнал об отзыве (аннулировании) у Кредитной организации-нерезидента специального разрешения (лицензии или иного основания) компетентного органа государства учреждения Кредитной организации-нерезидента, минимальной из следующих величин: (1) величины обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга его Средств обеспечения в иностранной валюте, и (2) абсолютного значения суммы, рассчитанной с учетом подпунктов а) и б) настоящего пункта Правил клиринга, пересчитанной в соответствующую иностранную валюту по курсу, установленному Банком России на день, в который Клиринговый центр узнал об отзыве (аннулировании) у Кредитной организации-нерезидента специального разрешения (лицензии или иного основания) компетентного органа государства учреждения Кредитной организации-нерезидента (учитывается со знаком «плюс»);
  - г) величины, равной пересчитанной в российские рубли по курсу, установленному Банком России на день, в который Клиринговый центр узнал об отзыве (аннулировании) у Кредитной организации-нерезидента специального разрешения (лицензии или иного основания) компетентного органа государства учреждения Кредитной организации-нерезидента, минимальной из следующих величин: (1) величины обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга его взноса в Гарантийный фонд в иностранной валюте, и (2) абсолютного значения суммы, рассчитанной с учетом подпунктов а) - в) настоящего пункта, пересчитанной в соответствующую иностранную валюту по курсу, установленному Банком России на день, в который Клиринговый центр узнал об отзыве (аннулировании) у Кредитной организации-нерезидента специального разрешения (лицензии или иного основания) компетентного органа государства учреждения Кредитной организации-нерезидента (учитывается со знаком «плюс»).

Расчет нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга прекращается, если в результате последовательного выполнения любого из действий, предусмотренных подпунктами а) - г) настоящего пункта Правил клиринга, полученная сумма является неотрицательной величиной.

Если сумма, рассчитанная в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга отрицательная, это означает наличие нетто-обязательства Участника клиринга по отношению к Клиринговому центру, если положительная - наличие нетто-требования Участника клиринга по отношению к Клиринговому центру.

Каждое из перечисленных выше обязательств, включенное в расчет нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга, в соответствующей части прекращается.

- 41.7.3. Информация о размере нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в российских рублях в отношении Клирингового центра, определенных в соответствии с пунктами 41.7.1 - 41.7.2 Правил клиринга направляется Клиринговым центром Участнику клиринга в форме электронного документа.
- 41.8. В случае отзыва (аннулирования) лицензии на осуществление банковских операций у Клирингового центра, обязательства по Договорам, заключенным до даты отзыва (аннулирования) такой лицензии, прекращаются полностью на дату, предшествующую дате отзыва (аннулирования) лицензии на осуществление банковских операций у Клирингового центра.
- Указанные обязательства прекращаются возникновением нетто-обязательств / нетто-требований Участников клиринга - сторон таких Договоров в отношении Клирингового центра, рассчитываемых в соответствии с пунктами 41.8.2 - 41.8.3 Правил клиринга.
- 41.8.1. В случае отзыва (аннулирования) лицензии на осуществление банковских операций у Клирингового центра, обязательства по Договорам, заключенным в дату отзыва (аннулирования) такой лицензии, являются недействительными.
- Участник клиринга вправе предъявить к Клиринговому центру требование о взыскании убытков, связанных с недействительностью указанных Договоров, а также неустоек (штрафов, пеней), подлежащих уплате в соответствии с Правилами клиринга, в общем порядке, предусмотренном законодательством о несостоятельности (банкротстве).
- 41.8.2. Участник клиринга рассчитывает величину, равную сумме с учетом знака рассчитанных в соответствующих валютах:
- а) сумм неисполненных обязательств Клирингового центра по Договорам, определенных на конец дня, предшествующего дате отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций (учитываются со знаком «плюс»);
  - б) для каждого расчетного кода Задолженности по расчетному коду Участника клиринга перед Клиринговым центром, возникшей до даты отзыва (аннулирования) у Клирингового центра указанной лицензии, за исключением Задолженности по расчетному коду перед Клиринговым центром, возникшей в связи с неисполнением Участником клиринга обязательств по уплате комиссионного вознаграждения и неустоек (штрафов, пени) (учитывается со знаком «минус»);
  - в) расчетной стоимости каждого Договора, учитываемого на регистре учета позиций Участника клиринга, рассчитанной на конец дня, предшествующего дате отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций. При определении расчетной стоимости Договора Участник клиринга может принимать во

внимание, действуя разумно и добросовестно, стоимость привлечения заемных средств и расходы или доходы, связанные с прекращением или исполнением хеджирующих или связанных договоров или заключением замещающих договоров с третьими лицами (в случае, если расчетная стоимость Договора подлежала бы выплате Клиринговым центром Участнику клиринга, такая стоимость учитывается для целей расчета нетто-обязательства / нетто-требования по настоящему пункту Правил клиринга со знаком плюс, а если расчетная стоимость Договора подлежала бы выплате Участником клиринга Клиринговому центру - со знаком минус).

При этом значения в иностранной валюте, рассчитанные в соответствии с настоящим подпунктом Правил клиринга, пересчитываются в российские рубли по курсу, установленному Банком России на день отзыва у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций.

Если величина, рассчитанная в соответствии с настоящим подпунктом Правил клиринга, положительная это означает наличие нетто-требования Участника клиринга по отношению к Клиринговому центру, при этом расчет нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга прекращается, если отрицательная – расчет нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга продолжается в соответствии с подпунктом 41.8.3 Правил клиринга.

41.8.3. Участник клиринга рассчитывает сумму с учетом знака отрицательной величины, рассчитанной в соответствии с подпунктом 41.8.2 Правил клиринга, и следующих величин, учитываемых на конец дня, предшествующего дате отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций, в следующей очередности и размере:

- а) величины обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга его Средств обеспечения в российских рублях (учитывается со знаком «плюс»);
- б) величины обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга его взноса в Гарантийный фонд в российских рублях (учитывается со знаком «плюс»);
- в) величины, равной пересчитанной в российские рубли по курсу, установленному Банком России на день отзыва у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций, минимальной из следующих величин: (1) величины обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга его Средств обеспечения в иностранной валюте, и (2) абсолютного значения суммы, рассчитанной с учетом подпунктов а) и б) настоящего пункта Правил клиринга, пересчитанной в соответствующую иностранную валюту по курсу, установленному Банком России на день отзыва у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций (учитывается со знаком «плюс»);
- г) величины, равной пересчитанной в российские рубли по курсу, установленному Банком России на день отзыва у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций, минимальной из следующих величин: (1) величины обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга его взноса в Гарантийный фонд в иностранной валюте, и (2) абсолютного значения суммы, рассчитанной с учетом подпунктов а) - в) настоящего пункта Правил клиринга, пересчитанной в соответствующую иностранную валюту по курсу, установленному Банком России на день отзыва у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций (учитывается со знаком «плюс»).

Расчет нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга прекращается, если в результате последовательного выполнения любого из действий, предусмотренных подпунктами а) - г) настоящего пункта Правил клиринга, полученная сумма является неотрицательной величиной.

Если сумма, рассчитанная в соответствии с настоящим подпунктом Правил клиринга отрицательная, это означает наличие нетто-обязательства Участника клиринга по отношению к Клиринговому центру, если положительная - наличие нетто-требования Участника клиринга по отношению к Клиринговому центру.

Каждое из перечисленных выше обязательств может приниматься в расчет нетто-обязательства / нетто-требования полностью или в части, при этом обязательство, включенное в расчет нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга, в соответствующей части прекращается.

- 41.8.4. Информация о размере нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в российских рублях в отношении Клирингового центра, определенных в соответствии с пунктами 41.8.2 - 41.8.3 Правил клиринга направляется Участником клиринга Клиринговому центру в форме электронного документа в течение 30 (тридцати) дней со дня отзыва у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций.

#### **Статья 42. Взаимодействие с Биржей при возникновении обстоятельств, которые могут повлиять на возможность проведения Торгов**

- 42.1. В случае возникновения обстоятельств, вызывающих и/или создающих предпосылки к возникновению сбоев (отказов) при эксплуатации Клиринговой системы и/или непосредственно препятствующие ее нормальному (штатному) функционированию, в том числе, обстоятельства непреодолимой силы, а также сбои, неисправности и отказы оборудования; сбои и ошибки программного обеспечения; сбои, неисправности и отказы систем связи, энергоснабжения, кондиционирования и других систем жизнеобеспечения, а также иные обстоятельства, такие как случаи нарушения правил разграничения доступа и/или попыток несанкционированного доступа к Клиринговой системе, Клиринговый центр незамедлительно уведомляет об этом Биржу и/или Расчетную организацию любым из доступных средств связи и предпринимает все возможные меры, направленные на устранение указанных обстоятельств.

#### **Статья 43. Чрезвычайные ситуации**

- 43.1. Чрезвычайной ситуацией может быть признана ситуация, связанная с наступлением обстоятельств, препятствующих клиринговому обслуживанию Участников клиринга, в том числе:

- обстоятельства, вызывающие и/или создающие предпосылки к возникновению сбоев (отказов) при эксплуатации Клиринговой системы и/или непосредственно препятствующие ее нормальному (штатному) функционированию, в том числе, обстоятельства непреодолимой силы, а также сбои, неисправности и отказы оборудования; сбои и ошибки программного обеспечения; сбои, неисправности и отказы систем связи, энергоснабжения, кондиционирования и других систем жизнеобеспечения, а также иные обстоятельства, такие как случаи нарушения правил разграничения доступа и/или попыток несанкционированного доступа к Клиринговой системе, последствия которых не устранены в течение 3 (трех) часов со времени окончания торгов;

- военные действия, акты террора, диверсии и саботажа, массовые беспорядки, забастовки, смена политического режима и другие политические осложнения;
  - изменения законодательных или иных актов государственных органов Российской Федерации, решений законодательных и исполнительных органов власти;
  - пожары или иные несчастные случаи, разрушения или значительные повреждения занимаемых Клиринговым центром помещений;
  - любые иные обстоятельства, которые создают или могут создать угрозу жизни или здоровью работников Клирингового центра;
  - получение сообщения Биржи о возникновении чрезвычайной ситуации, которая может привести к нарушению клирингового обслуживания Участников клиринга;
  - иные обстоятельства, препятствующие клиринговому обслуживанию Участников клиринга, которые, находятся вне контроля Клирингового центра.
- 43.2. Признание ситуации чрезвычайной осуществляется по решению Клирингового центра.
- 43.3. В случае признания ситуации чрезвычайной Клиринговый центр извещает Участников клиринга, Биржу, Расчетную организацию имеющимися доступными средствами связи о возникновении чрезвычайной ситуации и предпринимаемых в связи с этим действиях.
- 43.4. В качестве мер по урегулированию чрезвычайной ситуации (при необходимости по согласованию с Биржей) Клиринговым центром могут быть приняты следующие решения:
- об изменении времени проведения операций в Клиринговой системе и/или сроков осуществления документооборота в процессе взаимодействия Клирингового центра с Участниками клиринга, Расчетной организацией и Биржей;
  - об исключении из клирингового пула всех или некоторых обязательств, предусмотренных Правилами клиринга;
  - о переносе на следующий Рабочий день Даты исполнения обязательств Участников клиринга и Клирингового центра;
  - об осуществлении иных действий, направленных на урегулирование чрезвычайной ситуации.
- После принятия Клиринговым центром соответствующих решений по урегулированию чрезвычайной ситуации в Клиринговой системе производится корректировка соответствующих клиринговых регистров.
- В случае исключения из клирингового пула всех или некоторых обязательств, предусмотренных Правилами клиринга, в качестве меры по урегулированию чрезвычайной ситуации, Клиринговый центр направляет Участникам клиринга отчеты об обязательствах, исключенных из клирингового пула, в форме электронных документов с использованием Подсистемы ЭДО НКЦ.
- 43.5. При принятии решений по урегулированию чрезвычайных ситуаций (при необходимости по согласованию с Биржей) Клиринговый центр вправе:
- устанавливать сроки и порядок исполнения своих решений Участниками клиринга;
  - обуславливать порядок вступления в силу своих решений определенными обстоятельствами.



- 43.6. О мерах, предпринятых по решению Клирингового центра в целях урегулирования чрезвычайной ситуации, Участники клиринга и Биржа оповещаются имеющимися доступными средствами связи не позднее дня принятия данных мер.
- 43.7. Клиринговый центр не несет ответственности за убытки, которые могут возникнуть в связи с нарушением клирингового обслуживания Участников клиринга в случае признания ситуации чрезвычайной в связи с обстоятельствами, предусмотренными пунктом 43.1 Правил клиринга.

#### **Статья 44. Порядок разрешения споров**

- 44.1. Все споры и разногласия, возникшие между Участниками клиринга по любым вопросам, связанным с применением Правил клиринга, и/или с исполнением обязательств по итогам клиринга подлежат рассмотрению и разрешению в Арбитражной комиссии при Открытом акционерном обществе «Московская Биржа ММВБ-РТС» (далее – Арбитражная комиссия) в соответствии с документами, определяющими ее правовой статус и порядок разрешения споров, действующими на момент подачи искового заявления (за исключением споров и разногласий, стороной по которым является любая из компаний, входящих в Группу «Московская Биржа»).
- 44.2. Все споры и разногласия, возникающие Участником клиринга и любой из компаний, входящих в Группу «Московская Биржа» по любым вопросам, связанным с применением Правил клиринга, в связи с проведением клиринга (оказанием клиринговых и иных связанных с клирингом услуг) и/или с исполнением обязательств по итогам клиринга, подлежат рассмотрению и разрешению в Третейском суде НАУФОР в соответствии с его Регламентом, действующим на момент подачи искового заявления.
- 44.3. Решения Арбитражной комиссии/Третейского суда НАУФОР являются для спорящих сторон окончательными и обязательными для исполнения.
- 44.4. Неисполненное добровольно решение Арбитражной комиссии/Третейского суда НАУФОР подлежит принудительному исполнению в соответствии с законодательством РФ или законодательством страны места принудительного исполнения и международными соглашениями.

Приложение № 1

к Правилам клиринга

ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр»

на рынке Стандартизированных ПФИ

**Договор об оказании клиринговых услуг № \_\_\_\_\_**

город Москва

«\_\_» \_\_\_\_\_ 20\_\_ года

Участник клиринга (полное фирменное наименование)	
Клиринговая организация	Акционерный Коммерческий Банк «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое акционерное общество)

1. Клиринговая организация обязуется в соответствии с правилами клиринга оказывать участнику клиринга клиринговые и иные связанные с клирингом услуги, а участник клиринга обязуется оплачивать указанные услуги.
2. Состав услуг, условия и порядок их оказания, размер и порядок оплаты, а также иные права и обязанности сторон, связанные с клиринговым обслуживанием, устанавливаются правилами клиринга клиринговой организации. Клиринговая организация вправе утверждать различные правила клиринга, регламентирующие различные направления клиринговой деятельности.

	От имени участника клиринга	От имени клиринговой организации
ФИО		
Должность		
Основание полномочий		
Подпись, печать		

**Тарифы Клирингового центра за оказание клиринговых услуг**

	<b>Наименование операции</b>	<b>Тариф</b>	<b>Примечание</b>
1.	Клиринговые услуги, связанные с досрочным прекращением Договора, за Договор	5 000 руб., не облагается НДС	Списывается с денежного регистра обеспечения с расчетным кодом, которому соответствует код регистра учета позиций, на котором учитывается Договор, в день заключения Соглашения
2.	Клиринговые услуги, связанные с изменением условий Договора (в том числе опционного Договора), за Договор	5 000 руб., не облагается НДС	Списывается с денежного регистра обеспечения с расчетным кодом, которому соответствует код регистра учета позиций, на котором учитывается Договор, в день заключения Соглашения
3.	Клиринговые услуги, связанные с изменением условий опционного Договора, за опционный Договор	МАКС (0; КомКЦ2 – КомКЦ1), где КомКЦ1 – вознаграждение Клирингового центра, уплаченное при заключении Договора КомКЦ2 – вознаграждение Клирингового центра, рассчитанное в соответствии с пунктом 5 Тарифов на основании новых условий Договора	Списывается с денежного регистра обеспечения с расчетным кодом, которому соответствует код регистра учета позиций, на котором учитывается опционный Договор, в день заключения Соглашения
4.	Клиринговые услуги, связанные с изменением учета Договоров, за Договор	5 000 руб., не облагается НДС	Списывается с денежного регистра обеспечения с расчетным кодом, которому соответствует

		код регистра учета позиций, на котором был учтен Договор, до перевода в день изменения учета
5.	<p><b>Клиринговые услуги, связанные с исполнением Договоров, заключенных на рынке Стандартизированных ПФИ, за исключением опционных Договоров, НДС не облагается</b></p> <p>Вознаграждение Клирингового центра вычисляется по формуле:</p> $\text{КомКЦ} = k * \text{Max} (\text{Сбор}_{\text{min}}; K * n * N / 1\,000\,000),$ <p>где</p> <p>КомКЦ – вознаграждение Клирингового центра в российских рублях;</p> <p>Сбор<sub>min</sub> – величина, определенная в соответствии с настоящим разделом Тарифов в отношении каждого Договора;</p> <p>k, K – коэффициенты, значения которых установлены в отношении соответствующего вида Договора в настоящем разделе Тарифов;</p> <p>n – количество дней от даты заключения Договора до последнего Рабочего дня, в который должны исполняться обязательства по Договору в соответствии с его условиями ;</p> <p>N – Номинальная сумма Договора, руб.</p> <p><b>Клиринговые услуги, связанные с исполнением опционных Договоров, базовым активом которых являются индексы, заключенных на рынке Стандартизированных ПФИ, НДС не облагается</b></p> <p>Вознаграждение Клирингового центра вычисляется по формуле:</p> $\text{КомКЦ} = \text{Max} (\text{Сбор}_{\text{min}}; n * N * 300 / 365\,000\,000),$ <p>где</p> <p>КомКЦ – вознаграждение Клирингового центра в российских рублях;</p> <p>Сбор<sub>min</sub> – величина, определенная в соответствии с настоящим разделом Тарифов в отношении каждого Договора;</p> <p>n – количество дней от даты заключения опционного Договора до Даты истечения опционного Договора;</p> <p>N – Номинальная сумма Договора, руб.</p> <p><b>Клиринговые услуги, связанные с исполнением опционных Договоров, базовым активом которых является валюта, заключенных на рынке Стандартизированных ПФИ, НДС не облагается</b></p> <p>Вознаграждение Клирингового центра вычисляется по формуле:</p> $\text{КомКЦ} = \text{Max} (\text{Сбор}_{\text{min}}; N * (K_{\text{дельта}} + K_{\text{вега}}) / 1\,000\,000),$ <p>где</p> <p>КомКЦ – вознаграждение Клирингового центра в российских рублях;</p> <p>Сбор<sub>min</sub> – величина, определенная в соответствии с настоящим разделом Тарифов в отношении каждого Договора;</p>	

<p>N – Номинальная сумма Договора, руб.</p> <p><math>K_{\text{дельта}}</math> определяется на основании значения характеристики денежного состояния опционного Договора в соответствии со следующей таблицей:</p>																																																			
<table border="1"> <thead> <tr> <th colspan="7">Значение характеристики денежного состояния опционного Договора</th> </tr> <tr> <th></th> <th>Глубоко вне денег (Deer OTM)</th> <th>Вне денег (OTM)</th> <th>Около денег (ATM)</th> <th>В деньгах (ITM)</th> <th>Глубоко в деньгах (Deer ITM)</th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td><math>K_{\text{дельта}}</math> руб.</td> <td>20</td> <td>50</td> <td>100</td> <td>150</td> <td>200</td> <td></td> </tr> </tbody> </table>							Значение характеристики денежного состояния опционного Договора								Глубоко вне денег (Deer OTM)	Вне денег (OTM)	Около денег (ATM)	В деньгах (ITM)	Глубоко в деньгах (Deer ITM)		$K_{\text{дельта}}$ руб.	20	50	100	150	200																									
Значение характеристики денежного состояния опционного Договора																																																			
	Глубоко вне денег (Deer OTM)	Вне денег (OTM)	Около денег (ATM)	В деньгах (ITM)	Глубоко в деньгах (Deer ITM)																																														
$K_{\text{дельта}}$ руб.	20	50	100	150	200																																														
<p>Значение характеристики денежного состояния опционного Договора определяется на основании отношения форвардного курса Валютной пары опционного Договора к Цене исполнения опционного Договора и срока опционного Договора в соответствии со следующими таблицами:</p> <p>для опционного Договора с типом «колл»</p>																																																			
<table border="1"> <thead> <tr> <th colspan="7">Значение характеристики денежного состояния опционного Договора</th> </tr> <tr> <th>Срок опционного Договора</th> <th></th> <th>Глубоко вне денег (Deer OTM)</th> <th>Вне денег (OTM)</th> <th>Около денег (ATM)</th> <th>В деньгах (ITM)</th> <th>Глубоко в деньгах (Deer ITM)</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>Меньше или равно семи дней</td> <td rowspan="5">Forward/ Strike</td> <td>&lt;0.97</td> <td><math>0.97 \leq \text{и} \leq 0.99</math></td> <td><math>0.99 &lt; \text{и} &lt; 1.03</math></td> <td><math>1.03 \leq \text{и} \leq 1.05</math></td> <td>&gt;1.05</td> </tr> <tr> <td>Больше семи дней и меньше или равно одного месяца</td> <td>&lt;0.95</td> <td><math>0.95 \leq \text{и} \leq 0.98</math></td> <td><math>0.98 &lt; \text{и} &lt; 1.04</math></td> <td><math>1.04 \leq \text{и} \leq 1.07</math></td> <td>&gt;1.07</td> </tr> <tr> <td>Больше одного месяца и меньше или равно шести месяцев</td> <td>&lt;0.92</td> <td><math>0.92 \leq \text{и} \leq 0.96</math></td> <td><math>0.96 &lt; \text{и} &lt; 1.05</math></td> <td><math>1.05 \leq \text{и} \leq 1.10</math></td> <td>&gt;1.10</td> </tr> <tr> <td>Больше шести месяцев и меньше или равно одного двенадцати месяцев</td> <td>&lt;0.88</td> <td><math>0.88 \leq \text{и} \leq 0.94</math></td> <td><math>0.94 &lt; \text{и} &lt; 1.08</math></td> <td><math>1.08 \leq \text{и} \leq 1.14</math></td> <td>&gt;1.14</td> </tr> <tr> <td>Больше двенадцати месяцев и меньше или равно двадцати четырех месяцев</td> <td>&lt;0.84</td> <td><math>0.84 \leq \text{и} \leq 0.92</math></td> <td><math>0.92 &lt; \text{и} &lt; 1.11</math></td> <td><math>1.11 \leq \text{и} \leq 1.21</math></td> <td>&gt;1.21</td> </tr> </tbody> </table>							Значение характеристики денежного состояния опционного Договора							Срок опционного Договора		Глубоко вне денег (Deer OTM)	Вне денег (OTM)	Около денег (ATM)	В деньгах (ITM)	Глубоко в деньгах (Deer ITM)	Меньше или равно семи дней	Forward/ Strike	<0.97	$0.97 \leq \text{и} \leq 0.99$	$0.99 < \text{и} < 1.03$	$1.03 \leq \text{и} \leq 1.05$	>1.05	Больше семи дней и меньше или равно одного месяца	<0.95	$0.95 \leq \text{и} \leq 0.98$	$0.98 < \text{и} < 1.04$	$1.04 \leq \text{и} \leq 1.07$	>1.07	Больше одного месяца и меньше или равно шести месяцев	<0.92	$0.92 \leq \text{и} \leq 0.96$	$0.96 < \text{и} < 1.05$	$1.05 \leq \text{и} \leq 1.10$	>1.10	Больше шести месяцев и меньше или равно одного двенадцати месяцев	<0.88	$0.88 \leq \text{и} \leq 0.94$	$0.94 < \text{и} < 1.08$	$1.08 \leq \text{и} \leq 1.14$	>1.14	Больше двенадцати месяцев и меньше или равно двадцати четырех месяцев	<0.84	$0.84 \leq \text{и} \leq 0.92$	$0.92 < \text{и} < 1.11$	$1.11 \leq \text{и} \leq 1.21$	>1.21
Значение характеристики денежного состояния опционного Договора																																																			
Срок опционного Договора		Глубоко вне денег (Deer OTM)	Вне денег (OTM)	Около денег (ATM)	В деньгах (ITM)	Глубоко в деньгах (Deer ITM)																																													
Меньше или равно семи дней	Forward/ Strike	<0.97	$0.97 \leq \text{и} \leq 0.99$	$0.99 < \text{и} < 1.03$	$1.03 \leq \text{и} \leq 1.05$	>1.05																																													
Больше семи дней и меньше или равно одного месяца		<0.95	$0.95 \leq \text{и} \leq 0.98$	$0.98 < \text{и} < 1.04$	$1.04 \leq \text{и} \leq 1.07$	>1.07																																													
Больше одного месяца и меньше или равно шести месяцев		<0.92	$0.92 \leq \text{и} \leq 0.96$	$0.96 < \text{и} < 1.05$	$1.05 \leq \text{и} \leq 1.10$	>1.10																																													
Больше шести месяцев и меньше или равно одного двенадцати месяцев		<0.88	$0.88 \leq \text{и} \leq 0.94$	$0.94 < \text{и} < 1.08$	$1.08 \leq \text{и} \leq 1.14$	>1.14																																													
Больше двенадцати месяцев и меньше или равно двадцати четырех месяцев		<0.84	$0.84 \leq \text{и} \leq 0.92$	$0.92 < \text{и} < 1.11$	$1.11 \leq \text{и} \leq 1.21$	>1.21																																													
<p>для опционного Договора с типом «пут»</p>																																																			
<table border="1"> <thead> <tr> <th colspan="7">Значение характеристики денежного состояния опционного Договора</th> </tr> <tr> <th>Срок опционного Договора</th> <th></th> <th>Глубоко в деньгах (Deer ITM)</th> <th>В деньгах (ITM)</th> <th>Около денег (ATM)</th> <th>Вне денег (OTM)</th> <th>Глубоко вне денег (Deer OTM)</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> </tbody> </table>							Значение характеристики денежного состояния опционного Договора							Срок опционного Договора		Глубоко в деньгах (Deer ITM)	В деньгах (ITM)	Около денег (ATM)	Вне денег (OTM)	Глубоко вне денег (Deer OTM)																															
Значение характеристики денежного состояния опционного Договора																																																			
Срок опционного Договора		Глубоко в деньгах (Deer ITM)	В деньгах (ITM)	Около денег (ATM)	Вне денег (OTM)	Глубоко вне денег (Deer OTM)																																													

						OTM)
Меньше или равно семи дней	Forward/ Strike	<0.97	$0.97 \leq \text{и} \leq 0.99$	$0.99 < \text{и} < 1.03$	$1.03 \leq \text{и} \leq 1.05$	>1.05
Больше семи дней и меньше или равно одного месяца		<0.95	$0.95 \leq \text{и} \leq 0.98$	$0.98 < \text{и} < 1.04$	$1.04 \leq \text{и} \leq 1.07$	>1.07
Больше одного месяца и меньше или равно шести месяцев		<0.92	$0.92 \leq \text{и} \leq 0.96$	$0.96 < \text{и} < 1.05$	$1.05 \leq \text{и} \leq 1.10$	>1.10
Больше шести месяцев и меньше или равно одного двенадцати месяцев		<0.88	$0.88 \leq \text{и} \leq 0.94$	$0.94 < \text{и} < 1.08$	$1.08 \leq \text{и} \leq 1.14$	>1.14
Больше двенадцати месяцев и меньше или равно двадцати четырех месяцев		<0.84	$0.84 \leq \text{и} \leq 0.92$	$0.92 < \text{и} < 1.11$	$1.11 \leq \text{и} \leq 1.21$	>1.21

$K_{\text{вeга}}$  определяется на основании значения характеристики денежного состояния опционного Договора в соответствии со следующей таблицей:

	$K_{\text{вeга}}$ , руб.	
	Значение характеристики денежного состояния опционного Договора	
Срок опционного Договора	Около денег (ATM)	Глубоко вне денег (Deep OTM) или Вне денег (OTM) или В деньгах (ITM) или Глубоко в деньгах (Deep ITM)
Меньше или равно одного месяца	40	10
Больше одного месяца и меньше или равно шести месяцев	70	10
Больше шести месяцев и меньше или равно одного двенадцати месяцев	100	20
Больше двенадцати месяцев и меньше или равно двадцати четырех месяцев	140	70

Параметры, указанные в таблицах настоящего раздела Тарифов для опционных Договоров:

Strike – Цена исполнения опционного Договора;

Forward – значение форвардного курса Валютной пары опционного Договора на Дату истечения срока по опционному Договору, определяемого в соответствии с Методикой;

Срок опционного Договора – количество дней от даты заключения опционного Договора до Даты истечения срока по опционному Договору;

Количество дней в определенном количестве месяцев (далее в настоящем

	<p>приложении - период) определяется в следующем порядке:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• определяется месяц и год даты окончания периода путем прибавления к месяцу и году даты заключения опционного Договора определенного количества месяцев;</li> <li>• если в полученном месяце окончания периода есть число даты заключения опционного Договора, то это число является днем окончания периода, иначе днем окончания периода является ближайшее предшествующее число;</li> <li>• если полученная дата окончания периода не является рабочим днем, то датой окончания периода считается ближайший следующий рабочий день, а если этот ближайший следующий рабочий день является днем следующего месяца, то днем окончания периода считается ближайший предшествующий рабочий день. При этом, рабочим днем для целей определения даты окончания периода является Рабочий день, когда кредитные организации осуществляют банковские операции (в том числе на валютном рынке в соответствии со сложившейся на нем практикой) в каждой из валют, входящих в Валютную пару по опционному Договору, в Основных финансовых центрах;</li> <li>• количество дней в периоде равно количеству дней от даты заключения опционного Договора до полученной даты окончания периода.</li> </ul> <p>Порядок определения N:</p> <p>Если Договор содержит одну Номинальную сумму, то N равна Номинальной сумме Договора, при этом Номинальная сумма, выраженная в иностранной валюте, пересчитывается в российские рубли по курсу Банка России, установленному на день расчета комиссионного вознаграждения.</p> <p>Если Договор содержит две Номинальных суммы, то выбирается валюта Номинальной суммы Договора в соответствии со списком приоритетов валют Номинальных сумм, утвержденным Клиринговым центром. N равна Номинальной сумме Договора в выбранной валюте, при этом Номинальная сумма, выраженная в иностранной валюте, пересчитывается в российские рубли по курсу Банка России, установленному на день расчета комиссионного вознаграждения.</p> <p>Вознаграждение Клирингового центра подлежит списанию с денежного регистра обеспечения с кодом, которому соответствует код регистра учета позиций, на котором учитывается Договор, в день заключения Договора.</p> <table border="1" data-bbox="304 1429 1503 1906"> <thead> <tr> <th data-bbox="304 1429 992 1503">по Договорам</th> <th data-bbox="992 1429 1126 1503">k</th> <th data-bbox="1126 1429 1393 1503">Сбор<sub>min</sub></th> <th data-bbox="1393 1429 1503 1503">K</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td data-bbox="304 1503 992 1704">- по биржевым Договорам</td> <td data-bbox="992 1503 1126 1704">0,7</td> <td data-bbox="1126 1503 1393 1704">1000 (одна тысяча) российских рублей за Договор</td> <td data-bbox="1393 1503 1503 1704">0,41</td> </tr> <tr> <td data-bbox="304 1704 992 1906">- по внебиржевым Договорам, за исключением Аукционных договоров</td> <td data-bbox="992 1704 1126 1906">1</td> <td data-bbox="1126 1704 1393 1906">1000 (одна тысяча) российских рублей за Договор</td> <td data-bbox="1393 1704 1503 1906">0,33</td> </tr> </tbody> </table>	по Договорам	k	Сбор <sub>min</sub>	K	- по биржевым Договорам	0,7	1000 (одна тысяча) российских рублей за Договор	0,41	- по внебиржевым Договорам, за исключением Аукционных договоров	1	1000 (одна тысяча) российских рублей за Договор	0,33
по Договорам	k	Сбор <sub>min</sub>	K										
- по биржевым Договорам	0,7	1000 (одна тысяча) российских рублей за Договор	0,41										
- по внебиржевым Договорам, за исключением Аукционных договоров	1	1000 (одна тысяча) российских рублей за Договор	0,33										
6.	Штраф за неисполнение обязательств Участником клиринга, повлекшее применение процедуры урегулирования ситуации неисполнения обязательств												

	<p><math>5 * \text{Max} (\text{Сбор}_{\text{min}}; K * n * N / 1\,000\,000)</math></p> <p>за каждый Аукционный договор, заключенный Клиринговым центром с Участником клиринга, не являющимся Дефолтером.</p> <p>Подлежит списанию с основного собственного денежного регистра обеспечения в российских рублях в день заключения Аукционного договора.</p>
--	---



### **Процедура разрешения разногласий**

- 1) В случае возникновения споров, связанных с использованием АСП, стороны обязаны соблюсти претензионный порядок урегулирования споров.
- 2) В претензии указываются:
  - требования заявителя;
  - сумма претензии и ее обоснованный расчет, если претензия подлежит денежной оценке;
  - обстоятельства, на которых основываются требования, и доказательства, подтверждающие их;
  - перечень прилагаемых к претензии документов и других доказательств;
  - иные сведения, необходимые для урегулирования спора.
- 3) Претензия рассматривается в течение 7 (семи) рабочих дней со дня получения.
- 4) В ответе на претензию указываются признанные и непризнанные требования, содержащиеся в претензии.
- 5) При полном или частичном отказе в удовлетворении претензии в ответе на претензию указываются:
  - обоснованные мотивы отказа со ссылкой на соответствующие нормативные правовые акты;
  - доказательства, обосновывающие отказ;
  - перечень прилагаемых к ответу на претензию документов, других доказательств.
- 6) Претензия и ответ на претензию направляются в письменной форме, с использованием средств связи, обеспечивающих фиксирование их отправления, либо вручаются под расписку.
- 7) В случае полного или частичного отказа в удовлетворении претензии, фактического неудовлетворения претензии или неполучения в срок ответа на претензию спор подлежит рассмотрению в Арбитражной комиссии при ОАО Московская Биржа в соответствии с документами, определяющими ее правовой статус и порядок разрешения споров, действующими на момент подачи искового заявления.

**I Список документов, предоставляемых юридическим лицом, являющимся резидентом**

- 1) Анкета Участника клиринга, являющаяся приложением к Порядку предоставления информации и отчетности и размещенная на сайте Клирингового центра, в форме электронного документа (в случае если юридическое лицо не является Участником СЭД, то в форме электронного сообщения с подтверждением на бумажном носителе).
- 2) Копии учредительных документов юридического лица с изменениями и дополнениями с отметкой о регистрации федеральным органом исполнительной власти, уполномоченным на осуществление государственной регистрации юридических лиц. Указанные копии должны быть заверены федеральным органом исполнительной власти, уполномоченным на осуществление государственной регистрации юридических лиц, или нотариально (указанные документы не предоставляются государственными корпорациями).
- 3) Нотариально удостоверенные копии свидетельств о внесении записей в Единый государственный реестр юридических лиц (ЕГРЮЛ), выданных уполномоченным органом, осуществляющим государственную регистрацию юридических лиц, и подтверждающих факт внесения в ЕГРЮЛ записей о государственной регистрации юридического лица (либо о юридическом лице, зарегистрированном до 1 июля 2002 года), а также записей о государственной регистрации изменений, вносимых в учредительные документы юридического лица или листы записи ЕГРЮЛ.
- 4) Заверенная подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица копия свидетельства о постановке на учет в налоговом органе юридического лица.
- 5) Копия информационного письма или уведомления о присвоении кодов статистики, заверенная подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица.
- 6) Нотариально удостоверенная копия лицензии Банка России на осуществление банковских операций со средствами в рублях и иностранной валюте (для кредитных организаций).
- 7) Нотариально удостоверенные копии иных лицензий на право осуществления деятельности, подлежащей лицензированию (если имеются).
- 8) В отношении единоличного исполнительного органа (далее по тексту - руководитель):
  - нотариально удостоверенная копия письма Банка России с подтверждением согласования кандидатуры руководителя (для кредитных организаций и для некредитных организаций - профессиональных участников рынка ценных бумаг);
  - подлинник или нотариально удостоверенная копия решения уполномоченного органа юридического лица (также могут быть предоставлены нотариально удостоверенная выписка из решения или

- подлинник выписки, заверенный подписью лица, уполномоченного на подписание решения) об избрании (назначении) руководителя;
- копия документа, удостоверяющего личность руководителя, заверенная подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица, или письмо юридического лица, содержащее сведения о фамилии, имени, отчестве (при наличии), гражданстве, реквизитах документа, удостоверяющего личность, а также о дате и месте рождения, адресе места жительства (регистрации) или места пребывания, а также копия свидетельства о постановке на учет в налоговом органе (ИНН), заверенная подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица, либо письмо в произвольной форме с указанием ИНН (при наличии).
- 9) Оригинал доверенности, или нотариально удостоверенная копия, или копия, заверенная лицом, выдавшим указанную доверенность на представителя юридического лица, уполномоченного подписывать необходимые документы во взаимоотношениях с Клиринговым центром. В случае если доверенность предоставляет полномочия на совершение операций с денежными средствами или иным имуществом, дополнительно предоставляются:
- 10) копия документа, удостоверяющего личность представителя юридического лица, заверенная подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица, или письмо юридического лица, содержащее сведения о фамилии, имени, отчестве (при наличии), гражданстве, реквизитах документа, удостоверяющего личность, а также о дате и месте рождения, адресе места жительства (регистрации) или места пребывания, а также копия свидетельства о постановке на учет в налоговом органе (ИНН), заверенная подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица, либо письмо в произвольной форме с указанием ИНН (при наличии).
- 11) Карточка с образцами подписей и оттиска печати юридического лица, оформленная в соответствии с требованиями нормативных актов Банка России (либо нотариально удостоверенная копия карточки).
- 12) Подлинник или нотариально удостоверенная копия решения уполномоченного органа юридического лица (также могут быть предоставлены нотариально удостоверенная выписка из решения или подлинник выписки, заверенный подписью лица, уполномоченного на подписание решения) об одобрении сделок, заключаемых в соответствии с Правилами клиринга с Клиринговым центром, а также Договора об оказании клиринговых услуг в случае, если сделки/договор между юридическим лицом и Клиринговым центром в соответствии с требованиями действующего законодательства признаются сделками с заинтересованностью, в противном случае юридическое лицо предоставляет письмо об отсутствии признаков заинтересованности в указанных сделках (договорах).
- 13) Отзывы о деловой репутации юридического лица в соответствии с пунктом 6.6 Правил клиринга.
- 14) Согласие лиц, указанных в документах юридического лица, направляемых им в Клиринговый центр в соответствии с Правилами клиринга, на обработку персональных данных по форме, размещенной на сайте Клирингового центра (в случае если документы содержат персональные данные субъекта персональных данных в соответствии с Федеральным законом «О персональных данных» и если иное не вытекает из требований законодательства).

- 15) В случае если физическое лицо, на которое требуется предоставить копию документа, удостоверяющего личность, является иностранным гражданином (лицом без гражданства), то дополнительно необходимо предоставить:
- заверенную подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица копию документа, подтверждающего право иностранного гражданина (лица без гражданства) на пребывание (проживание) в Российской Федерации (вид на жительство, разрешение на временное проживание, виза, иной документ, подтверждающий в соответствии с законодательством Российской Федерации право иностранного гражданина или лица без гражданства на пребывание (проживание) в Российской Федерации);
  - заверенную подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица копию миграционной карты;
  - письмо со сведениями об адресе места жительства (регистрации) или места пребывания (если такая информация не содержится в иных документах, предоставленных в соответствии с настоящим списком).
- 16) Отчетность, указанная в пунктах 1) - 3) приложения № 5 к Правилам клиринга, в форме электронного документа (в случае если юридическое лицо не является Участником СЭД, то в форме электронного сообщения с подтверждением на бумажном носителе):
- кредитные организации предоставляют месячные формы отчетности на три последние отчетные даты, квартальные формы отчетности - на последнюю отчетную дату;
  - некредитные организации предоставляют квартальные формы отчетности за два последних отчетных квартала, месячные формы отчетности – на три последние отчетные даты;
  - для кредитных организаций, не являющихся профессиональными участниками рынка ценных бумаг, список аффилированных лиц (форма 0409051) актуальный по состоянию на дату предоставления документов<sup>1</sup>.
- 17) Анкета физического лица – бенефициарного владельца предоставляется в форме электронного сообщения с подтверждением на бумажном носителе за подписью руководителя юридического лица или иного уполномоченного лица (с приложением нотариально удостоверенной копии доверенности, подтверждающей полномочия лица на подписание данной анкеты) и печатью юридического лица в случае, если юридическое лицо не является Участником СЭД<sup>2</sup>.

---

<sup>1</sup> На дату предоставления списка аффилированных лиц сведения, содержащиеся в нем, должны соответствовать последней актуальной информации об аффилированных лицах, предоставленной в Банк России.

<sup>2</sup> Сведения о бенефициарных владельцах не предоставляются в случаях, перечисленных в статье 7 Федерального закона от 07.08.2001 №115-ФЗ «О противодействии легализации (отмыванию) доходов, полученных преступным путем, и финансированию терроризма».

В случае если владение юридическим лицом либо контроль за ним осуществляется через третьих лиц необходимо представить документы (при возможности их получения), подтверждающие право бенефициарного владельца в конечном счете прямо или косвенно (через третьих лиц) владеть (иметь преобладающее участие более 25 процентов в капитале) юридического лица либо имеет возможность

- 18) Анкета FATCA в форме электронного документа (в случае если юридическое лицо не является Участником СЭД, то в форме электронного сообщения с подтверждением на бумажном носителе), а также иные прилагаемые к Анкете FATCA документы и сведения, предоставляемые для целей FATCA, в том числе согласие на передачу информации в иностранный налоговый орган.
- 19) Иные документы, которые могут быть запрошены Клиринговым центром в необходимых случаях, также Клиринговый центр вправе потребовать уточнения информации, содержащейся в ранее предоставленных документах.

Документы, предоставляемые юридическим лицом, должны быть действительными на дату их предъявления Клиринговому центру.

К предоставляемым документам прилагается сопроводительное письмо с описью направляемых Клиринговому центру документов.

## **II Список документов, предоставляемых юридическим лицом, являющимся кредитной организацией-нерезидентом**

- 1) Анкета Участника клиринга, являющаяся приложением к Порядку предоставления информации и отчетности и размещенная на сайте Клирингового центра, в форме электронного документа (в случае если юридическое лицо не является Участником СЭД, то в форме электронного сообщения с подтверждением на бумажном носителе).
- 2) Опросная Анкета банка-нерезидента.
- 3) Действующие редакции учредительных документов и все изменения к ним.
- 4) Документ, подтверждающий государственную регистрацию юридического лица.
- 5) Документ о постановке на учет в налоговом органе юридического лица (при наличии).
- 6) Специальное разрешение (лицензия), выданное уполномоченным органом государства юридического лица, на право осуществления деятельности, осуществление которой в соответствии с национальным законодательством государства юридического лица возможно при наличии соответствующего специального разрешения уполномоченного органа.
- 7) В отношении лица, уполномоченного действовать от имени юридического лица в соответствии с учредительными документами (далее по тексту – руководитель):
  - документ, подтверждающий согласование кандидатуры руководителя юридического лица уполномоченным органом государства учреждения юридического лица (если такое согласование предусмотрено законодательством государства учреждения юридического лица);
  - документ уполномоченного органа юридического лица, подтверждающий избрание (назначение) руководителя;

---

контролировать действия юридического лица и/или ссылку на общедоступные источники информации. В случае невозможности представления подтверждающих документов и/или ссылки на общедоступные источники информации клиент представляет в Клиринговый Центр письмо о невозможности представления таких документов/ссылок.

- копия документа, удостоверяющего личность руководителя, или других документов, которые установлены федеральным законом или признаваемые в соответствии с международным договором Российской Федерации в качестве документа, удостоверяющего личность, а также копия свидетельства о постановке на учет в налоговом органе (ИНН), заверенная подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица, либо письмо в произвольной форме с указанием ИНН (при наличии).
- 8) Доверенности на представителей юридического лица, уполномоченных подписывать необходимые документы во взаимоотношениях с Клиринговым центром. В случае если доверенность предоставляет полномочия на совершение операций с денежными средствами или иным имуществом, дополнительно предоставляются:
- 9) копия документа, удостоверяющего личность представителя, или других документов, которые установлены федеральным законом или признаваемые в соответствии с международным договором Российской Федерации в качестве документа, удостоверяющего личность, а также копия свидетельства о постановке на учет в налоговом органе (ИНН), заверенная подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица, либо письмо в произвольной форме с указанием ИНН (при наличии).
- 10) Карточка или иной документ с образцами подписей лиц и оттиска печати юридического лица (оттиск печати проставляется при наличии).
- 11) Отзывы о деловой репутации юридического лица в соответствии с пунктом 6.6 Правил клиринга.
- 12) Согласие лиц, указанных в документах юридического лица, направляемых им в Клиринговый центр в соответствии с Правилами клиринга, на обработку персональных данных по форме, размещенной на сайте Клирингового центра (в случае если документы содержат персональные данные субъекта персональных данных в соответствии с Федеральным законом «О персональных данных» и если иное не вытекает из требований законодательства).
- 13) В случае если физическое лицо, на которое требуется предоставить копию документа, удостоверяющего личность, является иностранным гражданином (лицом без гражданства), то дополнительно необходимо предоставить:
- заверенную подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица копию документа, подтверждающего право иностранного гражданина (лица без гражданства) на пребывание (проживание) в Российской Федерации (вид на жительство, разрешение на временное проживание, виза, иной документ, подтверждающий в соответствии с законодательством Российской Федерации право иностранного гражданина или лица без гражданства на пребывание (проживание) в Российской Федерации);
  - заверенную подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица копию миграционной карты;
  - письмо со сведениями об адресе места жительства (регистрации) или места пребывания (если такая информация не содержится в иных документах, предоставленных в соответствии с настоящим списком).
- 14) Отчетность, указанную в пункте 4) приложения № 5 к Правилам клиринга в форме электронного документа (в случае если юридическое лицо не является Участником СЭД, то в форме электронного сообщения с подтверждением на бумажном носителе): месячные формы отчетности - на три последние отчетные даты, квартальные формы отчетности - на последнюю отчетную дату.

- 15) Анкета физического лица – бенефициарного владельца предоставляется в форме электронного сообщения с подтверждением на бумажном носителе за подписью руководителя юридического лица или иного уполномоченного лица (с приложением нотариально удостоверенной копии доверенности, подтверждающей полномочия лица на подписание данной анкеты) и печатью юридического лица и в электронном виде в случае, если юридическое лицо не является Участником СЭД<sup>3</sup>.
- 16) Анкета FATCA в форме электронного документа (в случае если юридическое лицо не является Участником СЭД, то в форме электронного сообщения с подтверждением на бумажном носителе), а также иные прилагаемые к Анкете FATCA документы и сведения, предоставляемые для целей FATCA, в том числе согласие на передачу информации в иностранный налоговый орган.
- 17) Иные документы, которые могут быть запрошены Клиринговым центром в необходимых случаях, также Клиринговый центр вправе потребовать уточнения информации, содержащейся в ранее предоставленных документах.

Документы (за исключением копий паспортов), составленные на территории иностранных государств, должны быть легализованы или апостилированы, если иное не предусмотрено международными договорами Российской Федерации.

Документы, составленные полностью или в какой-либо их части на иностранном языке (за исключением документов, удостоверяющих личности физических лиц, выданных компетентными органами иностранных государств, составленных на нескольких языках, включая русский язык), предоставляются с надлежащим образом заверенным переводом на русский язык.

Документы, предоставляемые юридическим лицом, должны быть действительными на дату их предъявления Клиринговому центру.

К предоставляемым документам прилагается сопроводительное письмо с описью направляемых Клиринговому центру документов.

---

<sup>3</sup> Сведения о бенефициарных владельцах не предоставляются в случаях, перечисленных в статье 7 Федерального закона от 07.08.2001 №115-ФЗ «О противодействии легализации (отмыванию) доходов, полученных преступным путем, и финансированию терроризма».

В случае если владение юридическим лицом либо контроль за ним осуществляется через третьих лиц необходимо представить документы (при возможности их получения), подтверждающие право бенефициарного владельца в конечном счете прямо или косвенно (через третьих лиц) владеть (иметь преобладающее участие более 25 процентов в капитале) юридического лица либо имеет возможность контролировать действия юридического лица и/или ссылку на общедоступные источники информации. В случае невозможности представления подтверждающих документов и/или ссылки на общедоступные источники информации клиент представляет в Клиринговый центр письмо о невозможности представления таких документов/ссылок.

## **Отчетность, предоставляемая Участниками клиринга Клиринговому центру**

- 1) Кредитные организации предоставляют Клиринговому центру:
  - оборотную ведомость по счетам бухгалтерского учета кредитной организации (форма 0409101) – ежемесячно;
  - информацию об обязательных нормативах и о других показателях деятельности кредитной организации (форма 0409135) – ежемесячно;
  - расчет собственных средств (капитала) («Базель III») (форма 0409123) – ежемесячно;
  - отчет о финансовых результатах кредитной организации (форма 0409102) – ежеквартально;
  - справку о численном значении норматива максимального размера риска на одного заемщика или группу связанных заемщиков (Н6) (по данным формы 0409118) – ежемесячно;
  - Кредитные организации, являющиеся профессиональными участниками рынка ценных бумаг, квартальный отчет профессионального участника рынка ценных бумаг (форма №1100) – ежеквартально;
  - Кредитные организации, не являющиеся профессиональными участниками рынка ценных бумаг, список аффилированных лиц (форма 0409051) – ежеквартально.
- 2) Некредитные организации предоставляют Клиринговому центру:
  - бухгалтерский баланс (форма 0710001) – ежеквартально;
  - отчет о финансовых результатах (форма 0710002) – ежеквартально;
  - расчет размера собственных средств (капитала) для профессиональных участников рынка ценных бумаг – ежемесячно;
  - квартальный отчет профессионального участника рынка ценных бумаг (форма №1100) – ежеквартально.
- 3) Участники клиринга (кредитные и некредитные организации, являющиеся резидентами) обязаны предоставлять отчетность, указанную в пунктах 1) - 2) настоящего приложения к Правилам клиринга, в следующие сроки:
  - расчет размера собственных средств (капитала) («Базель III») (форма 0409123) - не позднее 15 рабочего дня месяца, следующего за отчетным месяцем (кредитными организациями);
  - расчет размера собственных средств (капитала) - не позднее одного календарного месяца, следующего за отчетным месяцем (некредитными организациями);
  - оборотную ведомость по счетам бухгалтерского учета (форма 0409101) - не позднее 15 рабочего дня месяца, следующего за отчетным месяцем;
  - отчет о финансовых результатах (форма 0409102) - не позднее 15 рабочего дня месяца, следующего за отчетным кварталом;
  - бухгалтерский баланс некредитной организации (форма 0710001), отчет о финансовых результатах некредитной организации (форма 0710002) - не позднее 45 (сорока пяти) календарных дней, следующих за отчетным



кварталом, за исключением отчетности по состоянию на 1 января, которая предоставляется не позднее 15 апреля года, следующего за отчетным;

- информацию об обязательных нормативах и о других показателях деятельности кредитной организации (форма 0409135), справку о численном значении норматива максимального размера риска на одного заемщика или группу связанных заемщиков (Н6) кредитной организации (по данным формы 0409118) - не позднее 15 рабочего дня месяца, следующего за отчетным месяцем;
- квартальный отчет профессионального участника рынка ценных бумаг (форма №1100) - за I квартал - не позднее 25 мая текущего года; за II квартал - не позднее 25 августа текущего года; за III квартал - не позднее 25 ноября текущего года; за IV квартал - не позднее 25 апреля следующего года;
- список аффилированных лиц (форма 0409051) - не позднее 15 рабочего дня месяца, следующего за отчетным кварталом<sup>4</sup>.

4) Кредитные организации-нерезиденты не позднее 15 (пятнадцати) рабочих дней с даты сдачи ежеквартальной отчетности или с даты, определенной компетентным органом государства учреждения Нерезидента для сдачи отчетности (в случае если сроки сдачи отчетности устанавливаются компетентным органом государства учреждения Нерезидента) предоставляют Клиринговому центру:

- финансовую отчетность по МСФО или US GAAP на русском или английском языке - ежеквартально,
- документ, содержащий информацию о финансовых показателях, данные о величине и структуре активов и обязательств, финансовых результатах деятельности, величине собственных средств (капитала), отраженных в отчетности Кредитной организации-нерезидента – ежеквартально (по форме, установленной внутренним документом Клирингового центра, размещенном на Сайте Клирингового центра);
- документ, подтверждающий сведения о фактических и допустимых значениях обязательных нормативов деятельности, установленных компетентным органом государства учреждения Нерезидента – ежеквартально (в случае если в соответствии с личным законом Кредитной организации-нерезидента такие обязательные нормативы устанавливаются);

Кредитные организации-нерезиденты не позднее 15 (пятнадцати) рабочих дней с даты подписания отчетности организацией, проводившей аудит, предоставляют Клиринговому центру:

- заверенную аудитором финансовую отчетность по МСФО или US GAAP на русском или английском языке – ежегодно.

Форматы предоставления отчетности, указанной в настоящем приложении к Правилам клиринга, определены Порядком предоставления информации и отчетности.

---

<sup>4</sup> На дату предоставления списка аффилированных лиц сведения, содержащиеся в нем, должны соответствовать последней актуальной информации об аффилированных лицах, предоставленной в Банк России.

Документы, указанные в пункте 4) настоящего приложения к Правилам клиринга, должны быть апостилированы или легализованы в установленном порядке, переведены на русский язык. Верность перевода или подлинность подписи переводчика должна быть засвидетельствована нотариусом.

### Порядок расчета размера взноса в Гарантийный фонд

1) Минимальный размер взноса в Гарантийный фонд устанавливается равным 1000000 (одному миллиону) российских рублей.

2) Итоговый размер взноса в Гарантийный фонд вычисляется как сумма минимального размера взноса в Гарантийный фонд и переменной части, рассчитанной по формуле:

$$Float = \max(0; \Lambda * IM - Fixed), \text{ где}$$

*Float* - переменная часть взноса в Гарантийный фонд, округленная по правилам математического округления до величины, кратной 100 000 (ста тысячам) российских рублей;

*IM* - средняя величина суммы Требований к обеспечению по всем расчетным кодам Участника клиринга, определяемых в ходе клиринговой сессии, за период, устанавливаемый в соответствии с решением Клирингового центра (далее - среднее значение Требования к обеспечению Участника клиринга).

$\Lambda$  - коэффициент пропорциональности, определяемый следующим образом:

$$\Lambda = \max\left(0; \frac{Stress * \left(\sum_{i \in Max} IM_i\right) - RF}{\sum_{i \in ALL} IM_i}\right), \text{ где}$$

*Stress* - коэффициент, определяющий размер убытков в случае реализации стрессового сценария, устанавливаемый в соответствии с решением Клирингового центра;

$\sum_{i \in Max} IM_i$  - сумма средних значений Требования к обеспечению по первым *M* Участникам клиринга, упорядоченным по убыванию по величинам *IM*. Значение *M* устанавливается в соответствии с решением Клирингового центра;

$\sum_{i \in ALL} IM_i$  - сумма средних значений Требования к обеспечению всех Участников клиринга;

*RF* - величина, указанная в пункте 33.6 Правил клиринга;

*Fixed* - минимальный размер взноса в Гарантийный фонд.