

ФЕДЕРАЛЬНАЯ СЛУЖБА ПО  
ФИНАНСОВЫМ РЫНКАМ

**ЗАРЕГИСТРИРОВАНО**

Дата: "16" апреля 2013 г.

в реестре за № 13-856/пз-4

Заместитель  
руководителя: *Е.К. Денисов*



УТВЕРЖДЕНЫ

решением Наблюдательного совета  
ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр»

от «28» марта 2013 года (Протокол № 15)

Заместитель Председателя Наблюдательного совета  
ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр»



Денисов Ю.О.

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

Москва, 2013 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	11
Статья 4.	Конфиденциальность и персональные данные	13
Статья 5.	Порядок использования Аналога собственноручной подписи	14
Статья 6.	Клиринговые регистры	15
РАЗДЕЛ II.	ТРЕБОВАНИЯ К УЧАСТНИКАМ КЛИРИНГА	17
Статья 7.	Требования к Участникам клиринга	17
Статья 8.	Условия клирингового обслуживания. Порядок предоставления допуска к клиринговому обслуживанию	18
Статья 9.	Порядок регистрации Участников клиринга и их Клиентов	21
Статья 10.	Порядок приостановления и прекращения допуска к клиринговому обслуживанию	24
РАЗДЕЛ III.	МЕРЫ, НАПРАВЛЕННЫЕ НА УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ ПРИ ОСУЩЕСТВЛЕНИИ КЛИРИНГА	28
Статья 11.	Перечень мер, направленных на управление рисками при осуществлении клиринга	28
Статья 12.	Единый лимит и риск-параметры	28
РАЗДЕЛ IV.	ПОРЯДОК И УСЛОВИЯ ДОПУСКА ОБЯЗАТЕЛЬСТВ К КЛИРИНГУ	33
Статья 13.	Порядок взаимодействия с Администратором при подаче заявок и заключении Сделок	33
РАЗДЕЛ V.	ПОРЯДОК ПРОВЕДЕНИЯ КЛИРИНГА	38
Статья 14.	Порядок проведения клиринговых сессий	38
Статья 15.	Порядок внесения и возврата Обеспечения	40
Статья 16.	Порядок внесения и возврата взноса в Гарантийный фонд	44
Статья 17.	Порядок исполнения / прекращения обязательств по Сделкам и обязательств по возврату Гарантийных переводов	45
Статья 18.	Порядок урегулирования случаев неисполнения или ненадлежащего исполнения Участниками клиринга обязательств по Сделкам и Маржинальных требований	51
Статья 19.	Порядок использования и возмещения Гарантийного фонда	60
РАЗДЕЛ VI.	ПОРЯДОК ОПЛАТЫ УСЛУГ. ОТЧЕТЫ ПО ИТОГАМ КЛИРИНГА	63
Статья 20.	Порядок оплаты услуг Клирингового центра, Администратора и Технического центра	63
Статья 21.	Порядок предоставления отчетов по итогам клиринга	68

РАЗДЕЛ VII. ПРОЧИЕ УСЛОВИЯ	70
Статья 22. Порядок урегулирования обязательств в случае прекращения допуска к клиринговому обслуживанию	70
Статья 23. Взаимодействие с Администратором при возникновении обстоятельств, которые могут повлиять на возможность проведения торгов	78
Статья 24. Чрезвычайные ситуации	78
Статья 25. Порядок разрешения споров	80
Приложение № 1	81
Приложение № 2	82
Приложение № 3	85
Приложение № 4	87
Приложение № 5	94
Приложение № 6	97

## РАЗДЕЛ I. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ

Настоящие Правила клиринга ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр» на валютном рынке регулируют отношения, связанные с заключением и исполнением сделок по покупке и продаже иностранной валюты на торгах, организуемых ОАО Московская Биржа.

### Статья 1. Термины и определения

<b>Администратор Торговой системы ЕТС (Администратор) -</b>	валютная биржа, уполномоченная Банком России на выполнение специальных функций, определенных Правилами ЕТС. Администратором является Открытое акционерное общество «Московская Биржа ММВБ-РТС».
<b>Аналог собственноручной подписи / АСП –</b>	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. Аналогом собственноручной подписи признается Клиринговый идентификатор, позволяющий однозначно идентифицировать Участника клиринга или Клиринговый центр, направивший электронное сообщение и достоверно установить, что электронное сообщение исходит от Участника клиринга или Клирингового центра, которому присвоен данный Клиринговый идентификатор.
<b>Аутентификация -</b>	процедура подтверждения принадлежности АСП Участнику клиринга / Клиринговому центру.
<b>Банк – нерезидент Российской Федерации (Банк-нерезидент) -</b>	юридическое лицо, являющееся резидентом государства – стороны Соглашения о сотрудничестве в области организации интегрированного валютного рынка государств-членов Евразийского экономического сообщества, заключенного 25 января 2006 г. В Санкт-Петербурге, Российская Федерация (далее – Международное соглашение), которое на основании специального разрешения (лицензии или иного основания) компетентного органа Стороны Международного соглашения имеет право осуществлять банковские и валютные операции, предусмотренные национальным законодательством государства учреждения Банка – нерезидента, и которое в силу Международного соглашения имеет право на проведение межбанковских конверсионных операций на территории Российской Федерации.
<b>Биржевое свидетельство –</b>	документ, предоставляемый Клиринговым центром Участнику клиринга по итогам Торговых сессий ЕТС или по итогам Торговых и Дополнительной сессии ЕТС, содержащий информацию об Итоговых нетто-обязательствах и/или Итоговых нетто-требованиях, обязательстве / требовании Участника клиринга по возврату Гарантийных переводов.
<b>Гарантийный перевод -</b>	обеспечение Участника клиринга или Клирингового центра,

	рассчитываемое в порядке, предусмотренном Правилами клиринга и являющееся обеспечением исполнения обязательств по Сделкам, заключенным между данным Участником клиринга и Клиринговым центром.
<b>Гарантийный фонд -</b>	коллективное клиринговое обеспечение, сформированное Клиринговым центром за счет взносов Участников клиринга.
<b>Государственная корпорация -</b>	государственная корпорация, которая в соответствии с действующим законодательством Российской Федерации имеет право осуществлять банковские операции на территории Российской Федерации, включая куплю-продажу иностранной валюты.
<b>Дата исполнения -</b>	дата, в которую обязательства по Сделке должны быть исполнены в соответствии с условиями Сделки.
<b>Добросовестный участник клиринга -</b>	Участник клиринга, надлежащим образом исполнивший свои Итоговые нетто-обязательства перед Клиринговым центром.
<b>Договор о взаимодействии -</b>	Договор о взаимодействии при проведении торговых и дополнительных сессий Единой торговой сессии, заключенный между Банком России, Администратором и Клиринговым центром.
<b>Дополнительное обеспечение -</b>	величина в российских рублях, на которую уменьшается Единый лимит Участника клиринга, равная возможной сумме издержек Участника клиринга при неисполнении им своих Итоговых нетто-обязательств и заключении между таким Участником клиринга и Клиринговым центром сделок своп в ходе Дополнительной сессии ЕТС второго типа.
<b>Единый лимит -</b>	величина, рассчитываемая Клиринговым центром в российских рублях для каждого Участника клиринга, ограничивающая риски по Сделкам с частичным обеспечением, заключаемым Клиринговым центром с Участником клиринга, для которого рассчитан Единый лимит.
<b>Задолженность -</b>	Задолженность по комиссиям и/или Задолженность по сделкам и/или Задолженность по гарантийным переводам.
<b>Задолженность по гарантийным переводам -</b>	неисполненное обязательство (неисполненная часть обязательства) Участника клиринга в российских рублях по уплате Гарантийных переводов.
<b>Задолженность по комиссиям -</b>	неисполненное обязательство (неисполненная часть обязательства) Участника клиринга в российских рублях по уплате комиссионных вознаграждений.
<b>Задолженность по сделкам -</b>	Итоговое нетто-обязательство в российских рублях, не прекращенное после проведения зачета по итогам Дополнительной сессии ЕТС второго типа в порядке, определенном Правилами клиринга.
<b>Закон о клиринге -</b>	Федеральный закон от 07.02.2011 №7-ФЗ «О клиринге и клиринговой деятельности».
<b>Итоговое нетто-обязательство</b>	денежные обязательства в соответствующей валюте Участника клиринга перед Клиринговым центром, обязательства по

<b>Участника клиринга -</b>	которым не прекращены в результате зачета в ходе клиринга в соответствии с Правилами клиринга.
<b>Итоговое нетто-требование Участника клиринга -</b>	денежные требования в соответствующей валюте Участника клиринга к Клиринговому центру, обязательства по которым не прекращены в результате зачета в ходе клиринга в соответствии с Правилами клиринга.
<b>Клиент -</b>	юридическое или физическое лицо, зарегистрированное Клиринговым центром в качестве клиента Участника клиринга. Клиентом может быть как клиент Участника клиринга, так и клиент клиента Участника клиринга.
<b>Клиринговая система -</b>	подсистема программно-технического комплекса Технического центра, представляющая собой комплекс программно-технических средств, баз данных, телекоммуникационных средств, иного оборудования и программного обеспечения, с использованием которой обеспечивается осуществление Клиринговым центром клиринга.
<b>Клиринговый идентификатор -</b>	условное обозначение, однозначно определяющее Участника клиринга / Клиринговый центр.
<b>Клиринговый центр -</b>	ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр», действующий на основании лицензии на осуществление клиринговой деятельности и в соответствии с Законом о клиринге.
<b>Лимит, обеспеченный средствами фонда -</b>	величина в российских рублях, на которую увеличивается Единый лимит Участника клиринга, являющегося участником Гарантийного фонда, рассчитываемая в соответствии с Методикой лимитирования операций на валютном рынке.
<b>Маржинальное требование -</b>	требование Клирингового центра к Участнику клиринга об обеспечении обязательств по Сделкам, заключенным Клиринговым центром с Участником клиринга, предъявляемое в порядке и случае, определенных Правилами клиринга.
<b>Международная организация -</b>	юридическое лицо, учрежденное в соответствии с международным договором Российской Федерации и имеющее право осуществлять банковские операции, в том числе валютные операции, на территории Российской Федерации в соответствии с международными договорами Российской Федерации и законодательством Российской Федерации.
<b>Методика лимитирования операций на валютном рынке -</b>	внутренний документ Клирингового центра, устанавливающий порядок определения Лимитов, обеспеченных средствами фонда, для Участников клиринга, являющихся участниками Гарантийного фонда, и Торговых лимитов Участников клиринга, устанавливаемых на основании решения Клирингового центра.
<b>Методика определения риск-параметров валютного рынка -</b>	внутренний документ Клирингового центра, устанавливающий порядок определения риск-параметров валютного рынка ОАО Московская Биржа и параметров цены сделок своп, заключаемых в ходе Дополнительных сессий ЕТС.
<b>Недобросовестный участник клиринга -</b>	Участник клиринга, не исполнивший или ненадлежащим образом исполнивший свои Итоговые нетто-обязательства и/или Маржинальное требование и/или имеющий Задолженность

	перед Клиринговым центром.
<b>Нетто-обязательство Участника клиринга -</b>	сумма денежных средств в соответствующей валюте, представляющая собой превышение обязательств Участника клиринга по Сделкам над его требованиями к Клиринговому центру по Сделкам в данной валюте, определяемая по каждой Дате исполнения.
<b>Нетто-требование Участника клиринга -</b>	сумма денежных средств в соответствующей валюте, представляющая собой превышение требований Участника клиринга по Сделкам над его обязательствами перед Клиринговым центром по Сделкам в данной валюте, определяемая по каждой Дате исполнения.
<b>Обеспечение -</b>	индивидуальное клиринговое обеспечение Участника клиринга в российских рублях и/или денежные средства Участника клиринга в иностранной валюте (Обеспечение Участника клиринга в иностранной валюте), которые используются для обеспечения исполнения обязательств Участника клиринга по Сделкам, исполнения обязательств Участника клиринга по уплате комиссионных вознаграждений. Обеспечение может использоваться для исполнения обязательств Участника клиринга по Сделкам.
<b>Пароль -</b>	уникальная последовательность случайных чисел, используемая для аутентификации Участника клиринга или Клирингового центра.
<b>Подсистема ЭДО НКЦ -</b>	Подсистема Системы Электронного Документооборота ОАО ММВБ-РТС (далее – СЭД ОАО ММВБ-РТС), организатором которой является Клиринговый центр и которая используется Клиринговым центром для взаимодействия с участниками Подсистемы ЭДО НКЦ и Организатором СЭД. Подсистема ЭДО НКЦ представляет собой совокупность программного, информационного и аппаратного обеспечения Клирингового центра, Организатора СЭД и участников Подсистемы ЭДО НКЦ.
<b>Порядок предоставления информации и отчетности -</b>	внутренний документ Клирингового центра, устанавливающий состав, сроки и форматы предоставления информации и отчетности Участниками клиринга Клиринговому центру.
<b>Правила ЕТС -</b>	Правила проведения операций по покупке и продаже иностранной валюты на Единой торговой сессии (Правила организованных торгов), утвержденные уполномоченным органом Администратора и согласованные с Банком России.
<b>Правила клиринга -</b>	настоящие Правила клиринга ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр» на валютном рынке.
<b>Рабочий день -</b>	день, в том числе выходной или праздничный нерабочий день, в который Администратор проводит торги иностранными валютами на ЕТС.
<b>Расчетная организация -</b>	НКО ЗАО НРД.
<b>Расчетный банк -</b>	банк или небанковская кредитная организация, в том числе иностранная кредитная организация, в которой Клиринговым центром открыт корреспондентский счет для учета Обеспечения

	Участников клиринга в иностранной валюте.
<b>Расчетный день -</b>	день, который одновременно является Рабочим днем, а также рабочим днем в стране-эмитенте иностранной валюты и днем, включая выходной и праздничный нерабочий день по законодательству Российской Федерации, в который Расчетная организация осуществляет расчеты.
<b>Сайт Клирингового центра -</b>	сайт в сети Интернет по адресу <a href="http://www.nkcbank.ru">www.nkcbank.ru</a> , на котором осуществляется раскрытие информации Клиринговым центром.
<b>Сделка -</b>	сделка по покупке и продаже иностранной валюты, в том числе сделка своп, заключенная на ЕТС.
<b>Сделка с полным обеспечением -</b>	сделка по покупке и продаже иностранной валюты, заключенная на ЕТС, условием заключения которой является наличие Обеспечения Участника клиринга в размере, необходимом для исполнения обязательств по Сделке в полном объеме.
<b>Сделка с частичным обеспечением -</b>	сделка по покупке и продаже иностранной валюты, в том числе сделка своп, заключенная на ЕТС, условием заключения которой является достаточность Единого лимита Участника клиринга.
<b>Система «Клиент-КлирингБанк» -</b>	автоматизированная система дистанционного банковского и клирингового обслуживания, предназначенная для осуществления электронного документооборота между Участниками клиринга и Клиринговым центром.
<b>Счет для возврата денежных средств -</b>	зарегистрированный в Клиринговом центре счет в соответствующей валюте, открытый в банке на территории Российской Федерации или в банке за пределами территории Российской Федерации, и предназначенный для перечисления на него денежных средств с целью исполнения обязательств Клирингового центра по возврату денежных средств Участнику клиринга.
<b>Технический центр -</b>	Открытое акционерное общество «Московская Биржа ММВБ-РТС», обеспечивающее Участникам клиринга технический доступ к Клиринговой системе на основании соответствующего договора.
<b>Торговый лимит -</b>	величина (в российских рублях), ограничивающая сумму денежных средств Участника клиринга, учитываемых при расчете Единого лимита Участника клиринга; устанавливается на основании запроса Участника клиринга или на основании решения Клирингового центра в случаях и порядке, определенных Правилами клиринга.
<b>Уполномоченный участник торгов ЕТС -</b>	Участник клиринга, предоставляющий Клиринговому центру денежные средства путем заключения сделок своп в ходе Дополнительной сессии ЕТС второго типа на условиях, определенных в соответствии с Правилами клиринга, с целью исполнения Клиринговым центром своих обязательств по Сделкам перед Добросовестными участниками клиринга.
<b>Участник клиринга -</b>	юридическое лицо, которому Клиринговый центр оказывает клиринговые услуги на основании заключенного с ним Договора об оказании клиринговых услуг.

Термины, специально не определенные в Правилах клиринга, используются в значениях, установленных иными внутренними документами Клирингового центра, включая Методику определения риск-параметров валютного рынка, Правилами ЕТС, нормативными актами Банка России, нормативными правовыми актами федерального органа исполнительной власти по рынку ценных бумаг и иными нормативными правовыми актами Российской Федерации.

## **Статья 2. Общие положения**

- 2.1. Клиринговый центр осуществляет клиринг, выполняя функции центрального контрагента по всем Сделкам, заключаемым с Участниками клиринга в ходе Торговых сессий ЕТС и Дополнительных сессий ЕТС.
- 2.2. Перечень инструментов, по которым между Участниками клиринга и Клиринговым центром заключаются Сделки с частичным обеспечением и Сделки с полным обеспечением, устанавливается решением Клирингового центра и размещается на Сайте Клирингового центра.
- 2.3. В качестве способов обеспечения исполнения обязательств, допущенных к клирингу, Клиринговый центр использует индивидуальное клиринговое обеспечение Участников клиринга в российских рублях (Обеспечение Участников клиринга в российских рублях), коллективное клиринговое обеспечение (Гарантийный фонд), а также Обеспечение Участников клиринга в иностранной валюте.
- 2.4. Обеспечение Участника клиринга в иностранной валюте, является имуществом, переданным Участником клиринга Клиринговому центру для обеспечения исполнения обязательств Участника клиринга перед Клиринговым центром по Сделкам в соответствии с Правилами клиринга и для исполнения обязательств Участника клиринга перед Клиринговым центром по Сделкам и уплате комиссионных вознаграждений, а также для обеспечения исполнения нетто-обязательств Участника клиринга, определяемых в порядке и случаях, установленных статьей 22 Правил клиринга.
  - 2.4.1. Предельная доля иностранной валюты, принимаемой в Обеспечение Участника клиринга в иностранной валюте, составляет 100%.
- 2.5. Индивидуальное клиринговое обеспечение в российских рублях (Обеспечение Участников клиринга в российских рублях) учитывается на клиринговом банковском счете Клирингового центра, открытом в Расчетной организации и предназначенном для учета индивидуального клирингового обеспечения валютного рынка.
- 2.6. Коллективное клиринговое обеспечение (Гарантийный фонд) учитывается на клиринговом банковском счете Клирингового центра, открытом в Расчетной организации и предназначенном для учета коллективного клирингового обеспечения валютного рынка.
- 2.7. Обеспечение Участников клиринга в иностранной валюте учитывается на корреспондентских счетах Клирингового центра, открытых в Расчетных банках.

- 2.8. Информация о реквизитах клиринговых счетов Клирингового центра, предназначенных для учета индивидуального или коллективного клирингового обеспечения, и реквизиты корреспондентских счетов Клирингового центра, открытых в Расчетных банках и предназначенных для учета Обеспечения Участников клиринга в иностранной валюте, раскрываются 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 раскрытия соответствующей информации на Сайте Клирингового центра не позднее, чем за 3 (три) рабочих дня до введения этих изменений в действие.
- 2.9. Клиринговый центр вправе использовать в своих интересах денежные средства, составляющие индивидуальное и коллективное клиринговое обеспечение, а также Обеспечение Участников клиринга в иностранной валюте, с учетом ограничений, установленных внутренним документом Клирингового центра, определяющим критерии формирования инвестиционных активов Клирингового центра.
- Доходы от такого использования денежных средств, составляющих индивидуальное и коллективное клиринговое обеспечение, а также Обеспечения Участников клиринга в иностранной валюте, не включаются в состав индивидуального и коллективного клирингового обеспечения.
- 2.10. Обмен электронными документами между Участником клиринга и Клиринговым центром осуществляется посредством Подсистемы ЭДО НКЦ и/или системы «Клиент-КлирингБанк» и/или системы S.W.I.F.T. (в случаях, установленных Правилами клиринга).
- Порядок формирования и передачи электронных документов посредством Подсистемы ЭДО НКЦ предусмотрен Порядком организации электронного документооборота ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр» и Договором об обмене электронными документами, заключенным Участником клиринга с Клиринговым центром.
- Порядок формирования и передачи электронных документов посредством системы «Клиент-КлирингБанк» предусмотрен Договором об участии в системе «Клиент-КлирингБанк» ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр», заключенным Участником клиринга с Клиринговым центром.
- Электронные документы, направляемые посредством Подсистемы ЭДО НКЦ, формируются в формате, предусмотренном Порядком организации электронного документооборота ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр».
- Электронные документы, направляемые посредством Системы «Клиент-КлирингБанк», формируются исключительно средствами Системы «Клиент-КлирингБанк» в формате, поддерживаемом программным обеспечением Системы «Клиент-КлирингБанк».
- Электронные документы, направляемые посредством Системы S.W.I.F.T., формируются в форматах, установленных стандартами S.W.I.F.T., с учетом особенностей, установленных внутренними документами Клирингового центра.
- В случае несоответствия информации, содержащейся в электронном документе, направленном посредством Подсистемы ЭДО НКЦ, и электронном документе, направленном посредством системы «Клиент-КлирингБанк», и электронном

документе, направленном посредством системы S.W.I.F.T., Участники клиринга и Клиринговый центр в первую очередь руководствуются информацией, содержащейся в электронном документе, направленном посредством Подсистемы ЭДО НКЦ, во вторую - посредством системы «Клиент-КлирингБанк», в третью - посредством системы S.W.I.F.T.

- 2.11. Документы, направляемые Участником клиринга Клиринговому центру с использованием Клиринговой системы, являются электронными сообщениями, подписанными АСП Участника клиринга.

Документы и информация, получаемые Участником клиринга из Клиринговой системы, являются электронными сообщениями, подписанными АСП Клирингового центра.

Порядок использования АСП определен в статье 5 Правил клиринга.

- 2.12. Формы документов на бумажном носителе, предоставляемых Участниками клиринга Клиринговому центру в соответствии с Правилами клиринга, установлены документом «Формы документов, предоставляемых Участниками клиринга в соответствии с Правилами клиринга ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр» на валютном рынке», раскрываемом на Сайте Клирингового центра.

- 2.13. Клиринговый центр взаимодействует с Администратором в соответствии с заключенным договором, определяющим порядок и условия взаимодействия при осуществлении Клиринговым центром клиринга и иных функций, связанных с осуществлением клиринга по Сделкам, заключенным Участниками торгов, одновременно являющимися Участниками клиринга, а также при организации торгов на ЕТС Администратором.

- 2.14. Существуют следующие категории Участников клиринга: Участники клиринга категории «А», Участники клиринга категории «Б», Участники клиринга категории «В» и Участники клиринга категории «Г».

Участником клиринга категории «А» является Банк России.

Участниками клиринга категории «Б» являются кредитные организации – резиденты Российской Федерации (далее – кредитные организации), Государственные корпорации и Международные организации.

Участниками клиринга категории «В» являются юридические лица, являющиеся резидентами Российской Федерации и не являющиеся Участниками клиринга категорий «А» и «Б» (далее – некредитные организации).

Участниками клиринга категории «Г» являются Банки-нерезиденты.

- 2.15. Положения Правил клиринга распространяются на Банк России, если иные положения в отношении Банка России не предусмотрены Договором о взаимодействии.

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

- 3.1. Права и обязанности Участников клиринга и Клирингового центра определяются Договором об оказании клиринговых услуг и 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 и иных связанных с клирингом услуг, оказываемых Клиринговым центром Участникам клиринга в соответствии с Правилами клиринга, определен Тарифами Клирингового центра на валютном рынке, являющимися приложением № 2 к Правилам клиринга (далее – Тарифы Клирингового центра).
- 3.5. Порядок оплаты клиринговых и иных связанных с клирингом услуг Клирингового центра определен в статье 20 Правил клиринга.
- 3.6. Клиринговые и иные связанные с клирингом 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 расторжения 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 с момента заключения указанного Договора Участник клиринга не получил допуска к клиринговому обслуживанию, либо 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);
  - аннулирование специального разрешения (лицензии или иного основания),

выданного центральным (национальным) банком стороны Международного соглашения или иным органом государственного управления, который в соответствии с законодательством стороны Международного соглашения осуществляет валютное регулирование и банковский надзор (далее – компетентный орган), на основании которого Банк-нерезидент имеет право осуществлять банковские операции (для Банков-нерезидентов).

- 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. Если Участник клиринга является Банком-нерезидентом или Международной организацией, применимым правом, регулирующим Договор об оказании клиринговых услуг и связанные с ним отношения Участника клиринга и Клирингового центра, является законодательство Российской Федерации.

#### **Статья 4. Конфиденциальность и персональные данные**

- 4.1. Участник клиринга и Клиринговый центр обязуются рассматривать содержание Договора об оказании клиринговых услуг и условия заключенных Сделок как конфиденциальную информацию и не будут раскрывать ее третьим лицам (за исключением аудиторов Участника клиринга или Клирингового центра, уполномоченных государственных органов, Клиентов, в интересах которых заключены указанные сделки, 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 и Сделок, заключенных в рамках Договора об оказании клиринговых услуг, рассматриваются как конфиденциальные.
- 4.3. Участники клиринга соглашаются с тем, что Клиринговый центр на основании Договора о взаимодействии передает Банку России по его запросу информацию о ходе и итогах клиринга.
- 4.4. Участник клиринга / юридическое лицо подтверждают, что все персональные данные, передаваемые Участником клиринга / юридическим лицом и Клиринговым центром друг другу в соответствии с Правилами клиринга, в случае если это требуется в целях исполнения Договора об оказании клиринговых услуг, достоверны и получены от субъекта персональных данных в законном порядке и передаются с согласия субъекта персональных данных, в случае если такое согласие предусмотрено законодательством Российской Федерации.
- 4.5. Участник клиринга / юридическое лицо и/или Клиринговый центр обязуются не допускать распространения указанных персональных данных без согласия субъекта персональных данных или наличия иного законного основания, обеспечивать конфиденциальность персональных данных и безопасность персональных данных при их обработке в случаях, предусмотренных Правилами клиринга и законодательством Российской Федерации.

- 4.6. Положения, содержащиеся в пунктах 4.4-4.5 Правил клиринга, не распространяются на информацию, которая является общедоступной.

## **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 уполномоченным лицом Участника клиринга / Клирингового центра.
- 5.2. Клиринговый центр обеспечивает защищенность и целостность электронных сообщений Участника клиринга и Клирингового центра в результате применения комплекса организационных и технических мер.
- 5.3. 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 настоящим разделом.
- 5.4. Присвоение Клирингового идентификатора Участнику клиринга или Клиринговому центру осуществляется Клиринговым центром.  
Порядок присвоения Клирингового идентификатора Участнику клиринга определен пунктом 9.2 Правил клиринга.  
Включение информации о Клиринговом идентификаторе Участника клиринга в состав ежедневного Отчета о Клиринговых идентификаторах, считается уведомлением о присвоении Клирингового идентификатора Участнику клиринга.  
Сведения о присвоенных Клиринговых идентификаторах относятся к конфиденциальным и не подлежат передаче третьим лицам, за исключением Технического центра, которому такие сведения доступны в связи с проведением процедуры аутентификации. Участник клиринга и Клиринговый центр обеспечивают соблюдение требований о конфиденциальности и несут риск последствий, связанных с нарушением таких требований.
- 5.5. Процедура аутентификации осуществляется Техническим центром с использованием Клиринговой системы при осуществлении технического доступа Участника клиринга или Клирингового центра в Клиринговую систему через удаленное рабочее место Участника клиринга или Клирингового центра путем сопоставления введенных Клирингового идентификатора и пароля соответствующим Клиринговому идентификатору и паролю Участника клиринга / Клирингового центра, информация о которых содержится в базе данных Клиринговой системы.  
В случае успешного прохождения процедуры аутентификации Участник клиринга / Клиринговый центр получает возможность осуществления операций в Клиринговой системе.
- 5.6. При подаче (направлении) электронных сообщений, подписанных АСП, Технический центр с использованием Клиринговой системы осуществляет

идентификацию лица, подписавшего электронное сообщение, путем сопоставления АСП, содержащегося в электронном сообщении, Клиринговому идентификатору, присвоенному Участнику клиринга / Клиринговому центру, информация о котором содержится в базе данных Клиринговой системы.

- 5.7. Участник клиринга и Клиринговый центр соглашаются с тем, что Клиринговым центром могут быть изготовлены (распечатаны) копии подписанных АСП электронных сообщений на бумажном носителе, которые удостоверяются подписью уполномоченного лица Клирингового центра и являются бесспорным 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. По письменному запросу Участника клиринга Клиринговый центр предоставляет Участнику клиринга копию направленного Участником (Участнику) клиринга электронного сообщения, изготовленного (распечатанного) на бумажном носителе. Запрос Участника клиринга должен содержать дату, на которую, либо период времени, за который предоставляются электронные сообщения.
- 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 проводится техническая экспертиза в соответствии с приложением 3 к Правилам клиринга.
- 5.11. В случае, если по результатам технической экспертизы, проведенной в соответствии с приложением 3 к Правилам клиринга, конфликтная ситуация остается неурегулированной, то такая конфликтная ситуация подлежит рассмотрению в порядке, предусмотренном статьей 25 Правил клиринга.

## **Статья 6. Клиринговые регистры**

- 6.1. Клиринговый центр осуществляет внутренний учет, предусмотренный Законом о клиринге, на клиринговых регистрах. Клиринговые регистры ведутся Клиринговым центром в Клиринговой системе.
- 6.2. На клиринговых регистрах Клиринговый центр учитывает:
- Единый лимит каждого Участника клиринга;
  - Лимит, обеспеченный средствами фонда, каждого Участника клиринга для которого указанный лимит установлен;
  - Торговый лимит каждого Участника клиринга, для которого указанный Торговый лимит установлен;
  - обязанности и требования Участника клиринга по каждому обязательству по Сделке, допущенному к клирингу;
  - обязательства Участников клиринга и Клирингового центра по возврату Гарантийных переводов;

- Нетто-обязательство / Нетто-требование Участника клиринга в каждой валюте и с каждой Датой исполнения;
- Итоговое нетто-обязательство / Итоговое нетто-требование Участника клиринга в каждой валюте;
- Обеспечение Участника клиринга в каждой валюте;
- Маржинальное требование Участника клиринга (в случае наличия).

Указанный учет осуществляется Клиринговым центром в разрезе Расчетных кодов Участника клиринга.

- 6.3. Для каждого Участника клиринга Клиринговый центр также учитывает его взнос в Гарантийный фонд.
- 6.4. Порядок ведения клиринговых регистров определен в соответствующих статьях разделов IV и V Правил клиринга.

## РАЗДЕЛ II. ТРЕБОВАНИЯ К УЧАСТНИКАМ КЛИРИНГА

### Статья 7. Требования к Участникам клиринга

7.1. 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 приложении № 4 к Правилам клиринга;

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.

7.2. Юридическое лицо обязано предоставить иные документы, которые могут быть запрошены Клиринговым центром в необходимых случаях в целях, не противоречащих действующему законодательству Российской Федерации.

7.3. 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 настоящими Правилами клиринга не требуется.

7.4. Участник клиринга обязан ежегодно предоставлять Клиринговому центру Анкету Участника клиринга (клиента) (Регистрационную карточку) в форме электронного документа.

В случае изменения сведений, содержащихся в Анкете Участника клиринга (клиента) (Регистрационной карточке) 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 (клиента) (Регистрационную карточку) с обновленной информацией в форме электронного документа и соответствующие документы, подтверждающие такие изменения.

Форматы предоставления Участником клиринга Анкеты Участника клиринга (клиента) (Регистрационной карточки) определены Порядком предоставления информации и отчетности.

7.5. 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.

## **Статья 8. Условия клирингового обслуживания. Порядок предоставления допуска к клиринговому обслуживанию**

8.1. 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 банковских операций, выданную Банком России (для кредитных организаций);
- имеет специальное разрешение (лицензию или иное основание), выданное компетентным органом государства учреждения Банка-нерезидента, на основании которого Банк-нерезидент имеет право осуществлять банковские операции (для банков-нерезидентов);
- является участником Подсистемы ЭДО НКЦ;
- выполняет требования Клирингового центра по предоставлению информации и отчетности, предусмотренные пунктами 7.4-7.5 Правил клиринга;
- выполняет требования Клирингового центра к финансовой устойчивости Участника клиринга, предусмотренные пунктом 8.2 Правил клиринга;
- Участник клиринга - некредитная организация имеет собственные средства (капитал) не менее 180 000 000 (ста восьмидесяти миллионов) рублей;
- предоставил Клиринговому центру Перечень платежных реквизитов в форме электронного документа или документа на бумажном носителе, содержащий платежные реквизиты Счетов в российских рублях и в иностранной валюте для возврата денежных средств, учитываемых по основному Расчетному коду Участника клиринга.

В случае если владельцем Счета для возврата денежных средств, указанного в Перечне платежных реквизитов, является Клиент, Участник клиринга вместе с таким Перечнем платежных реквизитов предоставляет Клиринговому центру:

- Письмо об идентификации клиента;
- копию договора о брокерском обслуживании, заключенного между Клиентом и Участником клиринга, заверенную нотариально или Участником клиринга;
- иные документы (по требованию Клирингового центра).

В случае если Участник клиринга планирует получать клиринговые услуги только через свой(и) филиал(ы), Участнику клиринга необходимо предоставить платежные реквизиты только по своему (своим) филиалу(филиалам).

- 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 Сделкам с частичным обеспечением,

Маржинальные требования и/или иные обязательства Участника клиринга, возникающие из Правил клиринга.

8.2. Участник клиринга должен соответствовать следующим требованиям к финансовой устойчивости:

- кредитные организации и Банки-нерезиденты - соблюдать обязательные нормативы Банка России, установленные для кредитных организаций или обязательные нормативы, установленные компетентным органом государства учреждения Банка-нерезидента (в случае если в соответствии с национальным законодательством государства учреждения Банка-нерезидента такие обязательные нормативы устанавливаются);
- в деятельности Участников клиринга - кредитных организаций и Банков-нерезидентов 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, а также основания для отзыва Банком России лицензии на осуществление банковских операций в соответствии с законодательством Российской Федерации о банковской деятельности или основания для отзыва лицензии на осуществление банковских операций в соответствии с национальным законодательством государства учреждения Банка.

8.3. Участники клиринга должны соответствовать требованиям, приведенным в пунктах 8.1-8.2 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.

8.4. Клиринговый центр вправе не предоставлять допуск к клиринговому обслуживанию Участникам клиринга, не соответствующим следующим требованиям:

- 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;
- Государственные корпорации, Международные организации, некредитные организации – наличие по балансу на последнюю отчетную дату положительного финансового результата деятельности, определяемого как прибыль после налогообложения
- Банки-нерезиденты - наличие по финансовой отчетности на последнюю отчетную дату положительного финансового результата деятельности, определяемого как прибыль после налогообложения.

8.5. Допуск к клиринговому обслуживанию предоставляется Участнику клиринга Клиринговым центром в срок, не превышающий 5 (пяти) рабочих дней после выполнения Участником клиринга требований и условий, предусмотренных настоящей статьей Правил клиринга.

О факте предоставления Участнику клиринга допуска к клиринговому

обслуживанию Клиринговый центр извещает Участника клиринга и Администратора не позднее рабочего дня, следующего за днем предоставления допуска к клиринговому обслуживанию, направляя соответствующие уведомления в форме электронного документа.

- 8.6. Право участия в Гарантийном фонде имеют Участники клиринга категории «Б». Если Участник клиринга намерен участвовать в Гарантийном фонде, ему необходимо предоставить Клиринговому центру Заявление на участие в Гарантийном фонде.
- 8.7. Размер собственных средств (капитала) Участников клиринга, являющихся или намеревающихся стать участниками Гарантийного фонда, рассчитанный на момент вступления в Гарантийный фонд и в течение всего времени участия в Гарантийном фонде должен составлять не менее 400 000 000 (четырёхсот миллионов) российских рублей для Участников клиринга, являющихся банками, и не менее 200 000 000 (двухсот миллионов) российских рублей для Участников клиринга - небанковских кредитных организаций.
- 8.8. Клиринговый центр рассматривает Заявление на участие в Гарантийном фонде, полученное от Участника клиринга, и принимает решение о принятии или отказе в принятии Участника клиринга в Гарантийный фонд. Клиринговый центр уведомляет Участника клиринга о принятии или отказе в принятии его в Гарантийный фонд в течение 2 (двух) рабочих дней со дня принятия такого решения путем направления информационного письма в адрес Участника клиринга в форме электронного документа.
- 8.9. Клиринговый центр вправе принять решение о прекращении участия в Гарантийном фонде Участника клиринга в случае нарушения им требований для участия в Гарантийном фонде, установленных Правилами клиринга. Клиринговый центр уведомляет Участника клиринга о прекращении его участия в Гарантийном фонде и дате прекращения его участия в Гарантийном фонде не позднее рабочего дня, следующего за днем принятия такого решения, путем направления информационного письма в адрес Участника клиринга в форме электронного документа.
- 8.10. В случае необходимости изменения реквизитов Счетов для возврата денежных средств, Участник клиринга направляет Клиринговому центру реквизиты новых Счетов для возврата денежных средств в форме электронного документа или документа на бумажном носителе не позднее, чем за три рабочих дня до даты начала проведения операций с использованием новых Счетов для возврата денежных средств. В случае если владельцем Счета для возврата денежных средств, указанного в Перечне платежных реквизитов, является Клиент, Участник клиринга вместе с таким Перечнем платежных реквизитов предоставляет Клиринговому центру:
- Письмо об идентификации клиента;
  - копию договора о брокерском обслуживании, заключенного между Клиентом и Участником клиринга, заверенную нотариально или Участником клиринга;
  - иные документы (по требованию Клирингового центра).

- 8.11. Участники клиринга обязаны по запросу Клирингового центра не позднее следующего рабочего дня со дня получения запроса предоставить Клиринговому центру информацию, содержащую:
- сведения о наличии или отсутствии у Участника клиринга неисполненных обязательств перед кредиторами, вкладчиками и (или) по уплате обязательных платежей в связи с отсутствием или недостаточностью денежных средств на его счетах;
  - Участники клиринга – кредитные организации - иные сведения, свидетельствующие о наличии или отсутствии в деятельности Участника клиринга оснований для осуществления мер по предупреждению банкротства, указанных в законодательстве Российской Федерации о несостоятельности (банкротстве) кредитных организаций, для отзыва Банком России лицензии на осуществление банковских операций в соответствии с законодательством Российской Федерации о банковской деятельности;
  - Участники клиринга – Банки-нерезиденты – иные сведения, свидетельствующие о наличии или отсутствии в деятельности Банка-нерезидента оснований для осуществления мер по предупреждению банкротства в соответствии с национальным законодательством государства учреждения Банка-нерезидента, а также основания для отзыва лицензии на осуществления банковских операций в соответствии с национальным законодательством государства учреждения Банка-нерезидента;
  - Участники клиринга – некредитные организации - иные сведения, свидетельствующие о наличии или отсутствии в деятельности Участника клиринга оснований для осуществления мер по предупреждению банкротства, указанных в законодательстве Российской Федерации о несостоятельности (банкротстве).

## **Статья 9. Порядок регистрации Участников клиринга и их Клиентов**

- 9.1. Клиринговый центр осуществляет регистрацию Участников клиринга и их Клиентов и присваивает каждому Участнику клиринга / Клиенту Расчетный код или код Клиента, соответственно.
- 9.1.1. Участнику клиринга соответствует один основной Регистрационный код (идентификатор), присвоенный Участнику клиринга Администратором.
- 9.1.2. Администратором Участнику клиринга могут быть присвоены дополнительные Регистрационные коды (идентификаторы). При этом заключение нового Договора об оказании клиринговых услуг не требуется.
- 9.1.3. При получении от Администратора информации о присвоении Участнику клиринга Регистрационного кода (идентификатора), Участнику клиринга Клиринговым центром присваивается основной Расчетный код в рамках Регистрационного кода (идентификатора) (основного или дополнительного).
- 9.1.4. На основании заявления Участника клиринга, предоставленного Клиринговому центру, Участнику клиринга может быть присвоен дополнительный Расчетный код в рамках одного Регистрационного кода (идентификатора) (основного или дополнительного).
- Заявление о присвоении дополнительного Расчетного кода направляется Клиринговому центру в форме электронного документа.

Заявление о присвоении дополнительного Расчетного кода должно содержать платежные реквизиты для регистрации Счетов для возврата денежных средств для данного дополнительного Расчетного кода.

В случае если владельцем Счета для возврата денежных средств, указанного в Заявлении о присвоении дополнительного Расчетного кода, является Клиент, Участник клиринга вместе с таким заявлением предоставляет Клиринговому центру:

- Письмо об идентификации клиента;
- копию договора о брокерском обслуживании, заключенного между Клиентом и Участником клиринга, заверенную нотариально или Участником клиринга;
- иные документы (по требованию Клирингового центра).

9.1.5. Клиринговый центр информирует Участника клиринга о присвоенном ему Расчетном коде не позднее рабочего дня, следующего за днем присвоения Расчетного кода, посредством Подсистемы ЭДО НКЦ, если на момент присвоения Участнику клиринга Расчетного кода Участник клиринга является участником Подсистемы ЭДО НКЦ, либо путем направления Участнику клиринга уведомления на бумажном носителе.

9.1.6. Внесение Участником клиринга денежных средств в Обеспечение, уплата комиссионных вознаграждений и расчеты с Клиринговым центром осуществляются отдельно по Расчетному коду Участника клиринга.

9.1.7. Расчет Единого лимита, определение Нетто-обязательств / Нетто-требований, Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований, Задолженностей Участника клиринга, проверка возможности регистрации заявок, перечисление и учет денежных средств Участника клиринга, исполнение (прекращение) обязательств по Сделкам, возникновение и прекращение Маржинального требования, заключение и исполнение Сделок в ходе Дополнительных сессий ЕТС первого и второго типа, уплата комиссионных вознаграждений осуществляется по Расчетному коду Участника клиринга.

9.1.8. Аннулирование основного и дополнительных Расчетных кодов, присвоенных Участнику клиринга в рамках Регистрационного кода (идентификатора), осуществляется на основании полученного от Администратора уведомления о прекращении допуска к торгам на ЕТС Участника клиринга, являющегося Участником торгов ЕТС, по такому Регистрационному коду (идентификатору).

Аннулирование присвоенного Участнику клиринга дополнительного Расчетного кода осуществляется на основании письма от Участника клиринга.

9.1.9. Аннулирование присвоенного Участнику клиринга основного или дополнительного Расчетного кода осуществляется при условии отсутствия у Участника клиринга неисполненных обязательств, учитываемых по такому Расчетному коду.

9.1.10. При аннулировании присвоенного Участнику клиринга Расчетного кода Клиринговый центр в течение 3 (трех) банковских дней после получения соответствующего уведомления от Администратора или письма от Участника клиринга, осуществляет возврат Обеспечения Участнику клиринга в соответствующей валюте, учитываемого по данному Расчетному коду, на Счета для возврата денежных средств, зарегистрированные в Клиринговом центре для данного Расчетного кода.

- 9.1.11. Клиринговый центр информирует Участника клиринга об аннулировании Расчетного кода не позднее рабочего дня, следующего за днем его аннулирования, посредством Подсистемы ЭДО НКЦ.
- 9.2. Участнику клиринга, получившему допуск к клиринговому обслуживанию, Клиринговым центром присваиваются Клиринговые идентификаторы на основании Заявления о присвоении Клирингового идентификатора, предоставленного Участником клиринга Клиринговому центру.
- 9.2.1. Клиринговый идентификатор соответствует одному Регистрационному коду (идентификатору) Участника клиринга. Одному Регистрационному коду (идентификатору) Участника клиринга может соответствовать более одного Клирингового идентификатора.
- 9.2.2. Заявление о присвоении Клирингового идентификатора предоставляется Клиринговому центру на бумажном носителе.
- 9.2.3. Присвоение Участнику клиринга Клирингового идентификатора осуществляется Клиринговым центром в течение 5 (пяти) рабочих дней после получения Заявления о присвоении Клирингового идентификатора при условии отсутствия замечаний по представленному заявлению.
- 9.2.4. Клиринговый центр информирует Участника клиринга о присвоенном ему Клиринговом идентификаторе не позднее рабочего дня, следующего за днем присвоения Клирингового идентификатора, путем включения информации о Клиринговом идентификаторе Участника клиринга в состав ежедневного Отчета о Клиринговых идентификаторах.
- 9.3. Аннулирование присвоенного Участнику клиринга Клирингового идентификатора по инициативе Участника клиринга осуществляется на основании Заявления об аннулировании Клирингового идентификатора, предоставленного Участником клиринга Клиринговому центру.  
Заявление об аннулировании Клирингового идентификатора предоставляется Клиринговому центру на бумажном носителе.  
Аннулирование всех Клиринговых идентификаторов, соответствующих Регистрационному коду (идентификатору) Участника клиринга, осуществляется на основании полученного от Администратора уведомления о прекращении допуска к торгам на ЕТС Участника клиринга, являющегося Участником торгов ЕТС, по такому Регистрационному коду (идентификатору).
- 9.4. Регистрация Клиентов осуществляется на основании информации, полученной от Участника клиринга.
- 9.5. Регистрация Участников клиринга и Клиентов осуществляется Клиринговым центром в соответствии с порядком, установленным требованиями нормативных правовых актов федерального органа исполнительной власти в области финансовых рынков.
- 9.6. Сведения, необходимые для регистрации Клиента предоставляются Участником клиринга в Клиринговый центр в форме электронного документа.  
Состав и порядок предоставления информации о Клиентах, получаемой Клиринговым центром от Участника клиринга, определяется внутренним

документом Клирингового центра, регламентирующим технологические особенности регистрации клиентов.

- 9.7. Процедура регистрации Клиентов предусматривает присвоение Клиринговым центром таким Клиентам следующих уникальных кодов:
- код Клиента (присваивается в соответствии с нормативными правовыми актами федерального органа исполнительной власти в области финансовых рынков);
  - краткий код Клиента (указывается Участником клиринга самостоятельно).
- 9.8. Краткий код Клиента присваивается Клиенту при условии, что:
- Участнику клиринга присвоен Регистрационный код;
  - Клиенту присвоен код Клиента в соответствии с Правилами клиринга;
  - краткий код Клиента, предложенный Участником клиринга, соответствует формату (набор символов), используемому в Клиринговой системе, и является уникальным для данного Участника клиринга.
- 9.9. Клиенту может быть присвоен только один код Клиента. Клиенту может быть присвоено в Клиринговой системе более одного краткого кода Клиента. Для каждого Клиента устанавливается однозначное соответствие всех кратких кодов Клиента коду Клиента.
- 9.10. Клиринговый центр информирует Участников клиринга о присвоении Клиентам кодов (в том числе, кратких) путем направления соответствующего уведомления.
- 9.11. Для регистрации Администратором Клиента в качестве клиента Участника торгов Клиринговый центр передает имеющуюся у него информацию о Клиентах, а также о присвоенных им кодах Администратору.
- 9.12. Клиринговый центр вправе самостоятельно аннулировать регистрацию Клиентов в случае несоблюдения требований, установленных Правилами клиринга.
- 9.13. Участник клиринга самостоятельно отслеживает полноту и актуальность информации, предоставляемой в целях регистрации кодов Участника клиринга и кодов Клиента. Клиринговый центр не несет ответственности за актуальность и достоверность информации, предоставленной Участником клиринга, а также за нарушение Участником клиринга порядка предоставления таких сведений.

## **Статья 10. Порядок приостановления и прекращения допуска к клиринговому обслуживанию**

- 10.1. Клиринговый центр вправе приостановить допуск к клиринговому обслуживанию (в том числе по одному или нескольким инструментам) Участника клиринга по любому из следующих оснований:
- на основании соответствующего уведомления Администратора;
  - при возникновении обстоятельств, препятствующих в соответствии с законодательством Российской Федерации заключению и/или исполнению Участником клиринга сделок на ЕТС (за исключением чрезвычайных ситуаций), ставших известными Клиринговому центру;

- при нарушении Участником клиринга установленных Правилами клиринга требований;
- 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 сделок на ЕТС и назначение временной администрации по управлению кредитной организацией – Участником клиринга в рамках мер по предупреждению банкротства кредитной организации;
- при применении к Участнику клиринга санкций уполномоченных органов за нарушение законодательства Российской Федерации, в том числе при применении административных наказаний;
- наличие в деятельности Участника клиринга оснований для осуществления мер по предупреждению банкротства в соответствии с законодательством Российской Федерации о несостоятельности (банкротстве), а также оснований для отзыва (аннулирования) уполномоченным федеральным органом исполнительной власти лицензии на осуществление соответствующего вида деятельности в соответствии с законодательством Российской Федерации;
- при получении Клиринговым центром письменного сообщения от компетентного органа государства учреждения Банка-нерезидента в отношении Банка-нерезидента, из которого следует невозможность дальнейшего осуществления клирингового обслуживания Банка-нерезидента;
- по результатам рассмотрения Клиринговым центром предоставленных Участником клиринга в соответствии с пунктами 7.4-7.5 Правил клиринга информации и документов, а также в случае их непредставления в надлежащий срок;
- в случае отсутствия в отчетности Участника клиринга положительного финансового результата, предусмотренного пунктом 8.4 Правил клиринга;
- в случае приостановления Международного соглашения для Российской Федерации либо в случае приостановления Международного соглашения для государства Стороны Международного соглашения, являющегося государством учреждения такого Участника-клиринга – Банка-нерезидента;
- в случае приостановления международного договора для Российской Федерации, в соответствии с которым Международная организация учреждена либо в случае принятия решения уполномоченными лицами сторон указанного международного договора о приостановлении деятельности Международной организации;
- 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 Сделкам, Маржинальные требования и/или иные обязательства Участника клиринга, возникающие из Правил клиринга;
- при наличии фактов неисполнения или ненадлежащего исполнения Участником клиринга обязательств перед Клиринговым центром, возникших из Договора об оказании клиринговых услуг при оказании Клиринговым

центром услуг в соответствии с иными правилами клиринга, утвержденными Клиринговым центром и регламентирующими различные направления клиринговой деятельности.

- 10.2. Клиринговый центр приостанавливает допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию при получении Клиринговым центром от Участника клиринга письма о приостановлении допуска к клиринговому обслуживанию.
- 10.3. В случае приостановления допуска к клиринговому обслуживанию, в том числе по одному или нескольким инструментам, Клиринговый центр продолжает осуществлять клиринг и иные функции, связанные с осуществлением клиринга по Сделкам, заключенным данным Участником клиринга до момента приостановления допуска к клиринговому обслуживанию Участника клиринга или, соответственно, до момента приостановления допуска к клиринговому обслуживанию по одному или нескольким инструментам.
- 10.4. После получения Клиринговым центром от Участника клиринга и/или Администратора информации и/или документов, подтверждающих выполнение Участником клиринга требований Правил клиринга, и на основании соответствующего письма Участника клиринга Клиринговый центр вправе принять решение о возобновлении приостановленного клирингового обслуживания Участника клиринга или о возобновлении приостановленного клирингового обслуживания Участника клиринга по одному или нескольким инструментам.
- 10.5. Клиринговый центр прекращает допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию по любому из следующих оснований:
  - в случае прекращения действия Договора об оказании клиринговых услуг при условии отсутствия неисполненных обязательств, возникших до прекращения его действия;
  - в случае отзыва (аннулирования) Банком России лицензии на осуществление банковских операций у Участника клиринга – кредитной организации;
  - в случае назначения временной администрации или принятия арбитражным судом решения о введении в отношении Участника клиринга одной из процедур банкротства;
  - ликвидации Участника клиринга, а также в случае реорганизации Участника клиринга при условии, что деятельность Участника клиринга в результате реорганизации прекращается;
  - в случае отзыва (аннулирования) специального разрешения (лицензии или иного основания) компетентного органа государства учреждения Банка-нерезидента, в соответствии с которым Банк-нерезидент имеет право осуществлять банковские операции;
  - в случае прекращения Международного соглашения для Российской Федерации либо со дня прекращения Международного соглашения для государства - стороны Международного соглашения, являющегося государством учреждения Участника-клиринга – Банка-нерезидента;
  - в случае прекращения международного договора, в соответствии с которым учреждена Международная организация, для Российской Федерации либо со дня принятия решения уполномоченными лицами сторон указанного

международного договора о прекращении деятельности Международной организации;

- в случае принятия федерального закона о ликвидации Государственной корпорации;
- неоднократного (два и более раза) в течение одного года неисполнения Участником клиринга своих обязательств по Сделкам и/или обязательств Участника клиринга, возникающих на основании Правил клиринга;
- неоднократного (два и более раза) в течение одного года нарушения Участником клиринга установленных Правилами клиринга требований.

- 10.6. Клиринговый центр вправе прекратить допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию при поступлении в Клиринговый центр уведомления от Администратора о прекращении допуска Участника клиринга к участию в торгах, проводимых Администратором.
- 10.7. С момента получения в отношении Участника клиринга информации о случаях, указанных в пунктах 10.1, 10.5 Правил клиринга, Клиринговый центр вправе установить для такого Участника клиринга Лимит, обеспеченный средствами фонда, равным нулю.
- 10.8. Клиринговый центр извещает Участника клиринга и Администратора о приостановлении / прекращении или возобновлении приостановленного допуска к клиринговому обслуживанию (в том числе, по одному или нескольким инструментам) не позднее рабочего дня, следующего за днем приостановления / прекращения или возобновления приостановленного допуска к клиринговому обслуживанию, направляя соответствующие уведомления в форме электронного документа.
- 10.9. Прекращение допуска к клиринговому обслуживанию влечет за собой прекращение участия в Гарантийном фонде Участника клиринга с даты прекращения допуска к клиринговому обслуживанию. Клиринговый центр возвращает Участнику клиринга денежные средства, составляющие взнос Участника клиринга в Гарантийный фонд, учитываемый на дату прекращения допуска к клиринговому обслуживанию, в течение 3 (трех) банковских дней после получения Клиринговым центром письма от Участника клиринга о возврате вклада в Гарантийный фонд, содержащего платежные реквизиты, за исключением случаев, указанных в статье 22 Правил клиринга.

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

#### **Статья 11. Перечень мер, направленных на управление рисками при осуществлении клиринга**

- 11.1. В целях снижения рисков, связанных с осуществлением клиринга, Клиринговый центр:
- предъявляет требования к финансовой устойчивости Участников клиринга;
  - предъявляет к Участникам клиринга требование о внесении Обеспечения в российских рублях и иностранной валюте;
  - осуществляет предварительный контроль достаточности Обеспечения Участника клиринга при подаче заявок;
  - не реже, чем каждый Расчетный день, осуществляет переоценку стоимости Обеспечения Участника клиринга, а также Нетто-обязательств / Нетто-требований Участника клиринга и иных обязательств и требований Участников клиринга, возникающих в соответствии с Правилами клиринга, и контроль достаточности Обеспечения Участника клиринга, в случае недостаточности – предъявляет Участнику клиринга требование о внесении обеспечения (Маржинальное требование);
  - осуществляет контроль Единого лимита при исполнении / прекращении обязательств по Сделкам, возврате Обеспечения Участнику клиринга;
  - формирует Гарантийный фонд.
- 11.2. Гарантийный фонд формируется Клиринговым центром в долларах США за счет взносов в Гарантийный фонд Участников клиринга.  
Размер взноса в Гарантийный фонд составляет 80 000 (восемьдесят тысяч) долларов США.

#### **Статья 12. Единый лимит и риск-параметры**

- 12.1. Единый лимит рассчитывается Клиринговым центром при изменении размера Обеспечения Участника клиринга, при подаче Участником клиринга заявок, заключении им Сделок, исполнении / прекращении обязательств по Сделкам, изменении риск-параметров.
- 12.2. Единый лимит Участника клиринга используется для проверки возможности подачи Участником клиринга заявок, исполнения / прекращения обязательств по Сделкам, возврата Участнику клиринга денежных средств со счетов Клирингового центра, а также выполнения иных операций, предусмотренных Правилами клиринга. Указанная проверка осуществляется, исходя из анализа изменения значения Единого лимита Участника клиринга до и после проведения операции.
- 12.3. Единый лимит Участника клиринга рассчитывается с учетом:
- Обеспечения Участника клиринга в валютах, являющихся валютой лота или сопряженной валютой для Сделок с частичным обеспечением;
  - Лимита, обеспеченного средствами фонда (для Участников клиринга,

являющихся участниками Гарантийного фонда);

- Нетто-требований Участника клиринга в валютах, являющихся валютой лота или сопряженной валютой для Сделок с частичным обеспечением;
- Нетто-обязательств Участника клиринга в валютах, являющихся валютой лота или сопряженной валютой для Сделок с частичным обеспечением;
- Дополнительного обеспечения, рассчитанного для Участника клиринга;
- Задолженности по сделкам Участника клиринга перед Клиринговым центром в российских рублях;
- Задолженности по комиссиям Участника клиринга перед Клиринговым центром в российских рублях;
- Задолженности по гарантийным переводам Участника клиринга перед Клиринговым центром в российских рублях;
- корректировки Единого лимита с учетом Индикативных курсов сделок своп.

12.4. В случае если для Участника клиринга установлен Торговый лимит, размер Обеспечения Участника клиринга в российских рублях и стоимость в российских рублях Обеспечения Участника клиринга в иностранной валюте, учитываемая при расчете Единого лимита Участника клиринга, ограничивается величиной Торгового лимита такого Участника клиринга, который устанавливается в следующем порядке:

12.4.1. Торговый лимит Участника клиринга устанавливается на основании Запроса об установлении Торгового лимита, направляемого Участником клиринга в Клиринговый центр, или на основании решения Клирингового центра, принимаемого в связи с наличием фактов ухудшения финансового состояния Участника клиринга и/или информации, дающей основания считать возможным ухудшение финансового состояния Участника клиринга.

12.4.2. Запрос об установлении Торгового лимита направляется Клиринговому центру в электронном виде с использованием Клиринговой системы, или на бумажном носителе, или в форме электронного документа.

Запрос об установлении Торгового лимита исполняется Клиринговым центром, начиная с первого Торгового дня, следующего за датой предоставления указанного запроса.

Запрос об установлении Торгового лимита действует до его отмены Участником клиринга.

12.4.3. Торговый лимит Участника клиринга на основании решения Клирингового центра устанавливается, начиная с первого Торгового дня, следующего за датой принятия указанного решения, если иное не указано в решении Клирингового центра.

Торговый лимит Участника клиринга, установленный на основании решения Клирингового центра, действует до отмены указанного решения.

12.4.4. В случае установления Торгового лимита Участника клиринга на основании решения Клирингового центра, Запросы об установлении Торгового лимита Участника клиринга не исполняются.

12.5. Порядок определения Лимита, обеспеченного средствами фонда, для Участников клиринга, размер вноса в Гарантийный фонд которых соответствует установленному Клиринговым центром размеру вноса в Гарантийный фонд,

устанавливается Методикой лимитирования операций на валютном рынке.

Клиринговый центр уведомляет Участника клиринга об установленном ему Лимите, обеспеченном средствами фонда, в течение двух рабочих дней со дня принятия такого решения. Данное уведомление направляется Участнику клиринга при первоначальном установлении Лимита, обеспеченного средствами фонда, и при его изменении.

12.5.1. Лимит, обеспеченный средствами фонда, установленный Участнику клиринга Клиринговым центром, увеличивает Единый лимит по основному Расчетному коду основного Регистрационного кода Участника клиринга.

12.5.2. Участник клиринга может перераспределить Лимит, обеспеченный средствами фонда, между своими Регистрационными и Расчетными кодами, подав в Клиринговый центр Заявление о распределении Лимита, обеспеченного средствами фонда, в электронном виде с использованием Клиринговой системы, или на бумажном носителе, или в форме электронного документа.

12.5.3. В Заявлении о распределении Лимита, обеспеченного средствами фонда, указывается величина (в рублях, с учетом знака), на которую должно быть изменено значения Лимита, обеспеченного средствами фонда, по указанному в данном заявлении Расчетному коду. Положительная величина, указанная в данном заявлении, означает, что Лимит, обеспеченный средствами фонда, по Расчетному коду должен быть увеличен, отрицательная - уменьшен.

В Заявлении о распределении Лимита, обеспеченного средствами фонда, должен быть указан один Расчетный код, Лимит, обеспеченный средствами фонда, по которому должен быть уменьшен, и может быть указано более одного Расчетного кода, Лимит, обеспеченный средствами фонда, по которым должен быть увеличен.

12.5.4. Заявление о распределении Лимита, обеспеченного средствами фонда, не принимается Клиринговым центром к исполнению, если не соблюден порядок заполнения данного заявления, указанный в подпункте 12.5.3 Правил клиринга, или не выполняется хотя бы одно из перечисленных ниже условий:

- сумма (с учетом знака) величин изменения Лимита, обеспеченного средствами фонда, указанных в данном заявлении, равна нулю;
- значение Лимита, обеспеченного средствами фонда, по каждому из Расчетных кодов Участника клиринга в результате исполнения данного заявления останется неотрицательным;
- Единый лимит Участника клиринга по любому Расчетному коду в результате исполнения данного заявления останется неотрицательным, или отрицательный Единый лимит Участника клиринга по любому Расчетному коду в результате исполнения данного заявления увеличится.

12.5.5. При установлении Участнику клиринга Клиринговым центром нового Лимита, обеспеченного средствами фонда, разница между значениями нового и установленного ранее Лимита, обеспеченного средствами фонда, увеличивает (уменьшает) Лимит, обеспеченный средствами фонда, установленный по основному Расчетному коду основного Регистрационного кода Участника клиринга.

12.5.6. Если новый Лимит, обеспеченный средствами фонда, меньше, чем ранее установленный Лимит, обеспеченный средствами фонда, и разница между значением ранее установленного Лимита, обеспеченного средствами фонда, и

значением нового Лимита, обеспеченного средствами фонда, больше, чем Лимит, обеспеченный средствами фонда, установленный по основному Расчетному коду основного Регистрационного кода Участника клиринга, остаток указанной разницы уменьшает Лимиты, обеспеченные средствами фонда, установленные по иным Регистрационным и Расчетным кодам Участника клиринга, в следующей последовательности:

- в первую очередь, уменьшаются Лимиты, обеспеченные средствами фонда, установленные по дополнительным Расчетным кодам основного Регистрационного кода Участника клиринга в порядке возрастания значений дополнительных Расчетных кодов;
- в следующую очередь, уменьшаются Лимиты, обеспеченные средствами фонда, установленные по Расчетным кодам дополнительных Регистрационных кодов Участника клиринга. Выбор дополнительных Регистрационных кодов осуществляется в порядке возрастания значений Регистрационных кодов. Выбор Расчетных кодов в рамках дополнительных Регистрационных кодов осуществляется в порядке, аналогичном порядку, установленному для выбора Расчетных кодов в рамках основного Регистрационного кода.

12.5.7. При установлении Участнику клиринга Клиринговым центром нового Лимита, обеспеченного средствами фонда, у Участника клиринга сохраняется возможность его перераспределения между своими Регистрационными и Расчетными кодами в порядке, определенном настоящим пунктом Правил клиринга.

12.6. Единый лимит Участника клиринга в ходе торгов рассчитывается Клиринговым центром с учетом:

- зарегистрированных заявок на заключение Сделок с частичным обеспечением, поданных Участником торгов, являющимся Участником клиринга;
- зарегистрированных заявок на покупку на заключение Сделок с полным обеспечением, поданных Участником торгов, являющимся Участником клиринга.

12.7. Базовыми риск-параметрами, используемыми Клиринговым центром для контроля и управления рисками, являются:

- Центральный курс;
- Верхняя и Нижняя границы ценового коридора;
- Верхняя и Нижняя границы диапазона оценки рыночных рисков;
- центральное значение Индикативного курса сделок своп;
- верхнее и нижнее значения Индикативного курса сделок своп.

Помимо базовых риск-параметров Клиринговым центром используются дополнительные риск-параметры, приведенные в Методике определения риск-параметров валютного рынка.

12.8. Клиринговый центр вправе установить индивидуальные Верхнюю и Нижнюю границу диапазона оценки рыночных рисков для одного или нескольких Участников клиринга в следующих случаях:

- в случае необходимости предотвратить нарушение Клиринговым центром

обязательных нормативов Банка России;

- при превышении объема обязательств Участника клиринга определенного, установленного Клиринговым центром, значения.

12.9. Расчет и изменение риск-параметров осуществляется Клиринговым центром каждый Расчетный день по состоянию на 19:00 по московскому времени.

Клиринговый центр может принять решение об изменении риск-параметров до начала и в ходе торгов.

Изменения риск-параметров в ходе торгов, проводимых после 19:00 по московскому времени, не производится.

Порядок расчета и изменения риск-параметров установлен Методикой определения риск-параметров валютного рынка.

12.10. Единый лимит Участника клиринга рассчитывается Клиринговым центром исходя из оценки в российских рублях максимально возможного в течение двух торговых дней уменьшения в связи с изменением Центральных курсов и/или изменением процентных ставок по сделкам своп общей стоимости:

- Обеспечения Участника клиринга;
- Задолженности по сделкам Участника клиринга перед Клиринговым центром;
- Задолженности по комиссиям Участника клиринга перед Клиринговым центром;
- Задолженности по гарантийным переводам Участника клиринга перед Клиринговым центром;
- Нетто-обязательств и Нетто-требований Участников клиринга;
- обязательств и требований по Сделкам, которые могут быть заключены на основании зарегистрированных заявок, направленных на заключение Сделок с частичным обеспечением.

При расчете Единого лимита Участника клиринга обязательства по Сделкам, которые могут быть заключены на основании зарегистрированных заявок, Нетто-обязательства и Задолженности учитываются со знаком «минус», требования по Сделкам, которые могут быть заключены на основании зарегистрированных заявок, Нетто-требования и Обеспечение – со знаком «плюс».

Для целей расчета Единого лимита Участника клиринга Нетто-обязательства и Нетто-требования Участника клиринга в одной валюте с разными Датами исполнения складываются с учетом знака.

Указанная оценка проводится с использованием Верхней и Нижней границ диапазона оценки рыночных рисков.

Рассчитанный в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга Единый лимит корректируется (складывается с учетом знака) с итоговой корректировкой Единого лимита с учетом Индикативных курсов сделок своп, рассчитанной как сумма с учетом знака корректировок Единого лимита с учетом Индикативных курсов сделок своп по каждой валюте и каждой Дате исполнения, отстоящей от текущей даты более, чем на 1 (один) Расчетный день.

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

##### Статья 13. Порядок взаимодействия с Администратором при подаче заявок и заключении Сделок

- 13.1. Немедленно после того, как информация о поданной Участником клиринга заявке на продажу, направленной на заключение Сделки с полным обеспечением, стала доступной Клиринговому центру посредством ПТК ТЦ, Клиринговый центр:
- 13.1.1. проверяет, что значение цены, указанной в заявке, больше либо равно Нижней границе ценового коридора и меньше либо равно Верхней границе ценового коридора, установленных Клиринговым центром (в случае если заявка подана в рамках Торговой сессии ЕТС);
- 13.1.2. рассчитывает сумму денежных средств Участника клиринга в валюте лота, которая может быть использована для заключения Сделки с полным обеспечением, с учетом:
- Обеспечения Участника клиринга в валюте лота;
  - Нетто-обязательств и/или Нетто-требований Участника клиринга в валюте лота;
  - всех поданных Участником клиринга и зарегистрированных заявок на продажу, направленных на заключение сделок по покупке и продаже иностранной валюты, являющейся валютой лота в поданной заявке;
- 13.1.3. проверяет, что значение суммы денежных средств Участника клиринга, рассчитанной в соответствии с подпунктом 13.1.2 Правил клиринга, больше либо равно объему поданной заявки в валюте лота.
- 13.2. Немедленно после проведения Клиринговым центром проверок, указанных в подпунктах 13.1.1, 13.1.3 Правил клиринга, информация об их результате становится доступной Администратору посредством ПТК ТЦ: в случае положительного результата всех указанных проверок – информация о возможности регистрации заявки, в случае отрицательного результата хотя бы одной из указанных проверок – информация о невозможности регистрации заявки.
- 13.3. Немедленно после того, как информация о поданной Участником клиринга заявке на покупку, направленной на заключение Сделки с полным обеспечением, стала доступной Клиринговому центру посредством ПТК ТЦ, Клиринговый центр:
- 13.3.1. проверяет, что значение цены, указанной в заявке, больше либо равно Нижней границе ценового коридора и меньше либо равно Верхней границе ценового коридора, установленных Клиринговым центром (в случае если заявка подана в рамках Торговой сессии ЕТС);
- 13.3.2. рассчитывает сумму денежных средств Участников клиринга в российских рублях, которая может быть использована для заключения Сделки с полным обеспечением, с учетом:
- Обеспечения Участника клиринга в российских рублях;
  - Нетто-обязательств и/или Нетто-требований Участника клиринга в российских рублях;
  - всех поданных Участником клиринга и зарегистрированных заявок на

покупку, направленных на заключение сделок по покупке иностранной валюты за российские рубли;

- 13.3.3. проверяет, что значение суммы денежных средств Участника клиринга, рассчитанной в соответствии с подпунктом 13.3.2 Правил клиринга, больше либо равно объему поданной заявки в российских рублях;
  - 13.3.4. проверяет, что текущий Единый лимит Участника клиринга – неотрицательный;
  - 13.3.5. рассчитывает значение Единого лимита Участника клиринга без учета (за вычетом) суммы, равной объему поданной заявки в российских рублях;
  - 13.3.6. проверяет, что значение Единого лимита Участника клиринга, рассчитанное в соответствии с подпунктом 13.3.5 Правил клиринга, не стало отрицательным.
- 13.4. Немедленно после проведения Клиринговым центром проверок, указанных в подпунктах 13.3.1, 13.3.3, 13.3.4, 13.3.6 Правил клиринга, информация об их результате становится доступной Администратору посредством ПТК ТЦ: в случае положительного результата всех указанных проверок – информация о возможности регистрации заявки, в случае отрицательного результата хотя бы одной из указанных проверок – информация о невозможности регистрации заявки.
- 13.4.1. В случае возможности регистрации заявки, Клиринговый центр начинает учитывать значение Единого лимита Участника клиринга, рассчитанное в соответствии с подпунктом 13.3.5 Правил клиринга, в качестве нового значения Единого лимита Участника клиринга.
  - 13.4.2. В случае невозможности регистрации заявки, Клиринговый центр не изменяет учитываемое значение Единого лимита Участника клиринга.
- 13.5. Немедленно после того, как информация о поданной Участником клиринга заявке на покупку или заявке на продажу, направленной на заключение Сделки с частичным обеспечением, стала доступной Клиринговому центру посредством ПТК ТЦ, Клиринговый центр:
- 13.5.1. проверяет, что значение цены, указанной в заявке, больше либо равно Нижней границе ценового коридора и меньше либо равно Верхней границе ценового коридора, установленных Клиринговым центром для инструмента, по которому подана заявка (в случае если заявка подана в рамках Торговой сессии ЕТС);
  - 13.5.2. рассчитывает значение Единого лимита Участника клиринга с учетом поданной заявки;
  - 13.5.3. проверяет, что значение Единого лимита Участника клиринга, рассчитанное в соответствии с подпунктом 13.5.2 Правил клиринга, не стало отрицательным, или, если Единый лимит Участника клиринга был отрицательным до момента подачи заявки, - проверку того, что Единый лимит Участника клиринга, рассчитанный в соответствии с подпунктом 13.5.2 Правил клиринга, не стал меньше, чем Единый лимит Участника клиринга, рассчитанный до момента подачи заявки.
- 13.6. Немедленно после проведения Клиринговым центром проверок, указанных в подпунктах 13.5.1, 13.5.3 Правил клиринга, информация об их результате становится доступной Администратору посредством ПТК ТЦ: в случае положительного результата всех указанных проверок – информация о возможности регистрации заявки, в случае отрицательного результата хотя бы одной из

указанных проверок – информация о невозможности регистрации заявки.

- 13.6.1. В случае возможности регистрации заявки, Клиринговый центр начинает учитывать значение Единого лимита Участника клиринга, рассчитанное в соответствии с подпунктом 13.5.2 Правил клиринга, в качестве нового значения Единого лимита Участника клиринга.
- 13.6.2. В случае невозможности регистрации заявки, Клиринговый центр не изменяет учитываемое значение Единого лимита Участника клиринга.
- 13.7. После того, как информация о снятии зарегистрированной заявки, поданной Участником клиринга, стала доступной Клиринговому центру посредством ПТК ТЦ, Клиринговый центр рассчитывает Единый лимит Участника клиринга без учета отозванной заявки.
- 13.8. В случае регистрации заявки, являющейся в соответствии с Правилами ЕТС допустимой встречной по отношению к ранее зарегистрированной заявке, Клиринговый центр формирует подтверждения УКО по каждой из двух допустимых встречных заявок.  
Курс и объем заключаемых сделок определяются в соответствии с Правилами ЕТС.
- 13.9. В целях создания условий для исполнения обязательств по Сделкам Клиринговый центр вправе по зарегистрированной заявке на продажу или заявке на покупку, в отношении которой отсутствует зарегистрированная допустимая встречная заявка, сформировать в соответствии с Правилами ЕТС подтверждение УКО, содержащее определенное Клиринговым центром значение объема заключаемой Сделки.
- 13.10. После того, как информация о регистрации Сделки стала доступной Клиринговому центру посредством ПТК ТЦ, Клиринговый центр:
- рассчитывает Единый лимит Участника клиринга без учета заявки (части заявки), на основании которой была заключена Сделка, и с учетом заключенной Сделки;
  - допускает к клирингу обязательства по заключенной Сделке;
  - изменяет с учетом заключенной Сделки Нетто-обязательство и/или Нетто-требование Участника клиринга с Датами исполнения, соответствующими Дате (Датам) исполнения обязательств по заключенной Сделке.
- 13.11. Участник клиринга имеет право завершить заключение сделок с Клиринговым центром по инструментам с Датой исполнения, отличной от текущей, ранее установленного Администратором времени окончания торгов. Для реализации указанного права Участник клиринга должен предоставить Клиринговому центру Запрос на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром или Постоянное поручение на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром.
- 13.11.1. Запрос на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром направляется в электронном виде с использованием Клиринговой системы, или на бумажном носителе, или в форме электронного документа.  
Сроки предоставления и исполнения Запросов на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром установлены Временным регламентом исполнения обязательств по сделкам, заключенным на Единой торговой сессии, являющимся

приложением № 6 к Правилам клиринга (далее – Регламент).

- 13.11.2. Постоянное поручение на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром направляется в электронном виде с использованием Клиринговой системы, или на бумажном носителе, или в форме электронного документа.

Постоянное поручение на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром исполняется Клиринговым центром каждый Расчетный день, начиная с первого Расчетного дня, следующего за датой предоставления указанного поручения.

Постоянное поручение на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром действует до его отмены Участником клиринга.

Отмена Постоянного поручения на завершение заключения сделок с Клиринговым центром осуществляется с использованием Клиринговой системы или путем направления Участником клиринга Клиринговому центру документа на бумажном носителе в свободной форме.

- 13.11.3. В установленный Регламентом момент времени, Клиринговый центр направляет Администратору уведомление о раннем завершении заключения сделок с Клиринговым центром в отношении Участников клиринга, предоставивших Клиринговому центру Запрос на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром или Постоянное поручение на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром.

- 13.12. В случае принятия Постановления Правительства Российской Федерации о переносе выходных дней, в соответствии с которым Дата исполнения заключенных с Участниками клиринга Сделок станет выходным днем по законодательству Российской Федерации, Клиринговый центр в течение 10 (десяти) рабочих дней с даты принятия такого Постановления изменяет Даты исполнения таких заключенных Сделок на ближайший следующий Расчетный день.

При этом суммы Сделок изменяются с учетом изменения цены Сделок, рассчитанной по формуле:

$RateN = RateO + Rate\_delta$ , где

RateN – цена Сделки после изменения Даты исполнения,

RateO – цена Сделки до изменения Даты исполнения,

Rate\_delta - корректировка цены сделки,

$Rate\_delta = SWAPCRate\_dN - SWAPCRate\_dO$ , где

Rate\_delta – корректировка цены сделки,

SWAPCRate\_dN – центральное значение Индикативного курса сделок своп на новую Дату исполнения Сделки (после изменения),

SWAPCRate\_dO – центральное значение Индикативного курса сделок своп на первоначальную Дату исполнения Сделки (до изменения).

После изменения Даты исполнения Сделок в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга, Клиринговый центр изменяет Нетто-обязательства / Нетто-требования Участников клиринга по соответствующим Датам исполнения в соответствии с измененными условиями Сделок.

Суммы рассчитанных комиссионных вознаграждений по Сделкам, Дата исполнения которых изменена, не меняются.

После изменения Дат исполнения и сумм Сделок Клиринговый центр формирует и

передает Участникам клиринга Отчеты о сделках, Дата исполнения которых перенесена.

Об изменении Дат исполнения и сумм Сделок Клиринговый центр уведомляет Администратора посредством ПТК ТЦ.

## РАЗДЕЛ V. ПОРЯДОК ПРОВЕДЕНИЯ КЛИРИНГА

### Статья 14. Порядок проведения клиринговых сессий

14.1. До начала торгов в установленное Регламентом время Клиринговый центр проводит клиринговую сессию, в ходе которой Клиринговый центр:

- устанавливает риск-параметры в соответствии с Методикой определения риск-параметров валютного рынка;
- для каждого Участника клиринга рассчитывает и устанавливает новые значения Единых лимитов и Торговых лимитов Участника клиринга;
- определяет обязательства Участников клиринга и Клирингового центра по уплате Гарантийных переводов;
- формирует и передает каждому Участнику клиринга, имеющему обязательства по Сделкам, Дата исполнения которых не наступила, Отчет об обязательствах;
- формирует и передает Участникам клиринга, у которых возникли Задолженности, Отчет «Требование о погашении Задолженности»;
- определяет Участников клиринга, у которых возникли Маржинальные требования и суммы указанных Маржинальных требований: Маржинальное требование возникает у Участника клиринга, Единый лимит которого стал отрицательным; сумма Маржинального требования равна абсолютному значению текущего Единого лимита Участника клиринга;
- формирует и передает Участникам клиринга, у которых возникли Маржинальные требования, Отчет о Маржинальном требовании, содержащий информацию о его сумме.

14.2. Размер обязательства Участника клиринга и Клирингового центра по уплате Гарантийного перевода рассчитывается по обязательствам по Сделкам, Дата исполнения которых не наступила, по формуле:

$$\text{COM\_RUB} = \sum_i (\sum_j \text{OBL\_VAL}_{ij} \times (\text{Rc\_RUB\_VAL}_j + \text{SWAPCRate\_VAL}_{ij}) + \text{OBL\_RUB}_i) + \text{RET\_RUB}, \text{ где}$$

COM\_RUB – размер обязательства по уплате Гарантийного перевода, рассчитанный в ходе текущей клиринговой сессии;

OBL\_VAL<sub>ij</sub> – сумма (с учетом знака) Нетто-обязательств / Нетто-требований в иностранной валюте VAL<sub>j</sub> с i-ой Датой исполнения;

OBL\_RUB<sub>i</sub> - Нетто-обязательство / Нетто-требование Участника клиринга (с учетом знака) в российских рублях с i-ой Датой исполнения;

Rc\_RUB\_VAL<sub>j</sub> – Центральный курс Сделок по покупке и продаже иностранной валюты VAL<sub>j</sub> за российские рубли, рассчитанный в предыдущий Рабочий день;

SWAPCRate\_VAL<sub>ij</sub> - центральное значение Индикативного курса сделок своп, установленного в предыдущий Рабочий день для i-ой Даты исполнения и иностранной валюты VAL<sub>j</sub> за российские рубли. Для Даты исполнения в Расчетный день, следующий за текущим, значение SWAPCRate\_VAL<sub>i</sub> равно нулю;

VAL<sub>j</sub> – иностранная валюта, являющейся валютой лота для Сделок с

частичным обеспечением;

RET\_RUB – размер непрекращенного обязательства по возврату Гарантийных переводов (с учетом знака), рассчитанный в предыдущий Рабочий день;

$\sum_i$  – сумма по Датам исполнения;

$\sum_j$  – сумма по валютам VAL.

Если значение COM\_RUB отрицательное, это означает наличие обязанности Участника клиринга по уплате Гарантийного перевода Клиринговому центру в размере, равном абсолютному значению COM\_RUB, если положительное – наличие требования Участника клиринга к Клиринговому центру по получению Гарантийного перевода в размере, равном значению COM\_RUB.

Информация о размере обязательства Участника клиринга по уплате Гарантийного перевода указывается в Отчете об обязательствах.

- 14.3. Размер обязательства Участника клиринга и Клирингового центра по возврату Гарантийных переводов рассчитывается по формуле:

$RET\_RUB_{new} = RET\_RUB - COM\_RUB$ , где

RET\_RUB<sub>new</sub> – размер обязательства по возврату Гарантийных переводов (с учетом знака);

RET\_RUB – размер непрекращенного обязательства по возврату Гарантийных переводов (с учетом знака), рассчитанный в предыдущий Рабочий день;

COM\_RUB – размер обязательства (с учетом знака) по уплате Гарантийного перевода, рассчитанный в ходе текущей клиринговой сессии.

Если значение RET\_RUB<sub>new</sub> отрицательное, это означает наличие обязанности Участника клиринга по возврату Клиринговому центру Гарантийных переводов в размере, равном абсолютному значению RET\_RUB<sub>new</sub>, если положительное – наличие обязанности Клирингового центра по возврату Участнику клиринга Гарантийных переводов в размере, равном значению RET\_RUB<sub>new</sub>.

- 14.4. Если размер обязательства Участника клиринга по уплате Гарантийных переводов, определенный в ходе клиринговой сессии, отрицательный, Гарантийный перевод уплачивается Участником клиринга из Обеспечения, и на его абсолютное значение уменьшается размер Обеспечения Участника клиринга в российских рублях, если положительный, Гарантийный перевод вносится Клиринговым центром в счет Обеспечения, и на его значение увеличивается размер Обеспечения Участника клиринга в российских рублях.

- 14.5. Если Обеспечения Участника клиринга в российских рублях, недостаточно для исполнения обязательства Участника клиринга по уплате Гарантийных переводов в полном объеме, неисполненное обязательство (неисполненная часть обязательства) Участника клиринга по уплате Гарантийных переводов учитывается Клиринговым центром как Задолженность по гарантийным переводам Участника клиринга перед Клиринговым центром.

Указанная Задолженность по гарантийным переводам должна быть погашена Участником клиринга до установленного Регламентом времени текущего Рабочего дня.

Информация о наличии Задолженности по гарантийным переводам и ее размере передается Участнику клиринга в составе отчета «Требование о погашении Задолженности».

Отчет «Требование о погашении Задолженности» направляется Участнику клиринга в форме электронного документа в срок, установленный Регламентом.

- 14.6. Порядок действий Клирингового центра при неисполнении Участником клиринга Задолженности по гарантийным переводам в срок, установленный в пункте 14.5 Правил клиринга, определен в статье 18 Правил клиринга.
- 14.7. Проценты на сумму уплаченных и/или полученных Гарантийных переводов не начисляются и не уплачиваются.
- 14.8. Маржинальное требование, возникшее у Участника клиринга по итогам клиринговой сессии, должно быть исполнено Участником клиринга не позднее установленного Регламентом времени текущего Рабочего дня.
- 14.9. Маржинальное требование должно быть исполнено Участником клиринга путем перечисления денежных средств в валютах, являющихся валютой лота или сопряженной валютой для Сделок с частичным обеспечением, на счета Клирингового центра в порядке, определенном статьей 15 Правил клиринга.  
Маржинальное требование может быть также прекращено полностью или в части в случаях:
- исполнения обязательств по Сделкам с наступившей Датой исполнения;
  - заключения Сделок, приводящих к увеличению Единого лимита Участника клиринга;
  - увеличения Лимита, обеспеченного средствами фонда, в результате перераспределения Участником клиринга Лимита, обеспеченного средствами фонда, между его Регистрационными и Расчетными кодами, в соответствии с подпунктами 12.5.2-12.5.4 Правил клиринга.
- 14.10. Маржинальное требование по Расчетному коду, возникшее у Участника клиринга, считается прекращенным в момент времени, когда Единый лимит Участника клиринга по такому Расчетному коду станет неотрицательным.
- 14.11. Порядок действий Клирингового центра при ненадлежащем исполнении Участником клиринга Маржинального требования определен в статье 18 Правил клиринга.

## **Статья 15. Порядок внесения и возврата Обеспечения**

- 15.1. Участник клиринга обязан перечислять денежные средства в соответствующей валюте, которые предоставляются им в качестве Обеспечения, на клиринговый (корреспондентский) счет Клирингового центра по реквизитам, размещенным на сайте Клирингового центра, с обязательным указанием в назначении платежа соответствующего Расчетного кода Участника клиринга.
- 15.2. Клиринговый центр обязан учесть в Клиринговой системе денежные средства, перечисленные Участником клиринга, в качестве Обеспечения Участника клиринга не позднее срока, установленного Регламентом, и увеличить Единый лимит Участника клиринга с учетом перечисленной суммы денежных средств.
- 15.3. Денежные средства, учитываемые в качестве Обеспечения Участника клиринга,

используются для расчета Единого лимита, обеспечения исполнения обязательств по Сделкам, исполнения Итоговых нетто-обязательств в соответствующей валюте и обязательств по уплате комиссионных вознаграждений по Расчетному коду, по которому указанное Обеспечение учитывается.

- 15.4. Участник клиринга может перевести денежные средства, учитываемые в качестве Обеспечения, между своими Расчетными кодами, подав в Клиринговый центр Заявление о переводе денежных средств в электронном виде с использованием Клиринговой системы, или на бумажном носителе, или в форме электронного документа.

Данное заявление не принимается Клиринговым центром к исполнению, если сумма денежных средств в определенной валюте, указанная Участником клиринга в заявлении, превышает сумму денежных средств, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга по Расчетному коду, с которого денежные средства должны быть списаны, или если Единый лимит Участника клиринга по Расчетному коду, с которого денежные средства, учитываемые в качестве Обеспечения Участника клиринга, должны быть списаны, в результате такого списания станет отрицательным, или отрицательный Единый лимит Участника клиринга по такому Расчетному коду в результате такого списания уменьшится.

При исполнении Заявления о переводе денежных средств, сумма денежных средств Участника клиринга в соответствующей валюте, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга по Расчетному коду, с которого списываются денежные средства, уменьшается, а по Расчетному коду, на который зачисляются денежные средства, - увеличивается на сумму переводимых денежных средств.

- 15.5. Обеспечение Участника клиринга в российских рублях используется в следующей очередности:

- 1) для уплаты пеней за наличие на момент начала Дополнительной сессии ЕТС первого типа непогашенной Задолженности по сделкам и/или Задолженности по комиссиям и/или Задолженности по гарантийным переводам;
- 2) для погашения Задолженности по комиссиям Участника клиринга перед Клиринговым центром;
- 3) для погашения Задолженности по Гарантийным переводам Участника клиринга перед Клиринговым центром;
- 4) для погашения Задолженности по сделкам Участника клиринга перед Клиринговым центром;
- 5) для обеспечения исполнения обязательств Участника клиринга по Сделкам с полным обеспечением и Сделкам с частичным обеспечением;
- 6) для исполнения обязательств Участника клиринга в российских рублях по Сделкам с полным обеспечением и Сделкам с частичным обеспечением с наступившей Датой исполнения;
- 7) для исполнения обязательства Участника клиринга по уплате и возврату Гарантийных переводов;
- 8) для исполнения обязательств Участника клиринга по уплате комиссионного вознаграждения в пользу Клирингового центра;
- 9) для исполнения обязательств Участника клиринга по уплате комиссионного вознаграждения в пользу Администратора.

- 15.6. Обеспечение Участника клиринга в иностранной валюте, являющейся валютой лота или сопряженной валютой для Сделок с частичным обеспечением используется в следующей очередности:
- 1) для обеспечения исполнения обязательств Участника клиринга по Сделкам с частичным обеспечением;
  - 2) для исполнения обязательств Участника клиринга в соответствующей иностранной валюте по Сделкам с частичным обеспечением с наступившей Датой исполнения.
- 15.7. Обеспечение Участника клиринга в иностранной валюте, являющейся валютой лота для Сделок с полным обеспечением, используется:
- 1) для обеспечения исполнения обязательств Участника клиринга в валюте лота по Сделкам с полным обеспечением;
  - 2) для исполнения обязательств Участника клиринга в валюте лота по Сделкам с полным обеспечением с наступившей Датой исполнения.
- 15.8. После перечисления Участником клиринга денежных средств на счет Клирингового центра, открытый в Расчетном банке или Расчетной организации, и учета их в качестве Обеспечения Участника клиринга, у Клирингового центра возникает обязательство вернуть денежные средства Участнику клиринга в размере, определяемом в соответствии с пунктами 15.11, 15.12 Правил клиринга.
- 15.9. Возврат Клиринговым центром Участнику клиринга денежных средств, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга, осуществляется на основании Запроса о возврате денежных средств либо Постоянного поручения на возврат денежных средств в следующем порядке.
- 15.9.1. Запрос о возврате денежных средств направляется Участником клиринга в электронном виде с использованием Клиринговой системы, или на бумажном носителе, или в форме электронного документа. В случае если между Участником клиринга и Клиринговым центром предусмотрен обмен сообщениями по системе S.W.I.F.T., Участник клиринга вправе направить Запрос о возврате денежных средств в форме сообщения по системе S.W.I.F.T.
- Запросы о возврате денежных средств принимаются Клиринговым центром в Расчетные дни в период времени, установленный Регламентом.
- При предоставлении Запроса о возврате денежных средств позднее времени, указанного в Регламенте, Клиринговый центр вправе не исполнять Запрос о возврате денежных средств.
- Запрос о возврате денежных средств действует в день его предоставления.
- Запрос о возврате денежных средств, полученный в сроки, установленные Регламентом, исполняется после его получения при соблюдении условия, указанного в пункте 15.11 Правил клиринга.
- 15.9.2. Постоянное поручение на возврат денежных средств направляется Участником клиринга в электронном виде с использованием Клиринговой системы или на бумажном носителе, или в форме электронного документа.
- Постоянное поручение на возврат денежных средств исполняется Клиринговым центром каждый Расчетный день, начиная с первого Расчетного дня, следующего за датой предоставления указанного поручения, после исполнения Участником

клиринга Итоговых нетто-обязательств в соответствующей валюте и обязательств по уплате комиссионных вознаграждений в сумме, определенной в соответствии с пунктом 15.12 Правил клиринга.

Постоянное поручение на возврат денежных средств действует до его отмены Участником клиринга.

Отмена Постоянного поручения на возврат денежных средств осуществляется с использованием Клиринговой системы или путем направления Участником клиринга Клиринговому центру документа на бумажном носителе в свободной форме или электронного документа.

- 15.10. При непредоставлении Участником клиринга Запроса о возврате денежных средств или Постоянного поручения на возврат денежных средств Обеспечение Участника клиринга будет учтено Клиринговым центром для его использования в торгах следующего торгового дня.
- 15.11. Возврат Клиринговым центром Участнику клиринга денежных средств в соответствии с Запросом о возврате денежных средств осуществляется только в том случае, если Единый лимит Участника клиринга, рассчитанный без учета возвращаемой суммы денежных средств, не станет отрицательным.
- 15.12. Возврат Клиринговым центром Участнику клиринга денежных средств в соответствии с Постоянным поручением на возврат денежных средств осуществляется в сумме, без учета которой Единый лимит Участника клиринга не станет отрицательным.
- 15.13. Для исполнения своего обязательства по возврату Участнику клиринга денежных средств в соответствующей валюте Клиринговый центр перечисляет денежные средства в данной валюте на Счет в соответствующей валюте для возврата денежных средств, зарегистрированный в Клиринговом центре для соответствующего Расчетного кода Участника клиринга.
- 15.14. Обязательство Клирингового центра по возврату денежных средств Участнику клиринга считается исполненным с момента списания Расчетной организацией или Расчетным банком, в котором Клиринговым центром открыт корреспондентский счет для учета Обеспечения, денежных средств с соответствующего счета Клирингового центра.
- 15.15. При возврате Участнику клиринга денежных средств в соответствующей валюте размер Обеспечения Участника клиринга в этой валюте уменьшается на сумму возвращаемых денежных средств.
- 15.16. 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.
- 15.17. Информация об операциях с Обеспечением Участника клиринга передается Участнику клиринга в составе Отчета о движении денежных средств.  
Отчет о движении денежных средств, содержащий информацию об операциях с Обеспечением, выполненных в течение предыдущего Рабочего дня, направляется Участнику клиринга в форме электронного документа в срок, установленный

Регламентом.

- 15.18. Клиринговый центр осуществляет ежегодную сверку остатков Обеспечения Участника клиринга в соответствующих валютах 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 Обеспечения Участника клиринга в соответствующих валютах считаются подтвержденными.

## **Статья 16. Порядок внесения и возврата взноса в Гарантийный фонд**

- 16.1. Для учета денежных средств в качестве взноса в Гарантийный фонд Участник клиринга обязан перечислить денежные средства в долларах США в сумме, не меньшей установленного Клиринговым центром размера взноса в Гарантийный фонд, на клиринговый счет Клирингового центра, открытый в Расчетной организации и предназначенный для учета коллективного клирингового обеспечения валютного рынка, с обязательным указанием в назначении платежа слова «FUNDS» и после него без пробелов Расчетного кода Участника клиринга.

Пример назначения платежа: «TRANSFER OF FUNDSXXXXX», где XXXXX – Расчетный код.

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 счет Клирингового центра, предназначенный для учета средств Гарантийного фонда, в сумме, превышающей установленный Клиринговым центром размер взноса в Гарантийный фонд, возвращаются Клиринговым центром Участнику клиринга по письменному требованию Участника клиринга.

- 16.2. После перечисления Участником клиринга денежных средств на счет Клирингового центра, открытый в Расчетной организации, и учета их в качестве взноса Участника клиринга в Гарантийный фонд, у Клирингового центра возникает обязательство вернуть Участнику клиринга денежные средства в размере взноса Участника клиринга в Гарантийный фонд в случаях и порядке, предусмотренных Правилами клиринга.

- 16.3. Возврат Участнику клиринга его взноса в Гарантийный фонд осуществляется при прекращении допуска к клиринговому обслуживанию в соответствии с пунктом 10.8 Правил клиринга.

- 16.4. Участник клиринга вправе предоставить Клиринговому центру Заявление о возврате взноса в Гарантийный фонд.

Заявление Участника клиринга о возврате взноса в Гарантийный фонд исполняется Клиринговым центром в случае отсутствия у Участника клиринга Задолженности и/или неисполненных обязательств по Сделкам не позднее Расчетного дня,

следующего за датой получения указанного заявления.

Для исполнения Заявления Участника клиринга о возврате вклада в Гарантийный фонд, Клиринговый центр устанавливает Участнику клиринга Лимит, обеспеченный средствами фонда, равным нулю и прекращает его участие в Гарантийном фонде, после чего перечисляет денежные средства, составляющие вклад Участника клиринга в Гарантийный фонд в размере, учитываемом на дату возврата, по реквизитам, указанным в таком заявлении.

## **Статья 17. Порядок исполнения / прекращения обязательств по Сделкам и обязательств по возврату Гарантийных переводов**

17.1. В сроки, установленные Регламентом, Клиринговый центр определяет Итоговые нетто-обязательства / Итоговые нетто-требования Участников клиринга в иностранной валюте и/или Итоговые обязательства / Итоговые требования Участников клиринга в российских рублях и включает их в клиринговый пул.

17.1.1. В случае если для какой-либо иностранной валюты, включенной в Перечень инструментов, по которым заключаются Сделки с частичным обеспечением, время окончания торгов, на которых заключаются сделки с исполнением обязательств в дату их заключения, раньше, чем время окончания всех торгов, на которых заключаются сделки с исполнением обязательств в дату их заключения, то по окончании торговой сессии по такой иностранной валюте и получения от Администратора выписки из реестра сделок по итогам указанной торговой сессии Клиринговый центр:

- зачитывает встречные однородные обязательства и требования Участника клиринга и Клирингового центра в такой иностранной валюте по Сделкам с наступившей Датой исполнения, а в части, в которой обязательства и требования не были зачтены – определяет Итоговое нетто-обязательство и/или Итоговое нетто-требование каждого Участника клиринга в такой иностранной валюте;
- формирует и передает Участникам клиринга предварительные Биржевые свидетельства.

17.1.2. Порядок исполнения / прекращения Итогового нетто-обязательства или Итогового нетто-требования, определенного в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга, определен настоящим разделом Правил клиринга, сроки исполнения – Регламентом.

Необходимым условием исполнения Клиринговым центром Итогового нетто-требования Участника клиринга в иностранной валюте, определенного в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга, является наличие у Участника клиринга достаточного Обеспечения.

17.2. По окончании всех торгов, на которых заключаются сделки с исполнением обязательств в дату их заключения, и получения от Администратора выписки из реестра сделок по итогам Торговых сессий ЕТС Клиринговый центр:

17.2.1. рассчитывает обязательство каждого Участника клиринга и Клирингового центра по возврату Гарантийных переводов по Сделкам с наступившей Датой исполнения по формуле:

$$RET\_RUB = -(\sum_j OBL\_VAL_j \times Rc\_RUB\_VAL_j + OBL\_RUB), \text{ где}$$

RET\_RUB – размер обязательства Участника клиринга и Клирингового центра по возврату Гарантийных переводов (в российских рублях);

OBL\_VAL<sub>j</sub> – Итоговое нетто-обязательство / Итоговое нетто-требование Участника клиринга (с учетом знака) в иностранной валюте VAL<sub>j</sub>, рассчитанное без учета Сделок, обязательства по уплате Гарантийных переводов по которым в соответствии с Правилами клиринга не возникают;

OBL\_RUB - Итоговое нетто-обязательство / Итоговое нетто-требование Участника клиринга (с учетом знака) в российских рублях, рассчитанное без учета Сделок, обязательства по уплате Гарантийных переводов по которым в соответствии с Правилами клиринга не возникают;

Rc\_RUB\_VAL<sub>j</sub> – Центральный курс Сделок по покупке и продаже иностранной валюты VAL<sub>j</sub> за российские рубли, рассчитанный в день T-2, где T – текущий Рабочий день;

VAL<sub>j</sub> – иностранная валюта, являющаяся валютой лота для Сделок с частичным обеспечением;

$\sum_j$  - сумма по валютам VAL.

Если значение RET\_RUB отрицательное, это означает наличие обязанности Участника клиринга по возврату Клиринговому центру Гарантийных переводов в размере, равном абсолютному значению RET\_RUB, если положительное – наличие обязанности Клирингового центра по возврату Участнику клиринга Гарантийных переводов в размере, равном значению RET\_RUB;

- 17.2.2. зачитывает встречные однородные обязательства и требования Участника клиринга и Клирингового центра по Сделкам с наступившей Датой исполнения в соответствующей валюте, и обязательства / требования Участника клиринга по возврату Гарантийных переводов в российских рублях, а в части, в которой обязательства и требования не были зачтены – определяет Итоговые нетто-обязательства и/или Итоговые нетто-требования каждого Участника клиринга в каждой валюте.
- 17.3. Процедуры, указанные в пункте 17.2 Правил клиринга, могут быть выполнены Клиринговым центром в отношении отдельных Участников клиринга до окончания торгов, на которых заключаются сделки с исполнением обязательств в дату их заключения, в случае получения от Участника клиринга Запроса на проведение ранних расчетов или Постоянного поручения на проведение ранних расчетов.
- 17.3.1. Запрос на проведение ранних расчетов направляется в электронном виде с использованием Клиринговой системы, или на бумажном носителе по форме, или в форме электронного документа.  
Сроки предоставления и исполнения Запросов на проведение ранних расчетов установлены Регламентом.
- 17.3.2. Постоянное поручение на проведение ранних расчетов направляется в электронном виде с использованием Клиринговой системы, или на бумажном носителе, или в форме электронного документа.  
Постоянное поручение на проведение ранних расчетов исполняется Клиринговым центром каждый Расчетный день, начиная с первого Расчетного дня, следующего за датой предоставления указанного поручения.  
Постоянное поручение на проведение ранних расчетов действует до его отмены Участником клиринга.

Отмена Постоянного поручения на проведение ранних расчетов осуществляется с использованием Клиринговой системы или путем направления Участником клиринга Клиринговому центру документа на бумажном носителе в свободной форме.

- 17.3.3. После получения от Участника клиринга Запроса на проведение ранних расчетов или в установленный Регламентом момент времени, Клиринговый центр направляет Администратору уведомление о проведении ранних расчетов в отношении Участника клиринга, предоставившего Клиринговому центру Запрос на проведение ранних расчетов или Постоянное поручение на проведение ранних расчетов соответственно.
- 17.4. После определения обязательств Участников клиринга, указанных в пункте 17.1 Правил клиринга, Клиринговый центр формирует и передает Участникам клиринга Клиринговые отчеты по итогам Торговых сессий ЕТС и Биржевые свидетельства по итогам Торговых сессий ЕТС.
- 17.5. Участник клиринга вправе до установленного Регламентом времени предоставить Клиринговому центру Заявление о переносе, которое является уведомлением об изменении по инициативе Участника клиринга Даты исполнения обязательств по всем Сделкам с частичным обеспечением с наступившей Датой исполнения, заключенным с указанием определенного Расчетного кода и/или за счет определенного Клиента, на дату, соответствующую следующему Расчетному дню.
- 17.5.1. Заявление о переносе направляется Участником клиринга на бумажном носителе или в форме электронного документа.  
Заявление о переносе действует в день его предоставления.  
При предоставлении Заявления о переносе позднее установленного Регламентом времени, Заявление о переносе не исполняется.
- 17.5.2. В Заявлении о переносе обязательно должен быть указан Расчетный код, по которому учитываются обязательства по Сделкам с частичным обеспечением, Дата исполнения которых изменяется, а также может быть указан код Клиента, за счет которого заключены указанные сделки.  
Если код Клиента в Заявлении о переносе не указан, то изменению подлежит Дата исполнения всех Сделок с частичным обеспечением с наступившей Датой исполнения, обязательства по которым учитываются по указанному в Заявлении о переносе Расчетному коду.
- 17.5.3. Заявление о переносе не исполняется Клиринговым центром, если:
- допуск к клиринговому обслуживанию Участника клиринга со следующего Расчетного дня приостановлен или прекращен;
  - по Расчетному коду Участника клиринга, указанному в Заявлении о переносе, в текущую дату было проведено частичное или полное исполнение обязательств по Сделкам с частичным обеспечением с наступившей Датой исполнения;
  - количество исполненных Заявлений о переносе хотя бы для одной из Сделок, Дата исполнения которой должна быть изменена на основании такого заявления, равно 5 (пяти).
- 17.5.4. Для исполнения Заявления о переносе Клиринговый центр исключает

обязательства по Сделкам с частичным обеспечением с наступившей Датой исполнения, обязательства по которым учитываются по указанному в Заявлении о переносе Расчетному коду, или Сделки, заключенные Участником клиринга за счет Клиента, указанного в Заявлении о переносе, из расчета Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований Участника клиринга в соответствующей валюте (исключает указанные обязательства из клирингового пула) и включает в расчет Нетто-обязательств / Нетто-требований в соответствующей валюте с Датой исполнения в Расчетный день, следующий за текущим.

- 17.5.5. За исполнение Заявления о переносе Участник клиринга обязан уплатить Клиринговому центру комиссионное вознаграждение, рассчитываемое по формуле:  
 $Fee = (D \times 2 \times S \times n / 365)$ , где

Fee – сумма комиссионного вознаграждения, в российских рублях,

D – нетто-обязательство по Сделкам, Дата исполнения которых изменена, в российских рублях,

S – ставка, установленная Клиринговым центром в соответствии с Методикой определения риск-параметров валютного рынка для валюты нетто-обязательства по Сделкам, Дата исполнения которых изменена,

n - количество календарных дней между датой расчета суммы комиссионного вознаграждения и следующим Рабочим днем.

Нетто-обязательство в иностранной валюте по Сделкам, Дата исполнения которых изменена, для целей расчета суммы комиссионного вознаграждения в соответствии с настоящим подпунктом Правил клиринга, пересчитывается в российские рубли по курсу, установленному Банком России на дату расчета суммы комиссионного вознаграждения.

Комиссионное вознаграждение, рассчитанное в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга, не облагается НДС.

Порядок взимания комиссионного вознаграждения, рассчитанного в соответствии с настоящим подпунктом Правил клиринга, определен в статье 20 Правил клиринга.

- 17.5.6. После исполнения Заявления о переносе Клиринговый центр формирует и передает Участнику клиринга новый Клиринговый отчет по итогам Торговых сессий ЕТС, новое Биржевое свидетельство по итогам Торговых сессий ЕТС, а также Отчет о сделках, Дата исполнения которых перенесена.

Биржевое свидетельство по итогам Торговых сессий ЕТС и Клиринговый отчет по итогам Торговых сессий ЕТС, направленные Участнику клиринга ранее, утрачивают силу с момента направления ему Клиринговым центром Биржевого свидетельства по итогам Торговых сессий ЕТС и Дополнительной сессии ЕТС в соответствии с настоящим подпунктом Правил клиринга.

- 17.6. Необходимым условием исполнения Клиринговым центром Итоговых нетто-требований Участника клиринга является исполнение Участником клиринга своих Итоговых нетто-обязательств перед Клиринговым центром, за исключением случая, предусмотренного пунктом 17.14 Правил клиринга.

- 17.7. Участник клиринга обязан исполнить свои Итоговые нетто-обязательства в соответствующей валюте до времени, указанного в Регламенте.

В случае исполнения Участником клиринга Итоговых нетто-обязательств в соответствующей валюте в полном объеме в указанный срок данный Участник

клиринга признается Добросовестным участником клиринга.

В случае неисполнения Участником клиринга Итоговых нетто-обязательств в соответствующей валюте в полном объеме и/или в указанный срок данный Участник клиринга признается Недобросовестным участником клиринга.

17.8. Порядок действий Клирингового центра при неисполнении или ненадлежащем исполнении Участником клиринга своих Итоговых нетто-обязательств определен в статье 18 Правил клиринга.

17.9. Для исполнения Итоговых нетто-обязательств Участника клиринга в соответствующей валюте используется Обеспечение Участника клиринга в соответствующей валюте, в порядке, определенном пунктами 15.5-15.7 Правил клиринга.

Сроки перечисления денежных средств на счета Клирингового центра для учета в качестве Обеспечения текущим днем определены Регламентом.

Датой и временем перечисления Участниками клиринга денежных средств на счета Клирингового центра являются дата и время зачисления денежных средств на соответствующие счета Клирингового центра, открытые в Расчетных банках и Расчетной организации.

Перечисление денежных средств позже установленного срока с зачислением их ранее даты перевода (back value) не разрешается.

17.10. Клиринговый центр зачитывает Итоговое нетто-обязательство Участника клиринга в соответствующей валюте с требованием Участника клиринга по возврату денежных средств в соответствующей валюте, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга.

Итоговое нетто-обязательство Участника клиринга в соответствующей валюте считается исполненным, если размер Обеспечения Участника клиринга в соответствующей валюте не меньше, чем Итоговое нетто-обязательство Участника клиринга в соответствующей валюте.

При этом размер Обеспечения Участника клиринга в соответствующей валюте уменьшается на сумму исполненного Итогового нетто-обязательства в этой валюте.

17.11. Итоговое нетто-требование Участника клиринга в соответствующей валюте прекращается возникновением обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга денежных средств в соответствующей валюте, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга, в размере Итогового нетто-требования в соответствующей валюте.

При этом размер Обеспечения Участника клиринга в соответствующей валюте увеличивается на сумму прекращенного Итогового нетто-требования в этой валюте.

17.11.1. После этого обязательство Клирингового центра по возврату Участнику клиринга денежных средств в соответствующей валюте, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга, зачитывается с обязательством Участника клиринга по погашению его Задолженности по комиссиям, Задолженности по гарантийным переводам и Задолженности по сделкам перед Клиринговым центром в этой валюте (в случае наличия у Участника клиринга такого обязательства).

При этом размер Обеспечения Участника клиринга в российских рублях

уменьшается на сумму Задолженности по комиссиям Участника клиринга, сумму Задолженности по гарантийным переводам Участника клиринга, а затем - на сумму Задолженности по сделкам Участника клиринга.

- 17.11.2. После этого Клиринговый центр осуществляет возврат Участникам клиринга денежных средств, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга, в сумме Итогового нетто-требования в соответствующей валюте, но не более чем сумма денежных средств Участника клиринга в данной валюте, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга, при условии, что возврат этой суммы не приведет к возникновению у Участника клиринга отрицательного Единого лимита, либо в максимально возможной сумме, не превышающей сумму денежных средств Участника клиринга в данной валюте, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга, возврат которой не приведет к возникновению у Участника клиринга отрицательного Единого лимита.

Возврат Участникам клиринга денежных средств в соответствии с настоящим подпунктом Правил клиринга осуществляется в день, являющийся Расчетным днем для соответствующей валюты.

В случае если в Расчетный день для соответствующей валюты Клиринговый центр не может осуществить возврат денежных средств Участнику клиринга в связи с нефункционированием / ограниченным функционированием платежной системы Банка России и/или Расчетного банка, обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга денежных средств в соответствующей валюте, которые не могут быть исполнены в такой Расчетный день по вышеуказанным причинам, считаются надлежащим образом исполненными в ближайший следующий Расчетный день, когда такие причины будут отсутствовать.

- 17.11.3. В случае предоставления Участником клиринга Клиринговому центру Запроса о депонировании денежных средств, сумма денежных средств в соответствующей валюте, подлежащая возврату Клиринговым центром Участнику клиринга в соответствии с подпунктом 17.11.2 Правил клиринга, уменьшается на сумму денежных средств в этой валюте, указанную Участником клиринга в Запросе о депонировании денежных средств.

Запрос о депонировании денежных средств направляется в электронном виде с использованием Клиринговой системы, или на бумажном носителе, или в форме электронного документа.

Сроки предоставления Запросов о депонировании денежных средств установлены Регламентом.

При предоставлении Запроса о депонировании денежных средств позднее времени, указанного в Регламенте, Запрос о депонировании денежных средств не исполняется.

Запрос о депонировании денежных средств действует в день его предоставления.

- 17.12. Возврат Клиринговым центром Участнику клиринга денежных средств в соответствующей валюте в соответствии с пунктом 17.11 Правил клиринга осуществляется путем перечисления денежных средств в данной валюте на зарегистрированный Участником клиринга в Клиринговом центре Счет в соответствующей валюте для возврата денежных средств.

- 17.13. При возврате Участнику клиринга денежных средств в соответствующей валюте, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга, размер Обеспечения

Участника клиринга в этой валюте уменьшается на сумму возвращаемых денежных средств.

- 17.14. При частичном своевременном исполнении Участником клиринга своих Итоговых нетто-обязательств в соответствующей валюте Клиринговый центр частично исполняет Итоговые нетто-требования Участника клиринга в соответствующей валюте в порядке, определенном пунктом 17.11 Правил клиринга, в сумме, определяемой Клиринговым центром, и имеет право вернуть Участнику клиринга денежные средства в указанной сумме в порядке, определенном пунктом 17.12 Правил клиринга.

Клиринговый центр вправе не возвращать денежные средства Участнику клиринга, частично исполнившему свои Итоговые нетто-обязательства в соответствующей валюте, до полного исполнения Участником клиринга своих Итоговых нетто-обязательств в соответствующей валюте.

Если Участник клиринга имеет требования к Клиринговому центру по возврату денежных средств в разных валютах, то их исполнение в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга осуществляется в следующем порядке: сначала возвращаются денежные средства в той валюте, Итоговые нетто-обязательства Участника клиринга в которой имеют более ранний срок исполнения в течение одного Расчетного дня, установленный Регламентом.

- 17.15. В случае предоставления Участником клиринга Клиринговому центру Постоянного поручения на депонирование денежных средств, денежные средства в соответствующей валюте Клиринговым центром Участнику клиринга в соответствии с пунктом 17.11 Правил клиринга не возвращаются. В этом случае возврат Участнику клиринга денежных средств осуществляется только на основании Запроса о возврате денежных средств либо Постоянного поручения на возврат денежных средств в порядке, определенном разделом Статья 15 Правил клиринга.

Постоянное поручение на депонирование денежных средств направляется Участником клиринга в электронном виде с использованием Клиринговой системы, или на бумажном носителе, или в форме электронного документа.

Постоянное поручение на депонирование денежных средств исполняется Клиринговым центром каждый Расчетный день, начиная с первого Расчетного дня, следующего за датой предоставления указанного поручения.

Постоянное поручение на депонирование денежных средств действует до его отмены Участником клиринга.

Отмена Постоянного поручения на депонирование денежных средств осуществляется с использованием Клиринговой системы или путем направления Участником клиринга Клиринговому центру документа на бумажном носителе в свободной форме или электронного документа.

## **Статья 18. Порядок урегулирования случаев неисполнения или ненадлежащего исполнения Участниками клиринга обязательств по Сделкам и Маржинальных требований**

- 18.1. Урегулирование случаев неисполнения или ненадлежащего исполнения Участниками клиринга обязательств по Сделкам с частичным обеспечением с наступившей Датой исполнения, осуществляется Клиринговым центром в ходе

Дополнительных сессий ЕТС, проводимых Администратором в соответствии с Правилами ЕТС.

- 18.2. Дополнительная сессия ЕТС первого типа проводится в случае неисполнения Участником клиринга Маржинального требования в срок, установленный пунктом 14.8 Правил клиринга.
- 18.3. Дополнительная сессия ЕТС второго типа проводится в следующих случаях:
- в случае частичного неисполнения или неисполнения в полном объеме Участником клиринга своих Итоговых нетто-обязательств в соответствующей валюте;
  - в случае непогашения Участником клиринга до установленного Регламентом времени Задолженности по комиссиям, возникшей в предыдущие Расчетные дни, Задолженности по гарантийным переводам, возникшей в текущий день, и/или Задолженности по сделкам, возникшей в предыдущие Расчетные дни или текущий день, и наличия Обеспечения Участника клиринга в иностранных валютах, являющихся валютой лота для Сделок с частичным обеспечением;
  - в случае недостаточности денежных средств Клирингового центра для исполнения Итоговых нетто-требований в соответствующей валюте;
  - в случае частичного неисполнения или неисполнения в полном объеме Клиринговым центром Итоговых нетто-требований Участника клиринга в соответствующей валюте.
- 18.4. Время проведения Дополнительных сессий ЕТС определено Временным регламентом проведения торгов на Единой торговой сессии, утверждаемым Администратором.
- 18.5. В случаях, предусмотренных пунктами 18.2, 18.3 Правил клиринга, Клиринговый центр направляет Администратору уведомление о необходимости проведения Дополнительной сессии, в котором указываются:
- тип Дополнительной сессии ЕТС;
  - Регистрационный и Расчетный код Участника клиринга, в отношении которого должна быть проведена Дополнительная сессия ЕТС;
  - условия сделок, которые должны быть заключены между Клиринговым центром и Участником клиринга, включая:
    - код инструмента, направленность сделки, количество лотов и цена сделки (указываются для сделок по покупке и продаже иностранной валюты);
    - коды инструментов, по которым будет заключаться сделка своп, направленность сделки в отношении Участника клиринга, количество лотов и цену сделки своп (указываются для сделок своп).
- 18.6. Участник клиринга признает и подтверждает право Клирингового центра использовать Обеспечение данного Участника клиринга для прекращения (исполнения) обязательств данного Участника клиринга по Сделкам, заключенным в ходе Дополнительных сессий ЕТС.

- 18.7. Дополнительная сессия ЕТС первого типа в отношении Недобросовестного участника клиринга не проводится в случае, если у Недобросовестного участника клиринга отозвана (аннулирована) лицензия Банка России на осуществление банковских операций со средствами в рублях и иностранной валюте или в случае, если в отношении Недобросовестного участника клиринга действуют иные обстоятельства, предусмотренные пунктом 22.2 Правил клиринга.
- 18.8. В ходе Дополнительной сессии ЕТС первого типа между Клиринговым центром и Недобросовестным участником клиринга могут быть заключены сделки по покупке и продаже иностранной валюты, в том числе сделки своп.
- 18.9. Условия сделок, заключаемых между Клиринговым центром и Недобросовестным участником клиринга в ходе Дополнительной сессии ЕТС первого типа, формируются Клиринговым центром таким образом, чтобы заключение указанных сделок приводило к увеличению Единого лимита данного Участника клиринга.
- Указанные сделки заключаются до момента исполнения Маржинального требования Участника клиринга. Указанные сделки могут заключаться только при условии, что их заключение приводит к увеличению Единого лимита Участника клиринга, имеющего неисполненное Маржинальное требование.
- Условия сделок, заключаемых между Клиринговым центром и Недобросовестным участником клиринга в ходе Дополнительной сессии ЕТС первого типа, соответствуют условиям сделок, заключенных Клиринговым центром в соответствии с пунктом 18.26 Правил клиринга.
- 18.10. В случае наличия у Участника клиринга на момент начала Дополнительной сессии ЕТС второго типа непогашенной Задолженности по сделкам и/или Задолженности по комиссиям и/или Задолженности по гарантийным переводам, Участник клиринга обязан уплатить Клиринговому центру пеню, рассчитываемую по формуле:
- $$\text{Fine} = D \times 2 \times S \times n / 365, \text{ где}$$
- Fine – сумма пени, в российских рублях,  
D – сумма Задолженности по сделкам и/или Задолженности по комиссиям и/или Задолженности по гарантийным переводам, в российских рублях,  
S – ставка рефинансирования, установленная Банком России на дату расчета суммы пени,  
n - количество календарных дней между датой расчета суммы пени и следующим Рабочим днем,  
Сумма пени, рассчитанная в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга, не облагается НДС.
- 18.11. Клиринговый центр зачитывает обязательство Участника клиринга по уплате пени, рассчитанной в соответствии с пунктом 18.10 Правил клиринга, с требованием Участника клиринга по возврату денежных средств в российских рублях, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга, за исключением случаев отзыва (аннулирования) лицензии Банка России на осуществление банковских операций со средствами в рублях и иностранной валюте в связи с банкротством Участника клиринга, созданного в соответствии с законодательством Российской Федерации.

- 18.12. Дополнительная сессия второго типа в отношении Участника клиринга проводится при соблюдении следующих условий:
- а) у Участника клиринга не отозвана (не аннулирована) лицензия Банка России на осуществление банковских операций со средствами в рублях и иностранной валюте;
  - б) у Клирингового центра отсутствует информация об обстоятельствах в отношении Участника клиринга, перечисленных в пункте 10.1 Правил клиринга, при наступлении которых допуск к клиринговому обслуживанию Участника клиринга может быть приостановлен.

- 18.13. Условия сделок своп, заключаемых между Клиринговым центром и Недобросовестным участником клиринга в ходе Дополнительной сессии ЕТС второго типа в случае частичного неисполнения или неисполнения в полном объеме Недобросовестным участником клиринга своих Итоговых нетто-обязательств в соответствующей валюте, формируются Клиринговым центром таким образом, чтобы:

- в случае наличия у Участника клиринга неисполненного Итогового нетто-обязательства в иностранной валюте, по первой части сделки своп, заключенной в ходе Дополнительной сессии ЕТС второго типа, у Участника клиринга возникли требования в соответствующей иностранной валюте, противоположные указанному неисполненному Итоговому нетто-обязательству Участника клиринга в иностранной валюте в объеме, равном минимальной сумме, кратной установленному Правилами ЕТС для Дополнительной сессии ЕТС лоту инструмента, превышающей указанное неисполненное Итоговое нетто-обязательство Участника клиринга в иностранной валюте;
- в случае наличия у Участника клиринга неисполненного Итогового нетто-обязательства в российских рублях, по первой части сделки своп, заключенной в ходе Дополнительной сессии ЕТС второго типа, у Участника клиринга возникли требования в российских рублях, противоположные указанному неисполненному Итоговому нетто-обязательству Участника клиринга в российских рублях, и обязательства в иностранной валюте в объеме, равном максимальной сумме, кратной установленному Правилами ЕТС для Дополнительной сессии ЕТС лоту инструмента и не превышающей суммы Итогового нетто-требования в иностранной валюте, соответствующего неисполненному Участником клиринга Итоговому нетто-обязательству в российских рублях, и размера Обеспечения Участника клиринга в соответствующей иностранной валюте.

Условия сделок своп, заключаемых между Клиринговым центром и Недобросовестным участником клиринга в ходе Дополнительной сессии ЕТС второго типа в случае наличия у Участника клиринга Задолженности, формируются Клиринговым центром таким образом, чтобы по первой части сделки своп у Участника клиринга возникли требования, противоположные Задолженности в объеме, равном максимальной сумме, кратной установленному Правилами ЕТС для Дополнительной сессии ЕТС лоту инструмента и не превышающей размера Обеспечения Участника клиринга в иностранной валюте, являющейся валютой лота для Сделок с частичным обеспечением.

- 18.14. При необходимости проведения Дополнительной сессии ЕТС второго типа в

отношении Добросовестных участников клиринга в соответствии с пунктом 18.27 Правил клиринга, условия сделок своп, заключаемых между Клиринговым центром и Добросовестным участником клиринга в ходе Дополнительной сессии ЕТС второго типа в случае частичного неисполнения или неисполнения в полном объеме Клиринговым центром Итоговых нетто-требований Участника клиринга в иностранной валюте, формируются Клиринговым центром таким образом, чтобы:

- по первой части сделки своп, заключенной в ходе Дополнительной сессии ЕТС второго типа, у Участника клиринга возникли обязательства в соответствующей иностранной валюте, противоположные указанному неисполненному Итоговому нетто-требованию Участника клиринга в иностранной валюте в объеме, равном максимальной сумме, кратной установленному Правилами ЕТС для Дополнительной сессии ЕТС лоту инструмента, и не превышающей указанное неисполненное Итоговое нетто-требование Участника клиринга в иностранной валюте.

18.15. Базовый курс сделки своп, заключаемой в ходе Дополнительной сессии ЕТС второго типа, устанавливается равным Центральному курсу, определенному в 19:00 по московскому времени текущего Рабочего дня.

Цена сделки своп рассчитывается по следующей формуле:

$$\text{Swap\_Price} = K \times R_{c\_RUB\_VAL} \times S \times n / 365$$
, где

Swap\_Price – цена сделки своп,

K – коэффициент, равный 1, в случае если направленность сделки в отношении Недобросовестного участника клиринга - «продажа», а в отношении Добросовестного участника клиринга – «покупка», или равный -1, в случае если направленность сделки в отношении Недобросовестного участника клиринга - «покупка», а в отношении Добросовестного участника клиринга - «продажа»,

R<sub>c\_RUB\_VAL</sub> – Центральный курс сделок по покупке и продаже валюты VAL за российские рубли, рассчитанный в 19:00 по московскому времени текущего Рабочего дня,

VAL – валюта лота сделки своп (иностранная валюта, являющаяся валютой лота для Сделок с частичным обеспечением),

S – ставка, установленная Клиринговым центром в соответствии с Методикой определения риск-параметров валютного рынка; ставка может быть разной для разных валют лота сделки своп,

n – количество календарных дней между датой исполнения первой и второй части сделки своп.

18.16. В случае невозможности исполнения Участником клиринга своих Итоговых нетто-обязательств в соответствующей валюте вследствие непреодолимой силы или сбоя в платежной системе Банка России, в ходе Дополнительной сессии ЕТС второго типа Клиринговым центром с Участником клиринга заключаются сделки своп с Ценой сделки своп, равной нулю.

Под обстоятельствами непреодолимой силы понимаются:

- 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 Участником клиринга помещений;
- любые иные обстоятельства, которые создают или могут создать угрозу жизни или здоровью работников Участника клиринга.

О возникновении обстоятельств непреодолимой силы, вследствие которых исполнение Участником клиринга своих Итоговых нетто-обязательств в соответствующей валюте невозможно, Участник клиринга обязан уведомить Клиринговый центр любыми доступными средствами связи до установленного времени проведения Дополнительной сессии ЕТС второго типа.

Участник клиринга обязан предоставить Клиринговому центру документы, подтверждающие обстоятельства непреодолимой силы в течение 7 (семи) дней. В случае непредоставления Участником клиринга Клиринговому центру таких документов в указанный срок с Участника клиринга по решению Клирингового центра взыскивается неустойка, равная Цене сделки своп, рассчитанной в соответствии с пунктом 18.13 Правил клиринга в расчете на количество календарных дней между датой исполнения первой части сделки своп и датой расчета неустойки.

Уплата Участником клиринга неустойки в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга не освобождает Участника клиринга от исполнения обязательств по второй части сделки своп, заключенной в ходе Дополнительной сессии ЕТС второго типа.

18.17. Обязательства по Сделкам, заключенным в ходе Дополнительной сессии ЕТС первого или второго типа, включаются в клиринговый пул.

18.18. По итогам Дополнительной сессии ЕТС второго типа Клиринговый центр зачитывает встречные однородные Итоговые нетто-обязательства в соответствующей валюте и/или Задолженности в российских рублях Участника клиринга с требованиями в соответствующих валютах по первым частям сделок своп, заключенных в ходе данной Дополнительной сессии ЕТС Клиринговым центром с Участником клиринга, а Итоговые нетто-требования в соответствующей валюте Участника клиринга с обязательствами в соответствующих валютах по первым частям сделок своп, заключенных в ходе данной Дополнительной сессии ЕТС Клиринговым центром с Участником клиринга, и направляет ему Клиринговый отчет по итогам Торговых сессий ЕТС и Дополнительной сессии ЕТС, а также Биржевое свидетельство по итогам Торговых сессий ЕТС и Дополнительной сессии ЕТС.

Биржевое свидетельство по итогам Торговых сессий ЕТС, направленное Участнику клиринга, утрачивает силу с момента направления ему Клиринговым центром Биржевого свидетельства по итогам Торговых сессий ЕТС и Дополнительной сессии ЕТС.

18.19. Клиринговый центр зачитывает Итоговое нетто-обязательство Участника клиринга в соответствующей валюте, указанное в Биржевом свидетельстве по итогам Торговых сессий ЕТС и Дополнительной сессии ЕТС, предоставленном Участнику клиринга, с требованием Участника клиринга по возврату денежных средств в соответствующей валюте, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга.

При этом размер Обеспечения Участника клиринга в соответствующей валюте уменьшается на сумму исполненного Итогового нетто-обязательства в этой валюте.

- 18.20. После проведения Дополнительной сессии ЕТС второго типа или, в случае ее непроведения, в срок, установленный Регламентом для исполнения Участниками клиринга Итоговых нетто-обязательств в долларах США и российских рублях перед Клиринговым центром, обязательства по Сделкам, включенным в клиринговый пул, прекращаются.
- 18.21. Итоговое нетто-обязательство в российских рублях Участника клиринга, не прекращенные после проведения указанного в пункте 18.19 Правил клиринга зачета, учитываются Клиринговым центром как Задолженность по сделкам Участника клиринга перед Клиринговым центром.
- Указанная Задолженность по сделкам должна быть погашена Участником клиринга не позднее установленного Регламентом времени Рабочего дня, следующего за днем возникновения указанной задолженности.
- Информация о наличии у Участника клиринга Задолженности по сделкам и ее размере передается Участнику клиринга в составе отчета «Требование о погашении Задолженности», направляемом Участнику клиринга в соответствии с пунктом 14.5 Правил клиринга.
- 18.22. Если Задолженность Участника клиринга, внесшего взнос в Гарантийный фонд в размере, установленном пунктом 11.1 Правил клиринга, перед Клиринговым центром не погашена в установленные Регламентом сроки, Клиринговый центр использует средства Гарантийного фонда в порядке, определенном разделом Статья 19 Правил клиринга.
- 18.23. Итоговые нетто-требования в соответствующей валюте, указанные в Биржевом свидетельстве по итогам Торговых сессий ЕТС и Дополнительной сессии ЕТС, предоставленном Участнику клиринга, прекращаются возникновением обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга денежных средств в соответствующей валюте, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга, в размере Итогового нетто-требования в соответствующей валюте.
- При этом размер Обеспечения Участника клиринга в соответствующей валюте увеличивается на сумму прекращенного Итогового нетто-требования Участника клиринга в этой валюте.
- Возврат денежных средств Участнику клиринга по итогам Дополнительной сессии ЕТС второго типа не производится.
- 18.24. Обязательства / требования в соответствующих валютах по вторым частям сделок своп, заключенных в ходе Дополнительной сессии ЕТС второго типа Клиринговым центром с Участником клиринга, учитываются в составе Нетто-обязательств / Нетто-требований Участника клиринга с Датой исполнения, соответствующей дате исполнения обязательств по вторым частям указанных сделок своп.
- 18.25. При наличии у Клирингового центра информации об обстоятельствах в отношении Недобросовестного участника клиринга, перечисленных в пункте 10.1 Правил клиринга, в соответствии с которыми допуск к клиринговому обслуживанию Недобросовестного участника клиринга будет приостановлен в следующий

Торговый день, неисполненные обязательства Участника клиринга по Сделкам, в том числе с ненаступившей Датой исполнения, прекращаются выплатой неустойки.

- 18.25.1. Неустойка, уплачиваемая Недобросовестным участником клиринга Клиринговому центру, рассчитывается по одной из следующих формул:

$Penalty = |S| + |F|$ , если  $S < 0$ ;

$Penalty = |F|$ , если  $S \geq 0$ , где

$Penalty$  - сумма неустойки, в российских рублях,

$S = \sum_i (\sum_j (OBL\_VAL_{ij} \times (Rc\_RUB\_VAL_j + SWAPCRate\_VAL_{ij})) + OBL\_RUB_i) + RET\_RUB$ ,

$F = \sum_i \sum_j F\_VAL_{ij} + F\_RUB_i$ ,

$OBL\_VAL_{ij}$  - неисполненное Нетто-обязательство / Нетто-требование Участника клиринга в иностранной валюте  $VAL_j$  с  $i$ -ой Датой исполнения,

$OBL\_RUB_i$  - неисполненное Нетто-обязательство / Нетто-требование Участника клиринга в российских рублях с  $i$ -ой Датой исполнения,

Нетто-обязательство учитывается со знаком «минус», Нетто-требование – со знаком «плюс»,

$F\_VAL_{ij}$  - составляющая неустойки, рассчитываемая за неисполнение Участником клиринга Нетто-обязательства в иностранной валюте  $VAL_j$  с  $i$ -ой Датой исполнения, в случае, если  $OBL\_VAL_{ij} < 0$ ;

$F\_VAL_{ij} = OBL\_VAL_{ij} \times (Rc\_RUB\_VAL_j + SWAPCRate\_VAL_{ij}) \times K$ ,

$F\_RUB_i$  - составляющая неустойки, рассчитываемая за неисполнение Участником клиринга Нетто-обязательства в российских рублях с  $i$ -ой Датой исполнения, в случае, если  $OBL\_RUB_i < 0$ ;

$F\_RUB_i = OBL\_RUB_i \times K$ ,

$Rc\_RUB\_VAL_j$  – Центральный курс сделок по покупке и продаже иностранной валюты  $VAL_j$  за российские рубли, рассчитанный в 19:00 по московскому времени текущего Расчетного дня,

$SWAPCRate\_VAL_{ij}$  - центральное значение Индикативного курса сделок своп, установленного в текущий день для  $i$ -ой Даты исполнения и иностранной валюты  $VAL_j$  за российские рубли. Для Даты исполнения в Расчетный день, следующий за текущим, значение  $SWAPCRate\_VAL_i$  равно нулю,

$VAL_j$  – валюта, являющейся валютой лота для Сделок с частичным обеспечением,

$RET\_RUB$  – размер неисполненного обязательства по возврату Гарантийных переводов (с учетом знака),

$\sum_i$  – сумма по Датам исполнения,

$\sum_j$  - сумма по валютам  $VAL_j$ ,

$K$  – ставка неустойки, в долях единицы, устанавливаемая решением Клирингового центра и раскрываемая на Сайте Клирингового центра.

- 18.25.2. Клиринговый центр зачитывает обязательство Участника клиринга по уплате неустойки, рассчитанной в соответствии с подпунктом 18.25.1 Правил клиринга, с требованием Участника клиринга по возврату денежных средств в российских рублях, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга.

- 18.25.3. Требование Участника клиринга по получению неустойки, рассчитанной в соответствии с подпунктом 18.25.1 Правил клиринга, увеличивает размер

требования Участника клиринга по возврату денежных средств в российских рублях, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга.

- 18.26. В случае заключения Клиринговым центром сделок по покупке и продаже иностранной валюты с Недобросовестным участником клиринга, имеющим неисполненное Маржинальное требование, в соответствии с настоящим разделом Правил клиринга, а также в случаях прекращения обязательств Недобросовестного участника клиринга в соответствии с пунктом 18.25 Правил клиринга или прекращения обязательств по Сделкам в соответствии со статьей 22 Правил клиринга, Клиринговый центр вправе заключить сделку в порядке, предусмотренном пунктом 13.9 Правил клиринга.
- 18.27. При наличии Недобросовестных участников клиринга, не исполнивших полностью или частично свои Итоговые нетто-обязательства в соответствующей валюте, рассчитанные по Сделкам с частичным обеспечением, для исполнения Итоговых нетто-требований в соответствующей валюте Добросовестных участников клиринга Клиринговый центр осуществляет действия в следующей последовательности:
- использует свободные собственные денежные средства;
  - в случае недостаточности свободных собственных денежных средств в ходе Дополнительной сессии ЕТС второго типа заключает сделки своп с Уполномоченными участниками торгов ЕТС, за исключением Банка России;
  - в случае невозможности заключения сделок своп с Уполномоченными участниками торгов ЕТС, за исключением Банка России, заключает в соответствии с Договором о взаимодействии сделки своп с Банком России в ходе Дополнительной сессии ЕТС второго типа;
  - в случае невозможности заключения сделок своп с Уполномоченными участниками торгов ЕТС, включая Банк России, уведомляет Администратора о необходимости проведения Дополнительной сессии ЕТС второго типа в отношении Добросовестных участников клиринга.
- 18.27.1. Базовый курс и цена сделки своп, заключаемой Клиринговым центром с Уполномоченным участником торгов ЕТС, за исключением Банка России, определяются в соответствии с договором, заключенным Клиринговым центром с соответствующим Уполномоченным участником торгов ЕТС.
- 18.27.2. По итогам Дополнительной сессии ЕТС второго типа Клиринговый центр зачитывает встречные однородные Итоговые нетто-обязательства в соответствующей валюте / Итоговые нетто-требования в соответствующей валюте Уполномоченных участников торгов ЕТС, за исключением Банка России, с обязательствами / требованиями по первым частям сделок своп, заключенных в ходе данной Дополнительной сессии ЕТС Клиринговым центром с таким Уполномоченным участником торгов ЕТС, и направляет ему Клиринговый отчет по итогам Торговых сессий ЕТС и Дополнительной сессии ЕТС, а также Биржевое свидетельство по итогам Торговых сессий ЕТС и Дополнительной сессии ЕТС.
- 18.28. Порядок исполнения (прекращения) Итоговых нетто-обязательств в соответствующей валюте / Итоговых нетто-требований в соответствующей валюте с обязательствами / требованиями Уполномоченных участников торгов ЕТС, за исключением Банка России, по итогам Дополнительной сессии ЕТС второго типа,

определен пунктами 18.19, 18.23 Правил клиринга, порядок учета обязательств / требований Уполномоченных участников торгов ЕТС по вторым частям сделок своп, заключенных в ходе Дополнительной сессии ЕТС второго типа Клиринговым центром с таким Уполномоченным участником торгов ЕТС, - пунктом 18.24 Правил клиринга.

18.29. Порядок взаимодействия Администратора, Клирингового центра и Банка России в ходе проведения Дополнительных сессий ЕТС второго типа, а также условия сделок своп с Банком России и порядок их исполнения, определены Договором о взаимодействии.

18.30. В случае изменении условий обращения иностранной валюты, включенной в Перечень инструментов, с которыми заключаются Сделки с частичным обеспечением, Клиринговый центр вправе:

- исключить такую иностранную валюту из Перечня инструментов, с которыми заключаются Сделки с частичным обеспечением;
- прекратить обязательства Участников клиринга и Клирингового центра в такой иностранной валюте выплатой отступного, сумма которого рассчитывается по формуле:

$Penalty = |S|$ , где

Penalty – сумма отступного, в российских рублях,

$S = OBL\_VAL \times Rc\_RUB\_VAL + OBL\_RUB$ ,

OBL\_VAL - неисполненное Нетто-обязательство / Нетто-требование Участника клиринга в иностранной валюте VAL, обязательства в которой прекращаются выплатой отступного,

OBL\_RUB - неисполненное Нетто-обязательство / Нетто-требование Участника клиринга в российских рублях, соответствующее Нетто-требованию / Нетто-обязательству Участника клиринга в иностранной валюте VAL, обязательства в которой прекращаются выплатой отступного,

Нетто-обязательство учитывается со знаком «минус», Нетто-требование со знаком «плюс»,

Rc\_RUB\_VAL – Центральный курс сделок по покупке и продаже иностранной валюты VAL, обязательства в которой прекращаются выплатой отступного, рассчитанный в 19:00 по московскому времени текущего Расчетного дня.

Если  $S < 0$ , отступное, рассчитанное в соответствии с настоящим подпунктом Правил клиринга уплачивает Участник клиринга Клиринговому центру, если  $S > 0$ , Клиринговый центр - Участнику клиринга.

## **Статья 19. Порядок использования и возмещения Гарантийного фонда**

19.1. Клиринговый центр использует средства Гарантийного фонда для исполнения обязательств любого из Участников клиринга, внесших взносы в Гарантийный фонд в размере, установленном пунктом 11.1 Правил клиринга, по Сделкам с наступившей Датой исполнения в случае, если Задолженность такого Участника клиринга перед Клиринговым центром не погашена в установленные Регламентом сроки.

19.2. В первую очередь используется взнос в Гарантийный фонд Недобросовестного

участника клиринга, во вторую - взносы в Гарантийный фонд Добросовестных участников клиринга.

Взносы в Гарантийный фонд Добросовестных участников клиринга используются в случае, если сумма Задолженностей Недобросовестных участников клиринга перед Клиринговым центром, пересчитанная в доллары США по курсу, установленному Банком России на дату использования средств Гарантийного фонда, превышает 18 000 000 (восемнадцать миллионов) долларов США.

- 19.3. Взнос в Гарантийный фонд Недобросовестного участника клиринга используется для удовлетворения требований Клирингового центра по Задолженности Недобросовестного участника клиринга путем продажи Клиринговым центром долларов США, составляющих взнос в Гарантийный фонд Недобросовестного участника клиринга, за российские рубли по курсу, равному Нижней границе диапазона оценки рисков сделок по покупке и продаже долларов США за российские рубли, установленной на дату удовлетворения требований.

Удовлетворение требований за счет взноса в Гарантийный фонд Недобросовестного участника клиринга осуществляется Клиринговым центром без предварительного уведомления Недобросовестного участника клиринга.

Сумма, полученная по указанной конверсионной сделке засчитывается Клиринговым центром в счет погашения Задолженности Недобросовестного участника клиринга.

Взнос в Гарантийный фонд Недобросовестного участника клиринга уменьшается на сумму использованных средств Гарантийного фонда из взноса Недобросовестного участника клиринга.

- 19.4. Взносы в Гарантийный фонд Добросовестных участников клиринга используются в размере превышения суммы Задолженностей Недобросовестных участников клиринга пересчитанной в доллары США по курсу, установленному Банком России на дату использования средств Гарантийного фонда, величины, установленной пунктом 19.2 Правил клиринга.

- 19.4.1. Использование взносов в Гарантийный фонд Добросовестных участников клиринга осуществляется пропорционально размеру взноса в Гарантийный фонд каждого Участника клиринга.

- 19.4.2. Взнос в Гарантийный фонд Добросовестного участника клиринга используется для удовлетворения требований Клирингового центра по Задолженности Недобросовестного участника клиринга путем продажи Клиринговым центром долларов США, составляющих взнос в Гарантийный фонд Добросовестного участника клиринга, за российские рубли по курсу, равному Нижней границе диапазона оценки рисков сделок по покупке и продаже долларов США за российские рубли, установленной на дату удовлетворения требований.

Удовлетворение требований за счет взноса в Гарантийный фонд Добросовестного участника клиринга осуществляется Клиринговым центром без предварительного уведомления Добросовестного участника клиринга.

Сумма, полученная по указанной конверсионной сделке засчитывается Клиринговым центром в счет погашения Задолженности Недобросовестного участника клиринга.

Взнос в Гарантийный фонд Добросовестного участника клиринга уменьшается на сумму использованных средств Гарантийного фонда из взноса Добросовестного

участника клиринга.

- 19.5. В случае полного или частичного использования взноса в Гарантийный фонд Участника клиринга, Клиринговый центр вправе с рабочего дня, следующего за днем использования Гарантийного фонда, уменьшить Лимит, обеспеченный средствами фонда, такого Участника клиринга, в том числе установить равным нулю, в порядке, определенном Методикой лимитирования операций на валютном рынке.
- 19.6. В случае использования взносов в Гарантийный фонд Добросовестных Участников клиринга, Недобросовестный участник клиринга обязан в течение 2 (двух) рабочих дней возместить использованные средства Гарантийного фонда.
- Уведомление о необходимости возмещения средств Гарантийного фонда, содержащее информацию о сумме использованных средств Гарантийного фонда, подлежащей возмещению Участником клиринга, о реквизитах счета для возмещения средств Гарантийного фонда, о сроке, в течение которого средства Гарантийного фонда должны быть возмещены, направляется Участнику клиринга в форме электронного документа не позднее рабочего дня, следующего за датой использования Гарантийного фонда.
- В случае невозмещения Недобросовестным участником клиринга средств Гарантийного фонда Клиринговый центр вправе требовать от такого Участника клиринга этого возмещения в судебном порядке.
- 19.7. После возмещения Недобросовестным участником клиринга использованных средств Гарантийного фонда, Клиринговый центр возмещает использованные взносы в Гарантийный фонд Добросовестных участников клиринга.
- Если полученных от Недобросовестного участника клиринга 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.
- 19.8. В случае использования взносов в Гарантийный фонд Добросовестных участников клиринга и невозмещения Недобросовестным участником клиринга использованных средств Гарантийного фонда в течение 2 (двух) рабочих дней после их использования, Добросовестные участники клиринга обязаны восполнить свои взносы в Гарантийный фонд до размера, установленного Клиринговым центром в соответствии с пунктом 11.1 Правил клиринга. Указанная обязанность по восполнению взноса в Гарантийный фонд не может возникать у Добросовестного участника клиринга чаще, чем один раз в Расчетный день.
- Клиринговый центр информирует Добросовестных участников клиринга о необходимости восполнения их взносов в Гарантийный фонд путем направления соответствующих уведомлений.

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

### **Статья 20. Порядок оплаты услуг Клирингового центра, Администратора и Технического центра**

- 20.1. Клиринговый центр взимает с Участников клиринга:
- комиссионное вознаграждение в пользу Клирингового центра за клиринговое обслуживание (далее – комиссионное вознаграждение Клирингового центра);
  - комиссионное вознаграждение в пользу Администратора за организацию торгов;
  - вознаграждение в пользу Технического центра за предоставление интегрированного технологического сервиса (ИТС), включая дополнительный комиссионный сбор за предоставление ИТС, установленный документами Технического центра (далее – Дополнительный комиссионный сбор).
- 20.2. Размер комиссионного вознаграждения Клирингового центра, подлежащего уплате Участником клиринга, рассчитывается Клиринговым центром в соответствии с Тарифами Клирингового центра.
- 20.3. Комиссионное вознаграждение Администратора за организацию торгов взимается Клиринговым центром в соответствии с действующими размерами комиссионного вознаграждения за организацию торгов, утвержденными Администратором (далее – Тарифы Администратора), на основании Договора о взаимодействии.
- 20.4. Вознаграждение Технического центра взимается Клиринговым центром в соответствии с действующими размерами вознаграждения за предоставление ИТС, утвержденными Техническим центром (далее – Тарифы Технического центра), на основании Договора о взаимодействии.
- 20.5. Участник клиринга исполняет обязательства по уплате комиссионных вознаграждений Клирингового центра, Администратора и Технического центра в российских рублях.
- 20.6. Размер комиссионного вознаграждения Администратора за организацию торгов, вознаграждения Технического центра за предоставление ИТС и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за клиринговое обслуживание по сделкам по покупке и продаже иностранной валюты и по сделкам своп рассчитывается с учетом действующего для Участника клиринга тарифного плана.
- 20.6.1. Тарифный план по сделкам по покупке и продаже иностранной валюты или по сделкам своп действует для Регистрационного кода Участника клиринга и для всех Расчетных кодов, открытых в рамках Регистрационного кода.
- 20.6.2. Выбор или изменение Участником клиринга тарифного плана по сделкам своп и по сделкам по покупке и продаже иностранной валюты с Датой исполнения не ранее, чем на второй Расчетный день, следующий после даты заключения сделки, осуществляется путем предоставления Клиринговому центру Заявления о выборе (смене) тарифного плана по сделкам своп.
- Заявление о выборе (смене) тарифного плана по сделкам своп направляется

Участником клиринга в электронном виде с использованием Клиринговой системы или на бумажном носителе, или в форме электронного документа.

Заявление о выборе (смене) тарифного плана по сделкам своп предоставляется в Клиринговый центр не позднее, чем за 5 (пять) рабочих дней до начала календарного месяца, с которого будет применяться соответствующий тарифный план, за исключением случаев первоначального допуска к клиринговому обслуживанию.

Тарифные планы по сделкам своп и по сделкам по покупке и продаже иностранной валюты с Датой исполнения не ранее, чем на второй Расчетный день, следующий после даты заключения сделки, применяются с первого числа календарного месяца, за исключением Тарифного плана SWP\_0, который, в случае первоначального допуска к клиринговому обслуживанию, может применяться с любого числа календарного месяца.

Участникам клиринга, не выбравшим ни один из тарифных планов по сделкам своп и по сделкам по покупке и продаже иностранной валюты с Датой исполнения не ранее, чем на второй Расчетный день, следующий после даты заключения сделки, устанавливается тарифный план SWP\_0, который устанавливается с даты допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию и действует до начала применения иного тарифного плана, выбранного Участником клиринга.

- 20.6.3. Выбор или изменение Участником клиринга тарифного плана по сделкам по покупке и продаже иностранной валюты с Датой исполнения в дату заключения сделки или в первый Расчетный день, следующий за датой заключения сделки (за исключением сделок своп), осуществляется путем предоставления Клиринговому центру Заявления о выборе (смене) тарифного плана по сделкам по покупке и продаже иностранной валюты.

Заявление о выборе (смене) тарифного плана по сделкам по покупке и продаже иностранной валюты направляется Участником клиринга в электронном виде с использованием Клиринговой системы или на бумажном носителе, или в форме электронного документа.

Заявление о выборе (смене) тарифного плана по сделкам по покупке и продаже иностранной валюты предоставляется в Клиринговый центр не позднее, чем за 5 (пять) рабочих дней до начала календарного месяца, с которого будет применяться соответствующий тарифный план, за исключением первоначального допуска к клиринговому обслуживанию.

Тарифные планы по сделкам по покупке и продаже иностранной валюты с Датой исполнения в дату заключения сделки или в первый Расчетный день, следующий за датой заключения сделки (за исключением сделок своп), применяются с первого числа календарного месяца, за исключением Тарифного плана SPT\_0, который, в случае первоначального допуска к клиринговому обслуживанию, может применяться с любого числа календарного месяца.

Участникам клиринга, не выбравшим ни один из тарифных планов по сделкам по покупке и продаже иностранной валюты с Датой исполнения в дату заключения сделки или в первый Расчетный день, следующий за датой заключения сделки (за исключением сделок своп), устанавливается тарифный план SPT\_0, который устанавливается с даты допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию и действует до начала применения иного тарифного плана, выбранного Участником клиринга.

- 20.7. Размер оборотной части комиссионного вознаграждения Администратора за организацию торгов, оборотной части вознаграждения Технического центра за предоставление ИТС и оборотной части комиссионного вознаграждения Клирингового центра за клиринговое обслуживание по сделкам по покупке и продаже иностранной валюты и по сделкам своп рассчитывается после заключения Сделки и подлежит уплате Участником клиринга ежедневно в дату заключения Сделки в срок, установленный Регламентом.
- 20.8. Постоянная часть комиссионного вознаграждения Администратора за организацию торгов по сделкам по покупке и продаже иностранной валюты и по сделкам своп, постоянная часть вознаграждения Технического центра за предоставление ИТС по сделкам по покупке и продаже иностранной валюты и по сделкам своп и постоянная часть комиссионного вознаграждения Клирингового центра за клиринговое обслуживание по сделкам по покупке и продаже иностранной валюты и по сделкам своп подлежат уплате Участником клиринга в первый Рабочий день календарного месяца, за который взимается постоянная часть комиссионного вознаграждения, в срок, установленный Регламентом, по Расчетному коду, указанному Участником клиринга в Заявлении о выборе Расчетного кода для списания комиссионных вознаграждений (в случае предоставления указанного заявления) либо по основному Расчетному коду, соответствующему Регистрационному коду, для которого Участником клиринга выбран тарифный план, содержащий постоянную часть комиссионного вознаграждения по сделкам по покупке и продаже иностранной валюты и/или по сделкам своп.
- Заявление о выборе Расчетного кода для списания комиссионных вознаграждений направляется Участником клиринга на бумажном носителе, или в форме электронного документа.
- Заявление о выборе Расчетного кода для списания комиссионных вознаграждений действует, начиная с дня, следующего за днем его предоставления.
- 20.9. В случае приостановки / прекращения допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию в течение календарного месяца, постоянная часть комиссионного вознаграждения Администратора за организацию торгов по сделкам по покупке и продаже иностранной валюты и по сделкам своп, постоянная часть вознаграждения Технического центра за предоставление ИТС по сделкам по покупке и продаже иностранной валюты и по сделкам своп и постоянная часть комиссионного вознаграждения Клирингового центра за клиринговое обслуживание по сделкам по покупке и продаже иностранной валюты и по сделкам своп, уплаченная Участником клиринга, не пересчитывается и Участнику клиринга не возвращается.
- 20.10. В случае если для Участника клиринга действует тарифный план SPT\_0 по сделкам по покупке и продаже иностранной валюты с Датой исполнения в дату заключения сделки или в первый Расчетный день, следующий за датой заключения сделки (за исключением сделок своп), и по итогам месяца сумма рассчитанной оборотной части комиссионного вознаграждения Клирингового центра за клиринговое обслуживание по сделкам по покупке и продаже иностранной валюты с Датой исполнения в дату заключения сделки или в первый Расчетный день, следующий за датой заключения сделки (за исключением сделок своп), или оборотной части комиссионного вознаграждения Администратора за организацию торгов по сделкам по покупке и продаже иностранной валюты с Датой исполнения в дату

заклучения сделки или в первый Расчетный день, следующий за датой заклучения сделки (за исключением сделок своп), или оборотной части вознаграждения Технического центра за предоставление ИТС по сделкам по покупке и продаже иностранной валюты с Датой исполнения в дату заклучения сделки или в первый Расчетный день, следующий за датой заклучения сделки (за исключением сделок своп), подлежащего уплате Участником клиринга в течение истекшего месяца по всем Расчетным кодам, открытым в рамках одного Регистрационного кода, меньше, чем соответствующее минимальное ежемесячное комиссионное вознаграждение, установленное Тарифами Клирингового центра, Тарифами Администратора или Тарифами Технического центра, Участник клиринга обязан уплатить Клиринговому центру и/или Администратору и/или Техническому центру разницу между соответствующим минимальным ежемесячным комиссионным вознаграждением и суммой соответствующей рассчитанной оборотной части комиссионного вознаграждения Клирингового центра и/или Администратора и/или Технического центра по сделкам по покупке и продаже иностранной валюты с Датой исполнения в дату заклучения сделки или в первый Расчетный день, следующий за датой заклучения сделки (за исключением сделок своп), подлежащего уплате Участником клиринга в течение истекшего месяца (в том числе суммой равной нулю).

Указанная разница уплачивается Участником клиринга, имевшим доступ к торгам или клиринговому обслуживанию в течение одного и более дней в календарном месяце, вне зависимости от факта подачи заявок, заклучения и/или исполнения сделок, в последний Рабочий день месяца по Расчетному коду, указанному Участником клиринга в Заявлении о выборе Расчетного кода для списания комиссионных вознаграждений, предоставленном в соответствии с пунктом 20.8 Правил клиринга (в случае предоставления указанного заявления), либо по основному Расчетному коду, соответствующему Регистрационному коду Участника клиринга, по которому зафиксировано превышение соответствующего минимального ежемесячного комиссионного вознаграждения над соответствующей рассчитанной оборотной частью комиссионного вознаграждения Клирингового центра и/или Администратора и/или Технического центра по сделкам по покупке и продаже иностранной валюты с Датой исполнения в дату заклучения сделки или в первый Расчетный день, следующий за датой заклучения сделки (за исключением сделок своп), подлежащего уплате Участником клиринга в течение истекшего месяца.

В случае приостановки / прекращения допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию в течение календарного месяца, минимальное ежемесячное комиссионное вознаграждение взимается в последний Рабочий день указанного допуска.

- 20.11. Фиксированная часть вознаграждения за предоставление ИТС подлежит уплате Участником клиринга в первый Рабочий день календарного месяца, следующего за месяцем фактического оказания услуг по предоставлению ИТС, в срок, установленный Регламентом, по Расчетному коду, указанному Участником клиринга в Заявлении о выборе Расчетного кода для списания комиссионных вознаграждений, предоставленном в соответствии с пунктом 20.8 Правил клиринга (в случае предоставления указанного заявления), либо основному Расчетному коду, соответствующему Регистрационному коду.

В случае приостановки / прекращения допуска Участника клиринга к

клиринговому обслуживанию в течение календарного месяца, фиксированная часть вознаграждения за предоставление ИТС взимается в последний Рабочий день указанного допуска.

- 20.12. Подлежащий уплате в соответствии с Тарифами Технического центра Дополнительный комиссионный сбор, рассчитанный в отношении Участника клиринга / Клиента, подлежит уплате Участником клиринга в Расчетный день, по итогам которого указанное дополнительное вознаграждение рассчитано, в срок, установленный Регламентом для уплаты комиссионного вознаграждения, по Расчетному коду, с указанием которого Участником клиринга в течение данного Расчетного дня были заключены Сделки за свой счет или за счет указанного Клиента, если такой Расчетный код – единственный, либо по Расчетному коду, указанному Участником клиринга в Заявлении о выборе Расчетного кода для списания комиссионных вознаграждений, предоставленном в соответствии с пунктом 20.8 Правил клиринга (в случае предоставления указанного заявления), либо по основному Расчетному коду, если Участником клиринга в течение данного Расчетного дня Сделки за свой счет или за счет указанного Клиента были заключены с указанием нескольких Расчетных кодов.
- 20.13. В случае если сумма комиссионного вознаграждения Клирингового центра, Администратора или Технического центра выражена в долларах США, указанная сумма пересчитывается в российские рубли по курсу доллара США к российскому рублю, установленному Банком России на дату взимания соответствующего комиссионного вознаграждения.
- 20.14. По окончании торгов и получении от Администратора выписки из реестра сделок по итогам Основной сессии ЕТС Клиринговый центр рассчитывает обязательства Участника клиринга по уплате комиссионных вознаграждений в соответствии с настоящим разделом Правил клиринга.
- 20.15. Информация о размере комиссионного вознаграждения Администратора, Технического центра и Клирингового центра, подлежащего уплате Участником клиринга в отчетную дату, указывается в Отчете о комиссионных вознаграждениях, направляемом Клиринговым центром Участникам клиринга в сроки, установленные Регламентом.
- 20.16. Клиринговый центр зачитывает требование Участника клиринга к Клиринговому центру по возврату Участнику клиринга денежных средств в российских рублях, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга, с обязательством Участника клиринга по уплате комиссионных вознаграждений.  
При этом размер Обеспечения Участника клиринга в российских рублях уменьшается на сумму обязательства Участника клиринга по уплате комиссионных вознаграждений.
- 20.17. Если Обеспечения Участника клиринга в российских рублях недостаточно для исполнения обязательства Участника клиринга по уплате комиссионных вознаграждений в полном объеме, неисполненное обязательство (неисполненная часть обязательства) Участника клиринга по уплате комиссионных вознаграждений учитывается Клиринговым центром как Задолженность по комиссиям Участника клиринга перед Клиринговым центром.

Указанная Задолженность по комиссиям должна быть погашена Участником клиринга до установленного Регламентом времени следующего Рабочего дня.

Информация о наличии Задолженности по комиссиям и ее размере передается Участнику клиринга в составе отчета «Требование о погашении задолженности», направляемом Участнику клиринга в соответствии с пунктом 14.5 Правил клиринга.

- 20.18. Информация о размере оборотной части комиссионного вознаграждения Администратора за организацию торгов, оборотной части вознаграждения Технического центра за предоставление ИТС и оборотной части комиссионного вознаграждения Клирингового центра за клиринговое обслуживание по каждой заключенной Участником клиринга Сделке, рассчитанном Клиринговым центром, становится доступной Администратору посредством ПТК ТЦ немедленно после его расчета.

## **Статья 21. Порядок предоставления отчетов по итогам клиринга**

- 21.1. Клиринговый центр обеспечивает Участнику клиринга с использованием рабочего места Участника торгов ЕТС возможность получения следующей информации из Клиринговой системы:

- о размере Обеспечения Участника клиринга в каждой валюте;
- о размере Единого лимита Участника клиринга;
- о размере Лимита, обеспеченного средствами фонда (в случае если для Участника клиринга установлен Лимит, обеспеченный средствами фонда);
- о размере Торгового лимита Участника клиринга (в случае если для Участника клиринга установлен Торговый лимит);
- о значении Нетто-обязательства и/или Нетто-требования Участника клиринга в каждой валюте и с каждой Датой исполнения;
- о размере Обеспечения Участника клиринга в каждой валюте, недостающего для исполнения Нетто-обязательства Участника клиринга в соответствующей валюте с наступившей Датой исполнения;
- о наличии / отсутствии Маржинального требования Участника клиринга, о сумме Маржинального требования в российских рублях (в случае наличия);
- о наличии / отсутствии Задолженности Участника клиринга перед Клиринговым центром, о сумме Задолженности Участника клиринга (в случае наличия).

- 21.2. Клиринговый центр формирует отчеты по итогам клиринга для Участников клиринга в форме электронных документов.

Отчеты по итогам клиринга содержат реквизиты, набор полей и информацию, предусмотренные Правилами клиринга.

Отчеты по итогам клиринга подписываются Клиринговым центром с использованием электронной подписи.

По требованию Участника клиринга могут быть изготовлены (распечатаны) копии электронных документов на бумажном носителе.

Копии электронных документов на бумажном носителе и отчеты по итогам клиринга на бумажном носителе подписываются уполномоченным лицом

Клирингового центра и передаются сотруднику Участника клиринга, действующему на основании доверенности, либо направляются Участнику клиринга по почте заказным письмом с уведомлением.

21.3. Формы отчетов по итогам клиринга, предоставляемых Клиринговым центром Участникам клиринга в соответствии с Правилами клиринга, установлены документом «Формы отчетов, предоставляемых Участникам клиринга в соответствии с Правилами клиринга ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр» на валютном рынке», раскрываемом на Сайте Клирингового центра.

21.4. Клиринговый центр предоставляет Участнику клиринга с использованием Клиринговой системы информацию об Итоговых нетто-обязательствах и/или Итоговых нетто-требованиях Участника клиринга в соответствующей валюте.

В случае несоответствия информации, полученной Участником клиринга с использованием Клиринговой системы, и информации, содержащейся в подписанном уполномоченным лицом Клирингового центра Биржевом свидетельстве, расчеты должны осуществляться Участником клиринга на основании Биржевого свидетельства.

## РАЗДЕЛ VII. ПРОЧИЕ УСЛОВИЯ

### Статья 22. Порядок урегулирования обязательств в случае прекращения допуска к клиринговому обслуживанию

- 22.1. 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 22.7 Правил клиринга.
- 22.1.1. 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.
- 22.1.2. В случае отзыва (аннулирования) лицензии на осуществление банковских операций у Участника клиринга – кредитной организации, обязательства по Сделкам, 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.  
Указанные обязательства прекращаются возникновением нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга – кредитной организации, рассчитанного в соответствии с пунктом 22.7 Правил клиринга.
- 22.1.3. В случае отзыва (аннулирования) лицензии на осуществление банковских операций у Участника клиринга – кредитной организации, Сделки, заключенные в дату отзыва (аннулирования) такой лицензии и (или) после нее, являются недействительными.  
Клиринговый центр вправе предъявить к Участнику клиринга требование о взыскании убытков, связанных с недействительностью указанных сделок, а также неустоек (штрафов, пеней) и комиссионных вознаграждений, подлежащих уплате в соответствии с Правилами клиринга, в общем порядке, предусмотренном законодательством о несостоятельности (банкротстве).
- 22.1.4. 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 Сделкам не позднее Рабочего дня, следующего за датой прекращения обязательств по этим Сделкам.

Клиринговый центр направляет такому Участнику клиринга - кредитной организации в форме электронного документа уведомление о прекращении действия Договора об оказании клиринговых услуг.

- 22.1.5. Клиринговый центр в порядке, предусмотренном пунктом 22.7 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 22.7 Правил клиринга сумме нетто-обязательства или нетто-требования Участника клиринга.
- 22.1.6. Возврат денежных средств Участнику клиринга – кредитной организации осуществляется Клиринговым центром в течение 3 (трех) банковских дней после получения Клиринговым центром письма о возврате денежных средств от уполномоченного органа кредитной организации, содержащего платежные реквизиты, а также документов, подтверждающих полномочия указанного органа (если они ранее не были переданы Клиринговому центру).  
Возврат денежных средств Участнику клиринга – кредитной организации осуществляется Клиринговым центром в сумме нетто-требования Участника клиринга, рассчитанного в порядке, предусмотренном пунктом 22.7 Правил клиринга.
- 22.1.7. Клиринговый центр вправе предъявить к Участнику клиринга – кредитной организации требование о взыскании нетто-обязательства Участника клиринга, рассчитанного в порядке, предусмотренном пунктом 22.7 Правил клиринга, в общем порядке, предусмотренном законодательством о несостоятельности (банкротстве).
- 22.2. 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 22.8 Правил клиринга.
- 22.2.1. В случае назначения временной администрации или принятия арбитражным судом решения о введении в отношении Участника клиринга – некредитной организации одной из процедур банкротства, обязательства по Сделкам прекращаются полностью в дату прекращения допуска к клиринговому обслуживанию.  
Указанные обязательства по Сделкам прекращаются возникновением нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга – некредитной организации, рассчитанных в соответствии с пунктом 22.8 Правил клиринга.
- 22.2.2. Клиринговый центр направляет такому Участнику клиринга – некредитной организации в форме электронного документа уведомление о прекращении обязательств по сделкам не позднее Рабочего дня, следующего за датой прекращения обязательств по указанным сделкам.
- 22.2.3. Клиринговый центр в порядке, предусмотренном пунктом 22.8 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 22.8 Правил клиринга сумме нетто-обязательства или нетто-требования Участника клиринга.

22.2.4. Возврат денежных средств Участнику клиринга – некредитной организации осуществляется Клиринговым центром в течение 3 (трех) банковских дней после получения Клиринговым центром письма о возврате денежных средств от уполномоченного органа Участника клиринга – некредитной организации, содержащего платежные реквизиты, а также документов, подтверждающих полномочия указанного органа (если они ранее не были переданы Клиринговому центру).

Возврат денежных средств Участнику клиринга – некредитной организации осуществляется Клиринговым центром в сумме нетто-требования Участника клиринга, рассчитанного в порядке, предусмотренном пунктом 22.8 Правил клиринга.

22.2.5. Клиринговый центр вправе предъявить к Участнику клиринга – некредитной организации требование о взыскании нетто-обязательства Участника клиринга, рассчитанного в порядке, предусмотренном пунктом 22.8 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).

22.2.6. После назначения временной администрации или принятия арбитражным судом решения о введении в отношении Участника клиринга – некредитной организации одной из процедур банкротства и направления ему уведомления о рассчитанных нетто-обязательствах / нетто-требованиях Клиринговый центр направляет такому Участнику клиринга в форме электронного документа уведомление о прекращении действия Договора об оказании клиринговых услуг.

22.3. В случае отзыва (аннулирования) специального разрешения (лицензии или иного основания) компетентного органа государства учреждения Банка-нерезидента, в соответствии с которым Банк-нерезидент имеет право осуществлять банковские операции допуск к клиринговому обслуживанию Участника клиринга – Банка-нерезидента прекращается со дня отзыва (аннулирования) специального разрешения (лицензии или иного основания) компетентного органа государства учреждения Банка-нерезидента, в соответствии с которым Банк-нерезидент имеет право осуществлять банковские операции, за исключением расчета Клиринговым центром нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга – кредитной организации в соответствии с пунктом 22.9 Правил клиринга.

22.3.1. Подтверждением факта отзыва (аннулирования) указанного специального разрешения (лицензии или иного основания) компетентного органа государства учреждения Банка-нерезидента является письменное уведомление компетентного органа государства учреждения Банка-нерезидента, направленное Клиринговому центру (в том числе, посредством факсимильной связи) и/или размещенная компетентным органом государства учреждения Банка-нерезидента на сайте вышеуказанного компетентного органа в сети Интернет информация о принятом решении об отзыве (аннулировании) выданного Банку-нерезиденту специального разрешения (лицензии или иного основания), в соответствии с которым Банк-нерезидент имеет право осуществлять банковские операции, и/или направленное

компетентным органом по электронному адресу Клирингового центра соответствующее электронное сообщение.

- 22.3.2. В случае отзыва (аннулирования) специального разрешения (лицензии или иного основания) компетентного органа государства учреждения Банка-нерезидента, в соответствии с которым Банк-нерезидент имеет право осуществлять банковские операции, обязательства Банка-нерезидента по Сделкам прекращаются полностью в дату, в которую Клиринговый центр узнал об отзыве (аннулировании) компетентным органом государства учреждения Банка-нерезидента соответствующего специального разрешения (лицензии или иного основания).  
Указанные обязательства прекращаются возникновением нетто-обязательств /нетто-требований Участника клиринга – Банка-нерезидента, рассчитанных в соответствии с пунктом 22.9 Правил клиринга.
- 22.3.3. Клиринговый центр направляет такому Участнику клиринга – Банку-нерезиденту в форме электронного документа уведомление о прекращении обязательств по Сделкам не позднее Рабочего дня, следующего за датой прекращения обязательств по Сделкам.
- 22.3.4. Клиринговый центр в порядке, предусмотренном пунктом 22.9 Правил клиринга, рассчитывает сумму нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга – Банка-нерезидента и направляет такому Участнику клиринга в форме электронного документа уведомление о рассчитанной в соответствии с пунктом 22.9 Правил клиринга сумме нетто-обязательства или нетто-требования Участника клиринга.
- 22.3.5. Возврат денежных средств Участнику клиринга – Банку-нерезиденту осуществляется Клиринговым центром в течение 3 (трех) банковских дней после получения Клиринговым центром письма о возврате денежных средств от уполномоченного (в соответствии с национальным законодательством страны учреждения Банка-нерезидента) органа Банка-нерезидента, содержащего платежные реквизиты, в сумме нетто-требования в российских рублях Участника клиринга, рассчитанного в порядке, предусмотренном пунктом 22.9 Правил клиринга.
- 22.3.6. Клиринговый центр вправе предъявить Участнику клиринга - Банку-нерезиденту требование об уплате денежных средств в сумме нетто-обязательства Участника клиринга в российских рублях, рассчитанного в соответствии с пунктом 22.9 Правил клиринга, в судебном порядке.
- 22.3.7. После возврата денежных средств Участнику клиринга – Банку-нерезиденту Клиринговый центр направляет такому Участнику клиринга в форме электронного документа уведомление о прекращении действия Договора об оказании клиринговых услуг.
- 22.4. В случае прекращения Международного соглашения для Российской Федерации либо со дня прекращения Международного соглашения для государства - стороны Международного соглашения, являющегося государством учреждения Участника-клиринга – Банка-нерезидента, допуск к клиринговому обслуживанию такого Участника клиринга – Банка-нерезидента прекращается со дня прекращения Международного соглашения для Российской Федерации либо со дня прекращения Международного соглашения для государства - стороны Международного соглашения, являющегося государством учреждения такого Участника-клиринга – Банка-нерезидента.

- 22.4.1. После прекращения обязательств по Сделкам, заключенным данным Участником клиринга до момента прекращения допуска к клиринговому обслуживанию Участника клиринга, Клиринговый центр в течение 3 (трех) банковских дней после получения письма о возврате денежных средств от уполномоченного органа Участника клиринга – Банка-нерезидента, содержащего платежные реквизиты, осуществляет возврат денежных средств Участника клиринга, учитываемых на счетах Клирингового центра, и направляет такому Участнику клиринга в форме электронного документа уведомление о прекращении действия Договора об оказании клиринговых услуг.
- 22.5. В случае прекращения международного договора, в соответствии с которым учреждена Международная организация, для Российской Федерации либо со дня принятия решения уполномоченными лицами сторон указанного международного договора о прекращении деятельности Международной организации, допуск к клиринговому обслуживанию Международной организации прекращается со дня прекращения международного договора, в соответствии с которым такая Международная организация учреждена, для Российской Федерации либо со дня принятия решения уполномоченными лицами сторон указанного международного договора о прекращении деятельности Международной организации.
- 22.5.1. После прекращения обязательств по Сделкам, заключенным данным Участником клиринга до момента прекращения допуска к клиринговому обслуживанию Участника клиринга, Клиринговый центр в течение 3 (трех) банковских дней после получения письма о возврате денежных средств от уполномоченного органа Международной организации, содержащего платежные реквизиты, осуществляет возврат денежных средств Участнику клиринга – Международной организации и направляет такому Участнику клиринга – Международной организации в форме электронного документа уведомление о прекращении действия Договора об оказании клиринговых услуг.
- 22.6. В случае принятия федерального закона о ликвидации Государственной корпорации, допуск к клиринговому обслуживанию Государственной корпорации прекращается.
- 22.6.1. Если иное не предусмотрено федеральным законом о ликвидации Государственной корпорации, после прекращения обязательств по Сделкам, заключенным данным Участником клиринга до момента прекращения допуска к клиринговому обслуживанию Участника клиринга, Клиринговый центр в течение 3 (трех) банковских дней после получения письма о возврате денежных средств от уполномоченного органа Государственной корпорации, содержащего платежные реквизиты, осуществляет возврат денежных средств Участнику клиринга – Государственной корпорации и направляет такому Участнику клиринга – Государственной корпорации в форме электронного документа уведомление о прекращении действия Договора об оказании клиринговых услуг.
- 22.7. 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 как сумму с учетом знака рассчитанных в соответствующих валютах:
- а) разности суммы абсолютных величин Нетто-обязательств в соответствующей

валюте Участников клиринга по Сделкам, заключенным Клиринговым центром в соответствии с пунктом 18.26 Правил клиринга, и суммы абсолютных величин Нетто-обязательств в соответствующей валюте Участника клиринга, рассчитанных на конец дня, предшествующего дате отзыва (аннулирования) у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций, и

- б) разности суммы Нетто-требований в соответствующей валюте Участника клиринга, рассчитанных на конец дня, предшествующего дате отзыва (аннулирования) у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций, и суммы Нетто-требований в соответствующей валюте Участников клиринга по сделкам, заключенным Клиринговым центром в соответствии с пунктом 18.26 Правил клиринга, и
- в) Обеспечения Участника клиринга в соответствующей валюте (учитывается со знаком «плюс») и;
- г) значения (с учетом знака) обязательства / требования Участника клиринга в российских рублях по возврату Гарантийных переводов, рассчитанного на дату, предшествующую дате отзыва (аннулирования) у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций, и
- д) Задолженности по сделкам и/или Задолженности по гарантийным переводам (со знаком «минус») Участника клиринга в российских рублях, возникшей до даты отзыва (аннулирования) у Участника клиринга указанной лицензии.

При этом значения в иностранной валюте, рассчитанные в соответствии с подпунктами а), б), г) настоящего пункта, и Обеспечение в иностранной валюте пересчитывается 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 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.

22.8. В случае назначения временной администрации или принятия арбитражным судом решения о введении в отношении Участника клиринга - некредитной организацией одной из процедур банкротства, Клиринговый центр рассчитывает размер нетто-обязательства Участника клиринга в российских рублях по состоянию на конец дня, предшествующего дате назначения временной администрации или принятия арбитражным судом решения о введении в отношении Участника клиринга - некредитной организацией одной из процедур банкротства, в порядке, аналогичном предусмотренному пунктом 22.7 Правил клиринга.

22.9. В случае отзыва (аннулирования) специального разрешения (лицензии или иного основания) компетентного органа государства учреждения Банка-нерезидента, в соответствии с которым Банк-нерезидент имеет право осуществлять банковские операции, Клиринговый центр рассчитывает размер нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в соответствующей валюте как сумму с учетом знака рассчитанных в соответствующих валютах:

- а) разности суммы абсолютных величин Нетто-обязательств в соответствующей валюте Участников клиринга по Сделкам, заключенным Клиринговым центром в соответствии с пунктом 18.26 Правил клиринга, и суммы

- абсолютных величин Нетто-обязательств в соответствующей валюте Участника клиринга, рассчитанных на конец дня, в который Клиринговый центр узнал об отзыве (аннулировании) у Участника клиринга специального разрешения (лицензии или иного основания) компетентного органа государства учреждения Банка-нерезидента, и
- б) разности суммы Нетто-требований в соответствующей валюте Участника клиринга, рассчитанных на конец дня, в который Клиринговый центр узнал об отзыве (аннулировании) у Участника клиринга специального разрешения (лицензии или иного основания) компетентного органа государства учреждения Банка-нерезидента, в соответствии с которым Банк-нерезидент имеет право осуществлять банковские операции, и суммы Нетто-требований в соответствующей валюте Участников клиринга по сделкам, заключенным Клиринговым центром в соответствии с пунктом 18.26 Правил клиринга, и
  - в) Обеспечения Участника клиринга в соответствующей валюте (учитывается со знаком «плюс») и;
  - г) взноса Участника клиринга в Гарантийный фонд (учитывается со знаком «плюс») и;
  - д) значения (с учетом знака) обязательства / требования Участника клиринга в российских рублях по возврату Гарантийных переводов, рассчитанного на конец дня, в который Клиринговый центр узнал об отзыве (аннулировании) у Участника клиринга специального разрешения (лицензии или иного основания) компетентного органа государства учреждения Банка-нерезидента, в соответствии с которым Банк-нерезидент имеет право осуществлять банковские операции, и
  - е) Задолженности (со знаком «минус») Участника клиринга в российских рублях, возникшей до дня, в который Клиринговый центр узнал об отзыве (аннулировании) у Участника клиринга специального разрешения (лицензии или иного основания) компетентного органа государства учреждения Банка-нерезидента, в соответствии с которым Банк-нерезидент имеет право осуществлять банковские операции, и/или в указанный день.

При этом значения в иностранной валюте, рассчитанные в соответствии с подпунктами а), б), д) настоящего пункта, и Обеспечение в иностранной валюте пересчитывается в российские рубли по Центральному курсу, рассчитанному Клиринговым центром в ходе клиринговой сессии Рабочего дня, предшествующего дню расчета указанной суммы денежных средств.

- 22.10. В случае отзыва (аннулирования) лицензии на осуществление банковских операций у Клирингового центра, обязательства по Сделкам, 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-обязательства / нетто-требования Клирингового центра, рассчитанного в соответствии с пунктом 22.11 Правил клиринга.

- 22.10.1. В случае отзыва (аннулирования) лицензии на осуществление банковских операций у Клирингового центра, обязательства по Сделкам, заключенным в дату отзыва (аннулирования) такой лицензии, являются недействительными.

Участник клиринга вправе предъявить к Клиринговому центру требование о

взыскании убытков, связанных с недействительностью указанных Сделок, а также неустоек (штрафов, пеней), подлежащих уплате в соответствии с Правилами клиринга, в общем порядке, предусмотренном законодательством о несостоятельности (банкротстве).

22.11. В случае отзыва (аннулирования) лицензии на осуществление банковских операций у Клирингового центра размер нетто-обязательства / нетто-требования Клирингового центра в российских рублях в отношении каждого Участника клиринга рассчитывается как сумма с учетом знака по всем Регистрационным и Расчетным кодам Участника клиринга и всем Датам исполнения:

- а) суммы (с учетом знака) Нетто-обязательства Участника клиринга в российских рублях, рассчитанного на конец дня, предшествующего дате отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций, и требования Участника клиринга в российских рублях по оплате иностранной валюты, которое возникло бы в случае заключения между Участником клиринга и Клиринговым центром сделки по продаже Участником клиринга иностранной валюты в сумме, равной Нетто-требованию Участника клиринга в данной иностранной валюте, рассчитанному на конец дня, предшествующего дате отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций, по курсу, установленному Банком России на день отзыва у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций, в случае если на конец дня, предшествующего дате отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций, у Участника клиринга учитывалось Нетто-требование в данной иностранной валюте, и/или;
- б) суммы (с учетом знака) Нетто-требования Участника клиринга в российских рублях, рассчитанного на конец дня, предшествующего дате отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций, и обязательства Участника клиринга в российских рублях по оплате иностранной валюты, которое возникло бы в случае заключения между Участником клиринга и Клиринговым центром сделки по покупке Участником клиринга иностранной валюты в сумме, равной Нетто-обязательству Участника клиринга в данной иностранной валюте, рассчитанному на конец дня, предшествующего дате отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций, по курсу, установленному Банком России на день отзыва у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций, в случае если на конец дня, предшествующего дате отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций, у Участника клиринга учитывалось Нетто-обязательство в данной иностранной валюте.
- в) Обеспечения Участника клиринга в российских рублях (учитывается со знаком «плюс»);
- г) Обеспечения Участника клиринга в иностранной валюте, пересчитанного в российские рубли по курсу, установленному Банком России на день отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций (учитывается со знаком «плюс»);
- д) неисполненных Маржинальных требований, возникших до даты отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций (учитываются со знаком «минус»);

- е) взноса Участника клиринга в Гарантийный фонд (учитывается со знаком «плюс»);
- ж) значения (с учетом знака) обязательства / требования Участника клиринга в российских рублях по возврату Гарантийных переводов по Сделкам с частичным обеспечением, рассчитанного на дату, предшествующую дате отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций, и
- з) Задолженности по сделкам и/или Задолженности по гарантийным переводам (со знаком «минус») Участника клиринга в российских рублях, возникшей до даты отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций.

Если величина, рассчитанная в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга, отрицательная, это означает наличие нетто-требования Клирингового центра по отношению к Участнику клиринга, если положительная – наличие нетто-обязательства Клирингового центра по отношению к Участнику клиринга.

- 22.12. Информация о размере нетто-обязательства / нетто-требования Клирингового центра в российских рублях в отношении Участника клиринга, определенных в соответствии с пунктом 22.11 Правил клиринга направляется Клиринговым центром Участнику клиринга в форме электронного документа.

### **Статья 23. Взаимодействие с Администратором при возникновении обстоятельств, которые могут повлиять на возможность проведения торгов**

- 23.1. 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 Администратора любым из доступных средств связи и предпринимает все возможные меры, направленные на устранение указанных обстоятельств.

### **Статья 24. Чрезвычайные ситуации**

- 24.1. 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 30-ти минут после окончания установленного Регламентом времени исполнения Участниками клиринга своих Итоговых нетто-обязательств перед Клиринговым центром;

- 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.

24.2. Признание ситуации чрезвычайной осуществляется по решению Клирингового центра.

24.3. В случае признания Клиринговым центром возникшей ситуации чрезвычайной, Клиринговый центр предпринимает следующие действия:

- извещает Администратора имеющимися доступными средствами связи о возникновении чрезвычайной ситуации и о мерах, необходимых, по мнению Клирингового центра, для ее устранения;
- извещает Участников клиринга имеющимися у Клирингового центра и доступными ему в данной ситуации средствами о возникновении чрезвычайной ситуации и предпринимаемых в связи с этим действиях;
- на основании решения Клирингового центра, согласованного (если таковое согласование с учетом сложившихся обстоятельств было возможным) с Банком России и, при необходимости, с Администратором, не осуществляет клиринговое обслуживание Участников клиринга.

24.4. В качестве мер по урегулированию чрезвычайной ситуации Клиринговый центр по согласованию с Банком России и Администратором Клиринговым центром могут быть приняты следующие решения:

- об утрате силы Биржевых свидетельств, полученных Участниками клиринга в день возникновения чрезвычайной ситуации;
- об изменении способа и срока исполнения обязательств Участниками клиринга по итогам Торговых сессии ЕТС;
- об осуществлении иных действий, направленных на урегулирование чрезвычайной ситуации.

24.5. При принятии решений по урегулированию чрезвычайных ситуаций, Клиринговый центр по согласованию с Администратором вправе:

- устанавливать сроки и порядок исполнения своих решений Участниками клиринга;
- обуславливать порядок вступления в силу своих решений определенными

обстоятельствами.

- 24.6. О мерах, предпринятых по решению Клирингового центра в целях урегулирования чрезвычайной ситуации, Банк России, Участники клиринга и Администратор оповещаются имеющимися доступными средствами связи не позднее дня принятия данных мер.
- 24.7. Клиринговый центр не несет ответственности за убытки, которые могут возникнуть в связи с неосуществлением клирингового обслуживания Участников клиринга в соответствии с Правилами клиринга в случае признания ситуации чрезвычайной в связи с обстоятельствами, предусмотренными пунктом 24.1 Правил клиринга.

## **Статья 25. Порядок разрешения споров**

- 25.1. Все споры и разногласия, возникающие в связи с применением, нарушением, толкованием Правил клиринга, исполнением обязательств, вытекающих из Правил клиринга, признанием недействительными Правил клиринга или их части, подлежат рассмотрению и разрешению 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.
- 25.2. Решения Арбитражной комиссии при ОАО Московская Биржа являются окончательными и обязательными для исполнения. Неисполненное добровольно решение Арбитражной комиссии при ОАО Московская Биржа подлежит принудительному исполнению в соответствии с законодательством Российской Федерации или законодательством страны места принудительного исполнения и/или международными соглашениями.

**Приложение № 1**  
к Правилам клиринга ЗАО АКБ «Национальный  
Клиринговый Центр» на валютном рынке

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

город Москва

«\_\_» \_\_\_\_\_ 20\_\_ года

<b>Участник клиринга</b> (полное фирменное наименование)	
<b>Клиринговая организация</b>	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.

	<b>От имени участника клиринга</b>	<b>От имени клиринговой организации</b>
<b>ФИО</b>		
<b>Должность</b>		
<b>Основание полномочий</b>		
<b>Подпись, печать</b>		

**Приложение № 2**  
к Правилам клиринга ЗАО АКБ «Национальный  
Клиринговый Центр» на валютном рынке

**Тарифы Клирингового центра на валютном рынке**

№ п/п	Наименование услуги	Тариф, включая НДС
1.	<b>Предоставление Участнику клиринга по письменному запросу копии отчета по итогам клиринга на бумажном носителе (клирингового отчета, биржевого свидетельства, отчета о комиссионных вознаграждениях или иного отчета, предусмотренного Правилами клиринга) за дату, отстоящую от даты получения запроса на срок:</b>	В российских рублях, за каждый документ
	а) менее месяца;	100
	б) от одного месяца до одного года;	200
	в) свыше одного года.	300

№ п/п	Наименование услуги	Тариф (НДС не облагается)
2.	<b>Комиссионное вознаграждение за клиринговое обслуживание по сделкам по покупке и продаже иностранной валюты с Датой исполнения в дату заключения сделки или в первый Расчетный день, следующий за датой заключения сделки (за исключением сделок своп)<sup>6</sup></b>	
2.1.	Оборотная часть комиссионного вознаграждения за клиринговое обслуживание по сделкам по покупке и продаже	В процентах от объема каждой сделки в российских рублях или в долларах США <sup>2</sup> , взимается в дату заключения сделки, но не менее 0,43 рубля
2.1.1.	казахстанских тенге за российские рубли, белорусских рублей за российские рубли, украинских гривен за российские рубли	0,002125
2.1.2.	долларов США за российские рубли, евро за российские рубли, евро за доллары США, китайских юаней за российские рубли, Бивалютной корзины <sup>1</sup> за российские рубли	
	SPT_0	0,0006375
	SPT_1000	0,000425
	SPT_2000	0,00034
2.2.	Постоянная часть комиссионного вознаграждения по сделкам по покупке и продаже долларов США за российские рубли, евро за российские рубли, евро за доллары США, китайских юаней за российские рубли, Бивалютной корзины за российские рубли	В российских рублях, по одному Регистрационному коду за каждый календарный месяц, взимается в первый рабочий день месяца оказания клиринговых услуг с Участника клиринга, имеющего доступ к клиринговому обслуживанию в течение одного и более дней в календарном месяце, вне зависимости от факта подачи заявок, заключения и/или исполнения Участником клиринга сделок на ETC

	SPT_0	0
	SPT_1000	425 000
	SPT_2000	850 000
2.3.	Минимальное ежемесячное комиссионное вознаграждение за клиринговое обслуживание для Участника клиринга, в отношении которого действует тарифный план SPT_0	В российских рублях, по одному Регистрационному коду за каждый календарный месяц, взимается в последний рабочий день месяца <sup>3</sup> с Участника клиринга, имеющего доступ к клиринговому обслуживанию в течение одного и более дней в календарном месяце, вне зависимости от факта подачи заявок, заключения и/или исполнения Участником клиринга сделок на ETC
		8 500

№ п/п	Наименование услуги	Тариф (НДС не облагается)							
<b>3.</b>	<b>Комиссионное вознаграждение за клиринговое обслуживание по сделкам своп и по сделкам по покупке и продаже иностранной валюты с Датой исполнения не ранее, чем на второй Расчетный день после даты заключения сделки<sup>7</sup></b>								
3.1.	Оборотная часть комиссионного вознаграждения по сделкам своп	В процентах от объема первой части сделки своп в российских рублях или в долларах США <sup>2</sup> , взимается в дату заключения сделки, но не менее 0,43 рубля							
	со сроком исполнения <sup>4</sup> :	1, 7 дней	14 дней	30, 60 дней	90 дней	180 дней	270 дней	365 дней	
	SWP_0	0,0002125	0,000425	0,00085	0,001275	0,002125	0,0031875	0,00425	
	SWP_300	0,0001275	0,0002975	0,00051	0,000765	0,001275	0,0019125	0,00255	
	SWP_600	0,000085	0,00017	0,00034	0,00051	0,00085	0,001275	0,0017	
	SWP_1000	0,000068	0,000136	0,000272	0,000408	0,00068	0,00102	0,00136	
	SWP_1500	0,0000595	0,000119	0,000238	0,000357	0,000595	0,0008925	0,00119	
	SWP_3500	0,0000425	0,000085	0,00017	0,000255	0,000425	0,0006375	0,00085	
3.2.	Оборотная часть комиссионного вознаграждения по сделкам по покупке и продаже иностранной валюты с Датой исполнения не ранее, чем на второй Расчетный день после даты заключения сделки (за исключением сделок своп)	В процентах от объема сделки в российских рублях или в долларах США <sup>2</sup> , взимается в дату заключения сделки							
	со сроком исполнения <sup>5</sup> :	от 1 до 6 дней	от 7 до 29 дней	от 30 до 89 дней	от 90 до 179 дней	от 180 до 269 дней	от 270 до 364 дней	от 365 и более	
	SWP_0	0,0002125	0,000425	0,00085	0,001275	0,002125	0,0031875	0,00425	
	SWP_300	0,0001275	0,0002975	0,00051	0,000765	0,001275	0,0019125	0,00255	
	SWP_600	0,000085	0,00017	0,00034	0,00051	0,00085	0,001275	0,0017	
	SWP_1000	0,000068	0,000136	0,000272	0,000408	0,00068	0,00102	0,00136	
	SWP_1500	0,0000595	0,000119	0,000238	0,000357	0,000595	0,0008925	0,00119	
	SWP_3500	0,0000425	0,000085	0,00017	0,000255	0,000425	0,0006375	0,00085	
3.3.	Постоянная часть комиссионного вознаграждения	В российских рублях, по одному Регистрационному коду за каждый календарный месяц, взимается в первый рабочий день месяца оказания клиринговых услуг с Участника клиринга, имеющего доступ к клиринговому обслуживанию в течение одного и более дней в календарном месяце, вне зависимости от факта							

	подачи заявок, заключения и/или исполнения Участником клиринга сделок на ETC
SWP_0	0
SWP_300	127 500
SWP_600	255 000
SWP_1000	425 000
SWP_1500	637 500
SWP_3500	1 487 500

<sup>1</sup> от объема каждой сделки в российских рублях, входящей в сделку с инструментом Бивалютная корзина.

<sup>2</sup> от объема каждой сделки в долларах США - при совершении операций по покупке и продаже евро за доллары США.

<sup>3</sup> В случае расторжения Договора об оказании клиринговых услуг или Договора на клиринговое обслуживание в течение месяца, Минимальное ежемесячное комиссионное вознаграждение за клиринговое обслуживание взимается в последний рабочий день действия указанного договора.

<sup>4</sup> под сроком исполнения сделки своп понимается количество календарных дней от Даты исполнения обязательств по первой части сделки своп, не включая эту дату, до Даты исполнения обязательств по второй части сделки своп, включая эту дату, указанных при подаче заявки на заключение сделки.

<sup>5</sup> под сроком исполнения сделки по покупке и продаже (за исключением сделок своп) понимается количество календарных дней от первого Расчетного дня, следующего за датой заключения сделки, не включая этот день, до Даты исполнения обязательств по сделке, включая эту дату, указанной при подаче заявки на заключение сделки.

<sup>6</sup> для Участников клиринга, которым на дату вступления в силу настоящих Тарифов Клирингового центра на валютном рынке, по сделкам по покупке и продаже иностранной валюты с Датой исполнения в дату заключения сделки или в первый Расчетный день, следующий за датой заключения сделки (за исключением сделок своп), установлены тарифный план «Базовый», или тарифный план «Advanced», или тарифный план «Maximum», с даты вступления в силу настоящих Тарифов Клирингового центра на валютном рынке устанавливаются тарифные планы SPT\_0, SPT\_1000 или SPT\_2000 соответственно.

<sup>7</sup> для Участников клиринга, которым на дату вступления в силу настоящих Тарифов Клирингового центра на валютном рынке, по сделкам своп и по сделкам по покупке и продаже иностранной валюты с Датой исполнения не ранее, чем на второй Расчетный день, следующий после даты заключения сделки, установлены тарифный план 1 (базовый), или тарифный план 2 (экономный), или тарифный план 3 (market leader), с даты вступления в силу настоящих Тарифов Клирингового центра на валютном рынке устанавливаются тарифные планы SWP\_0, SWP\_300 или SWP\_600 соответственно.

**Приложение № 3**  
к Правилам клиринга ЗАО АКБ «Национальный  
Клиринговый Центр» на валютном рынке

**ПОРЯДОК ПРОВЕДЕНИЯ ТЕХНИЧЕСКОЙ ЭКСПЕРТИЗЫ**

- 1) Проведение технической экспертизы в случае возникновения конфликтной ситуации в связи с использованием АСП осуществляется технической комиссией, формируемой в случае невозможности разрешения конфликтной ситуации в рабочем порядке.
- 2) Если стороны в конфликтной ситуации не договорятся об ином, в состав технической комиссии входит равное количество, но не менее чем по одному уполномоченному представителю каждой из конфликтующих сторон и Технического центра. Право представлять в технической комиссии соответствующую сторону должно подтверждаться доверенностью, выданной каждому представителю на срок работы технической комиссии.
- 3) Проведение технической экспертизы при разрешении конфликтных ситуаций в соответствии с особенностями функционирования Клиринговой системы требует применения специального программного и информационного обеспечения для выполнения необходимых проверок и документирования данных, используемых при выполнении необходимых проверок.
- 4) Для проведения технической экспертизы необходимы:
  - информация от заявителя претензии (Участника клиринга или Клирингового центра) о параметрах электронного сообщения, в отношении которого проводится техническая экспертиза;
  - дата и время формирования электронного сообщения;
  - номер электронного сообщения, зарегистрированный в Клиринговой системе;
  - параметры электронного сообщения, необходимые для рассмотрения претензии;
  - архив регистрации транзакций в Клиринговой системе на указанную дату (файл TransLog);
  - файлы с электронными сообщениями на указанную дату;
  - рабочее место, позволяющее просматривать и распечатывать информацию из файла TransLog и файлов с электронными сообщениями в удобном для восприятия членами технической комиссии виде;
  - отчетные документы, подтверждающие направление в установленном порядке уведомления о присвоении Клирингового идентификатора уполномоченному представителю заявителю претензии.
- 5) Проведение технической экспертизы включает в себя выполнение следующих действий:
  - изготовление (распечатку) на бумажном носителе копии электронного сообщения, в отношении которого проводится техническая экспертиза;

- проверку наличия в изготовленной (распечатанной) на бумажном носителе копии электронного сообщения информации о регистрации электронного сообщения, в отношении которого проводится техническая экспертиза;
- проверку соответствия АСП в копии электронного сообщения на бумажном носителе присвоенному Участнику клиринга / Клиринговому центру Клиринговому идентификатору;
- фиксирование результатов проверки в протоколе работы технической комиссии.

б) В случае, если:

- электронное сообщение, в отношении которого проводится техническая экспертиза, найдено в файле TransLog;
- электронное сообщение, в отношении которого проводится техническая экспертиза, соответствует копии электронного сообщения, изготовленной (распечатанной) на бумажном носителе;
- установлено соответствие АСП в копии электронного сообщения на бумажном носителе присвоенному Участнику клиринга / Клиринговому центру Клиринговому идентификатору;

считается установленным, что:

- электронное сообщение, в отношении которого возникла конфликтная ситуация, было сформировано Участником клиринга / Клиринговым центром;
- после подачи электронного сообщения Участником клиринга / Клиринговым центром с использованием Клиринговой системы не было изменено ни одного параметра данного электронного сообщения.

7) Все действия, предпринимаемые технической комиссией для выяснения фактических обстоятельств, а также выводы, сделанные комиссией, заносятся в Протокол работы технической комиссии. Протокол работы технической комиссии должен содержать следующие данные:

- состав технической комиссии с указанием сведений о должности и месте работы каждого из членов технической комиссии;
- краткое изложение обстоятельств возникшей конфликтной ситуации;
- мероприятия, проводимые технической комиссией для установления причин и последствий возникшей конфликтной ситуации, с указанием даты, времени и места их проведения;
- выводы, к которым пришла техническая комиссия в результате проведенных мероприятий;
- подписи всех членов технической комиссии.

Протокол составляется на бумажном носителе в количестве экземпляров, равном количеству организаций, уполномоченные представители которых принимали участие в работе технической комиссии.

**Приложение № 4**  
к Правилам клиринга ЗАО АКБ «Национальный  
Клиринговый Центр» на валютном рынке

**Документы, предоставляемые юридическим лицом для заключения  
Договора об оказании клиринговых услуг**

**I. Документы, предоставляемые юридическим лицом - резидентом**

- 1) Анкета Участника клиринга (Регистрационная карточка) на бумажном носителе и в электронном виде.
- 2) Нотариально удостоверенная копия Свидетельства о внесении записи в ЕГРЮЛ, выданная уполномоченным органом исполнительной власти, осуществляющим государственную регистрацию юридических лиц, и подтверждающую факт внесения в ЕГРЮЛ записи о государственной регистрации юридического лица (либо о юридическом лице, зарегистрированном до 1 июля 2002 года).
- 3) 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).
- 4) Выписка из Единого государственного реестра юридических лиц (ЕГРЮЛ), действующая на дату предоставления документов и выданная регистрирующим органом не ранее 30-ти дней до дня предоставления выписки из Единого государственного реестра юридических лиц в Клиринговый центр, или нотариально удостоверенную копию такой выписки.
- 5) Нотариально удостоверенная копия свидетельства о постановке на учет в налоговом органе.
- 6) Нотариально удостоверенная копия информационного письма о присвоении кодов статистики или копия, заверенная подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица.
- 7) Нотариально удостоверенная копия лицензии Банка России на осуществление банковских операций со средствами в рублях и иностранной валюте (для кредитных организаций).
- 8) Нотариально удостоверенные копии иных лицензий на право осуществления деятельности, подлежащей лицензированию (если имеются).
- 9) В отношении единоличного исполнительного органа (далее по тексту - руководитель):
  - 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 единоличного исполнительного органа;

- нотариально удостоверенная копия письма территориального учреждения Банка России с подтверждением согласования кандидатуры руководителя (для кредитных организаций);
  - нотариально удостоверенная копия сообщения Банка России о принятии карточки с образцом подписи в случае, если решение уполномоченного органа кредитной организации об избрании/назначении нового единоличного исполнительного органа принято ранее даты согласования кандидатуры нового единоличного исполнительного органа (для кредитных организаций);
  - копия документа, удостоверяющего личность, заверенная подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица, или письмо юридического лица, содержащее сведения о реквизитах документа, удостоверяющего личность, а также о дате и месте рождения, адресе места жительства (регистрации) или места пребывания;
  - 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) В случае подписания Договора об оказании клиринговых услуг и (или) других документов в соответствии с настоящими Правилами клиринга от имени юридического лица не единоличным исполнительным органом, юридическое лицо предоставляет на такое уполномоченное лицо оригинал доверенности или нотариально удостоверенную копию, или копию доверенности, заверенную лицом, выдавшим указанную доверенность. В случае если доверенность представляет полномочия на совершение операций с денежными средствами или иным имуществом, дополнительно предоставляются:
- копия документа, удостоверяющего личность, заверенная подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица, или письмо юридического лица, содержащее сведения о реквизитах документа, удостоверяющего личность, а также о дате и месте рождения, адресе места жительства (регистрации) или места пребывания;
  - 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) Нотариально удостоверенная копия карточки с образцами подписей и оттиска печати юридического лица.
- 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) 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).

- 14) Иные документы, которые могут быть запрошены Клиринговым центром в необходимых случаях в целях, не противоречащих действующему законодательству Российской Федерации.
- 15) Если физическое лицо, на которое требуется предоставить копию документа, удостоверяющего личность, заверенную подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица, является иностранным гражданином (лицом без гражданства), то дополнительно необходимо представить:
- заверенную печатью юридического лица и подписью уполномоченного лица 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 печатью юридического лица и подписью уполномоченного лица юридического лица копию миграционной карты;
  - письмо со сведениями об адресе места жительства (регистрации) или места пребывания (если такая информация не содержится в иных документах, представленных в соответствии с настоящим списком).
- 16) Отчетность, указанная в приложении № 5 к Правилам клиринга:
- для кредитных организаций - за три последних отчетных месяца (за исключением отчета о прибылях и убытках), а отчет о прибылях и убытках - на последнюю отчетную квартальную дату;
  - для некредитных организаций - за два последних отчетных квартала (за исключением расчета размера собственных средств (капитала)), а расчет размера собственных средств (капитала) – на три последние отчетные даты;
  - для кредитных организаций, являющихся профессиональными участниками рынка ценных бумаг, - квартальный отчет профессионального участника рынка ценных бумаг (форма №1100) за последний отчетный квартал;
  - 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>.

Указанная отчетность предоставляется на бумажном носителе и в электронном виде или в форме электронного документа.

---

<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.

## **II. Документы, предоставляемые Государственной корпорацией**

Государственная корпорация помимо документов, указанных в разделе I настоящего приложения к Правилам клиринга, предоставляет:

- 1) Копии документов, подтверждающие создание Государственной корпорации, предусмотренные законом.
- 2) В отношении руководителя:
  - копию нормативного документа о назначении единоличного исполнительного органа Государственной корпорации.
- 3) Отчетность, указанную в пункте 2) приложения № 5 к Правилам клиринга, за исключением отчета о прибылях и убытках, за три последних отчетных месяца, а отчет о прибылях и убытках - на последнюю отчетную квартальную дату.  
Указанная отчетность предоставляется на бумажном носителе и в электронном виде или в форме электронного документа.

## **III. Документы, предоставляемые Банком-нерезидентом**

- 1) Анкета Участника клиринга (Регистрационная карточка) на бумажном носителе и в электронном виде.
- 2) Опросная Анкета Банка-нерезидента.
- 3) Действующие редакции учредительных документов и все изменения к ним.
- 4) Документы, подтверждающие правовой статус Банка-нерезидента по национальному законодательству государства его учреждения, в том числе, документы, подтверждающие государственную регистрацию Банка-нерезидента.
- 5) Документы, подтверждающие постановку на учет или подтверждающие учет в налоговом органе Российской Федерации (в случае если в соответствии с законодательством Российской Федерации постановка на налоговый учет или учет является обязательными).
- 6) Специальное разрешение (лицензия или иное основание) на осуществление банковских операций, выданное компетентным органом.
- 7) Специальное разрешение (лицензия или иное основание), выданное уполномоченным органом государства учреждения Банка-нерезидента на право осуществления деятельности, осуществление которой в соответствии с национальным законодательством государства учреждения Банка-нерезидента возможно при наличии соответствующего специального разрешения уполномоченного органа.
- 8) Документ, подтверждающий полномочия руководителей Банка-нерезидента, или доверенности на уполномоченных лиц.
- 9) В отношении руководителя Банка-нерезидента документы, подтверждающие прохождение кандидатом в руководители Банка-нерезидента установленные национальным законодательством государства учреждения Банка-нерезидента процедуры назначения, если назначение на соответствующие должности обусловлено прохождением установленных процедур.
- 10) В отношении лиц, уполномоченных действовать от имени Банка-нерезидента:
  - копии паспортов или других документов, которые в соответствии с

законодательством Российской Федерации являются документами, удостоверяющими личность и содержащие образцы подписей лиц, уполномоченных действовать от имени Банка-нерезидента, заверенные печатью юридического лица и подписью уполномоченного лица;

- копии свидетельств о постановке на учет в налоговом органе (ИНН), заверенные подписью уполномоченного лица и печатью Банка-нерезидента, либо письмо в произвольной форме с указанием ИНН (при наличии).

11) В случае подписания Договора об оказании клиринговых услуг и (или) других документов в соответствии с настоящими Правилами клиринга от имени Банка-нерезидента не единоличным исполнительным органом, Банк-нерезидент предоставляет на такое уполномоченное лицо оригинал доверенности или нотариально удостоверенную копию, или копию доверенности, заверенную лицом, выдавшим указанную доверенность. В случае если доверенность представляет полномочия на совершение операций с денежными средствами или иным имуществом, дополнительно предоставляются:

- копия документа, удостоверяющего личность, заверенная подписью уполномоченного лица и печатью Банка-нерезидента, или письмо Банка-нерезидента, содержащее сведения о реквизитах документа, удостоверяющего личность, а также о дате и месте рождения, адресе места жительства (регистрации) или места пребывания.

12) Если физическое лицо, на которое требуется предоставить копию документа, удостоверяющего личность, заверенную подписью уполномоченного лица и печатью Банка-нерезидента, является иностранным гражданином (лицом без гражданства), то дополнительно необходимо представить:

- заверенную печатью Банка-нерезидента и подписью уполномоченного лица Банка-нерезидента 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 печатью Банка-нерезидента и подписью уполномоченного лица юридического лица копию миграционной карты;
- письмо со сведениями об адресе места жительства (регистрации) или места пребывания (если такая информация не содержится в иных документах, представленных в соответствии с настоящим списком).

13) Согласие лиц, указанных в документах Банка-нерезидента, 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).

14) Отчетность, указанную в пункте 5) приложения № 5 к Правилам клиринга, за исключением финансовой отчетности, за 3 (три) последние отчетные даты, а финансовую отчетность - за последний отчетный год.

Указанная отчетность предоставляется на бумажном носителе и в электронном виде или в форме электронного документа.

#### **IV. Документы, предоставляемые Международной организацией**

- 1) Анкета Участника клиринга (Регистрационная карточка) на бумажном носителе и в электронном виде.
- 2) Копия международного договора.
- 3) Копия устава или иного аналогичного документа, подтверждающего статус Международной организации, с изменениями и дополнениями;
- 4) Нотариально удостоверенная копия свидетельства о постановке на учет в налоговом органе.
- 5) Нотариально удостоверенная копия карточки с образцами подписей и оттиска печати Международной организации.
- 6) Нотариально удостоверенная копия документов, подтверждающих полномочия единоличного исполнительного органа.
- 7) Согласие лиц, указанных в документах Международной организации, направляемых ею 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).
- 8) Нотариально удостоверенная копия информационного письма о присвоении кодов статистики или копию, заверенную подписью уполномоченного лица и печатью Организации.
- 9) Отчетность, указанную в пункте 2) приложения № 5 к Правилам клиринга, за исключением отчета о прибылях и убытках, за три последних отчетных месяца, а отчет о прибылях и убытках - на последнюю отчетную квартальную дату.  
Указанная отчетность предоставляется на бумажном носителе и в электронном виде или в форме электронного документа.
- 10) В отношении представителей Международной организации:
  - копия документа, удостоверяющего личность, заверенная подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица, или письмо юридического лица, содержащее сведения о реквизитах документа, удостоверяющего личность, а также о дате и месте рождения, адресе места жительства (регистрации) или места пребывания;
  - 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);  
Если физическое лицо, на которое требуется предоставить копию документа, удостоверяющего личность, заверенную подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица, является иностранным гражданином (лицом без гражданства), то дополнительно необходимо представить:
    - заверенную печатью юридического лица и подписью уполномоченного 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 печатью юридического лица и подписью уполномоченного лица юридического лица копию миграционной карты;
- письмо со сведениями об адресе места жительства (регистрации) или места пребывания (если такая информация не содержится в иных документах, представленных в соответствии с настоящим списком).

При предоставлении документов, указанных в настоящем приложении к Правилам клиринга нерезидентами, указанные документы должны быть переведены на государственный язык Российской Федерации (русский язык), верность перевода и подлинность подписи переводчика должны быть нотариально удостоверены.

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

Требование о представлении документов с надлежащим образом заверенным переводом на русский язык не распространяется:

- на документы, удостоверяющие личности физических лиц, выданные компетентными органами иностранных государств, составленные на нескольких языках, включая русский;
- на документы, удостоверяющие личности физических лиц, выданные компетентными органами иностранных государств, при условии наличия у физического лица документа, подтверждающего право законного пребывания на территории Российской Федерации (например, въездная виза, миграционная карта).

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

В целях идентификации Организации и ее представителей - физических лиц и (или) выгодоприобретателей, Клиринговый центр при необходимости может запросить дополнительные документы (сведения), а также потребовать уточнения информации, содержащейся в ранее представленных документах.

Все предъявляемые документы должны быть действительны на дату их предъявления.

К предоставляемым документам прилагается сопроводительное письмо с описью направляемых Клиринговому центру документов, подготовленное с использованием надстройки MS EXCEL "Опись документов", размещенной на Сайте Клирингового центра).

**Приложение № 5**  
к Правилам клиринга ЗАО АКБ «Национальный  
Клиринговый Центр» на валютном рынке

**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) (форма 0409134) – ежемесячно;
  - отчет о прибылях и убытках 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) Государственные корпорации и Международные организации предоставляют Клиринговому центру:
  - оборотную ведомость по счетам бухгалтерского учета (форма 0409101) - ежемесячно;
  - отчет о прибылях и убытках (форма 0409102) - ежеквартально;
  - расчет собственных средств (капитала) (форма 0409134) – ежемесячно.
- 3) Некредитные организации предоставляют Клиринговому центру:
  - бухгалтерский баланс (форма 0710001) – ежеквартально;
  - отчет о прибылях и убытках (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.
- 4) Участники клиринга обязаны предоставлять отчетность, указанную в пунктах 1)-3) настоящего приложения к Правилам клиринга, в следующие сроки:
  - расчет размера собственных средств:
    - не позднее 15 рабочего дня месяца, следующего за отчетным месяцем (кредитными организациями, Государственными корпорациями и Международными организациями);

- 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 прибылях и убытках (форма 0409102) - не позднее 15 рабочего дня месяца, следующего за отчетным кварталом;
  - бухгалтерский баланс некредитной организации (форма 0710001), отчет о прибылях и убытках 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) - не позднее 55 (пятидесяти пяти) календарных дней, следующих за отчетным кварталом, за исключением отчетности по состоянию на 1 января, которая предоставляется не позднее 25 апреля года, следующего за отчетным;
  - список аффилированных лиц (форма 0409051) - не позднее 15 рабочего дня месяца, следующего за отчетным кварталом<sup>2</sup>.
- 5) Банки-нерезиденты не позднее 15 (пятнадцати) рабочих дней с даты сдачи ежемесячной или квартальной отчетности соответственно или с даты, определенной компетентным органом государства учреждения Банка-нерезидента для сдачи ежемесячной или квартальной отчетности соответственно (в случае если сроки сдачи отчетности устанавливаются компетентным органом государства учреждения Банка-нерезидента), предоставляют Клиринговому центру следующие документы, составленные на русском или английском языке:
- баланс в форме оборотной ведомости по счетам бухгалтерского учета по национальным стандартам государства учреждения Банка-нерезидента бухгалтерского учета и отчетности - ежемесячно;
  - документ, содержащий информацию о финансовых показателях за отчетный месяц, данные о величине и структуре активов и обязательств, финансовых результатах деятельности, величине собственных средств (капитала), отраженных в отчетности Банка-нерезидента – ежемесячно (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

---

<sup>2</sup> На дату предоставления списка аффилированных лиц сведения, содержащиеся в нем, должны соответствовать последней актуальной информации об аффилированных лицах, предоставленной в Банк России.

органом – ежемесячно (в случае если в соответствии с национальным законодательством государства учреждения Банка-нерезидента такие обязательные нормативы устанавливаются);

- отчет о прибылях и убытках по национальным стандартам бухгалтерского учета и отчетности - ежеквартально;
- расчет собственных средств (капитала) по национальным стандартам бухгалтерского учета и отчетности (в случае если в соответствии с национальным законодательством государства учреждения Банка-нерезидента такой расчет устанавливается) – ежемесячно;
- финансовую отчетность по МСФО (при наличии) – ежеквартально.

Банки-нерезиденты не позднее 15 (пятнадцати) рабочих дней с даты подписания отчетности организацией, проводившей аудит Банка – нерезидента, предоставляют Клиринговому центру:

- финансовую отчетность по МСФО на русском или английском языке за последний отчетный год, заверенную аудитором, а при ее отсутствии - аудированную финансовую отчетность, составленную в соответствии с требованиями национального законодательства государства учреждения Банка-нерезидента. Указанная отчетность представляется, начиная с года, следующего за годом предоставления доступа Банку-нерезиденту к клиринговому обслуживанию – ежегодно.

- б) Форматы предоставления отчетности, указанной в пунктах 1)-3), 5) настоящего приложения к Правилам клиринга, определены Порядком предоставления информации и отчетности.

**Приложение № 6**  
к Правилам клиринга ЗАО АКБ «Национальный  
Клиринговый Центр» на валютном рынке

**Временной регламент исполнения обязательств по сделкам, заключенным на Единой  
торговой сессии<sup>1</sup>**

№ п/п	Наименование операции	Время (московское)
1.	Внесение Участником клиринга на счета Клирингового центра денежных средств для учета текущим днем в качестве Обеспечения:	
	- в китайских юанях;	до 10:00
	- в казахстанских тенге, белорусских рублях, украинских гривнах;	до 12:00
	- в евро;	до 17:00
	- в долларах США;	до 20:00
	- в российских рублях.	до 20:00
2.	Учет полученных от Участника клиринга денежных средств в качестве Обеспечения	в течение 15 минут с момента получения информации о зачислении денежных средств на счет Клирингового центра в Расчетном банке / Расчетной организации
3.	Передача Участником клиринга в Клиринговый центр Запроса на проведение ранних расчетов.	до 16:30
4.	Определение Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований в китайских юанях <sup>2</sup>	11:00
5.	Определение Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований в евро Участников клиринга, не предоставивших Запрос на проведение ранних расчетов или Постоянное поручение на проведение ранних расчетов.	15:15
6.	Определение Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований:	
	- Участников клиринга, предоставивших Запрос на проведение ранних расчетов до 11:00 или Постоянное поручение на проведение ранних расчетов с указанием времени 11:00;	11:00
	- Участников клиринга, предоставивших Запрос на проведение ранних расчетов с 14:00 до 15:15 или Постоянное поручение на проведение ранних расчетов с указанием времени 15:15;	15:15
	- Участников клиринга, предоставивших Запрос на проведение ранних расчетов с 11:00 до 14:00 и с 15:15 до 16:30;	после получения Клиринговым центром Запроса на проведение ранних расчетов

№ п/п	Наименование операции	Время (москowsкое)
	- Участников клиринга, не предоставивших Запрос на проведение ранних расчетов или Постоянное поручение на проведение ранних расчетов.	17:30
7.	Передача Клиринговым центром предварительных Биржевых свидетельств по итогам торговой сессии по китайским юаням за российские рубли <sup>2</sup> .	с 11:00 до 11:15
8.	Передача Клиринговым центром предварительных Биржевых свидетельств по итогам торговой сессии по евро за российские рубли и евро за доллары США Участникам клиринга, не предоставившим Запрос на проведение ранних расчетов или Постоянное поручение на проведение ранних расчетов.	с 15:15 до 15:30
9.	Передача Клиринговым центром Клиринговых отчетов по итогам Торговых сессий ЕТС, Биржевых свидетельств по итогам Торговых сессий ЕТС:	
	- Участникам клиринга, предоставившим Запрос на проведение ранних расчетов до 11:00 или Постоянное поручение на проведение ранних расчетов с указанием времени 11:00;	с 11:00 до 11:15
	- Участникам клиринга, предоставившим Запрос на проведение ранних расчетов с 14:00 до 15:15 или Постоянное поручение на проведение ранних расчетов с указанием времени 15:15;	с 15:15 до 15:30
	- Участникам клиринга, предоставившим Запрос на проведение ранних расчетов с 11:00 до 14:00 и с 15:15 до 16:30;	в течение 15 мин. после получения Клиринговым центром Запроса на проведение ранних расчетов
	- Участникам клиринга, не предоставившим Запрос на проведение ранних расчетов или Постоянное поручение на проведение ранних расчетов.	с 17:30 до 17:45
10.	Передача Участником клиринга в Клиринговый центр Запросов о депонировании денежных средств:	
	- в казахстанских тенге, белорусских рублях, украинских гривнах, китайских юанях;	до 11:15
	- в долларах США, российских рублях, евро:	
	Участником клиринга, предоставившим Запрос на проведение ранних расчетов до 11:00 или Постоянное поручение на проведение ранних расчетов с указанием времени 11:00;	до 11:15

№ п/п	Наименование операции	Время (московское)
	Участником клиринга, предоставившим Постоянное поручение на проведение ранних расчетов с указанием времени 15:15;	до 15:30
	Участником клиринга, предоставившим Запрос на проведение ранних расчетов после 11:00 и до 16:30;	до направления Запроса на проведение ранних расчетов
	Участником клиринга, не предоставившим Запрос на проведение ранних расчетов или Постоянное поручение на проведение ранних расчетов.	до 17:45
11.	Проведение клиринговой сессии.	с 9:30 до 10:00
12.	Передача Клиринговым центром Участникам клиринга Отчетов об обязательствах, Отчетов о Маржинальном требовании, Требований о погашении задолженности.	до 10:15
13.	Передача Клиринговым центром Участникам клиринга Отчетов о движении денежных средств.	до 11:00
14.	Исполнение Маржинальных требований.	до 17:30 дня возникновения Маржинального требования
15.	Погашение Задолженностей по гарантийным переводам.	до 20:00 дня возникновения Задолженности по гарантийным переводам
16.	Погашение Задолженностей по комиссиям и Задолженностей по сделкам.	до 20:00 Рабочего дня, следующего за днем возникновения Задолженности по комиссиям / Задолженности по сделкам
17.	Передача Клиринговым центром Отчетов о комиссионных вознаграждениях и Клиринговых отчетов по итогам Торговых сессий ЕТС, содержащих информацию о Сделках с Датой исполнения в дату их заключения, заключенных после 17:30:	
	- Участникам клиринга, предоставившим Запрос или Постоянное поручение на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром в 18:00;	до 18:15
	- Участникам клиринга, предоставившим Запрос или Постоянное поручение на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром в 19:00;	до 19:15
	- Участникам клиринга, не предоставившим Запрос или Постоянное поручение на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром.	до 09:30 следующего Рабочего дня

№ п/п	Наименование операции	Время (московское)
18.	Исполнение Участниками клиринга Итоговых нетто-обязательств в китайских юанях перед Клиринговым центром <sup>2</sup> .	до 12:00
19.	Исполнение Участниками клиринга Итоговых нетто-обязательств перед Клиринговым центром:	
	- в евро;	до 17:00 <sup>3</sup>
	- в долларах США и российских рублях.	до 20:00 <sup>3</sup>
20.	Исполнение Участниками клиринга обязательств по уплате комиссионных вознаграждений:	
	- по Сделкам, заключенным до 19:00	до 20:00 <sup>3</sup>
	- по Сделкам, заключенным после 19:00	до 20:00 <sup>3</sup> следующего Рабочего дня
21.	Передача Клиринговым центром Участникам клиринга Клиринговых отчетов по итогам Торговых сессий ЕТС и Дополнительной сессии ЕТС, Биржевых свидетельств по итогам Торговых сессий ЕТС и Дополнительной сессии ЕТС.	до 20:15
22.	Перечисление Клиринговым центром денежных средств на счета Участников клиринга с целью исполнения Итоговых нетто-требований Участников клиринга:	
	- в китайских юанях <sup>4</sup> ;	до 12:00
	- в казахстанских тенге, белорусских рублях, украинских гривнах;	до 12:00
	- в китайских юанях <sup>2</sup> ;	до 13:00
	- в евро, долларах США, российских рублях.	в день торгов
23.	Передача Участником клиринга в Клиринговый центр Запросов о возврате денежных средств:	
	- в китайских юанях;	до 11:00
	- в казахстанских тенге, белорусских рублях, украинских гривнах;	до 12:00
	- в евро;	до 17:00
	- в долларах США;	до 20:00
	- в российских рублях.	до 20:00
24.	Передача Участником клиринга в Клиринговый центр Заявления о переносе.	до 17:00

<sup>1</sup> - решением Клирингового центра время проведения отдельных операций, за исключением времени проведения Основных сессий ЕТС, может быть изменено.

<sup>2</sup> – в случае если китайские юани за российские рубли включены в Перечень инструментов, по которым заключаются Сделками с частичным обеспечением;

<sup>3</sup> - при наличии сбоя в платежных системах указанное время может быть продлено по решению Клирингового центра до устранения указанного сбоя;

<sup>4</sup> - в случае если китайские юани за российские рубли включены в Перечень инструментов, по которым заключаются Сделками с полным обеспечением.