УТВЕРЖДЕНЫ

решением Наблюдательного совета
ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр»

от «26» сентября 2014 года (Протокол № 5)

Председатель Наблюдательного совета
ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр»

_____ Лыков С.П.

Центральный Банк
Российской Федерации (Банк России)
ЗАРЕГИСТРИРОВАНО
Дата 30 октября 2014
РБ-52-2/604

ПРАВИЛА КЛИРИНГА
ЗАО АКБ «НАЦИОНАЛЬНЫЙ КЛИРИНГОВЫЙ ЦЕНТР»
НА ВАЛЮТНОМ РЫНКЕ И РЫНКЕ ДРАГОЦЕННЫХ МЕТАЛЛОВ

Москва, 2014 г.

СОДЕРЖАНИЕ

РАЗДЕЛ I. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ 5

Статья 1. Термины и определения 5

Статья 2. Общие положения 12

Статья 3. Права и обязанности Участников клиринга и Клирингового центра 15

Статья 4. Конфиденциальность 17

Статья 5. Порядок использования Аналога собственноручной подписи 17

Статья 6. Клиринговые регистры 19

РАЗДЕЛ II. ТРЕБОВАНИЯ К УЧАСТНИКАМ КЛИРИНГА 20

Статья 7. Требования к Участникам клиринга 20

Статья 8. Категории Участников клиринга 21

Статья 9. Условия клирингового обслуживания. Порядок предоставления допуска к клиринговому обслуживанию 22

Статья 10. Порядок регистрации Участников клиринга и присвоения Участникам клиринга Расчетных кодов и Клиринговых идентификаторов 27

Статья 11. Порядок приостановления и прекращения допуска к клиринговому обслуживанию 31

РАЗДЕЛ III. МЕРЫ, НАПРАВЛЕННЫЕ НА УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ ПРИ ОСУЩЕСТВЛЕНИИ КЛИРИНГА 36

Статья 12. Перечень мер, направленных на управление рисками при осуществлении клиринга 36

Статья 13. Единый лимит и риск-параметры 37

Статья 14. Порядок подачи и исполнения Поручений на управление риском 40

РАЗДЕЛ IV. ПОРЯДОК И УСЛОВИЯ ДОПУСКА ОБЯЗАТЕЛЬСТВ К КЛИРИНГУ 42

Статья 15. Порядок взаимодействия с Биржей при подаче заявок и заключении Сделок 42

РАЗДЕЛ V. ПОРЯДОК ПРОВЕДЕНИЯ КЛИРИНГА 47

ПОДРАЗДЕЛ V-I. ПОРЯДОК ВНЕСЕНИЯ И ВОЗВРАТА ОБЕСПЕЧЕНИЯ И ВЗНОСА В ГАРАНТИЙНЫЙ ФОНД 47

Статья 16. Порядок внесения Обеспечения 47

Статья 17. Порядок возврата Обеспечения 49

Статья 18. Порядок внесения взноса в Гарантийный фонд и Обеспечения под

стресс ……..51

Статья 19. Порядок возврата взноса в Гарантийный фонд и Обеспечения под стресс ……..52

ПОДРАЗДЕЛ V-II. КЛИРИНГОВЫЕ СЕССИИ 53

Статья 20. Порядок проведения клиринговых сессий 53

Статья 21. Вариационная маржа и Гарантийные переводы 55

ПОДРАЗДЕЛ V-III. ПОРЯДОК ОПРЕДЕЛЕНИЯ И ИСПОЛНЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ ПО СДЕЛКАМ ……60

Статья 22. Порядок исполнения / прекращения обязательств по Сделкам и обязательств по возврату Гарантийных переводов 60

Статья 23. Порядок урегулирования случаев неисполнения или ненадлежащего исполнения Участниками клиринга обязательств по Сделкам и Маржинальных требований ……..66

Статья 24. Порядок использования и возмещения гарантийных фондов и иных средств в целях погашения Задолженностей Участников клиринга 75

РАЗДЕЛ VI. ПОРЯДОК ОПЛАТЫ УСЛУГ. ОТЧЕТЫ ПО ИТОГАМ КЛИРИНГА 81

Статья 25. Порядок оплаты услуг Клирингового центра, Биржи и Технического центра ……..81

Статья 26. Порядок предоставления отчетов по итогам клиринга 86

РАЗДЕЛ VII. ПРОЧИЕ УСЛОВИЯ 88

Статья 27. Перевод обязательств и перевод Обеспечения клиента Участника клиринга от одного Участника клиринга другому Участнику клиринга 88

Статья 28. Порядок действий в случае включения Участника клиринга в перечень организаций, в отношении которых имеются сведения об их причастности к экстремистской деятельности или терроризму 92

Статья 29. Порядок урегулирования обязательств в случае прекращения допуска к клиринговому обслуживанию 93

Статья 30. Взаимодействие с Биржей при возникновении обстоятельств, которые могут повлиять на возможность проведения торгов 106

Статья 31. Чрезвычайные ситуации 106

Статья 32. Порядок разрешения споров 108

Приложение № 1 110

Приложение № 2 111

Приложение № 3 116

Приложение № 4 118

Приложение № 5 130

РАЗДЕЛ I. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ

Настоящие Правила клиринга ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр» на валютном рынке и рынке драгоценных металлов регулируют отношения, связанные с исполнением сделок с иностранной валютой и драгоценными металлами, заключенных на торгах, организуемых ОАО Московская Биржа.

В случае внесения изменений в настоящие Правила клиринга, в том числе принятия Правил клиринга в новой редакции, соответствующие изменения со дня введения их в действие распространяются на отношения по вышеуказанным сделкам, заключенным до введения в действие соответствующих изменений (новой редакции), и не исполненных (прекращенных) на день введения в действие изменений в Правила клиринга.

Статья 1. Термины и определения

Аналог собственноручной подписи / АСП –	реквизит электронного сообщения, направляемого с использованием Клиринговой системы, подтверждающий идентификацию направившего электронное сообщение лица, целостность и неизменность электронных сообщений за счет использования специализированных программно-технических средств и организационных мероприятий. Аналогом собственноручной подписи признается Клиринговый идентификатор, позволяющий однозначно идентифицировать Участника клиринга или Клиринговый центр, направивших электронное сообщение и достоверно установить, что электронное сообщение исходит от Участника клиринга или Клирингового центра, которому присвоен данный Клиринговый идентификатор.
Анкета FATCA -	Анкета идентификации юридического лица в соответствии с нормами и положениями закона FATCA.
Аутентификация -	процедура подтверждения принадлежности АСП Участнику клиринга / Клиринговому центру.
Банк ЕврАзЭс -	Банк-нерезидент, зарегистрированный на территории государства - члена Евразийского экономического сообщества, подписавшего Соглашение о сотрудничестве в области организации интегрированного валютного рынка государств - членов Евразийского экономического сообщества (далее – Международное соглашение), который в соответствии с Международным соглашением имеет право на проведение межбанковских конверсионных операций на территории Российской Федерации.
Банк-нерезидент -	юридическое лицо, являющееся Нерезидентом, которое на основании специального разрешения (лицензии или иного основания) компетентного органа государства учреждения имеет право осуществлять банковские операции, предусмотренные личным законом Банка-нерезидента.
Биржа -	организатор торговли, оказывающий в соответствии с Правилами торгов услуги по организации торгов иностранной

	валютой и драгоценными металлами. Биржей является Открытое акционерное общество «Московская Биржа ММВБ-РТС».
Биржевое свидетельство –	документ, предоставляемый Клиринговым центром Участнику клиринга, содержащий информацию об Итоговых нетто-обязательствах и/или Итоговых нетто-требованиях, обязательстве / требовании Участника клиринга по возврату Гарантийных переводов.
Временной регламент -	внутренний документ Клирингового центра, устанавливающий сроки исполнения обязательств, определенных Правилами клиринга, а также сроки проведения клиринговых операций, сроки предоставления документов Клиринговому центру / Клиринговым центром в процессе взаимодействия с Участниками клиринга при проведении клиринга и расчетов по Сделкам.
Гарантийный перевод -	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.
Гарантийный фонд -	коллективное клиринговое обеспечение, сформированное Клиринговым центром за счет взносов определенных Правилами клиринга Участников клиринга в целях обеспечения исполнения обязательств по Сделкам.
Государственная корпорация -	государственная корпорация, которая в соответствии с действующим законодательством Российской Федерации имеет право осуществлять банковские операции на территории Российской Федерации, включая куплю-продажу иностранной валюты.
Дата исполнения -	дата, в которую обязательства по Сделке должны быть исполнены в соответствии с условиями Сделки.
Добросовестный участник клиринга -	Участник клиринга, надлежащим образом исполнивший свои Итоговые нетто-обязательства перед Клиринговым центром.
Договор о взаимодействии -	Договор о взаимодействии при проведении торговых и дополнительных сессий Единой торговой сессии, заключенный между Банком России, Биржей и Клиринговым центром.
Дополнительная сессия -	период времени, в течение которого между Участником клиринга и Клиринговым центром в порядке, предусмотренном Правилами клиринга, заключаются сделки в целях урегулирования случаев неисполнения или ненадлежащего исполнения Участником клиринга обязательств по сделкам, а также в иных целях, установленных Правилами клиринга.
Единый лимит -	величина, рассчитываемая Клиринговым центром в российских рублях для каждого Участника клиринга, ограничивающая риски по Сделкам, заключаемым между Клиринговым центром и Участником клиринга, для которого рассчитан Единый

	лимит.
Задолженность -	неисполненные обязательства Участника клиринга, в том числе обязательства по Сделкам, обязательства по уплате комиссионных вознаграждений, обязательства по уплате вариационной маржи, обязательства по уплате Гарантийных переводов и/или иные обязательства, указанные в Правилах клиринга.
Закон о клиринге -	Федеральный закон от 07.02.2011 №7-ФЗ «О клиринге и клиринговой деятельности».
Закон FATCA -	Федеральный закон от 28.06.2014 N 173-ФЗ «Об особенностях осуществления финансовых операций с иностранными гражданами и юридическими лицами, о внесении изменений в Кодекс Российской Федерации об административных правонарушениях и признании утратившими силу отдельных положений законодательных актов Российской Федерации».
Идентификатор (Идентификатор Участника клиринга) -	уникальный буквенно-цифровой код, присваиваемый Клиринговым центром Участнику клиринга и однозначно определяющий Участника клиринга.
Индивидуальный Участник клиринга -	Участник клиринга, являющийся также участником торгов, заключающим сделки только от своего имени.
Итоговое нетто-обязательство Участника клиринга -	обязательства Участника клиринга перед Клиринговым центром в соответствующей валюте или драгоценном металле, не прекращенные в результате зачета в ходе клиринга в соответствии с Правилами клиринга.
Итоговое нетто-требование Участника клиринга -	требования Участника клиринга к Клиринговому центру в соответствующей валюте или драгоценном металле, не прекращенные в результате зачета в ходе клиринга в соответствии с Правилами клиринга.
Клиент -	юридическое или физическое лицо, зарегистрированное Биржей в качестве клиента Участника торгов.
Клиринг с полным обеспечением -	клиринг по Сделке, условием заключения которой является наличие Обеспечения Участника клиринга и/или требования Участника клиринга по получению иностранной валюты / российских рублей / драгоценного металла с Датой исполнения не позднее, чем Дата исполнения обязательств по заключаемой Сделке, в размере, необходимом для исполнения обязательств по такой Сделке в полном объеме.
Клиринг с частичным обеспечением -	клиринг по Сделке, условием заключения которой является достаточность Единого лимита Участника клиринга.
Клиринговая система -	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.

Клиринговый брокер -	Участник клиринга, исполняющий функции клирингового брокера в соответствии с Законом о клиринге и Правилами клиринга.
Клиринговый идентификатор Участника клиринга (Клиринговый идентификатор) -	уникальный буквенно-цифровой код, присваиваемый Участнику клиринга Клиринговым центром в целях совершения операций в Клиринговой системе.
Клиринговый центр -	ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр», действующий на основании лицензии на осуществление клиринговой деятельности и в соответствии с Законом о клиринге.
Кредитная организация -	кредитная организация, являющаяся Резидентом.
Маржинальное требование -	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.
Маржинальное требование по обеспечению под стресс -	требование о приведении размера средств, внесенных Участником клиринга в качестве Обеспечения под стресс, в соответствие установленному Клиринговым центром для Участника клиринга размеру Обеспечения под стресс.
Маржинальное требование по фондам -	требование о приведении взносов Участника клиринга в гарантийные фонды в соответствие установленным Клиринговым центром размерам взносов в гарантийные фонды.
Международная организация -	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.
Методика определения размера Обеспечения под стресс -	внутренний документ Клирингового центра, устанавливающий порядок определения размера Обеспечения под стресс Участников клиринга.
Методика определения риск-параметров валютного рынка и рынка драгоценных металлов -	внутренний документ Клирингового центра, устанавливающий порядок определения риск-параметров валютного рынка и рынка драгоценных металлов ОАО Московская Биржа и параметров цены сделок своп, заключаемых в ходе Дополнительных сессий.
Недобросовестный участник клиринга -	Участник клиринга, не исполнивший или ненадлежащим образом исполнивший свои Итоговые нетто-обязательства и/или Маржинальное требование и/или имеющий Задолженность перед Клиринговым центром.
Некредитная организация -	юридическое лицо, являющееся Резидентом и не являющееся кредитной организацией.
Некредитная	юридическое лицо, являющееся Нерезидентом и не имеющее права осуществлять банковские операции.

организация – нерезидент -	
Нерезидент -	лицо, являющееся нерезидентом в соответствии с законодательством Российской Федерации о валютном регулировании и валютном контроле.
Нетто-обязательство Участника клиринга -	сумма денежных средств в соответствующей валюте / количество соответствующего драгоценного металла, представляющие собой превышение обязательств Участника клиринга в данной валюте / в данном драгоценном металле по Сделкам над его требованиями к Клиринговому центру в данной валюте / в данном драгоценном металле по Сделкам, определяемые по каждой Дате исполнения.
Нетто-требование Участника клиринга -	сумма денежных средств в соответствующей валюте / количество соответствующего драгоценного металла, представляющие собой превышение требований Участника клиринга в данной валюте / в данном драгоценном металле по Сделкам над его обязательствами перед Клиринговым центром в данной валюте / в данном драгоценном металле по Сделкам, определяемые по каждой Дате исполнения.
Обеспечение -	индивидуальное клиринговое обеспечение Участника клиринга в российских рублях (Обеспечение Участника клиринга в российских рублях) и/или денежные средства Участника клиринга в иностранной валюте и/или драгоценные металлы Участника клиринга (Обеспечение Участника клиринга в иностранной валюте и/или драгоценных металлах), которые используются для обеспечения исполнения обязательств Участника клиринга по Сделкам. Обеспечение используется для исполнения обязательств Участника клиринга по Сделкам, а также иных обязательств Участника клиринга, указанных в Правилах клиринга.
Обеспечение под стресс -	индивидуальное клиринговое обеспечение определенных Правилами клиринга Участников клиринга в российских рублях и/или иностранной валюте и/или ценных бумагах, которое используется для обеспечения исполнения обязательств Участника клиринга по Сделкам.
Общий Участник клиринга -	Участник клиринга, имеющий право действовать в качестве клирингового брокера.
Пароль -	последовательность символов, используемая для аутентификации Участника клиринга или Клирингового центра.
Подсистема ЭДО НКЦ -	Подсистема Системы Электронного Документооборота ОАО Московская Биржа (далее – СЭД ОАО Московская Биржа), 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.
Порядок предоставления информации и отчетности -	внутренний документ Клирингового центра, устанавливающий состав, сроки и форматы предоставления информации и отчетности Участниками клиринга Клиринговому центру.
Порядок ЭДО -	Порядок организации электронного документооборота ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр».
Правила торгов -	действующие Правила организованных торгов ОАО Московская Биржа на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.
Правила клиринга -	настоящие Правила клиринга ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр» на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.
Правила клиринга на рынке ценных бумаг -	действующие Правила клиринга ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр» на рынке ценных бумаг.
Правила клиринга на срочном рынке -	действующие Правила клиринга ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр» на срочном рынке.
Рабочий день -	день, в том числе выходной или праздничный нерабочий день, в который Биржа проводит торги иностранными валютами и/или драгоценными металлами.
Расчетная организация -	НКО ЗАО НРД и/или Банк России, в которой(-ом) Клиринговым центром открыт клиринговый банковский счет для учета Обеспечения в российских рублях и/или клиринговый банковский счет для учета коллективного клирингового обеспечения.
Расчетная цена -	цена, используемая для расчета вариационной маржи по своп контракту / фьючерсному контракту, определяемая в соответствии с Правилами клиринга.
Расчетный банк -	банк или небанковская кредитная организация, в том числе иностранная кредитная организация, в которой Клиринговым центром открыт корреспондентский счет для учета Обеспечения в иностранной валюте.
Расчетный день -	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. Не является Расчетным днем по соответствующей валюте / драгоценному металлу день, в который Биржа не проводит торги ни по одному инструменту в такой валюте / драгоценном металле с Датой исполнения обязательств в день проведения торгов.
Расчетный код -	сектор аналитического учета во внутреннем учете Клирингового центра. Значение Расчетного кода соответствует пяти последним цифрам в номерах счетов, открытых Участнику клиринга в бухгалтерском учете Клирингового

	центра.
Резидент -	юридическое лицо, являющееся резидентом в соответствии с законодательством Российской Федерации о валютном регулировании и валютном контроле.
Сайт Клирингового центра -	сайт в сети Интернет по адресу www.nkcbank.ru, на котором осуществляется раскрытие информации Клиринговым центром.
Сделка -	каждая из заключаемых на торгах Биржи сделок с иностранной валютой / драгоценным металлом, в т.ч. сделка спот, сделка своп, своп контракт или фьючерсный контракт.
Система «Клиент-КлирингБанк» -	автоматизированная система дистанционного банковского и клирингового обслуживания, предназначенная для осуществления электронного документооборота между Участниками клиринга и Клиринговым центром.
Счет для возврата -	зарегистрированный в Клиринговом центре счет, предназначенный для перечисления на него денежных средств в соответствующей валюте / соответствующих драгоценных металлов с целью исполнения обязательств Клирингового центра по возврату денежных средств / драгоценных металлов Участнику клиринга. В качестве Счета для возврата денежных средств может выступать счет Участника клиринга / клиента Участника клиринга, открытый в банке на территории Российской Федерации или в банке за пределами территории Российской Федерации. В качестве Счета для возврата драгоценных металлов может выступать открытый в Клиринговом центре обезличенный металлический счет Участника клиринга - банка, имеющего лицензию на привлечение во вклады и размещение драгоценных металлов, или обезличенный металлический счет Участника клиринга в банке, открывшем в Клиринговом центре обезличенный металлический счет и имеющем лицензию на привлечение во вклады и размещение драгоценных металлов.
Счет обеспечения -	открытый в Клиринговом центре обезличенный металлический счет Участника клиринга, предназначенный для учета Обеспечения Участника клиринга в соответствующем драгоценном металле.
Технический центр -	Открытое акционерное общество «Московская Биржа ММВБ-РТС», обеспечивающее Участникам клиринга технический доступ к Клиринговой системе на основании соответствующего договора.
Торговый лимит -	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.

Уполномоченный участник клиринга -	Участник клиринга, предоставляющий Клиринговому центру денежные средства путем заключения между ним и Клиринговым центром сделок своп в соответствии с Правилами клиринга с целью исполнения Клиринговым центром своих обязательств по Сделкам перед Добросовестными участниками клиринга, а также в целях исполнения Клиринговым центром своих обязательств на других рынках, на которых Клиринговый центр осуществляет функции клиринговой организации и/или центрального контрагента.
Участник клиринга -	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 Правила клиринга на срочном рынке, Правила клиринга на рынке ценных бумаг, Методику определения риск-параметров валютного рынка и рынка драгоценных металлов, внутренними документами Биржи - Правилами торгов, Спецификациями, а также законами, нормативными актами Банка России в сфере финансовых рынков и иными нормативными правовыми актами Российской Федерации.

Статья 2. Общие положения

2.1. Клиринговый центр осуществляет клиринг, выполняя функции центрального контрагента по всем Сделкам, стороной по которым являются Участники клиринга.

2.2. Клиринговый центр осуществляет клиринг с частичным обеспечением и клиринг с полным обеспечением.

2.3. Клиринговый центр вправе принять решение об осуществлении по отдельным инструментам исключительно клиринга с полным обеспечением.

2.4. Клиринговый центр осуществляет клиринг с частичным обеспечением по Сделкам, заключенным Участниками клиринга категории «О» и «Б» по инструментам, по которым Клиринговым центром не принято решение об осуществлении исключительно клиринга с полным обеспечением.

2.5. Клиринговый центр осуществляет клиринг с полным обеспечением по валюте лота и сопряженной валюте:

- по Сделкам, заключенным Участниками клиринга категории «В»;
- по Сделкам, заключенным Участниками клиринга категории «О» и «Б» по инструментам, по которым Клиринговым центром принято решение об осуществлении исключительно клиринга с полным обеспечением.

2.6. Клиринговый центр вправе установить для определенной иностранной валюты / драгоценного металла признак «запрет коротких продаж».

Установление признака «запрет короких продаж» означает, что по Сделкам с такой иностранной валютой / драгоценным металлом осуществляется только клиринг с

полным обеспечением по такой иностранной валюте / драгоценному металлу.

2.7. В качестве способов обеспечения исполнения обязательств, допущенных к клирингу, Клиринговый центр использует Обеспечение Участников клиринга, Обеспечение под стресс Участников клиринга, Гарантийный фонд.

2.8. Обеспечение Участника клиринга в иностранной валюте и/или драгоценных металлах 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, а также для обеспечения исполнения нетто-обязательств Участника клиринга, определяемых в порядке и случаях, установленных статьей 27 Правил клиринга.

2.9. Обеспечение Участников клиринга в российских рублях учитывается на клиринговом банковском счете Клирингового центра, открытом в Расчетной организации и предназначенном для учета Обеспечения Участников клиринга.

2.10. Обеспечение Участников клиринга в иностранной валюте учитывается на корреспондентских счетах Клирингового центра, открытых в Расчетных банках.

2.11. Обеспечение Участника клиринга в драгоценных металлах учитывается на Счетах обеспечения Участников клиринга.

2.12. Коллективное клиринговое обеспечение (Гарантийный фонд) в российских рублях или иностранной валюте учитывается на клиринговом банковском счете Клирингового центра в соответствующей валюте, открытом в Расчетной организации и предназначенном для учета коллективного клирингового обеспечения (гарантийных фондов).

2.13. Коллективное клиринговое обеспечение (Гарантийный фонд) в ценных бумагах учитывается на клиринговом счете депо Клирингового центра, открытом в Расчетном депозитарии и предназначенном для учета коллективного клирингового обеспечения (гарантийных фондов).

2.14. Обеспечение под стресс в российских рублях или иностранной валюте Участников клиринга учитывается на клиринговом банковском счете Клирингового центра в соответствующей валюте, открытом в Расчетной организации и предназначенном для учета Обеспечения под стресс.

2.15. Обеспечение под стресс в ценных бумагах учитывается на клиринговом счете депо Клирингового центра, открытом в Расчетном депозитарии и предназначенном для учета Обеспечения под стресс.

2.16. Учет обязательств и Обеспечения Участника клиринга в драгоценных металлах осуществляется в граммах.

2.17. Информация о реквизитах клиринговых счетов Клирингового центра, предназначенных для учета индивидуального или коллективного клирингового обеспечения, и реквизитах корреспондентских счетов Клирингового центра,

открытых в Расчетных банках и предназначенных для учета Обеспечения 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, если решением Клирингового центра не установлен иной срок для извещения об изменении реквизитов указанных счетов.

2.18. Учет Клиринговым центром индивидуального клирингового или иного обеспечения, внесенного Участниками клиринга, является услугой, оказываемой Клиринговым центром Участнику клиринга в рамках осуществления Клиринговым центром клиринговой деятельности.

2.19. 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 размещения временно свободных денежных средств 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.

2.20. 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).

2.20.1. Порядок формирования и передачи электронных документов посредством Подсистемы ЭДО НКЦ предусмотрен Порядком ЭДО и Договором об обмене электронными документами, заключенным Участником клиринга с Клиринговым центром.

2.20.2. 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.

2.20.3. Электронные документы, направляемые посредством Подсистемы ЭДО НКЦ, формируются в формате, предусмотренном Порядком ЭДО.

2.20.4. Электронные документы, направляемые посредством Системы «Клиент–КлирингБанк», формируются исключительно средствами Системы «Клиент–КлирингБанк» в формате, поддерживаемом программным обеспечением Системы «Клиент–КлирингБанк».

2.20.5. 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.

2.20.6. 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.

2.21. 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.

2.22. Формы и форматы документов, предоставляемых Участниками клиринга Клиринговому центру в соответствии с Правилами клиринга и способ их предоставления установлены документом «Формы и форматы документов, предоставляемых Участниками клиринга в соответствии с Правилами клиринга ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр» на валютном рынке и рынке драгоценных металлов», если иное не установлено Правилами клиринга.

Указанный документ раскрывается на Сайте Клирингового центра.

2.23. Клиринговый центр взаимодействует с Биржей в соответствии с заключенным договором, определяющим порядок и условия взаимодействия при организации Биржей торгов иностранной валютой и драгоценными металлами, а также при осуществлении Клиринговым центром клиринга и иных функций, связанных с осуществлением клиринга по Сделкам, заключенным на торгах Биржи.

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 Клирингового центра.

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 Клирингового центра.

3.4. Размер оплаты клиринговых услуг, оказываемых Клиринговым центром Участникам клиринга в соответствии с Правилами клиринга, определен Тарифами Клирингового центра на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, являющимися приложением № 2 к Правилам клиринга (далее – Тарифы Клирингового центра).

3.5. Порядок оплаты клиринговых услуг Клирингового центра определен в статье 25 Правил клиринга.

3.6. Клиринговые услуги Клирингового центра считаются оказанными надлежащим образом, если в течение 5 (пяти) рабочих дней после окончания месяца, в течение которого оказывались услуги, Участник клиринга письменно не заявит об обратном.

3.7. Участник клиринга вправе отказаться от исполнения Договора об оказании клиринговых услуг только при отсутствии у него имущественных обязательств по указанному договору, а также неисполненных им обязательств, допущенных к клирингу, письменно уведомив об этом Клиринговый центр не позднее, чем за 5 (пять) дней до даты 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 Клирингового центра.

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 ни по одним правилам клиринга Клирингового центра в связи с приостановлением / прекращением / неполучением им допуска к клиринговому обслуживанию.

3.10. Действие Договора об оказании клиринговых услуг прекращается в следующих случаях:

1) прекращения допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию в соответствии со всеми правилам клиринга Клирингового центра, на основании которых Участник клиринга был допущен к клиринговому обслуживанию;
2) ликвидации Участника клиринга, а также в случае реорганизации Участника клиринга при условии, что деятельность Участника клиринга в результате реорганизации прекращается;
3) отзыва (аннулирования) лицензии на осуществление банковских операций у Участника клиринга (для Кредитных организаций);
4) аннулирование специального разрешения (лицензии или иного основания), выданного центральным (национальным) банком или иным компетентным органом страны Банка-нерезидента, который в соответствии с законодательством страны Банка-нерезидента осуществляет валютное регулирование и банковский надзор (далее – компетентный орган), на основании которого Банк-нерезидент имеет право осуществлять банковские операции, предусмотренные личным законом Банка–нерезидента (для Банков-нерезидентов, в т.ч. Банков ЕврАзЭс).

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. Для Участника клиринга - Банка-нерезидента, Международной организации или для отдельной категории юридических лиц, 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

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, Участников торгов, которыми заключены указанные Сделки, и их 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.

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 10.18 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. 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 32 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;
- Торговый лимит каждого Участника клиринга, для которого указанный Торговый лимит установлен;
- обязанности и требования Участника клиринга по каждому обязательству по Сделке, допущенному к клирингу;
- совокупность Поручений на управление риском;
- обязательства Участников клиринга и Клирингового центра по уплате вариационной маржи / Гарантийных переводов;
- обязательства Участников клиринга и Клирингового центра по возврату Гарантийных переводов;
- Нетто-обязательства / Нетто-требования Участника клиринга с каждой Датой исполнения в каждой валюте и каждом драгоценном металле;
- Итоговое нетто-обязательство / Итоговое нетто-требование Участника клиринга в каждой валюте и каждом драгоценном металле;
- Обеспечение Участника клиринга в каждой валюте и каждом драгоценном металле;
- 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 денежные средства и/или ценные бумаги, внесенные Участником клиринга в качестве взноса в Гарантийный фонд и в качестве Обеспечения под стресс.

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 целях получения информации о юридическом лице Клиринговый центр имеет право использовать сведения (информацию) о юридическом лице из официальных источников, в том числе электронного сервиса Федеральной налоговой службы.

7.4. В случае если между юридическим лицом и Клиринговым центром уже заключен Договор об оказании клиринговых услуг по форме, установленной приложением № 1 к Правилам клиринга, для осуществления клирингового обслуживания в соответствии с иными правилами клиринга Клирингового центра, то заключение нового Договора об оказании клиринговых услуг в соответствии с настоящими Правилами клиринга не требуется.

7.5. 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.

7.6. Одновременно с ежегодным предоставлением Клиринговому центру Анкеты

Участника клиринга (клиента) (Регистрационной карточки) Участник клиринга, за исключением Участника клиринга категории «А», обязан предоставлять Клиринговому центру Отзывы о деловой репутации, заверенные подписями уполномоченных представителей лиц, их выдавших.

Участник клиринга предоставляет Отзывы о деловой репутации от других Участников клиринга Клирингового центра, имеющих с ним деловые отношения, и (или) Отзывы о деловой репутации от кредитных организаций, у которых Участник клиринга находится или ранее находился на обслуживании. Списки Участников клиринга раскрываются на Сайте Клирингового центра. В случае невозможности получения отзыва о деловой репутации Участник клиринга направляет Клиринговому центру письмо об отсутствии возможности его получения.

7.7. Для подтверждения своего финансового состояния Участники клиринга, за исключением Участников клиринга категории «А», 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.

7.8. Участник клиринга предоставляет Клиринговому центру Анкету FATCA в форме электронного документа, а также иные прилагаемые к Анкете FATCA документы и сведения, предоставляемые для целей FATCA, необходимость представления которых следует из Анкеты FATCA и (или) действующего законодательства, в том числе согласие на передачу информации в иностранный налоговый орган.

7.8.1. В случае изменения сведений, содержащихся в Анкете FATCA, Участник клиринга обязан в течение 30 (тридцати) дней после таких изменений предоставить Клиринговому центру Анкету FATCA с обновленной информацией и прилагаемыми к Анкете FATCA документами в форме электронного документа.

7.8.2. Форма для заполнения Анкеты FATCA Участниками клиринга размещается на сайте Клирингового центра. При этом документы, прилагаемые к Анкете FATCA, заполняются Участником клиринга и предоставляются в Клиринговый центр в виде PDF файлов, содержащих скан-копии этих документов.

Статья 8. Категории Участников клиринга

8.1. Существуют четыре категории Участников клиринга:

- Участники клиринга категории «А»;
- Участники клиринга категории «О»;
- Участники клиринга категории «Б»;
- Участники клиринга категории «В».

8.2. Участниками клиринга категории «А» являются Банк России, а также иные лица, на которые в соответствии с Законом о клиринге не распространяется требование о передаче имущества в индивидуальное и коллективное клиринговое обеспечение.

Положения Правил клиринга распространяются на Участников клиринга категории «А», если иное не предусмотрено договором, заключенным между

соответствующим Участником клиринга категории «А» и Клиринговым центром.

8.3. Участниками клиринга категории «О» являются Общие Участники клиринга.

Участник клиринга категории «О» имеет допуск к клирингу с частичным обеспечением, за исключением случаев, установленных Правилами клиринга.

8.4. Участниками клиринга категории «Б» являются Индивидуальные Участники клиринга, имеющие допуск к клирингу с частичным обеспечением.

8.5. Участниками клиринга категории «В» являются Индивидуальные Участники клиринга, не имеющие допуска к клирингу с частичным обеспечением.

Статья 9. Условия клирингового обслуживания. Порядок предоставления допуска к клиринговому обслуживанию

9.1. Допуск к клиринговому обслуживанию в соответствии с Правилами клиринга предоставляется Участнику клиринга, соответствующему требованиям, установленным пунктами 9.2, 9.3 и/или 9.4 Правил клиринга, на основании соответствующего Заявления о предоставлении допуска к клиринговому обслуживанию.

9.2. Для допуска к клиринговому обслуживанию Участник клиринга категории «В» должен соответствовать следующим требованиям:

9.2.1. иметь действующий Договор об оказании клиринговых услуг, заключенный с Клиринговым центром;

9.2.2. иметь действующий договор / договоры, заключенный(-ые) с Техническим центром и обеспечивающий(-ие) технический доступ к Клиринговой системе, и установить необходимое для клирингового обслуживания программно-техническое обеспечение, соответствующее требованиям, установленным Техническим центром;

9.2.3. иметь действующую лицензию на осуществление банковских операций, выданную Банком России (для Кредитных организаций);

9.2.4. иметь специальное разрешение (лицензию или иное основание), выданное компетентным органом государства учреждения Банка-нерезидента, на основании которого Банк-нерезидент имеет право осуществлять банковские операции, предусмотренные личным законом Банка–нерезидента (для Банков-нерезидентов);

9.2.5. являться участником Подсистемы ЭДО НКЦ;

9.2.6. выполнять требования Клирингового центра по предоставлению информации и отчетности, предусмотренные пунктами 7.5-7.7 Правил клиринга;

9.2.7. выполнять требования Клирингового центра к финансовой устойчивости Участника клиринга, предусмотренные пунктом 9.4 Правил клиринга;

9.2.8. предоставить Клиринговому центру реквизиты Счетов для возврата для основного Расчетного кода Участника клиринга в соответствии с порядком, определенным пунктом 2) подпункта 10.3.1 Правил клиринга.

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).

9.3. Для допуска к клиринговому обслуживанию Участник клиринга категории «Б» помимо требований, установленных пунктом 9.2 Правил клиринга, должен соответствовать следующим требованиям:

9.3.1. Участник клиринга - Некредитная организация имеет собственные средства (капитал) не менее 180 000 000 (ста восьмидесяти миллионов) российских рублей;

9.3.2. внести взнос в Гарантийный фонд в размере, установленном в соответствии с пунктом 12.3 Правил клиринга;

9.3.3. в деятельности Участника клиринга должны отсутствовать факты ухудшения его финансового состояния и/или должна отсутствовать 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, Маржинальные требования и/или иные обязательства Участника клиринга, возникающие из Правил клиринга.

9.4. Для допуска к клиринговому обслуживанию Участник клиринга категории «О» помимо требований, установленных пунктом 9.2 и подпунктами 9.3.2-9.3.3 Правил клиринга, должен соответствовать следующим требованиям:

9.4.1. иметь собственные средства (капитал) не менее, чем 50 000 000 000 (пятьдесят миллиардов) российских рублей, либо

9.4.2. иметь собственные средства (капитал) не менее, чем 20 000 000 000 (двадцать миллиардов) российских рублей и рейтинг по международной шкале долгосрочной кредитоспособности по обязательствам в российских рублях или в иностранной валюте не ниже, чем на один уровень меньше суверенного рейтинга Российской Федерации, либо

9.4.3. иметь собственные средства (капитал) не менее, чем 20 000 000 000 (двадцать миллиардов) российских рублей при условии, что рейтинг организации, имеющей право прямо или косвенно осуществлять контроль за деятельностью Участника клиринга, по международной шкале долгосрочной кредитоспособности по обязательствам в российских рублях или в иностранной валюте не ниже, чем на один уровень меньше суверенного рейтинга Российской Федерации.

9.4.4. Участник клиринга – Резидент помимо требований, установленных подпунктами 9.4.1-9.4.3 Правил клиринга, должен иметь лицензию Банка России на осуществление банковских операций со средствами в рублях и иностранной валюте и/или лицензию на осуществление клиринговой деятельности.

9.4.5. Для проверки соответствия собственных средств (капитала) Участника клиринга – Нерезидента требованиям, установленным подпунктами 9.4.1-9.4.3 Правил клиринга, размер собственных средств (капитала) Участника клиринга – Нерезидента в иностранной валюте пересчитывается в российские рубли по курсу иностранной валюты к российскому рублю, установленному Банком России на первое число календарного квартала предоставления Участником клиринга Заявления о предоставлении допуска к клиринговому обслуживанию с категорией «О».

9.5. Клиринговый центр вправе запросить у Участника клиринга, предоставившего

Клиринговому центру Заявление о предоставлении допуска к клиринговому обслуживанию с категорией «О» или Заявление об изменении категории Участника клиринга на категорию «О»:

- информацию о структуре собственности Участника клиринга;
- методику и результаты стресс-тестирования системы управления рисками Участника клиринга.

9.6. Клиринговый центр вправе запросить у Участника клиринга, соответствующего требованиям подпункта 9.4.3 Правил клиринга и предоставившего Клиринговому центру Заявление о предоставлении допуска к клиринговому обслуживанию с категорией «О» или Заявление об изменении категории Участника клиринга на категорию «О», письмо, выданное организацией, имеющей право прямо или косвенно осуществлять контроль за деятельностью Участника клиринга, содержащее:

1) подтверждение, что указанная организация знает о намерении лица, в отношении которого выдается указанное письмо, получить статус Участника клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов ОАО Московская Биржа и осуществлять функции клирингового брокера;
2) сведения о доли участия организации, выдающей указанное письмо, в организации, в отношении которой выдается указанное письмо и/или подтверждение осуществления контроля и заверение об отсутствии намерений уменьшить указанную долю / прекратить осуществлять контроль;
3) подтверждение намерения организации, выдающей указанное письмо, в случае недостаточности у Участника клиринга, в отношении которого выдается такое письмо, денежных средств для исполнения своих обязательств перед Клиринговым центром, предоставить Участнику клиринга необходимое финансирование.

Указанное в настоящем пункте Правил клиринга письмо может быть предоставлено на русском или английском языке.

9.7. На основании анализа информации и/или документов, полученных Клиринговым центром от Участника клиринга в соответствии с пунктами 9.5 и 9.6 Правил клиринга, или в случае непредоставления указанной информации и/или документов, Клиринговый центр вправе отказать Участнику клиринга в исполнении Заявления о предоставлении допуска к клиринговому обслуживанию с категорией «О» или Заявления об изменении категории Участника клиринга на категорию «О».

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

9.8.1. в деятельности Участника клиринга должны отсутствовать основания для осуществления мер по предупреждению банкротства в соответствии с законодательством Российской Федерации о несостоятельности (банкротстве) или в соответствии с личным законом Участника клиринга;

9.8.2. 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);

9.8.3. в деятельности Участников клиринга - Кредитных организаций должны отсутствовать основания для отзыва Банком России лицензии на осуществление банковских операций в соответствии с законодательством Российской Федерации о банковской деятельности;

9.8.4. в деятельности Участников клиринга - Банков-нерезидентов должны отсутствовать основания для отзыва лицензии на осуществление банковских операций в соответствии с личным законом Банка-нерезидента.

9.9. Участники клиринга должны соответствовать требованиям, приведенным в пунктах 9.2-9.4 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.

9.10. Клиринговый центр вправе не предоставлять допуск к клиринговому обслуживанию Участникам клиринга категорий «О», «Б» и «В», не соответствующим следующим требованиям:

9.10.1. 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;

9.10.2. Государственные корпорации, Международные организации, Некредитные организации – наличие по балансу на последнюю отчетную дату положительного финансового результата деятельности, определяемого как прибыль после налогообложения;

9.10.3. Нерезиденты - наличие по финансовой отчетности на последнюю отчетную дату положительного финансового результата деятельности, определяемого как прибыль после налогообложения.

9.11. Клиринговый центр вправе предоставить Участнику клиринга допуск к клиринговому обслуживанию как по всем инструментам, так и по ограниченному перечню инструментов.

9.12. Клиринговый центр вправе определить особенности применения требований по допуску к клиринговому обслуживанию для отдельных категорий юридических лиц, в том числе для Банков-нерезидентов, с учетом положений соответствующего Международного соглашения, для Международных организаций - с учетом положений соответствующего международного договора.

9.13. 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 Биржу не позднее рабочего дня, следующего за днем предоставления допуска к клиринговому обслуживанию.

9.14. Для заключения сделок купли-продажи драгоценных металлов Участником клиринга должен быть открыт Счет обеспечения в соответствующем драгоценном металле.

9.15. 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 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 отзыва лицензии на осуществления банковских операций в соответствии с личным законом Банка-нерезидента;
- иные сведения, свидетельствующие о наличии или отсутствии в деятельности Участника клиринга оснований для осуществления мер по предупреждению банкротства в соответствии с законодательством Российской Федерации о несостоятельности (банкротстве) или в соответствии с личным законом Участника клиринга.

9.16. Участник клиринга вправе предоставить Клиринговому центру Заявление об изменении категории Участника клиринга.

9.16.1. Заявление об изменении категории Участника клиринга с категории «Б» на категорию «В» исполняется при соблюдении следующих условий:

1) у Участника клиринга отсутствуют Маржинальные требования по всем Расчетным кодам, и
2) у Участника клиринга отсутствуют непогашенные Задолженности по всем Расчетным кодам, учитываемые в соответствии с Правилами клиринга, а также непогашенные задолженности, учитываемые в соответствии с иными правилами клиринга Клирингового центра.

9.16.2. Заявление на изменении категории Участника клиринга с категории «О» на категорию «Б» или «В» осуществляется при соблюдении условий, указанных в подпункте 9.16.1 Правил клиринга, а также при отсутствии неисполненных обязательств по Сделкам, заключенным Участниками торгов с указанием соответствующего Участника клиринга категории «О» в качестве клирингового брокера.

9.16.3. Клиринговый центр вправе изменить категорию Участника клиринга с категории «В» на категорию «Б» без подачи заявления при выполнении Участником клиринга требований, установленных для Участников клиринга категории «Б».

9.16.4. Клиринговый центр извещает Участника клиринга и Биржу об изменении категории Участника клиринга не позднее рабочего дня, следующего за днем установления Участнику клиринга новой категории.

Статья 10. Порядок регистрации Участников клиринга и присвоения Участникам клиринга Расчетных кодов и Клиринговых идентификаторов

10.1. Клиринговый центр осуществляет регистрацию Участников клиринга.

10.1.1. Процедура регистрации Участника клиринга предусматривает присвоение Участнику клиринга следующих кодов и идентификаторов:

- код Участника клиринга (присваивается в соответствии с нормативными актами Банка России);
- основной Идентификатор (присваивается Клиринговым центром). Если Участник клиринга является Участником торгов, Идентификатор присваивается на основании данных, полученных от Биржи.

10.1.2. Информация о коде Участника клиринга учитывается в реестре Участников клиринга и предоставляется по запросу Банка России, иных уполномоченных лиц и органов, а также Участников клиринга и содержит данные, соответствующие требованиям Банка России, предъявляемым к регистрации Участников клиринга (кодов Участников клиринга).

10.1.3. Клиринговым центром Участнику клиринга могут быть присвоены дополнительные Идентификаторы. При этом для каждого Участника клиринга устанавливается однозначное соответствие всех Идентификаторов присвоенному коду Участника клиринга.

10.2. При присвоении Клиринговым центром Участнику клиринга Идентификатора, Участнику клиринга Клиринговым центром присваивается основной Расчетный код в рамках Идентификатора (основного или дополнительного).

По умолчанию основной Расчетный код используется для заключения Сделок на основании заявок Участника торгов, являющегося Участником клиринга, которому присвоен данный основной Расчетный код, а также для учета денежных средств / драгоценных металлов такого Участника клиринга и обязательств Участника клиринга по Сделкам, заключенным за счет такого Участника клиринга (далее – собственный Расчетный код).

Участнику клиринга могут быть присвоены дополнительные собственные Расчетные коды.

10.2.1. В случае заключения Сделок за счет своих клиентов Участник клиринга обязан открыть отдельный дополнительный Расчетный код для учета денежных средств / драгоценных металлов клиентов и обязательств Участника клиринга по Сделкам, заключенным за счет клиентов (далее – клиентский Расчетный код).

10.2.2. В случае заключения Сделок за счет денежных средств, находящихся в доверительном управлении Участника клиринга, Участник клиринга обязан

открыть отдельный дополнительный Расчетный код для учета денежных средств / драгоценных металлов, находящихся в доверительном управлении этого Участника клиринга и обязательств Участника клиринга по Сделкам, заключенным за счет денежных средств / драгоценных металлов, находящихся в доверительном управлении этого Участника клиринга (далее – Расчетный код ДУ).

10.3. Присвоение дополнительного Расчетного кода Участнику клиринга в рамках одного Идентификатора (основного или дополнительного) осуществляется на основании заявления Участника клиринга, предоставленного Клиринговому центру.

10.3.1. Заявление о присвоении дополнительного Расчетного кода должно содержать:

1) указание на тип Расчетного кода:
   - собственный Расчетный код;
   - клиентский Расчетный код;
   - Расчетный код ДУ.
2) реквизиты Счетов для возврата для данного Расчетного кода.

   В случае если владельцем Счета для возврата является клиент Участника клиринга Участник клиринга предоставляет Клиринговому центру:
   - Письмо об идентификации клиента;
   - копию договора об обслуживании / оказании услуг, заключенного между клиентом Участника клиринга и Участником клиринга, заверенную нотариально или Участником клиринга (в случае если владельцем Счета для возврата является Нерезидент);
   - иные документы (по требованию Клирингового центра).

10.4. Для заключения Сделок на основании заявок Участника торгов, в которых Участник клиринга указан в качестве Клирингового брокера, Участник клиринга категории «О» предоставляет Клиринговому центру информацию об Идентификаторе и наименовании Участника торгов, который вправе подавать заявки с указанием Расчетного кода данного Участника клиринга.

Указанная информация предоставляется в форме Заявления о соответствии Участника торгов Расчетному коду**.**

Подача указанного заявления считается согласием Участника клиринга на указание его в заявках с соответствующим Расчетным кодом в качестве Клирингового брокера.

10.5. Участник клиринга категории «О» или «Б» вправе с использованием Клиринговой системы установить для Расчетного кода признак «запрет коротких продаж и необеспеченных покупок».

Установление признака «запрет коротких продаж и необеспеченных покупок» по Расчетному коду Участнику клиринга означает, что по всем Сделкам, заключенным с указанием такого Расчетного кода, осуществляется клиринг с полным обеспечением по валюте лота и сопряженной валюте.

10.6. Для предоставления клиенту Участника клиринга, которым может являться Участник торгов или клиент Участника торгов, возможности воспользоваться в будущем Переводом обязательств и Переводом Обеспечения, определенными в

статье 27 Правил клиринга, по основаниям и в порядке, установленным в статье 27 Правил клиринга, Участник клиринга должен открыть для такого клиента Участника клиринга (далее – Обособленный клиент) отдельный дополнительный клиентский Расчетный код в соответствии с подпунктом 10.3.1 Правил клиринга и предоставить Клиринговому центру Заявление на регистрацию Обособленного клиента, в котором указать:

1) клиентский Расчетный код, открытый Участником клиринга для Обособленного клиента;
2) наименование / фамилию, имя и отчество Обособленного клиента;
3) ИНН Обособленного клиента – юридического лица, имеющего ИНН, или номер паспорта Обособленного клиента – физического лица, или адрес и регистрационный номер в стране регистрации Обособленного клиента – юридического лица, являющегося Нерезидентом и не имеющего ИНН.

Участник клиринга несет ответственность за достоверность информации об Обособленном клиенте, предоставленной Клиринговому центру в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга.

10.7. Участнику клиринга может быть присвоено неограниченное количество дополнительных Расчетных кодов.

10.8. 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.

10.9. Клиринговый центр посредством ПТК ТЦ передает Бирже информацию о присвоенных Участникам клиринга Расчетных кодах, об Участниках торгов, имеющих право подавать заявки с указанием таких Расчетных кодов, и об Обособленных клиентах, для которых открыты отдельные клиентские Расчетные коды.

10.10. Внесение Участником клиринга Обеспечения, уплата комиссионных вознаграждений и расчеты с Клиринговым центром осуществляются отдельно по Расчетному коду Участника клиринга.

10.11. 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 и драгоценных металлов Участника клиринга, исполнение (прекращение) обязательств по Сделкам, возникновение и прекращение Маржинального требования, заключение и исполнение Сделок в ходе Дополнительных сессий первого и второго типа, уплата комиссионных вознаграждений осуществляется по Расчетному коду Участника клиринга.

10.12. Участник клиринга вправе изменить реквизиты основного или дополнительного Расчетного кода, указанные в подпункте 10.3.1 Правил клиринга, предоставив Клиринговому центру Заявление об изменении реквизитов Расчетного кода.

Новые реквизиты Расчетного кода действуют с Рабочего дня, следующего за днем получения Клиринговым центром Заявления об изменении реквизитов Расчетного кода.

10.13. В случае получения от Биржи уведомления о прекращении допуска к торгам Участника торгов, являющегося Участником клиринга, по Регистрационному коду (идентификатору) Участника торгов Клиринговый центр аннулирует основной и дополнительные Расчетные коды, присвоенные Участнику клиринга в рамках Идентификатора, соответствующего такому Регистрационному коду (идентификатору) Участника торгов.

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

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

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

10.17. Клиринговый центр информирует Участника клиринга об аннулировании Расчетного кода не позднее рабочего дня, следующего за днем его аннулирования, посредством Подсистемы ЭДО НКЦ.

10.18. Участнику клиринга, получившему допуск к клиринговому обслуживанию, Клиринговым центром присваиваются Клиринговые идентификаторы на основании Заявления о присвоении Клирингового идентификатора, предоставленного Участником клиринга Клиринговому центру.

10.18.1. Клиринговый идентификатор соответствует одному Идентификатору Участника клиринга. Одному Идентификатору Участника клиринга может соответствовать более одного Клирингового идентификатора.

10.18.2. 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.

10.18.3. 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.

10.18.4. Аннулирование присвоенного Участнику клиринга Клирингового идентификатора

по инициативе Участника клиринга осуществляется на основании Заявления об аннулировании Клирингового идентификатора, предоставленного Участником клиринга Клиринговому центру.

Аннулирование всех Клиринговых идентификаторов, соответствующих Идентификатору Участника клиринга, осуществляется на основании полученного от Биржи уведомления о прекращении допуска к торгам Участника торгов, являющегося Участником клиринга, по Регистрационному коду (идентификатору) Участника торгов, соответствующему такому Идентификатору Участника клиринга, или при прекращении допуска к клиринговому обслуживанию Участника клиринга.

Статья 11. Порядок приостановления и прекращения допуска к клиринговому обслуживанию

11.1. Клиринговый центр вправе приостановить допуск к клиринговому обслуживанию (в том числе по одному или нескольким инструментам) Участника клиринга категории «О», «Б» или «В» по любому из следующих оснований:

11.1.1. на основании соответствующего уведомления Биржи (для Участника клиринга, являющегося Участником торгов);

11.1.2. при возникновении обстоятельств, препятствующих, в соответствии с законодательством Российской Федерации, заключению и/или исполнению Участником клиринга Сделок (за исключением чрезвычайных ситуаций), ставших известными Клиринговому центру;

11.1.3. при нарушении Участником клиринга установленных Правилами клиринга требований;

11.1.4. 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 и назначение временной администрации по управлению кредитной организацией – Участником клиринга в рамках мер по предупреждению банкротства кредитной организации;

11.1.5. при применении к Участнику клиринга санкций уполномоченных органов за нарушение законодательства Российской Федерации, в том числе при применении административных наказаний;

11.1.6. наличие в деятельности Участника клиринга оснований для осуществления мер по предупреждению банкротства в соответствии с законодательством Российской Федерации о несостоятельности (банкротстве) или в соответствии с личным законом Участника клиринга - Нерезидента, а также оснований для отзыва (аннулирования) уполномоченным органом / Банком России лицензии на осуществление соответствующего вида деятельности в соответствии с законодательством Российской Федерации или в соответствии с личным законом Участника клиринга - Нерезидента;

11.1.7. 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, и/или размещении соответствующей информации на сайте вышеуказанного компетентного органа в сети Интернет;

11.1.8. 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 ЕврАзЭс;

11.1.9. 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;

11.1.10. по результатам рассмотрения Клиринговым центром предоставленных Участником клиринга в соответствии с пунктами 7.5-7.7 Правил клиринга информации и документов, а также в случае их непредставления в надлежащий срок;

11.1.11. 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;

11.1.12. 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 Клирингового центра, регламентирующими различные направления клиринговой деятельности;

11.1.13. в случае отсутствия в отчетности Участника клиринга положительного финансового результата, предусмотренного пунктом 9.10 Правил клиринга, по состоянию на две и более последовательные отчетные даты;

11.1.14. в случае непредоставления Участником клиринга Анкеты FATCA в соответствии с пунктом 7.8 Правил клиринга;

11.1.15. в случае получения от иностранного налогового органа уведомления о невыполнении Участником клиринга требований законодательства иностранного государства.

11.2. Клиринговый центр вправе установить Участнику клиринга категории «Б» категорию «В» по основаниям, предусмотренным подпунктами 11.1.10-11.1.13 Правил клиринга, а также в следующих случаях:

11.2.1. при несоответствии размера собственных средств (капитала) Участника клиринга требованию, установленному подпунктом 9.3.1 Правил клиринга;

11.2.2. при несоответствии размера взноса Участника клиринга в Гарантийный фонд размеру, установленному в соответствии с пунктом 12.3 Правил клиринга;

11.2.3. при несоответствии размера Обеспечения под стресс Участника клиринга размеру, установленному в соответствии с пунктом 12.4 Правил клиринга.

11.3. Клиринговый центр вправе установить по всем Расчетным кодам Участника клиринга категории «О» признак «запрет коротких продаж и необеспеченных покупок» по основаниям, предусмотренным подпунктами 11.1.10-11.1.13, 11.2.2, 11.2.3 Правил клиринга, а также при несоответствии Участника клиринга требованиям, установленным подпунктом 9.4.1, или подпунктом 9.4.2, или подпунктом 9.4.3 Правил.

При этом в целях проверки соответствия собственных средств (капитала) Участника клиринга – Нерезидента требованиям, установленным подпунктами 9.4.1-9.4.3 Правил клиринга, размер собственных средств (капитала) Участника клиринга – Нерезидента в иностранной валюте пересчитывается в российские рубли по курсу иностранной валюты к российскому рублю, установленному Банком России на первое число каждого каледарного квартала.

11.4. В случае если действие оснований для установления Участнику клиринга категории «О» признака «запрет коротких продаж и необеспеченных покупок» не прекращено в течение 3-х Рабочих дней после установления указанного признака в соответствии с пунктами 11.3, 20.12 или 24.9 Правил клиринга, Клиринговый центр вправе приостановить допуск к клиринговому обслуживанию Участника клиринга категории «О», начиная с 4-го Рабочего дня с даты установления указанного признака.

11.5. Клиринговый центр вправе установить Участнику клиринга категории «О» категорию «Б» в случае, если в течение 2-х (двух) лет с даты присвоения Участнику клиринга категории «О» Участник клиринга не предоставил Клиринговому центру информацию ни об одном Участнике торгов, который вправе подавать заявки с указанием Расчетных кодов данного Участника клиринга, в соответствии с пунктом 10.4 Правил клиринга.

11.6. 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, стороной по которым является данный Участник клиринга, заключенным до момента приостановления допуска к клиринговому обслуживанию Участника клиринга или, соответственно, до момента приостановления допуска к клиринговому обслуживанию по одному или нескольким инструментам.

11.7. После получения информации о прекращении действия оснований для приостановления допуска к клиринговому обслуживанию и на основании соответствующего письма Участника клиринга Клиринговый центр вправе принять решение о возобновлении приостановленного клирингового обслуживания Участника клиринга.

Для возобновления допуска к клиринговому обслуживанию, приостановленного на основании подпункта 11.1.1 Правил клиринга, предоставление соответствующего письма Участника клиринга не требуется.

11.8. Клиринговый центр прекращает допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию (независимо от его категории) по любому из следующих оснований:

11.8.1. прекращение действия Договора об оказании клиринговых услуг при условии отсутствия неисполненных обязательств, возникших до прекращения его действия;

11.8.2. отзыв (аннулирование) Банком России лицензии на осуществление банковских операций у Участника клиринга – Кредитной организации;

11.8.3. отзыв (аннулирование) Банком России лицензии на осуществление клиринговой деятельности у Участника клиринга категории «О»;

11.8.4. назначение временной администрации или принятие арбитражным судом решения о введении в отношении Участника клиринга одной из процедур банкротства;

11.8.5. ликвидация Участника клиринга, а также реорганизация Участника клиринга при условии, что деятельность Участника клиринга в результате реорганизации прекращается;

11.8.6. отзыв (аннулирование) специального разрешения (лицензии или иного основания) компетентного органа государства учреждения Банка-нерезидента, в соответствии с которым Банк-нерезидент имеет право осуществлять банковские операции;

11.8.7. прекращение Международного соглашения для Российской Федерации либо прекращение Международного соглашения для государства - стороны Международного соглашения, являющегося государством учреждения Участника-клиринга – Банка ЕврАзЭс;

11.8.8. прекращение международного договора, в соответствии с которым учреждена Международная организация, для Российской Федерации либо принятие решения уполномоченными лицами сторон указанного международного договора о прекращении деятельности Международной организации;

11.8.9. принятие федерального закона о ликвидации Государственной корпорации;

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

11.9. Клиринговый центр вправе прекратить допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию:

11.9.1. при поступлении в Клиринговый центр уведомления от Биржи о прекращении допуска Участника клиринга к участию в торгах, проводимых Биржей (для Участника клиринга, являющегося Участником торгов);

11.9.2. 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;

11.9.3. неоднократного (два и более раза) в течение одного года нарушения Участником клиринга установленных Правилами клиринга требований.

11.10. Клиринговый центр извещает Участника клиринга и Биржу о приостановлении / прекращении или возобновлении приостановленного допуска к клиринговому

обслуживанию (в том числе, по одному или нескольким инструментам) или об изменении категории Участника клиринга не позднее Рабочего дня, следующего за днем приостановления / прекращения или возобновления приостановленного допуска к клиринговому обслуживанию / днем изменения категории Участника клиринга.

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

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

12.1. В целях снижения рисков, связанных с осуществлением клиринга, Клиринговый центр:

- предъявляет требования к финансовой устойчивости Участников клиринга;
- предъявляет к Участникам клиринга требование о внесении Обеспечения;
- 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 заключении Сделок, возврате Обеспечения Участнику клиринга;
- формирует Гарантийный фонд;
- не реже, чем каждый Расчетный день, осуществляет переоценку стоимости ценных бумаг и иностранной валюты, учитываемых в качестве взносов в Гарантийный фонд;
- предъявляет к Участникам клиринга требование о внесении Обеспечения под стресс;
- не реже, чем каждый Расчетный день, осуществляет переоценку стоимости ценных бумаг и иностранной валюты, учитываемых в качестве Обеспечения под стресс Участника клиринга.

12.2. Предельная доля иностранной валюты, принимаемой в Обеспечение Участника клиринга, составляет 100%.

Предельная доля драгоценных металлов, принимаемых в Обеспечение Участника клиринга, составляет 100%.

12.2.1. Клиринговый центр вправе установить ограничение на предельную сумму иностранной валюты / предельное количество драгоценного металла, принимаемого в Обеспечение Участника клиринга, путем установления равной нулю любой из Нижних границ диапазона оценки рыночных рисков по такой иностранной валюте / драгоценному металлу для отдельного Участника клиринга или для всех Участников клиринга.

12.3. Гарантийный фонд формируется Клиринговым центром за счет взносов в Гарантийный фонд всех Участников клиринга категорий «О» и «Б».

Размер взноса в Гарантийный фонд каждого Участника клиринга категорий «О» и

«Б» составляет 3 000 000 (три миллиона) российских рублей.

12.4. Обеспечение под стресс обязаны вносить Участники клиринга категорий «О» и «Б».

Порядок определения размера Обеспечения под стресс Участника клиринга установлен Методикой определения размера Обеспечения под стресс.

12.5. В качестве взноса в Гарантийный фонд и/или Обеспечения под стресс Участники клиринга могут вносить денежные средства в российских рублях и иностранной валюте, а также ценные бумаги.

12.5.1. Перечень иностранных валют и ценных бумаг, принимаемых Клиринговым центром в качестве взносов в Гарантийный фонд и/или Обеспечения под стресс, устанавливается решением Клирингового центра.

12.5.2. Предельная доля иностранной валюты, принимаемой Клиринговым центром в качестве взноса в Гарантийный фонд и/или Обеспечения под стресс, составляет 100%.

Предельная доля ценных бумаг, принимаемых Клиринговым центром в качестве взноса в Гарантийный фонд и/или Обеспечения под стресс, составляет 100%.

12.6. Участники клиринга категорий «О» и «Б» обязаны внести взносы в Гарантийный фонд в размере, определенном в соответствии с пунктом 12.3 Правил клиринга, и Обеспечение под стресс в размере, определенном в соответствии с пунктом 12.4 Правил клиринга, в течение срока, установленного решением Клирингового центра.

Статья 13. Единый лимит и риск-параметры

13.1. Единый лимит Участника клиринга рассчитывается Клиринговым центром при изменении размера Обеспечения Участника клиринга, при подаче Участником торгов заявок на заключение Сделок, стороной по которым будет являться Участник клиринга, при заключении Сделок или исполнении / прекращении обязательств по Сделкам, стороной по которым является Участник клиринга, изменении риск-параметров.

13.2. Единый лимит Участника клиринга используется для проверки возможности подачи Участником торгов заявок на заключение Сделок, стороной по которым будет являться Участник клиринга, возврата Участнику клиринга Обеспечения в денежных средствах / драгоценных металлах, 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.

13.3. Единый лимит Участника клиринга рассчитывается с учетом:

- Обеспечения Участника клиринга в российских рублях, Обеспечения Участника клиринга в иностранной валюте и драгоценных металлах, за исключением иностранной валюты, по Сделкам с которой осуществляется только клиринг с полным обеспечением;
- Нетто-обязательств / Нетто-требований Участника клиринга в российских

рублях / иностранной валюте / драгоценных металлах, за исключением иностранной валюты, по Сделкам с которой осуществляется только клиринг с полным обеспечением;

- совокупности действующих Поручений на управление риском, поданных Участником клиринга;
- обязательств по уплате комиссионных вознаграждений, учитываемых по Расчетному коду;
- Задолженности Участника клиринга перед Клиринговым центром в российских рублях;
- корректировки Единого лимита с учетом Индикативных курсов сделок своп.

13.4. 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 и/или драгоценных металлах, учитываемая при расчете Единого лимита Участника клиринга, ограничивается величиной Торгового лимита такого Участника клиринга, который устанавливается в следующем порядке:

13.4.1. 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.

13.4.2. 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.

13.4.3. 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.

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

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

- поданных Участником торгов и зарегистрированных заявок на заключение Сделок, по которым осуществляется клиринг с частичным обеспечением, стороной которых будет являться Участник клиринга;
- поданных Участником торгов и зарегистрированных заявок на покупку на заключение Сделок, по которым осуществляется клиринг с полным обеспечением, стороной которых будет являться Участник клиринга.

13.6. 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 и рынка драгоценных металлов.

13.7. Верхняя и Нижняя границы диапазона оценки рыночных рисков и Верхнее и Нижнее значения Индикативного курса сделок своп, используемые при расчете Единого лимита Участника клиринга, зависят от объема обязательств Участника клиринга по Сделкам.

13.8. Клиринговый центр вправе установить индивидуальные Верхние и Нижние границы диапазона оценки рыночных рисков и Верхние и Нижние значения Индикативного курса сделок своп, расширяющие указанные диапазоны, для одного или нескольких Участников клиринга.

13.9. Участник клиринга категории «О» или «Б» вправе с использованием Клиринговой системы установить индивидуальные Верхние и Нижние границы диапазона оценки рыночных рисков и Верхние и Нижние значения Индикативного курса сделок своп, расширяющие указанные диапазоны, для определенных Расчетных кодов Участника клиринга.

13.10. 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 и рынка драгоценных металлов.

13.11. Единый лимит Участника клиринга рассчитывается Клиринговым центром исходя из оценки в российских рублях максимально возможного уменьшения в течение срока, необходимого для прекращения обязательств по Сделкам в случае неисполнения Участником клиринга Маржинального требования, общей стоимости активов и обязательств Участника клиринга, указанных в пункте 13.3, в связи с изменением Центральных курсов и/или изменением процентных ставок по сделкам своп.

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 / в одном и том же драгоценном металле с разными Датами исполнения складываются с учетом знака.

Указанная оценка проводится с использованием Верхних и Нижних границ диапазона оценки рыночных рисков и верхних и нижних значений Индикативного курса сделок своп.

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 / драгоценному металлу и каждой Дате исполнения, отстоящей от текущей даты более, чем на 1 (один) Расчетный день.

Статья 14. Порядок подачи и исполнения Поручений на управление риском

14.1. В целях оптимизации расчета Единого лимита с учетом сделок, заключенных Участником клиринга на срочном рынке Биржи, Участник клиринга вправе предоставить Клиринговому центру Поручение на управление риском.

Для получения указанной возможности Участник клиринга обязан заблаговременно предоставить Клиринговому центру Заявление о соответствии Брокерской фирмы Расчетному коду валютного рынка.

Порядок предоставления Заявления о соответствии Брокерской фирмы Расчетному коду валютного рынка и Поручения на управление риском определен Правилами клиринга на срочном рынке.

14.2. Поручение на управление риском исполняется при одновременном исполнении следующих условий:

1) при условии невозникновения в соответствии с Правилами клиринга на срочном рынке Маржинального требования по разделу регистра учета позиций, указанному в Поручении на управление риском, а также по Брокерской фирме и Расчетной фирме, соответствующим разделу регистра учета позиций, указанному в Поручении на управление риском;
2) если Единый лимит Участника клиринга по Расчетному коду, указанному в Поручении на управление риском, в результате исполнения такого Поручения не станет отрицательным, или отрицательный Единый лимит Участника клиринга по такому Расчетному коду в результате исполнения такого Поручения не уменьшится.

14.3. Клиринговый центр учитывает совокупность поданных Участником клиринга Поручений на управление риском по каждой валюте по каждому инструменту управления риском по Расчетному коду, указанному в Поручении на управление риском, в Дате исполнения, соответствующей Расчетному дню, следующему за текущим Расчетным днем, и учитывает их при расчете Единого лимита Участника клиринга по тому же Расчетному коду в соответствии со статьей 13 Правил клиринга.

14.4. Информация о поданных Участником клиринга в течение Расчетного дня

Поручениях на управление риском предоставляется Клиринговым центром Участнику клиринга в составе Отчета о Поручениях на управление риском.

РАЗДЕЛ IV. ПОРЯДОК И УСЛОВИЯ ДОПУСКА ОБЯЗАТЕЛЬСТВ К КЛИРИНГУ

Статья 15. Порядок взаимодействия с Биржей при подаче заявок и заключении Сделок

15.1. Немедленно после того, как информация о поданной Участником торгов заявке на продажу, направленной на заключение Сделки, по которой осуществляется клиринг с полным обеспечением по иностранной валюте / драгоценному металлу, являющемуся валютой лота, стороной которой будет являться Участник клиринга, стала доступной Клиринговому центру посредством ПТК ТЦ, Клиринговый центр:

15.1.1. 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;

15.1.2. рассчитывает сумму денежных средств Участника клиринга в валюте лота, которая может быть использована для заключения Сделки, с учетом:

- Обеспечения Участника клиринга в валюте лота, учитываемого по Расчетному коду, указанному в заявке;
- Нетто-обязательств и/или Нетто-требований Участника клиринга в валюте лота, учитываемых по Расчетному коду, указанному в заявке;
- всех зарегистрированных заявок на продажу, поданных Участниками торгов с указанием Расчетного кода Участника клиринга и направленных на заключение сделок купли-продажи иностранной валюты, являющейся валютой лота в поданной заявке, стороной которых будет являться Участник клиринга;

15.1.3. проверяет, что размер обязательства в валюте лота по Сделке, которая может быть заключена на основании поданной заявки, в Дату его исполнения не превышает суммы денежных средств Участника клиринга, рассчитанной в соответствии с подпунктом 15.1.2 Правил клиринга, с учетом обязательств и требований Участника клиринга в валюте лота по Сделкам и поданным заявкам на заключение Сделок с Датой исполнения не позднее, чем Дата исполнения обязательства по заключаемой Сделке.

Для заявок на заключение сделок своп и своп контрактов проверки, указанные в настоящем подпункте Правил клиринга, осуществляются для первой и второй части сделки своп / своп контракта с учетом одновременности возникновения обязательств по первой и второй части сделки своп / своп контракта.

15.1.4. проверяет достаточность Единого лимита Участника клиринга по Расчетному коду, указанному в заявке, в соответствии с пунктом 15.4 Правил клиринга.

15.2. Немедленно после того, как информация о поданной Участником торгов заявке на покупку, направленной на заключение Сделки, по которой осуществляется клиринг с полным обеспечением по иностранной валюте, являющейся сопряженной валютой, стороной которой будет являться Участник клиринга, стала доступной Клиринговому центру посредством ПТК ТЦ, Клиринговый центр:

15.2.1. 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 Основной сессии);

15.2.2. рассчитывает сумму денежных средств Участников клиринга в сопряженной валюте, которая может быть использована для заключения Сделки, с учетом:

- Обеспечения Участника клиринга в сопряженной валюте, учитываемого по Расчетному коду, указанному в заявке;
- Нетто-обязательств и/или Нетто-требований Участника клиринга в сопряженной валюте, учитываемых по Расчетному коду, указанному в заявке;
- всех зарегистрированных заявок на покупку, поданных Участниками торгов с указанием Расчетного кода Участника клиринга и направленных на заключение сделок купли-продажи иностранной валюты / драгоценных металлов за сопряженную валюту, стороной которых будет являться Участник клиринга;

15.2.3. проверяет, что размер обязательства в сопряженной валюте по Сделке, которая может быть заключена на основании поданной заявки, в Дату его исполнения не превышает суммы денежных средств Участника клиринга, рассчитанной в соответствии с подпунктом 15.2.2 Правил клиринга, с учетом обязательств и требований Участника клиринга в сопряженной валюте по Сделкам и поданным заявкам на заключение Сделок с Датой исполнения не позднее, чем Дата исполнения обязательства по заключаемой Сделке.

Для заявок на заключение сделок своп и своп контрактов проверки, указанные в настоящем подпункте Правил клиринга, осуществляются для первой и второй части сделки своп / своп контракта с учетом одновременности возникновения обязательств по первой и второй части сделки своп / своп контракта

15.2.4. проверяет достаточность Единого лимита Участника клиринга по Расчетному коду, указанному в заявке, в соответствии с пунктом 15.4 Правил клиринга.

15.3. Немедленно после того, как информация о поданной Участником торгов заявке, направленной на заключение Сделки, по которой осуществляется клиринг с частичным обеспечением, стороной которой будет являться Участник клиринга, стала доступной Клиринговому центру посредством ПТК ТЦ, Клиринговый центр:

15.3.1. 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 для инструмента, по которому подана заявка (в случае если заявка подана в рамках Основной сессии);

15.3.2. рассчитывает значение Единого лимита Участника клиринга по Расчетному коду, указанному в заявке, с учетом поданной заявки;

15.3.3. проверяет достаточность Единого лимита Участника клиринга по Расчетному коду, указанному в заявке, в соответствии с пунктом 15.4 Правил клиринга.

15.4. Единый лимит Участника клиринга по Расчетному коду является достаточным для подачи заявки, при условии, что значение Единого лимита с учетом обязательств по Сделке, которая может быть заключена на основании поданной заявки, и обязательств по уплате комиссионных вознаграждений по такой Сделке не станет отрицательным, или, если Единый лимит Участника клиринга по такому Расчетному коду был отрицательным до момента подачи заявки, при условии, что

Единый лимит Участника клиринга по такому Расчетному коду, рассчитанный с учетом указанных обязательств, не станет меньше, чем Единый лимит Участника клиринга по этому Расчетному коду, рассчитанный до момента подачи заявки.

15.5. Немедленно после проведения Клиринговым центром проверок, предусмотренных настоящей статьей Правил клиринга для соответствующих заявок, информация о результате таких проверок становится доступной Бирже посредством ПТК ТЦ: в случае положительного результата всех необходимых проверок – информация о возможности регистрации заявки, в случае отрицательного результата хотя бы одной из необходимых проверок – информация о невозможности регистрации заявки.

15.5.1. В случае возможности регистрации заявки, Клиринговый центр начинает учитывать значение Единого лимита Участника клиринга по Расчетному коду, указанному в заявке, рассчитанное при проверке возможности регистрации заявки, в качестве нового значения Единого лимита Участника клиринга по такому Расчетному коду.

15.5.2. В случае невозможности регистрации заявки, Клиринговый центр не изменяет значение Единого лимита Участника клиринга по Расчетному коду, указанному в заявке.

15.6. После того, как информация о снятии зарегистрированной заявки, в которой Участник клиринга был указан в качестве стороны Сделки, стала доступной Клиринговому центру посредством ПТК ТЦ, Клиринговый центр рассчитывает Единый лимит Участника клиринга по Расчетному коду, указанному в заявке, без учета отозванной заявки.

15.7. При регистрации заявки, являющейся в соответствии с Правилами торгов допустимой встречной по отношению к ранее зарегистрированной заявке, Клиринговый центр заключает Сделку с каждым из Участников клиринга, указанным в заявке в качестве стороны по Сделке.

15.8. В целях создания условий для исполнения обязательств по Сделкам Клиринговый центр вправе заключать Сделки на основании заявок, поданных Клиринговым центром.

15.9. После того, как информация о регистрации Сделки стала доступной Клиринговому центру посредством ПТК ТЦ, Клиринговый центр:

- рассчитывает Единый лимит Участника клиринга по Расчетному коду, указанному в заявке, на основании которой заключена Сделка, без учета такой заявки (части такой заявки) 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 по Расчетному коду, указанному в заявке, на основании которой заключена Сделка, с Датами исполнения, соответствующими Дате (Датам) исполнения обязательств по заключенной Сделке.

15.10. Участник клиринга имеет право завершить заключение Сделок с Клиринговым

центром по инструментам с Датой исполнения, отличной от текущей, ранее установленного Биржей 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.

15.10.1. Запрос на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром действует в день его предоставления.

15.10.2. 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.

15.10.3. В установленный Временным регламентом момент времени Клиринговый центр направляет Бирже уведомление о раннем завершении заключения Сделок с Клиринговым центром в отношении Участников клиринга, предоставивших Клиринговому центру Запросы на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром или Постоянные поручения на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром.

15.11. В случае принятия нормативного правового акта Российской Федерации о переносе выходных дней, в соответствии с которым Дата исполнения заключенных с Участниками клиринга Сделок станет выходным днем по законодательству Российской Федерации, либо в случае получения от Биржи уведомления, в соответствии с которым Дата исполнения заключенных с Участниками клиринга Сделок перестанет являться Расчетным днем по соответствующей валюте / соответствующему драгоценному металлу, Клиринговый центр в течение 10 (десяти) рабочих дней с даты принятия такого нормативного правового акта / получения уведомления от Биржи 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 Биржу посредством ПТК ТЦ.

РАЗДЕЛ V. ПОРЯДОК ПРОВЕДЕНИЯ КЛИРИНГА

ПОДРАЗДЕЛ V-I. ПОРЯДОК ВНЕСЕНИЯ И ВОЗВРАТА ОБЕСПЕЧЕНИЯ И ВЗНОСА В ГАРАНТИЙНЫЙ ФОНД

Статья 16. Порядок внесения Обеспечения

16.1. Участник клиринга обязан перечислять денежные средства в соответствующей валюте, которые предоставляются им в качестве Обеспечения в российских рублях и/или Обеспечения в иностранной валюте, на соответствующий клиринговый банковский или корреспондентский счет Клирингового центра по реквизитам, размещенным на сайте Клирингового центра, с обязательным указанием в назначении платежа соответствующего Расчетного кода Участника клиринга.

16.2. Внесение Обеспечения в драгоценных металлах осуществляется путем перечисления драгоценных металлов на Счет обеспечения Участника клиринга.

16.3. Клиринговый центр учитывает в Клиринговой системе денежные средства / драгоценные металлы, перечисленные Участником клиринга, в качестве Обеспечения Участника клиринга, и увеличивает Единый лимит Участника клиринга с учетом перечисленной суммы денежных средств / перечисленного количества драгоценного металла в срок, установленный Временным регламентом.

16.4. Денежные средства и драгоценные металлы, учитываемые в качестве Обеспечения Участника клиринга, используются для расчета Единого лимита, обеспечения исполнения обязательств по Сделкам, исполнения Итоговых нетто-обязательств в соответствующей валюте / соответствующем драгоценном металле и обязательств по уплате комиссионных вознаграждений по Расчетному коду, по которому указанное Обеспечение учитывается.

16.5. Участник клиринга может перевести денежные средства / драгоценные металлы, учитываемые в качестве Обеспечения, между своими Расчетными кодами, подав в Клиринговый центр Заявление о переводе.

Данное заявление не принимается Клиринговым центром к исполнению, если сумма денежных средств в определенной валюте / количество определенного драгоценного металла, указанная Участником клиринга в заявлении, превышает сумму денежных средств / количество драгоценного металла, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга по Расчетному коду, с которого денежные средства / драгоценные металлы должны быть списаны, или если Единый лимит Участника клиринга по Расчетному коду, с которого денежные средства / драгоценные металлы, 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.

В случае если в соответствии с поданным Заявлением о переводе, списание денежных средств / драгоценных металлов осуществляется с Расчетного кода с признаком «запрет коротких продаж и необеспеченных покупок» и/или с Расчетного кода Участника клиринга категории «В» и/или при списании валюты /

драгоценного металла, по которому установлен признак «запрет коротких продаж», дополнительным условием исполнения такого заявления является непревышение размера обязательств по Сделкам в валюте / драгоценном металле, указанной(-ом) в Заявлении о переводе, по каждой Дате исполнения, учитываемых по Расчетному коду, Обеспечения Участника клиринга в соответствующей валюте / драгоценном металле по Расчетному коду с учетом обязательств и требований Участника клиринга в соответствующей валюте / драгоценном металле по Сделкам с Датой исполнения не позднее, чем проверяемая Дата исполнения, и без учета списываемых денежных средств / драгоценных металлов.

При исполнении Заявления о переводе, сумма денежных средств Участника клиринга в соответствующей валюте / количество соответствующего драгоценного металла, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга по Расчетному коду, с которого списываются денежные средства / драгоценные металлы, уменьшается, а по Расчетному коду, на который зачисляются денежные средства / драгоценные металлы, - увеличивается на сумму переводимых денежных средств / количество переводимых драгоценных металлов.

16.6. Обеспечение Участника клиринга в российских рублях используется в следующей очередности:

1) для погашения Задолженности Участника клиринга перед Клиринговым центром;
2) для обеспечения исполнения обязательств Участника клиринга по Сделкам;
3) для исполнения обязательств Участника клиринга в российских рублях по Сделкам с наступившей Датой исполнения;
4) для исполнения обязательств по уплате вариационной маржи;
5) для исполнения обязательства Участника клиринга по уплате и возврату Гарантийных переводов;
6) для исполнения обязательств Участника клиринга по уплате вознаграждений (комиссионных вознаграждений);
7) для уплаты пеней за наличие на момент начала Дополнительной сессии первого типа непогашенной Задолженности.

16.7. Обеспечение Участника клиринга в иностранной валюте и драгоценных металлах используется в следующей очередности:

1) для обеспечения исполнения обязательств Участника клиринга по Сделкам;
2) для исполнения обязательств Участника клиринга в соответствующей иностранной валюте / драгоценном металле по Сделкам с наступившей Датой исполнения.

16.8. После перечисления Участником клиринга денежных средств на счет Клирингового центра, открытый в Расчетной организации / Расчетном банке, 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 17.4, 17.5 Правил клиринга.

Статья 17. Порядок возврата Обеспечения

17.1. Списание со Счета обеспечения драгоценных металлов, перечисленных Участником клиринга или Клиринговым центром на Счет обеспечения Участника клиринга (далее – возврат драгоценных металлов), осуществляется в порядке, определенном настоящей статьей Правил клиринга.

17.2. Возврат Клиринговым центром Участнику клиринга денежных средств / драгоценных металлов, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга, осуществляется на основании Запроса о возврате, Постоянного поручения на возврат или в результате прекращения Итогового нетто-требования Участника клиринга в соответствии с пунктами 22.10-22.14 Правил клиринга.

17.2.1. 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 принимаются Клиринговым центром в Расчетные дни в период времени, установленный Временным регламентом.

При предоставлении Запроса о возврате позднее времени, указанного во Временном регламенте, Клиринговый центр вправе не исполнять Запрос о возврате.

Запрос о возврате действует в день его предоставления.

Запрос о возврате, полученный в сроки, установленные Временным регламентом, исполняется после его получения при соблюдении условия, указанного в пункте 17.4 Правил клиринга.

17.2.2. Постоянное поручение на возврат 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 / драгоценном металле и обязательств по уплате комиссионных вознаграждений в сумме, определенной в соответствии с пунктом 17.5 Правил клиринга.

Клиринговый центр вправе принять решение об аннулировании действующих Постоянных поручений на возврат в случае, если у Клирингового центра возникнут основания полагать, что существует необходимость в уточнении информации, указанной в Постоянном поручении на возврат.

Постоянное поручение на возврат действует до его отмены Участником клиринга или до даты принятия Клиринговым центром решения об аннулировании Постоянных поручений на возврат.

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

17.2.3. Условия возврата денежных средств / драгоценных металлов, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга, в результате прекращения Итогового нетто-требования Участника клиринга, определены пунктами 22.10-22.15 Правил клиринга.

17.3. При непредоставлении Участником клиринга Запроса о возврате или Постоянного

поручения на возврат оставшееся Обеспечение Участника клиринга будет учтено Клиринговым центром для его использования в торгах следующего торгового дня.

17.4. Возврат Клиринговым центром Участнику клиринга денежных средств / драгоценных металлов в соответствии с Запросом о возврате осуществляется только в том случае, если Единый лимит Участника клиринга, рассчитанный без учета возвращаемой суммы денежных средств / количества драгоценного металла, не станет отрицательным.

В случае возврата денежных средств / драгоценных металлов с Расчетного кода с признаком «запрет коротких продаж и необеспеченных покупок» и/или с Расчетного кода Участника клиринга категории «В» и/или при возврате валюты / драгоценного металла, по которому установлен признак «запрет коротких продаж», дополнительным условием исполнения такого возврата является непревышение размера обязательств по Сделкам в валюте / драгоценном металле, указанном в Запросе о возврате, по каждой Дате исполнения, учитываемых по Расчетному коду, Обеспечения Участника клиринга в соответствующей валюте / драгоценном металле по Расчетному коду с учетом обязательств и требований Участника клиринга в соответствующей валюте / драгоценном металле по Сделкам с Датой исполнения не позднее, чем проверяемая Дата исполнения, и без учета возвращаемых денежных средств / драгоценных металлов.

17.5. Возврат Клиринговым центром Участнику клиринга денежных средств / драгоценных металлов в соответствии с Постоянным поручением на возврат осуществляется в сумме, без учета которой Единый лимит Участника клиринга не станет отрицательным.

17.6. Для исполнения своего обязательства по возврату Участнику клиринга денежных средств в соответствующей валюте / соответствующего драгоценного металла Клиринговый центр перечисляет денежные средства в данной валюте / данные драгоценные металлы на соответствующий Счет для возврата, зарегистрированный в Клиринговом центре для соответствующего Расчетного кода Участника клиринга.

17.7. Обязательство Клирингового центра по возврату денежных средств Участнику клиринга считается исполненным с момента списания Расчетной организацией или Расчетным банком, в котором открыт клиринговый банковский счет или корреспондентский счет Клирингового центра для учета Обеспечения, денежных средств с соответствующего счета Клирингового центра.

Обязательство Клирингового центра по возврату драгоценных металлов Участнику клиринга считается исполненным с момента списания Клиринговым центром драгоценных металлов со Счета обеспечения Участника клиринга.

Клиринговый центр не несет ответственности за неисполнение (ненадлежащее исполнение) Расчетной организацией или Расчетным банком распоряжения Клирингового центра о списании денежных средств в пользу Участника клиринга за исключением случаев, если такое неисполнение явилось следствием вины Клирингового центра.

17.8. При возврате Участнику клиринга денежных средств в соответствующей валюте / соответствующего драгоценного металла размер Обеспечения Участника клиринга в этой валюте / этом драгоценном металле уменьшается на сумму возвращаемых

денежных средств / количество возвращаемого драгоценного металла.

17.9. Клиринговый центр вправе осуществить в любое время зачет денежных требований Участника клиринга по возврату ему денежных средств в соответствующей валюте с денежными требованиями Клирингового центра к этому Участнику клиринга в соответствующей валюте.

17.10. Информация об операциях с Обеспечением Участника клиринга передается Участнику клиринга в составе Отчета о движении денежных средств.

17.11. В случае прекращения допуска к клиринговому обслуживанию Клиринговый центр возвращает Участнику клиринга денежные средства и/или драгоценные металлы, учитываемые в качестве Обеспечения на дату прекращения допуска к клиринговому обслуживанию, не позднее 3 (трех) рабочих дней с даты прекращения Договора об оказании клиринговых услуг, российские рубли - на корреспондентский счет Участника клиринга – Кредитной организации, открытый в Банке России, российские рубли Участникам клиринга, не являющимся Кредитной организацией, и иностранную валюту, драгоценные металлы - по реквизитам Счета для возврата в соответствующей валюте / драгоценном металле, зарегистрированного Участником клиринга в соответствии с правилами клиринга Клирингового центра, с учетом положений статьи 29 Правил клиринга.

17.12. Клиринговый центр осуществляет ежегодную сверку остатков Обеспечения Участника клиринга в соответствующих валютах / драгоценных металлах 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 / драгоценных металлах считаются подтвержденными.

Статья 18. Порядок внесения взноса в Гарантийный фонд и Обеспечения под стресс

18.1. Внесение денежных средств / ценных бумаг в качестве взноса в Гарантийный фонд и/или Обеспечения под стресс осуществляется на соответствующие клиринговые счета Клирингового центра в порядке, определенном Правилами клиринга на рынке ценных бумаг.

18.2. Обязательство Участника клиринга по внесению взноса в Гарантийный фонд считается исполненным полностью, если Единый лимит Участника клиринга по Торгово-клиринговому счету для учета взносов в гарантийные фонды, рассчитанный в соответствии с Правилами клиринга на рынке ценных бумаг, является неотрицательным.

18.3. Обязательство Участника клиринга по внесению Обеспечения под стресс считается исполненным полностью, если Единый лимит Участника клиринга по Торгово-клиринговому счету для учета Обеспечения под стресс, рассчитанный в соответствии с Правилами клиринга на рынке ценных бумаг, является неотрицательным.

18.3.1. В случае изменения размера Обеспечения под стресс в соответствии с Методикой определения размера Обеспечения под стресс, новое значение размера Обеспечения под стресс Участника клиринга используется при расчете Единого лимита Участника клиринга по Торгово-клиринговому счету для учета Обеспечения под стресс, начиная с 6-го Расчетного дня со дня направления Участнику клиринга Клиринговым центром уведомления о новом значении размера Обеспечения под стресс.

Статья 19. Порядок возврата взноса в Гарантийный фонд и Обеспечения под стресс

19.1. Возврат Участнику клиринга денежных средств / ценных бумаг, учитываемых в качестве взносов Участника клиринга в Гарантийный фонд / Обеспечения под стресс, осуществляется на основании Запроса о возврате денежных средств / ценных бумаг из гарантийных фондов / Обеспечения под стресс в порядке и на условиях, установленных Правилами клиринга на рынке ценных бумаг.

19.2. Возврат Участнику клиринга денежных средств и/или ценных бумаг, учитываемых в качестве взносов Участника клиринга в Гарантийный фонд / Обеспечения под стресс, осуществляется при изменении категории Участника клиринга с категории «О» или «Б» на категорию «В» на основании заявления Участника клиринга, порядок и условия предоставления и исполнения которого установлены пунктом 9.16 Правил клиринга.

19.3. В случае прекращения допуска к клиринговому обслуживанию или изменения категории Участника клиринга с категории «О» или «Б» на категорию «В», Клиринговый центр возвращает Участнику клиринга денежные средства и/или ценные бумаги, учитываемые в качестве взноса Участника клиринга в Гарантийный фонд / Обеспечения под стресс на дату прекращения допуска к клиринговому обслуживанию / дату изменения категории Участника клиринга, не позднее 3 (трех) рабочих дней с даты прекращения Договора об оказании клиринговых услуг, российские рубли - на корреспондентский счет Участника клиринга – Кредитной организации, открытый в Банке России, российские рубли Участнику клиринга, не являющемуся Кредитной организацией, и иностранную валюту - по реквизитам Счета для возврата в соответствующей валюте, зарегистрированного Участником клиринга в соответствии с правилами клиринга Клирингового центра, ценные бумаги – на торговый счет депо владельца Участника клиринга, с учетом положений статьи 29 Правил клиринга.

ПОДРАЗДЕЛ V-II. КЛИРИНГОВЫЕ СЕССИИ

Статья 20. Порядок проведения клиринговых сессий

20.1. Каждый Рабочий день до начала торгов в установленное Временным регламентом время Клиринговый центр проводит клиринговую сессию, в ходе которой Клиринговый центр:

- устанавливает риск-параметры в соответствии с Методикой определения риск-параметров валютного рынка и рынка драгоценных металлов;
- определяет Расчетные цены в соответствии с пунктом 20.2 Правил клиринга;
- 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 вариационной маржи / Гарантийных переводов в соответствии со статьей 21 Правил клиринга;
- формирует и передает каждому Участнику клиринга, имеющему обязательства по Сделкам, Дата исполнения которых не наступила, Отчет об обязательствах и/или Отчет об обязательствах по ПФИ;
- 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;
- определяет Участников клиринга, у которых возникли Маржинальные требования по Обеспечению под стресс и Маржинальные требования по фондам и суммы указанных Маржинальных требований.

20.2. Расчетная цена для определенного базисного актива и определенной Даты исполнения определяется как сумма Центрального курса сделок купли-продажи иностранной валюты, являющейся таким базисным активом, за российские рубли, установленного Клиринговым центром на текущий Расчетный день, и центрального значения Индикативного курса сделок своп на дату, соответствующую такой Дате исполнения.

20.3. Маржинальное требование, возникшее у Участника клиринга по итогам клиринговой сессии, должно быть исполнено Участником клиринга не позднее установленного Временным регламентом времени текущего Рабочего дня.

20.4. Маржинальное требование должно быть исполнено Участником клиринга путем перечисления денежных средств в любой валюте, по Сделкам с которой может осуществляться клиринг с частичным обеспечением, на соответствующий счет

Клирингового центра либо путем внесения Обеспечения в драгоценных металлах на соответствующий Счет обеспечения в порядке, определенном статьей 16 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.

20.5. 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.

20.6. Порядок действий Клирингового центра при неисполнении Участником клиринга Маржинального требования определен в статье 23 Правил клиринга.

20.7. В случае если Единый лимит Участника клиринга по Торгово-клиринговому счету для учета взносов в гарантийные фонды становится меньше величины, установленной решением Клирингового центра (далее – порог выставления Маржинального требования по фондам), Клиринговый центр направляет Участнику клиринга Маржинальное требование по фондам.

Информация о Маржинальном требовании по фондам направляется Участнику клиринга в составе Отчета о гарантийных фондах, порядок предоставления которого установлен Правилами клиринга на рынке ценных бумаг.

Указанное требование должно быть исполнено Участником клиринга не позднее установленного Временным регламентом времени текущего Рабочего дня путем перечисления денежных средств в российских рублях и/или иностранной валюте и/или ценных бумаг для учета в качестве взносов в гарантийные фонды в порядке, установленном Правилами клиринга на рынке ценных бумаг.

Маржинальное требование по фондам считается исполненным в момент времени, когда Единый лимит Участника клиринга по Торгово-клиринговому счету для учета взносов в гарантийные фонды станет больше либо равен нулю.

20.8. В случае если Единый лимит Участника клиринга по Торгово-клиринговому счету для учета Обеспечения под стресс становится меньше величины, установленной решением Клирингового центра (далее – порог выставления Маржинального требования по Обеспечению под стресс), Клиринговый центр направляет Участнику клиринга Маржинальное требование по Обеспечению под стресс.

Информация о Маржинальном требовании по Обеспечению под стресс направляется Участнику клиринга в составе Отчета об Обеспечении под стресс, порядок предоставления которого установлен Правилами клиринга на рынке ценных бумаг.

Указанное требование должно быть исполнено Участником клиринга не позднее установленного Временным регламентом времени текущего Рабочего дня, путем перечисления денежных средств в российских рублях и/или иностранной валюте и/или ценных бумаг для учета в качестве Обеспечения под стресс в порядке, установленном Правилами клиринга на рынке ценных бумаг.

Маржинальное требование по Обеспечению под стресс считается исполненным в

момент времени, когда Единый лимит Участника клиринга по Торгово-клиринговому счету для учета Обеспечения под стресс станет больше либо равен нулю.

20.9. В случае неисполнения Участником клиринга Маржинального требования по фондам в срок, установленный пунктом 20.7 Правил клиринга, и/или Маржинального требования по Обеспечению под стресс в срок, установленный пунктом 20.8 Правил клиринга, Клиринговый центр вправе перевести денежные средства / ценные бумаги в объеме, необходимом для исполнения Маржинального требования Участника клиринга по фондам и/или Маржинального требования Участника клиринга по Обеспечению под стресс, из средств, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга по собственным Расчетным кодам в соответствии с Правилами клиринга и/или иными правилами клиринга Клирингового центра.

20.10. В случае неисполнения Участником клиринга Маржинального требования по фондам в срок, установленный пунктом 20.7 Правил клиринга, считается, что Участник клиринга не исполнил обязательства по внесению взносов во все гарантийные фонды, участником которых он является, и к Участнику клиринга применяются меры, предусмотренные соответствующими правилами клиринга Клирингового центра.

20.11. В случае неисполнения Участником клиринга Маржинального требования по Обеспечению под стресс в срок, установленный пунктом 20.8 Правил клиринга, считается, что Участник клиринга не исполнил обязательства по внесению Обеспечения под стресс в соответствии со всеми правилами клиринга Клирингового центра, в соответствии с которыми Клиринговым центром к Участнику клиринга было предъявлено требование о внесении Обеспечения под стресс, и к Участнику клиринга применяются меры, предусмотренные соответствующими правилами клиринга Клирингового центра.

20.12. При неисполнении Участником клиринга обязательства по внесению взноса в Гарантийный фонд, созданный в соответствии с Правилами клиринга, и/или Маржинального требования по Обеспечению под стресс в соответствии с Правилами клиринга:

- Участнику клиринга категории «Б» устанавливается категория «В»;
- Участнику клиринга категории «О» по всем Расчетным кодам Участника клиринга устанавливается признак «запрет коротких продаж и необеспеченных покупок».

Статья 21. Вариационная маржа и Гарантийные переводы

21.1. В Расчетный день, следующий за датой заключения своп контракта, вариационная маржа по своп контракту рассчитывается по формуле:

$VM_O = (Rc – (BR + SR)) \times L$, где

VM_O – вариационная маржа по своп контракту;

Rc – Расчетная цена, определенная в текущий Расчетный день;

BR – базовый курс своп контракта;

SR – цена своп контракта;

L – лот своп контракта.

Начиная со второго Расчетного дня, следующего за датой заключения своп контракта и до Даты исполнения обязательств по второй части своп контракта включительно, вариационная маржа по своп контракту рассчитывается по формуле:

$VM_T = (Rc – Rc_p) \times L$, где

VM_T – вариационная маржа по своп контракту;

Rc – Расчетная цена, определенная в текущий Расчетный день;

Rc_p– Расчетная цена, определенная в предыдущий Расчетный день;

L – лот своп контракта.

21.2. В Расчетный день, следующий за датой заключения фьючерсного контракта, вариационная маржа по фьючерсному контракту рассчитывается по формуле:

$VM_O = (Rc – Price) \times L$, где

VM_O – вариационная маржа по фьючерсному контракту;

Rc – Расчетная цена, определенная в текущий Расчетный день;

Price – цена фьючерсного контракта;

L – лот фьючерсного контракта.

Начиная со второго Расчетного дня, следующего за датой заключения фьючерсного контракта и до Даты исполнения обязательств по фьючерсному контракту включительно, вариационная маржа по фьючерсному контракту рассчитывается по формуле:

$VM_T = (Rc – Rc_p) \times L$, где

VM_T – вариационная маржа по фьючерсному контракту;

Rc – Расчетная цена, определенная в текущий Расчетный день;

Rc_p – Расчетная цена, определенная в предыдущий Расчетный день;

L – лот фьючерсного контракта.

21.3. Для Участника клиринга – продавца по своп контракту / фьючерсному контракту Клиринговый центр рассчитывает величину VM_S по формуле:

$VM_S = – VOL_i \times VM$, где

VOL_i – количество заключенных своп контрактов / фьючерсных контрактов с i-м базисным активом, по которым Участник клиринга является продавцом;

VM – вариационная маржа по своп контракту / фьючерсному контракту, рассчитанная в соответствии с пунктами 21.1-21.2 Правил клиринга.

21.4. Для Участника клиринга – покупателя по своп контракту / фьючерсному контракту Клиринговый центр рассчитывает величину VM_B по формуле:

$VM_B = VOL_i \times VM$, где

VOL_i – количество заключенных своп контрактов / фьючерсных контрактов с i-м базисным активом, по которым Участник клиринга является покупателем;

VM – вариационная маржа по своп контракту / фьючерсному контракту, рассчитанная в соответствии с пунктами 21.1-21.2 Правил клиринга.

21.5. Если значение, рассчитанное в соответствии с пунктом 21.3 или 21.4, отрицательное, это означает наличие обязанности Участника клиринга по уплате вариационной маржи Клиринговому центру в размере, равном абсолютному значению VM_S или VM_B, если положительное – наличие требования Участника клиринга к Клиринговому центру по получению вариационной маржи в размере, равном значению VM_S или VM_B.

Информация о размере обязательств Участника клиринга по уплате вариационной маржи указывается в Отчете об обязательствах по ПФИ.

21.6. После определения обязательств по уплате вариационной маржи в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга, Клиринговый центр:

21.6.1. для каждого своп контракта с определенным базисным активом и Датой исполнения обязательств по второй части своп контракта рассчитывает сумму в российских рублях, которую покупатель по своп контракту обязан уплатить продавцу по своп контракту по второй части своп контракта, как произведение Расчетной цены, определенной в текущий Расчетный день, на количество заключенных своп контрактов;

21.6.2. для каждого фьючерсного контракта с определенным базисным активом и Датой исполнения рассчитывает сумму в российских рублях, которую покупатель по фьючерсному контракту обязан уплатить продавцу по фьючерсному контракту, как произведение Расчетной цены, определенной в текущий Расчетный день, на количество заключенных фьючерсных контрактов;

21.6.3. пересчитывает Нетто-обязательства / Нетто-требования в российских рублях с соответствующей Датой исполнения с учетом изменения суммы обязательств по второй части своп контрактов / по фьючерсным контрактам, рассчитанной в соответствии с подпунктами 21.6.1, 21.6.2 Правил клиринга.

21.7. Размер обязательства Участника клиринга и Клирингового центра по уплате Гарантийного перевода рассчитывается по обязательствам по Сделкам, не являющимся производными финансовыми инструментами, Дата исполнения которых отстоит от текущей не менее, чем на два Расчетных дня, по формуле:

$COM_RUB = \sum_i (\sum_j OBL_VAL_{ij} \times (Rc_RUB_VAL_j + SWAPCRate_VAL_{ij}) + OBL_RUB_i) + RET_RUB$, где

COM_RUB – размер обязательства по уплате Гарантийного перевода, рассчитанный в ходе текущей клиринговой сессии;

OBL_VAL_{ij} – сумма (с учетом знака) Нетто-обязательств / Нетто-требований в иностранной валюте / драгоценном металле VAL_j с i-ой Датой исполнения;

OBL_RUB_i - Нетто-обязательство / Нетто-требование Участника клиринга (с учетом знака) в российских рублях с i-ой Датой исполнения;

$Rc_RUB_VAL_j$ – Центральный курс сделок купли-продажи иностранной валюты / драгоценного металла VAL_j за российские рубли, рассчитанный в предыдущий Рабочий день;

$SWAPCRate_VAL_{ij}$ - центральное значение Индикативного курса сделок своп, установленного в предыдущий Рабочий день для i-ой Даты исполнения и

иностранной валюты / драгоценного металла VAL_j за российские рубли. Для Даты исполнения в Расчетный день, следующий за текущим, значение $SWAPCRate_VAL_i$ равно нулю;

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 и драгоценным металлам 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.

21.8. После определения обязательств по уплате Гарантийного перевода в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга, Клиринговый центр рассчитывает размер обязательства Участника клиринга и Клирингового центра по возврату Гарантийных переводов по формуле:

$RET_RUB_{new} = RET_RUB - COM_RUB$, где

RET_RUB_{new} – 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_{new} отрицательное, это означает наличие обязанности Участника клиринга по возврату Клиринговому центру Гарантийных переводов в размере, равном абсолютному значению RET_RUB_{new}, если положительное – наличие обязанности Клирингового центра по возврату Участнику клиринга Гарантийных переводов в размере, равном значению RET_RUB_{new}.

21.9. Определенные в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга обязательства по уплате вариационной маржи / Гарантийных переводов допускаются к клирингу и включаются в клиринговый пул клиринговой сессии, в ходе которой они были определены.

21.10. Обязанность Участника клиринга по уплате вариационной маржи / Гарантийного перевода по Расчетному коду исполняется за счет Обеспечения Участника клиринга в российских рублях, учитываемого по тому же Расчетному коду. Клиринговый центр зачитывает обязательство Участника клиринга по уплате вариационной маржи / Гарантийного перевода с его требованием к Клиринговому центру по возврату Обеспечения. Размер Обеспечения Участника клиринга в российских рублях уменьшается на размер исполненного обязательства Участника клиринга по уплате вариационной маржи / Гарантийного перевода.

21.11. Если Обеспечения Участника клиринга в российских рублях, недостаточно для

исполнения обязательства Участника клиринга по уплате вариационной маржи / Гарантийного перевода в полном объеме, неисполненное обязательство (неисполненная часть обязательства) Участника клиринга по уплате вариационной маржи / Гарантийного перевода учитывается Клиринговым центром как Задолженность Участника клиринга перед Клиринговым центром.

Указанная Задолженность должна быть погашена Участником клиринга до установленного Временным регламентом времени текущего Рабочего дня.

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

21.12. Порядок действий Клирингового центра при неисполнении Участником клиринга Задолженности в срок, установленный в пункте 21.11 Правил клиринга, определен в статье 23 Правил клиринга.

21.13. Требование Участника клиринга по получению вариационной маржи / Гарантийного перевода по Расчетному коду прекращается возникновением обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга Обеспечения в российских рублях по тому же Расчетному коду. При этом размер Обеспечения Участника клиринга в российских рублях увеличивается на размер исполненного требования Участника клиринга.

21.14. Проценты на сумму уплаченной и/или полученной вариационной маржи / Гарантийных переводов не начисляются и не уплачиваются.

ПОДРАЗДЕЛ V-III. ПОРЯДОК ОПРЕДЕЛЕНИЯ И ИСПОЛНЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ ПО СДЕЛКАМ

Статья 22. Порядок исполнения / прекращения обязательств по Сделкам и обязательств по возврату Гарантийных переводов

22.1. В сроки, установленные Временным регламентом, Клиринговый центр определяет Итоговые нетто-обязательства / Итоговые нетто-требования Участников клиринга в каждой валюте и каждом драгоценном металле.

22.1.1. В случае если для какой-либо иностранной валюты 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 торгов по такой иностранной валюте и получения от Биржи выписки из реестра сделок по итогам указанных торгов Клиринговый центр:

- включает в клиринговый пул обязательства и требования Участника клиринга и Клирингового центра по Сделкам с такой иностранной валютой с наступившей Датой исполнения;
- 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.

22.1.2. 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 – Временным 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.

22.1.3. По окончании всех торгов, на которых заключаются Сделки с исполнением обязательств в дату их заключения, и получения от Биржи выписки из реестра сделок по итогам Основной сессии Клиринговый центр:

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

$RET_RUB = -(\sum_j OBL_VAL_j \times Rc_RUB_VAL_j + OBL_RUB)$, где

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

OBL_VAL_j – Итоговое нетто-обязательство / Итоговое нетто-требование Участника клиринга (с учетом знака) в иностранной валюте / драгоценном

металле VAL_j, 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;

$Rc_RUB_VAL_j$ – Центральный курс сделок купли-продажи иностранной валюты / драгоценных металлов VAL_j за российские рубли, рассчитанный в день Т-2, где Т – текущий Рабочий день;

$\sum_j$ - 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.

22.1.5. включает в клиринговый пул:

- неисполненные обязательства и требования Участника клиринга и Клирингового центра по Сделкам с наступившей Датой исполнения, в том числе обязательства / требования в российских рублях по Сделкам, являющимся производными финансовыми инструментами, определенные в соответствии с подпунктами 21.6.1, 21.6.2 Правил клиринга;
- обязательства / требования Участника клиринга по возврату Гарантийных переводов, определенные в соответствии с подпунктом 22.1.4 Правил клиринга;
- обязательства Участника клиринга по уплате комиссионных вознаграждений, определенные в соответствии со статьей 25 Правил клиринга;

22.1.6. зачитывает встречные однородные обязательства и требования Участника клиринга и Клирингового центра, включенные в клиринговый пул, 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 / каждом драгоценном металле.

22.2. Процедуры, указанные в пункте 22.1.3 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.

22.2.1. Запрос на проведение ранних расчетов действует в день его предоставления.

22.2.2. 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.

22.2.3. После получения от Участника клиринга Запроса на проведение ранних расчетов или в установленный Временным регламентом момент времени, Клиринговый центр направляет Бирже 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.

22.3. После определения обязательств Участников клиринга, указанных в пункте 22.1 Правил клиринга, Клиринговый центр формирует и передает Участникам клиринга Клиринговые отчеты и Биржевые свидетельства.

22.4. 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 22.13 Правил клиринга.

22.5. Участник клиринга обязан исполнить свои Итоговые нетто-обязательства в соответствующей валюте / драгоценных металлах до времени, указанного во Временном регламенте.

В случае исполнения Участником клиринга Итоговых нетто-обязательств в каждой валюте / каждом драгоценном металле в полном объеме в указанный срок данный Участник клиринга признается Добросовестным участником клиринга.

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

22.6. Порядок действий Клирингового центра при неисполнении или ненадлежащем исполнении Участником клиринга своих Итоговых нетто-обязательств определен в статье 23 Правил клиринга.

22.7. Для исполнения Итоговых нетто-обязательств Участника клиринга в соответствующей валюте / соответствующем драгоценном металле используется Обеспечение Участника клиринга в соответствующей валюте / соответствующем драгоценном металле, в порядке, определенном пунктами 16.6-16.7 Правил клиринга.

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.

Датой и временем внесения Участником клиринга драгоценнных металлов в Обеспечение являются дата и время зачисления драгоценнных металлов на Счет обеспечения Участника клиринга.

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

22.8. 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.

22.9. Итоговое нетто-обязательство Участника клиринга в соответствующем драгоценном металле исполняется за счет Обеспечения Участника клиринга в этом драгоценном металле.

Итоговое нетто-обязательство Участника клиринга в соответствующем драгоценном металле считается исполненным, если размер Обеспечения Участника клиринга в соответствующем драгоценном металле не меньше, чем Итоговое нетто-обязательство Участника клиринга в этом драгоценном металле.

Клиринговый центр списывает соответствующий драгоценный металл в количестве, равном объему Итогового нетто-обязательства Участника клиринга в этом драгоценном металле, со Счета обеспечения Участника клиринга в счет исполнения Итогового нетто-обязательства Участника клиринга в этом драгоценном металле.

При этом размер Обеспечения Участника клиринга в соответствующем драгоценном металле уменьшается на сумму исполненного Итогового нетто-обязательства в этом драгоценном металле.

22.10. Обязательство Клирингового центра по исполнению Итогового нетто-требования 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 Участника клиринга в этой валюте.

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

22.10.1. 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 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 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.

Клиринговый центр вправе принять решение о неосуществлении возврата денежных средств в иностранной валюте в соответствии с настоящим подпунктом Правил клиринга в случае, если у Клирингового центра возникнут основания полагать, что существует необходимость в уточнении реквизитов Счетов для возврата в соответствующей валюте.

22.10.2. 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 22.10.1 Правил клиринга, уменьшается на сумму денежных средств в этой валюте, указанную Участником клиринга в Запросе о депонировании денежных средств.

При предоставлении Запроса о депонировании денежных средств позднее времени, указанного во Временном регламенте, Клиринговый центр исполняет Запрос о депонировании денежных средств только в случае, если на момент получения указанного запроса возврат денежных средств Участнику клиринга в соответствии с подпунктом 22.10.1 Правил клиринга еще не осуществлен.

Запрос о депонировании денежных средств действует в день его предоставления.

22.11. Возврат Клиринговым центром Участнику клиринга денежных средств в соответствующей валюте в соответствии с пунктом 22.10 Правил клиринга осуществляется путем перечисления денежных средств в данной валюте на зарегистрированный Участником клиринга в Клиринговом центре соответствующий Счет для возврата.

22.12. 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.

22.13. Для исполнения Итогового нетто-требования Участника клиринга в соответствующем драгоценном металле Клиринговый центр зачисляет соответствующий драгоценный металл в количестве, равном объему Итогового нетто-требования Участника клиринга в этом драгоценном металле, на Счет обеспечения Участника клиринга.

При этом размер Обеспечения Участника клиринга в соответствующем драгоценном металле увеличивается на сумму исполненного Итогового нетто-требования Участника клиринга в этом драгоценном металле.

22.14. При частичном своевременном исполнении Участником клиринга своих Итоговых нетто-обязательств в соответствующей валюте / соответствующем драгоценном металле Клиринговый центр частично исполняет Итоговые нетто-требования Участника клиринга в соответствующей валюте / соответствующем драгоценном металле в порядке, определенном пунктом 22.9 Правил клиринга, в сумме / количестве, определяемых Клиринговым центром, и имеет право возвратить Участнику клиринга денежные средства в указанной сумме в порядке, определенном пунктом 22.11 Правил клиринга.

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

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 Временным регламентом.

22.15. 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 22.10 Правил клиринга не возвращаются. В этом случае возврат Участнику клиринга денежных средств осуществляется только на основании Запроса о возврате либо Постоянного поручения на возврат в порядке, определенном статьей 17 Правил клиринга.

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.

22.16. В случае обращения взыскания на имущество Участника клиринга, находящееся на клиринговом счете, Клиринговый центр вправе принять решение о том, что Дата исполнения обязательств по всем или отдельным Сделкам, стороной по которым является Участник клиринга, считается наступившей в Расчетный день, когда Клиринговый центр получил копию документа, являющегося основанием для указанного обращения взыскания.

22.16.1. Включение в Клиринговый пул обязательств по Сделкам, в отношении которых Клиринговым центром принято решение о наступлении Даты исполнения обязательств в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга, осуществляется в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга, при этом в случае недостаточности денежных средств / драгоценных металлов для исполнения

Итоговых нетто-обязательств Участника клиринга в соответствующей валюте / соответствующем драгоценном металле, Клиринговый центр предпринимает действия, предусмотренные статьей 23 Правил клиринга.

22.16.2. Информация о решении, принятом Клиринговым центром в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга, раскрывается на Сайте Клирингового центра, а также направляется Участникам клиринга с использованием Подсистемы ЭДО НКЦ.

Статья 23. Порядок урегулирования случаев неисполнения или ненадлежащего исполнения Участниками клиринга обязательств по Сделкам и Маржинальных требований

23.1. Урегулирование случаев неисполнения или ненадлежащего исполнения Участниками клиринга обязательств по Сделкам, по которым осуществляется клиринг с частичным обеспечением, с наступившей Датой исполнения, осуществляется Клиринговым центром в ходе Дополнительных сессий.

23.2. Дополнительная сессия первого типа проводится в случае неисполнения Участником клиринга Маржинального требования в срок, установленный пунктом 20.3 Правил клиринга.

23.3. Дополнительная сессия второго типа проводится в следующих случаях:

- в случае частичного неисполнения или неисполнения в полном объеме Участником клиринга своих Итоговых нетто-обязательств в соответствующей валюте / соответствующем драгоценном металле;
- в случае непогашения Участником клиринга до установленного Временным регламентом времени Задолженности и наличия Обеспечения Участника клиринга в иностранных валютах, за исключением валют, по Сделкам с которыми возможен только клиринг с полным обеспечением, и/или Обеспечения в драгоценных металлах;
- в случае недостаточности денежных средств Клирингового центра для исполнения Итоговых нетто-требований в соответствующей валюте, а также в случае недостаточности денежных средств Клирингового центра в соответствующей валюте для исполнения Клиринговым центром своих обязательств перед Участниками клиринга на других рынках, на которых Клиринговый центр осуществляет функции клиринговой организации и/или центрального контрагента;
- в случае частичного неисполнения или неисполнения в полном объеме Клиринговым центром Итоговых нетто-требований Участника клиринга в соответствующей валюте.

23.4. Время проведения Дополнительных сессий определено Временным регламентом.

23.5. В ходе Дополнительных сессий между Участником клиринга и Клиринговым центром заключаются сделки с иностранной валютой / драгоценными металлами на условиях и в порядке, определенных Правилами клиринга.

23.5.1. Клиринговый центр, действуя от имени Участника клиринга в отношении себя

лично, осуществляет все юридические и фактические действия, необходимые для заключения сделок в ходе Дополнительных сессий.

23.5.2. Моментом заключения сделки в ходе Дополнительной сессии является момент внесения записи о заключении сделки в Реестр сделок Дополнительных сессий, который ведется Клиринговым центром.

23.5.3. Клиринговый центр предоставляет Участникам клиринга информацию о сделках, заключенных в ходе Дополнительной сессии, в отчете «Выписка из Реестра сделок Дополнительной сессии».

23.6. Дополнительная сессия 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 пунктами 29.2, 29.3, 29.4 Правил клиринга.

23.7. В ходе Дополнительной сессии первого типа между Клиринговым центром и Недобросовестным участником клиринга заключаются сделки купли-продажи иностранной валюты / драгоценных металлов, в том числе сделки своп, своп контракты и фьючерсные контракты.

23.7.1. Сделки купли-продажи драгоценных металлов в ходе Дополнительной сессии первого типа между Клиринговым центром и Недобросовестным участником клиринга – кредитной организацией не заключаются в случае отзыва (аннулирования) у такого Недобросовестного участника клиринга лицензии Банка России на привлечение во вклады и размещение драгоценных металлов.

23.8. Условия Сделок, заключаемых между Клиринговым центром и Недобросовестным участником клиринга в ходе Дополнительной сессии первого типа соответствуют установленным в Правилах торгов условиям соответствующих сделок, при этом условия указанных Сделок формируются Клиринговым центром таким образом, чтобы заключение указанных Сделок приводило к увеличению Единого лимита данного Участника клиринга.

Указанные Сделки заключаются до момента прекращения 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 первого типа, соответствуют условиям Сделок, заключенных Клиринговым центром в соответствии с пунктом 23.27 Правил клиринга.

23.9. В случае наличия у Участника клиринга на момент начала Дополнительной сессии второго типа непогашенной Задолженности, Участник клиринга обязан уплатить Клиринговому центру пеню, рассчитываемую по формуле:

Fine = D × 2 × S × n / 365, где

Fine – сумма пени, в российских рублях,

D – сумма Задолженности, 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.

23.10. Клиринговый центр зачитывает обязательство Участника клиринга по уплате пени, рассчитанной в соответствии с пунктом 23.9 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.

23.11. Дополнительная сессия второго типа в отношении Участника клиринга не проводится в следующих случаях:

а) у Участника клиринга отозвана (аннулирована) лицензия Банка России на осуществление банковских операций со средствами в рублях и иностранной валюте или в отношении Участника клиринга действуют иные обстоятельства, предусмотренные пунктами 29.2, 29.3, 29.4 Правил клиринга;

б) у Клирингового центра имеется информация об обстоятельствах в отношении Участника клиринга, перечисленных в пункте 11.1 Правил клиринга, при наступлении которых допуск к клиринговому обслуживанию Участника клиринга может быть приостановлен.

23.11.1. Дополнительная сессия второго типа в отношении Участника клиринга – кредитной организации по инструментам с драгоценными металлами не проводится в случае, если у такого Участника клиринга отозвана (аннулирована) лицензия Банка России на привлечение во вклады и размещение драгоценных металлов.

23.12. Сделки своп в ходе Дополнительной сессии второго типа заключаются при соблюдении следующего условия:

- количество Расчетных дней, в течение которых Участник клиринга не исполняет Итоговое нетто-обязательство в соответствующей валюте / соответствующем драгоценном металле по одному Расчетному коду, не превышает 2 (двух) Расчетных дней подряд.

23.13. Условия сделок своп, заключаемых между Клиринговым центром и Недобросовестным участником клиринга в ходе Дополнительной сессии второго типа в случае частичного неисполнения или неисполнения в полном объеме Недобросовестным участником клиринга своих Итоговых нетто-обязательств в соответствующей валюте / соответствующем драгоценном металле, соответствуют условиям сделок своп, установленным в Правилах торгов, при этом условия указанных сделок своп формируются Клиринговым центром таким образом, чтобы:

- в случае наличия у Участника клиринга неисполненного Итогового нетто-обязательства в иностранной валюте / драгоценном металле, по первой части

сделки своп, заключенной в ходе Дополнительной сессии второго типа, у Участника клиринга возникли требования в соответствующей иностранной валюте / драгоценном металле в объеме, равном указанному неисполненному Итоговому нетто-обязательству Участника клиринга в иностранной валюте / драгоценном металле;

- в случае наличия у Участника клиринга неисполненного Итогового нетто-обязательства в российских рублях, по первой части сделки своп, заключенной в ходе Дополнительной сессии второго типа, у Участника клиринга возникли требования в российских рублях и обязательства в иностранной валюте / драгоценном металле в объеме, равном Итоговому нетто-требованию Участника клиринга в иностранной валюте / драгоценном металле и/или размеру Обеспечения Участника клиринга в иностранной валюте / драгоценном металле, соответствующим неисполненному Участником клиринга Итоговому нетто-обязательству в российских рублях.

Условия сделок своп, заключаемых между Клиринговым центром и Недобросовестным участником клиринга в ходе Дополнительной сессии 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 в российских рублях и обязательства в иностранной валюте / драгоценном металле в объеме, равном размеру Обеспечения Участника клиринга в иностранной валюте / драгоценном металле, соответствующему сумме Задолженности.

23.14. При необходимости проведения Дополнительной сессии второго типа в отношении Добросовестных участников клиринга в соответствии с пунктом 23.28 Правил клиринга, условия сделок своп, заключаемых между Клиринговым центром и Добросовестным участником клиринга в ходе Дополнительной сессии второго типа в случае частичного неисполнения или неисполнения в полном объеме Клиринговым центром Итоговых нетто-требований Участника клиринга в иностранной валюте / драгоценном металле, соответствуют условиям сделок своп, установленным в Правилах торгов, при этом условия указанных сделок своп формируются Клиринговым центром таким образом, чтобы:

- по первой части сделки своп, заключенной в ходе Дополнительной сессии второго типа, у Участника клиринга возникли обязательства в соответствующей иностранной валюте / соответствующем драгоценном металле, противоположные указанному неисполненному Итоговому нетто-требованию Участника клиринга в иностранной валюте / драгоценном металле в объеме, равном сумме указанного неисполненного Итогового нетто-требования Участника клиринга в иностранной валюте / драгоценном металле.

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

Цена сделки своп рассчитывается по следующей формуле:

Swap_Price = K× Rc_RUB_VAL × S × n / 365, где

Swap_Price – цена сделки своп,

K – коэффициент, равный 1, в случае если направленность сделки в отношении

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

Rc_RUB_VAL – Центральный курс сделок купли-продажи иностранной валюты / драгоценного металла VAL за российские рубли, рассчитанный в 19:00 по московскому времени текущего Рабочего дня,

VAL – валюта лота сделки своп,

S – ставка, установленная Клиринговым центром в соответствии с Методикой определения риск-параметров валютного рынка и рынка драгоценных металлов,

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

23.16. В случае невозможности исполнения Участником клиринга своих Итоговых нетто-обязательств в соответствующей валюте / соответствующем драгоценном металле вследствие непреодолимой силы или сбоя в платежной системе Банка России, в ходе Дополнительной сессии 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 / соответствующем драгоценном металле невозможно, Участник клиринга обязан уведомить Клиринговый центр любыми доступными средствами связи до установленного времени проведения Дополнительной сессии 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 23.15 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 второго

типа.

23.17. При наличии у Клирингового центра информации об обстоятельствах в отношении Участника клиринга, перечисленных в пункте 11.1 Правил клиринга, в соответствии с которыми допуск к клиринговому обслуживанию Участника клиринга будет приостановлен в следующий Расчетный день, а также в случае отзыва (аннулирования) у Участника клиринга – кредитной организации лицензии Банка России на привлечение во вклады и размещение драгоценных металлов, Клиринговый центр вправе принять решение о том, что Дата исполнения обязательств по Сделкам, стороной которых является такой Участник клиринга, считается наступившей в текущий Расчетный день.

23.17.1. Обязательства по Сделкам, в отношении которых Клиринговым центром принято решение в соответствии с пунктом 23.17 Правил клиринга, включаются в клиринговый пул и участвуют в определении Итогового нетто-обязательства / Итогового нетто-требования Участника клиринга в соответствии со статьей 22 Правил клиринга, при этом при наличии неисполненного Итогового нетто-обязательства Участника клиринга в иностранной валюте / драгоценном металле между Клиринговым центром и Недобросовестным участником клиринга в ходе Дополнительной сессии второго типа заключается сделка купли-продажи иностранной валюты / драгоценного металла, условия которой соответствуют условиям первой части сделки своп, определенным в пункте 23.12 Правил клиринга, а цена сделки устанавливается равной цене сделки с соответствующей иностранной валютой / драгоценным металлом, заключенной Клиринговым центром в соответствии с пунктом 23.27 Правил клиринга.

23.18. При несоблюдении условия, указанного в пункте 23.12 Правил клиринга, в ходе Дополнительной сессии второго типа между Клиринговым центром и Участником клиринга заключается сделка купли-продажи иностранной валюты / драгоценного металла, условия которой соответствуют условиям первой части сделки своп, определенным в пункте 23.13 Правил клиринга, а цена сделки устанавливается равной цене сделки с соответствующей иностранной валютой / драгоценным металлом, заключенной Клиринговым центром в соответствии с пунктом 23.27 Правил клиринга.

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

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

итогам Дополнительной сессии.

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

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

Клиринговый центр списывает соответствующий драгоценный металл в количестве, равном объему Итогового нетто-обязательства Участника клиринга в этом драгоценном металле, указанного в Биржевом свидетельстве по итогам Дополнительной сессии, предоставленном Участнику клиринга, со Счета обеспечения Участника клиринга в счет исполнения указанного Итогового нетто-обязательства Участника клиринга в этом драгоценном металле.

При этом размер Обеспечения Участника клиринга в соответствующей валюте / соответствующем драгоценном металле уменьшается на сумму прекращенного / исполненного Итогового нетто-обязательства в этой валюте / драгоценном металле.

23.22. После проведения Дополнительной сессии второго типа или, в случае ее непроведения, в срок, установленный Временным 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.

23.23. Итоговое нетто-обязательство в российских рублях Участника клиринга, не прекращенные после проведения указанного в пункте 23.21 Правил клиринга зачета, учитываются Клиринговым центром как Задолженность Участника клиринга перед Клиринговым центром.

Указанная Задолженность должна быть погашена Участником клиринга не позднее установленного Временным регламентом времени Рабочего дня, следующего за днем возникновения указанной задолженности.

Информация о наличии у Участника клиринга Задолженности и ее размере передается Участнику клиринга в составе отчета «Требование о погашении Задолженности», направляемом Участнику клиринга в соответствии с пунктом 21.11 Правил клиринга.

Задолженность Участника клиринга считается погашенной, если на момент времени, установленный Временным регламентом в качестве времени погашения соответствующей Задолженности, значение Обеспечения в российских рублях по Расчетному коду, по которому учитывалась Задолженность, является неотрицательным.

23.24. Если Задолженность Участника клиринга, внесшего взнос в Гарантийный фонд и/или Обеспечение под стресс, перед Клиринговым центром не погашена в установленные Временным регламентом сроки, Клиринговый центр использует средства Гарантийного фонда и/или Обеспечение под стресс в порядке, определенном статьей 24 Правил клиринга.

23.25. Обязательство Клирингового центра по исполнению Итогового нетто-требования Участника клиринга в соответствующей валюте, указанного в Биржевом свидетельстве по итогам Дополнительной сессии, предоставленном Участнику клиринга, 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 Участника клиринга в соответствующей валюте.

Для исполнения Итогового нетто-требования Участника клиринга в соответствующем драгоценном металле, указанного в Биржевом свидетельстве по итогам Дополнительной сессии, предоставленном Участнику клиринга, Клиринговый центр зачисляет соответствующий драгоценный металл в количестве, равном объему указанного Итогового нетто-требования Участника клиринга в этом драгоценном металле, на Счет обеспечения Участника клиринга.

При этом размер Обеспечения Участника клиринга в соответствующей валюте / соответствующем драгоценном металле увеличивается на сумму прекращенного / исполненного Итогового нетто-требования Участника клиринга в этой валюте / этом драгоценном металле.

Возврат денежных средств / драгоценных металлов Участнику клиринга по итогам Дополнительной сессии второго типа не производится.

23.26. Обязательства / требования в соответствующих валютах / драгоценных металлах по вторым частям сделок своп, заключенных в ходе Дополнительной сессии 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.

23.27. В случае заключения Клиринговым центром в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга сделок купли-продажи иностранной валюты / драгоценного металла с Недобросовестным участником клиринга, имеющим неисполненное Маржинальное требование, а также в случаях, предусмотренных пунктами 23.17, 23.18 Правил клиринга, Клиринговый центр заключает Сделки в порядке, предусмотренном пунктом 15.8 Правил клиринга и/или внебиржевые сделки купли-продажи иностранной валюты / драгоценных металлов с целью обеспечения равенства суммы обязательств и суммы требований Клирингового центра в иностранных валютах / драгоценных металлах по всем Датам исполнения.

23.28. При наличии Недобросовестных участников клиринга, не исполнивших полностью или частично свои Итоговые нетто-обязательства в соответствующей валюте / драгоценном металле, для исполнения Итоговых нетто-требований в соответствующей валюте / драгоценном металле Добросовестных участников клиринга Клиринговый центр осуществляет действия в следующей последовательности:

- использует свободные собственные денежные средства / драгоценные металлы;
- в случае недостаточности свободных собственных денежных средств, в ходе Дополнительной сессии второго типа заключает сделки своп с Уполномоченными участниками клиринга, за исключением Банка России;

- в случае невозможности заключения сделок своп с Уполномоченными участниками клиринга, за исключением Банка России, заключает в соответствии с Договором о взаимодействии сделки своп с Банком России, в том числе в ходе Дополнительной сессии второго типа, за исключением сделок своп с драгоценными металлами;
- в случае невозможности заключения сделок своп с Уполномоченными участниками клиринга, включая Банк России, проводит Дополнительную сессию второго типа в отношении Добросовестных участников клиринга.

23.28.1. Базовый курс и цена сделки своп, заключаемой Клиринговым центром с Уполномоченным участником клиринга, за исключением Банка России, определяются в соответствии с договором, заключенным Клиринговым центром с соответствующим Уполномоченным участником клиринга.

23.28.2. По итогам Дополнительной сессии второго типа Клиринговый центр зачитывает встречные однородные Итоговые нетто-обязательства / Итоговые нетто-требования в соответствующей валюте / соответствующем драгоценном металле Уполномоченных участников клиринга, за исключением Банка России, с обязательствами / требованиями в соответствующей валюте / соответствующем драгоценном металле по первым частям сделок своп, заключенных в ходе данной Дополнительной сессии Клиринговым центром с таким Уполномоченным участником клиринга, и направляет ему Клиринговый отчет по итогам Дополнительной сессии, а также Биржевое свидетельство по итогам Дополнительной сессии.

23.29. Порядок исполнения (прекращения) Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований в соответствующей валюте / соответствующем драгоценном металле Уполномоченных участников клиринга, за исключением Банка России, по итогам Дополнительной сессии второго типа, определен пунктами 23.21, 23.25 Правил клиринга, порядок учета обязательств / требований Уполномоченных участников клиринга по вторым частям сделок своп, заключенных в ходе Дополнительной сессии второго типа Клиринговым центром с таким Уполномоченным участником клиринга, - пунктом 23.26 Правил клиринга.

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

23.31. В случае изменения условий обращения иностранной валюты, по Сделкам с которой может осуществляться клиринг с частичным обеспечением, Клиринговый центр вправе:

- принять решение об осуществлении исключительно клиринга с полным обеспечением по инструментам с такой иностранной валютой;
- 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 × 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 купли-продажи иностранной валюты VAL, обязательства в которых 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 24. Порядок использования и возмещения гарантийных фондов и иных средств в целях погашения Задолженностей Участников клиринга

24.1. Настоящая статья Правил клиринга применяется, если Задолженность Участника клиринга, учитываемая по Расчетному коду, не погашена в результате действий, предпринятых Клиринговым центром в соответствии со статьей 23 Правил клиринга

24.2. Индивидуальное клиринговое обеспечение и иное обеспечение Недобросовестного участника клиринга, Обеспечение под стресс, средства Гарантийного фонда и гарантийных фондов, созданных в соответствии с иными правилами клиринга, используются для погашения Задолженности Участника клиринга, учитываемой по Расчетному коду, в следующей очередности:

1) Обеспечение Недобросовестного участника клиринга в денежных средствах / драгоценных металлах, учитываемое в соответствии с Правилами клиринга по собственным Расчетным кодам Недобросовестного участника клиринга;
2) индивидуальное клиринговое обеспечение Недобросовестного участника клиринга в денежных средствах, учитываемое Клиринговым центром в соответствии с иными правилами клиринга Клирингового центра по собственным Расчетным кодам Недобросовестного участника клиринга по выбору Клирингового центра, и Обеспечение Недобросовестного участника клиринга в ценных бумагах, учитываемое в соответствии с иными правилами клиринга Клирингового центра по Разделам / разделам депо регистра обеспечения, соответствующим собственным Расчетным кодам;
3) Обеспечение под стресс Недобросовестного участника клиринга, учитываемое в соответствии с Правилами клиринга;
4) Обеспечение под стресс Недобросовестного участника клиринга, учитываемое в соответствии с иными правилами клиринга Клирингового центра по выбору Клирингового центра;
5) взнос в Гарантийный фонд Недобросовестного участника клиринга, учитываемый в соответствии с Правилами клиринга;

6) взносы в гарантийные фонды Недобросовестного участника клиринга, учитываемые в соответствии с иными правилами клиринга Клирингового центра по выбору Клирингового центра;

7) взносы в Гарантийный фонд Добросовестных участников клиринга, учитываемые в соответствии с Правилами клиринга (с учетом условия пункта 24.11 Правил клиринга).

24.3. Взносы в гарантийные фонды и иные средства Участников клиринга каждой очереди, указанной в пункте 24.2 Правил клиринга, используются в следующей очередности:

- российские рубли;
- иностранная валюта;
- ценные бумаги;
- драгоценные металлы.

24.4. Использование средств гарантийных фондов и иных средств следующей очереди в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга осуществляется в случае, если Задолженность Участника клиринга не погашена при использовании средств предыдущей очереди.

24.5. В случае использования для погашения Задолженности Недобросовестного участника клиринга индивидуального клирингового обеспечения, за исключением Обеспечения под стресс, внесенного в соответствии с иными правилами клиринга, такое обеспечение используется в соответствии с порядком, установленным теми правилами клиринга Клирингового центра, в соответствии с которыми оно учитывается, при условии отсутствия Маржинального требования или задолженности по расчетному коду, открытому в соответствии с такими правилами клиринга, и в объеме, не приводящим к возникновению Маржинального требования или задолженности по такому расчетному коду.

24.6. Если после использования индивидуального клирингового обеспечения Недобросовестного участника клиринга, учитываемого по всем собственным Расчетным кодам, Задолженность Участника клиринга не погашена, между Клиринговым центром и Недобросовестным участником клиринга по собственным Расчетным кодам, присвоенным в соответствии с Правилами клиринга, заключаются сделки в порядке, аналогичном порядку, указанному в пункте 23.7 Правил клиринга, затем – сделки по собственным расчетным кодам, присвоенным в соответствии с иными правилами клиринга Клирингового центра, направленные на прекращение обязательств Недобросовестного участника клиринга и увеличение объема свободного индивидуального клирингового обеспечения Недобросовестного участника клиринга, за исключением Обеспечения под стресс, учитываемого по таким расчетным кодам.

Индивидуальное клиринговое обеспечение, освободившееся в результате заключения сделок в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга, переводится Клиринговым центром на Расчетный код, по которому учитывается Задолженность, и используется для ее погашения.

Указанные в настоящем пункте Правил клиринга сделки заключаются до момента погашения Задолженности Участника клиринга, учитываемой по Расчетному коду,

или до момента прекращения всех обязательств Недобросовестного участника клиринга, учитываемых по собственным расчетным кодам, присвоенным в соответствии со всеми правилами клиринга (в зависимости от того, что наступит раньше).

24.7. Если после прекращения всех обязательств Недобросовестного участника клиринга, учитываемых по собственным расчетным кодам, присвоенным в соответствии со всеми правилами клиринга, Задолженность Участника клиринга не погашена, между Клиринговым центром и Недобросовестным участником клиринга по клиентским Расчетным кодам и Расчетным кодам ДУ, присвоенным в соответствии с Правилами клиринга, заключаются сделки в порядке, аналогичном порядку, указанному в пункте 23.7 Правил клиринга, направленные на прекращение обязательств Недобросовестного участника клиринга.

После заключения сделок в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга Обеспечение под стресс Недобросовестного участника клиринга, учитываемое в соответствии с Правилами клиринга, а затем взнос в Гарантийный фонд Недобросовестного участника клиринга, учитываемый в соответствии с Правилами клиринга, используются для погашения его Задолженности.

24.8. Если после использования Обеспечения под стресс и взноса в Гарантийный фонд Недобросовестного участника клиринга, учитываемых в соответствии с Правилами клиринга, Задолженность Участника клиринга не погашена, между Клиринговым центром и Недобросовестным участником клиринга по клиентским расчетным кодам и расчетным кодам ДУ, присвоенным в соответствии с иными правилами клиринга, заключаются сделки в порядке, аналогичном порядку, указанному в пункте 23.7 Правил клиринга, направленные на прекращение обязательств Недобросовестного участника клиринга.

После заключения сделок в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга Обеспечение под стресс Недобросовестного участника клиринга, учитываемое в соответствии с иными правилами клиринга, а затем взнос в Гарантийный фонд Недобросовестного участника клиринга, учитываемый в соответствии с иными правилами клиринга, используются для погашения его Задолженности.

При этом Обеспечение под стресс и взнос в Гарантийный фонд Недобросовестного участника клиринга, учитываемый в соответствии с иными правилами клиринга, используются в случае отсутствия у Участника клиринга задолженности, учитываемой в соответствии с такими правилами клиринга.

24.9. При использовании взноса Участника клиринга в Гарантийный фонд и/или Обеспечения под стресс, учитываемых в соответствии с Правилами клиринга, Участнику клиринга категории «Б» устанавливается категория «В», Участнику клиринга категории «О» по всем Расчетным кодам Участника клиринга устанавливается признак «запрет коротких продаж и необеспеченных покупок».

24.10. В случае использования взноса в Гарантийный фонд и/или Обеспечения под стресс Недобросовестного участника клиринга, такой Участник клиринга обязан в течение 1 (одного) Расчетного дня после направления Клиринговым центром Маржинального требования по фонду и/или Маржинального требования по Обеспечению под стресс в соответствии с пунктами 20.7/20.8 Правил клиринга восполнить свой взнос в Гарантийный фонд / свое Обеспечение под стресс до

размеров, установленных Клиринговым центром.

В случае возмещения Недобросовестным участником клиринга средств Гарантийного фонда и Обеспечения под стресс, учитываемых в соответствии с Правилами клиринга, Участнику клиринга категории «В» устанавливается категория «Б», Участнику клиринга категории «О» снимается признак «запрет коротких продаж и необеспеченных покупок».

24.11. Взносы в Гарантийный фонд Добросовестных участников клиринга используются в случае, если сумма Задолженностей Недобросовестных участников клиринга перед Клиринговым центром на дату использования средств Гарантийного фонда превышает 2 000 000 000 (два миллиарда) российских рублей.

24.12. Для погашения задолженности одного Недобросовестного Участника клиринга используется не более ½ (одной второй) Гарантийного фонда.

24.13. В случае возникновения нескольких задолженностей одного или нескольких Недобросовестных Участников клиринга в соответствии с Правилами клиринга и иными правилами клиринга Клирингового центра, взнос Недобросовестного участника клиринга в Гарантийный фонд / Обеспечение под стресс Недобросовестного Участника клиринга используется, в первую очередь, для погашения Задолженности Участника клиринга, учитываемой в соответствии с Правилами клиринга, во вторую – задолженностей, учитываемых в соответствии с иными правилами клиринга Клирингового центра.

24.14. Взнос в Гарантийный фонд / Обеспечение под стресс Недобросовестного участника клиринга используется для удовлетворения требований Клирингового центра по Задолженности Недобросовестного участника клиринга путем передачи денежных средств / ценных бумаг, учитываемых в качестве взноса в Гарантийный фонд / Обеспечения под стресс Недобросовестного участника клиринга, Клиринговому центру в счет погашения Задолженности Недобросовестного участника клиринга.

24.14.1. При этом сумма денежных средств в иностранной валюте и/или количество ценных бумаг, подлежащих передаче Клиринговому центру из взноса Участника клиринга в Гарантийный фонд / из Обеспечения под стресс Участника клиринга, рассчитывается исходя из суммы Задолженности в порядке, установленном Правилами клиринга на рынке ценных бумаг.

24.14.2. Удовлетворение требований за счет взноса в Гарантийный фонд / Обеспечения под стресс Недобросовестного участника клиринга осуществляется Клиринговым центром без предварительного уведомления Недобросовестного участника клиринга.

24.14.3. При этом размер взноса в Гарантийный фонд / Обеспечения под стресс Недобросовестного участника клиринга уменьшается в порядке, установленном Правилами клиринга на рынке ценных бумаг.

24.15. Взносы в Гарантийный фонд Добросовестных участников клиринга используются в размере превышения суммы Задолженностей Недобросовестных участников клиринга величины, установленной в соответствии с пунктом 24.11 Правил клиринга.

24.15.1. Использование взносов в Гарантийный фонд Добросовестных участников клиринга

осуществляется в равных долях.

24.15.2. Взнос в Гарантийный фонд Добросовестного участника клиринга используется для удовлетворения требований Клирингового центра по Задолженности Недобросовестного участника клиринга путем передачи денежных средств / ценных бумаг, составляющих взнос в Гарантийный фонд Добросовестного участника клиринга, Клиринговому центру в счет погашения Задолженности Недобросовестного участника клиринга.

При этом сумма денежных средств в иностранной валюте и/или количество ценных бумаг, подлежащих передаче Клиринговому центру из взноса Добросовестного участника клиринга в Гарантийный фонд, рассчитывается исходя из суммы Задолженности в порядке, установленном Правилами клиринга на рынке ценных бумаг.

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

24.16. В случае использования взносов в Гарантийный фонд Добросовестных Участников клиринга, Недобросовестный участник клиринга обязан в течение 1 (одного) Расчетного дня возместить Клиринговому центру в российских рублях использованные средства Гарантийного фонда.

Уведомление о необходимости возмещения средств Гарантийного фонда, содержащее информацию о сумме в российских рублях, 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.

24.17. После возмещения Недобросовестным участником клиринга использованных средств Гарантийного фонда из взносов Добросовестных Участников клиринга, Клиринговый центр возмещает в российских рублях 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 Добросовестного участника клиринга.

При этом размер взноса в Гарантийный фонд Добросовестного участника клиринга и размер обязательства Клирингового центра по возврату Добросовестному участнику клиринга взноса в Гарантийный фонд увеличиваются в порядке, установленном Правилами клиринга на рынке ценных бумаг.

24.18. После возмещения Недобросовестным участником клиринга использованных средств Гарантийного фонда из взносов Добросовестных Участников клиринга такой Участник клиринга обязан возместить (внести) свой взнос в Гарантийный фонд и/или Обеспечение под стресс в установленном Клиринговым центром

размере.

24.19. В случае использования взносов в Гарантийный фонд Добросовестных участников клиринга, Добросовестные участники клиринга обязаны в течение 1 (одного) Расчетного дня после направления Клиринговым центром Маржинальных требований по фонду в соответствии с пунктом 20.7 Правил клиринга восполнить в российских рублях свои взносы в Гарантийный фонд до размера, установленного Клиринговым центром.

Указанная обязанность по восполнению взноса в Гарантийный фонд не может возникать у Добросовестного участника клиринга чаще, чем 1 (один) раз в Расчетный день и 7 (семь) раз в течение календарного года.

РАЗДЕЛ VI. ПОРЯДОК ОПЛАТЫ УСЛУГ. ОТЧЕТЫ ПО ИТОГАМ КЛИРИНГА

Статья 25. Порядок оплаты услуг Клирингового центра, Биржи и Технического центра

25.1. Клиринговый центр взимает:

- комиссионное вознаграждение в пользу Клирингового центра за клиринговое обслуживание (далее – комиссионное вознаграждение Клирингового центра);
- комиссионное вознаграждение в пользу Биржи 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).

25.2. Участник клиринга исполняет обязательства по уплате комиссионных вознаграждений Биржи и Технического центра за Участников торгов, имеющих право подавать заявки с указанием Расчетных кодов данного Участника клиринга.

25.3. Размер комиссионного вознаграждения Клирингового центра, подлежащего уплате Участником клиринга, рассчитывается Клиринговым центром в соответствии с Тарифами Клирингового центра.

25.4. Комиссионное вознаграждение Биржи за организацию торгов взимается Клиринговым центром в соответствии с действующими размерами комиссионного вознаграждения за организацию торгов иностранной валютой/драгоценным металлами, утвержденными Биржей (далее – Тарифы Биржи), и Правилами торгов на основании Договора о взаимодействии.

25.5. Вознаграждение Технического центра взимается Клиринговым центром в соответствии с действующими размерами вознаграждения за предоставление ИТС при совершении сделок с иностранной валютой/драгоценными металлами, утвержденными Техническим центром, и/или в соответствии с договором, заключенным Техническим центром с Участником клиринга (далее – Тарифы Технического центра), на основании Договора о взаимодействии.

25.6. Обязательства по уплате комиссионных вознаграждений Клирингового центра, Биржи и Технического центра исполняются в российских рублях.

25.6.1. В случае если сумма комиссионного вознаграждения Клирингового центра, Биржи 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.

25.7. Размер комиссионного вознаграждения Биржи за организацию торгов, вознаграждения Технического центра за предоставление ИТС и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за клиринговое обслуживание по сделкам с иностранной валютой, рассчитывается с учетом действующего для Участника

торгов и/или Участника клиринга тарифного плана.

25.7.1. Тарифный план действует для Регистрационного кода (идентификатора) Участника торгов / для Идентификатора Участника клиринга и для всех Расчетных кодов, открытых в рамках Идентификатора Участника клиринга.

25.7.2. Тарифный план по сделкам своп применяется к сделкам своп, своп контрактам и фьючерсным контрактам.

Выбор или изменение Участником торгов / Участником клиринга тарифного плана по сделкам своп осуществляется путем предоставления Клиринговому центру Заявления о выборе (смене) тарифного плана по сделкам своп.

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 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 торгов / Участникам клиринга, не выбравшим ни один из тарифных планов по сделкам своп устанавливается тарифный план SWP_0, который устанавливается с даты допуска Участника торгов к торгам / с даты допуска Участника клиринга к клиринговму обслуживанию и действует до начала применения иного тарифного плана, выбранного Участником торгов / Участником клиринга.

25.7.3. Тарифный план по сделкам спот применяется к сделкам спот с иностранной валютой.

Выбор или изменение Участником торгов / Участником клиринга тарифного плана по сделкам спот осуществляется путем предоставления Клиринговому центру Заявления о выборе (смене) тарифного плана по сделкам купли-продажи иностранной валюты.

Заявление о выборе (смене) тарифного плана по сделкам спот 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 спот 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 торгов / Участникам клиринга, не выбравшим ни один из тарифных планов по сделкам спот, устанавливается тарифный план SPT_0, который устанавливается с даты допуска Участника торгов к торгам / с даты допуска Участника клиринга к клиринговму обслуживанию и действует до начала применения иного тарифного плана, выбранного Участником торгов / Участником клиринга.

25.8. Размер оборотной части комиссионного вознаграждения Биржи за организацию

торгов, оборотной части вознаграждения Технического центра за предоставление ИТС и оборотной части комиссионного вознаграждения Клирингового центра за клиринговое обслуживание по сделкам с иностранной валютой / драгоценными металлами рассчитывается после заключения Сделки и удерживается Клиринговым центром с Участника клиринга ежедневно в дату заключения Сделки в срок, установленный Временным регламентом.

25.9. Постоянная часть комиссионного вознаграждения Биржи за организацию торгов, постоянная часть вознаграждения Технического центра за предоставление ИТС и постоянная часть комиссионного вознаграждения Клирингового центра за клиринговое обслуживание по сделкам с иностранной валютой удерживается Клиринговым центром с Участника клиринга в первый Рабочий день календарного месяца, за который взимается постоянная часть комиссионного вознаграждения, в срок, установленный Временным 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.

25.9.1. Участник клиринга категории «О» вправе указать в Заявлении о выборе Расчетного кода для списания комиссионных вознаграждений Регистрационный код (идентификатор) и наименование Участника торгов в целях списания с указанного в заявлении Расчетного кода подлежащих уплате данным Участником торгов постоянных/фиксированных частей вознаграждений Биржи и/или Технического центра, минимальных ежемесячных комиссионных вознаграждений, а также Дополнительного комиссионного сбора.

25.9.2. Заявление о выборе Расчетного кода для списания комиссионных вознаграждений действует, начиная с дня, следующего за днем его предоставления.

25.10. В случае приостановки / прекращения допуска Участника торгов к торгам / Участника клиринга к клиринговому обслуживанию в течение календарного месяца, постоянная часть комиссионного вознаграждения Биржи за организацию торгов, постоянная часть вознаграждения Технического центра за предоставление ИТС и/или постоянная часть комиссионного вознаграждения Клирингового центра за клиринговое обслуживание по сделкам с иностранной валютой, уплаченная Участником торгов / Участником клиринга, не пересчитывается и Участнику торгов / Участнику клиринга не возвращается.

25.11. В случае если для Участника торгов / Участника клиринга действует тарифный план SPT_0 по сделкам спот и по итогам месяца:

а) сумма рассчитанной оборотной части комиссионного вознаграждения Клирингового центра за клиринговое обслуживание по сделкам спот с иностранной валютой, подлежащего уплате Участником клиринга в течение истекшего месяца по всем Расчетным кодам, открытым в рамках одного Идентификатора Участника клиринга, меньше, чем минимальное ежемесячное комиссионное вознаграждение, установленное Тарифами Клирингового центра, и/или

б) сумма рассчитанной оборотной части комиссионного вознаграждения Биржи за организацию торгов по сделкам спот с иностранной валютой, подлежащего уплате Участником торгов в течение истекшего месяца по всем Расчетным

кодам, соответствующим одному Регистрационному коду (идентификатору) Участника торгов, меньше, чем минимальное ежемесячное комиссионное вознаграждение, установленное Тарифами Биржи, и/или

в) сумма рассчитанной оборотной части вознаграждения Технического центра за предоставление ИТС по сделкам спот с иностранной валютой, подлежащего уплате Участником торгов в течение истекшего месяца по всем Расчетным кодам, соответствующим одному Регистрационному коду (идентификатору) Участника торгов, меньше, чем минимальное ежемесячное комиссионное вознаграждение, установленное Тарифами Технического центра,

Клиринговый центр удерживает разницу между соответствующим минимальным ежемесячным комиссионным вознаграждением, подлежащим уплате Клиринговому центру и/или Бирже и/или Техническому центру и указанной в подпункте «а», и/или «б», и/или «в» настоящего пункта Правил клиринга суммой соответствуюшей оборотной части комиссионного вознаграждения (в том числе суммой равной нулю).

Указанная разница удерживается в случае, если Участник клиринга / Участник торгов имел доступ к клиринговому обслуживанию / торгам в течение одного и более дней в календарном месяце, вне зависимости от факта подачи заявок, заключения 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 25.9 Правил клиринга (в случае предоставления указанного заявления), либо по основному Расчетному коду, соответствующему Регистрационному коду (идентификатору) Участника торгов / Идентификатору Участника клиринга, по которому зафиксировано превышение соответствующего минимального ежемесячного комиссионного вознаграждения над суммой, указанной, соответственно, в подпункте «а», и/или «б», и/или «в» настоящего пункта Правил клиринга.

В случае приостановки / прекращения допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию / допуска Участника торгов к торгам в течение календарного месяца, указанная разница удерживается в последний Рабочий день, когда Участник клиринга / Участник торгов был допущен к клиринговому обслуживанию / торгам, за исключением случаев, предусмотренных Тарифами Клирингового центра / Тарифами Биржи / Тарифами Технического центра.

25.12. Фиксированная часть вознаграждения за предоставление ИТС удерживается Клиринговым центром с Участника клиринга в первый Рабочий день календарного месяца, следующего за месяцем фактического оказания услуг по предоставлению ИТС, в срок, установленный Временным регламентом, по Расчетному коду, указанному Участником клиринга в Заявлении о выборе Расчетного кода для списания комиссионных вознаграждений, предоставленном в соответствии с пунктом 25.9 Правил клиринга (в случае предоставления указанного заявления), либо основному Расчетному коду.

В случае приостановки / прекращения допуска Участника торгов к торгам в течение календарного месяца, фиксированная часть вознаграждения за предоставление ИТС удерживается в последний Рабочий день, когда Участник торгов был допущен к торгам, за исключением случаев, предусмотренных Тарифами Технического центра.

25.13. Подлежащий уплате в соответствии с Тарифами Технического центра Дополнительный комиссионный сбор, рассчитанный в отношении Участника торгов / Клиента, удерживается Клиринговым центром с Участника клиринга в Расчетный день, по итогам которого указанное дополнительное вознаграждение рассчитано, в срок, установленный Временным регламентом для уплаты комиссионного вознаграждения, по Расчетному коду, с указанием которого Участником торгов в течение данного Расчетного дня были поданы заявки на заключение Сделок за свой счет или за счет указанного Клиента (в случае 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 25.9 Правил клиринга (в случае предоставления указанного заявления), либо по основному Расчетному коду, если Участником торгов в течение данного Расчетного дня были поданы заявки на заключение Сделок за свой счет или за счет указанного Клиента с указанием нескольких Расчетных кодов.

25.14. Комиссионное вознаграждение Клирингового центра за учет Обеспечения и Обеспечения под стресс удерживается Клиринговым центром с Участника клиринга в первый Рабочий день календарного месяца, следующего за месяцем оказания услуг в срок, установленный Временным 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, за исключением случаев, предусмотренных Тарифами Клирингового центра.

Клиринговый центр ежемесячно направляет Участнику клиринга Отчет о комиссионном вознаграждении за учет Обеспечения и Обеспечения под стресс.

25.15. Информация о размере комиссионного вознаграждения Биржи, Технического центра и Клирингового центра, подлежащего уплате Участником торгов / Участником клиринга в отчетную дату, указывается в Отчете о комиссионных вознаграждениях, направляемом Клиринговым центром Участникам клиринга в сроки, установленные Временным регламентом.

25.16. 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.

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

Статья 26. Порядок предоставления отчетов по итогам клиринга

26.1. Клиринговый центр обеспечивает Участнику клиринга с использованием рабочего места Участника клиринга возможность получения следующей информации из Клиринговой системы:

- о размере Обеспечения Участника клиринга в каждой валюте / каждом драгоценном металле;
- о размере Единого лимита Участника клиринга;
- 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 / каждом драгоценном металле и с каждой Датой исполнения;
- о размере Обеспечения Участника клиринга в каждой валюте / каждом драгоценном металле, недостающего для исполнения Нетто-обязательства Участника клиринга в соответствующей валюте / соответствующем драгоценном металле 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).

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

- Отчет об обязательствах, содержащий информацию о допущенных к клирингу обязательствах по Сделкам, не являющимся производными финансовыми инструментами, по всем Датам исполнения;
- Отчет об обязательствах по ПФИ, содержащий информацию о допущенных к клирингу обязательствах по своп контрактам и фьючерсным контрактам и обязательствах по уплате вариационной маржи;
- Клиринговый отчет и Клиринговый отчет по итогам Дополнительной сессии, содержащие информацию об обязательствах, включенных в клиринговый пул;
- Биржевое свидетельство, Биржевое свидетельство по итогам Дополнительной сессии, предварительное Биржевое свидетельство, содержащие информацию об обязательствах, определенных по результатам клиринга;
- Отчет о сделках, дата исполнения которых перенесена, содержащий информацию об обязательствах, исключенных из клирингового пула;
- Отчет о движении денежных средств, содержащий информацию о размере Обеспечения Участника клиринга в денежных средствах / драгоценных металлах, об изменения размера такого Обеспечения, включая информацию об использовании Обеспечения, в том числе для исполнения обязательств, определенных по итогам клиринга;
- Отчет о комиссионных вознаграждениях;
- Отчет о Клиринговых идентификаторах;

- Требование о погашении Задолженности;
- Отчет о Маржинальном требовании;
- Отчет о Поручениях на управление риском;
- Отчет о комиссионном вознаграждении за учет Обеспечения.

26.3. Отчеты, указанные в пункте 26.2 Правил клиринга, направляются Участнику клиринга в форме электронных документов в соответствии с Порядком ЭДО.

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.

26.4. Форматы и формы отчетов по итогам клиринга, предоставляемых Клиринговым центром Участникам клиринга в соответствии с Правилами клиринга, установлены документом «Форматы и формы отчетов, предоставляемых Участникам клиринга в соответствии с Правилами клиринга ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр» на валютном рынке и рынке драгоценных металлов», раскрываемом на Сайте Клирингового центра.

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

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 27. Перевод обязательств и перевод Обеспечения клиента Участника клиринга от одного Участника клиринга другому Участнику клиринга

27.1. Клиринговый центр осуществляет перевод долга и уступку требований одного Участника клиринга (далее – Базовый Участник клиринга) по обязательствам по Сделкам, учитываемым по Расчетному коду, за которым закреплен Обособленный клиент (далее – Перевод обязательств), другому Участнику клиринга (далее – Участник клиринга – реципиент) при наличии Заявления на перевод обязательств (далее также – Заявление), предоставляемого Обособленным клиентом. В Заявлении должны быть указаны наименование Участника клиринга – реципиента, которому Клиринговый центр должен осуществить Перевод обязательств, а также не менее чем одно из следующих оснований в отношении Базового Участника клиринга для осуществления Перевода обязательств:

27.1.1. основания, предусмотренные подпунктами 11.1.2, 11.1.3, 11.1.5-11.1.12, пунктами 11.3, 11.4, 11.9, 20.9 или 24.16 Правил клиринга;

27.1.2. наличие дела о банкротстве в отношении Базового Участника клиринга в производстве арбитражного суда более 2 (двух) месяцев с момента подачи соответствующего заявления;

27.1.3. нарушение Базовым Участником клиринга правил российских или иностранных организатора торгов или клиринговой организации;

27.1.4. включение в повестку дня органов управления Базового Участника клиринга вопроса о ликвидации Базового Участника клиринга либо принятие решения органами управления Базового Участника клиринга о ликвидации Базового Участника клиринга;

27.1.5. принятие органами управления Базового Участника клиринга решения о реорганизации Базового Участника клиринга (за исключением случаев реорганизации, которые не влекут прекращения деятельности Базового Участника клиринга);

27.1.6. вынесение решения суда о взыскании, наложении ареста либо ином обременении в отношении имущества Базового Участника клиринга;

27.1.7. наличие Задолженности Базового Участника клиринга по Расчетному коду, не погашенной в установленные Временным регламентом сроки;

27.1.8. предоставление Базовым Участником клиринга Клиринговому центру поручения на перевод обязательств и Обеспечения.

27.2. Заявление на регистрацию Обособленного клиента, предоставленное Базовым участником клиринга Клиринговому центру в порядке, предусмотренном подпунктом 10.6 Правил клиринга, является основанием для перевода Обеспечения, учитываемого по такому Расчетному коду (далее – Перевод Обеспечения) при подаче соответствующим Обособленным клиентом Базового участника клиринга Заявления в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга.

Перевод Обеспечения осуществляется одновременно с Переводом обязательств в порядке и на условиях, предусмотренных настоящей статьей Правил клиринга.

Подача Базовым Участником клиринга Заявления на регистрацию Обособленного клиента является безусловным согласием Базового участника клиринга на перевод Клиринговым центром Участнику клирингу – реципиенту Обеспечения в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга, а также согласием на раскрытие Клиринговым центром Участнику клиринга – реципиенту информации о Базовом участнике, предусмотренной пунктом 27.6 Правил клиринга. Такое согласие не может быть отозвано Базовым участником клиринга.

27.3. Перевод обязательств и Перевод Обеспечения не осуществляется:

27.3.1. в случае принятия решения арбитражного суда о введении в отношении Базового Участника клиринга – некредитной организации одной из процедур банкротства;

27.3.2. в случае отзыва (аннулирования) Банком России лицензии на осуществление банковских операций у Базового Участника клиринга – кредитной организации;

27.3.3. при отсутствии согласия Участника клиринга – реципиента, предусмотренного пунктом 27.7 Правил клиринга.

27.4. Заявление на перевод обязательств предоставляется Обособленным клиентом вместе с копией документа, подтверждающего полномочия лица, подписавшего Заявление (в случае если такой документ не был предоставлен Клиринговому центру ранее). Подача Заявления на перевод обязательств является безусловным согласием Обособленного клиента на раскрытие Клиринговым центром Участнику клиринга – реципиенту информации, предусмотренной пунктом 27.6 Правил клиринга.

27.4.1. В случае если между Обособленным клиентом и Клиринговым центром предусмотрен обмен сообщениями с использованием Подсистемы ЭДО НКЦ или по системе S.W.I.F.T., Обособленный клиент вправе направить Заявление на перевод обязательств в форме сообщения с использованием Подсистемы ЭДО НКЦ или по системе S.W.I.F.T.

27.4.2. Клиринговый центр не осуществляет проверку достоверности оснований для Перевода обязательств, указанных Обособленным клиентом в Заявлении. При этом Клиринговый центр вправе отказать Обособленному клиенту в исполнении Заявления на перевод обязательств при наличии информации об отсутствии указанных в Заявлении оснований.

27.4.3. Клиринговый центр не несет ответственности за убытки, понесенные Базовым участником клиринга / Обособленным клиентом в случае исполнения / неисполнения Клиринговым центром Заявления, поданного Обособленным клиентом в соответствии с пунктом 27.1 Правил клиринга.

27.5. В случае если между Обособленным клиентом и Клиринговым центром предусмотрен обмен сообщениями с использованием Подсистемы ЭДО НКЦ или по системе S.W.I.F.T., и Клиринговому центру стало известно о наступлении в отношении Базового Участника клиринга одного или нескольких оснований для Перевода обязательств, предусмотренных пунктом 27.1 Правил клиринга, а Заявление на перевод обязательств от Обособленного клиента, закрепленного за

Расчетным кодом Базового Участника клиринга, не получено, Клиринговый центр вправе сообщить Обособленному клиенту о наличии таких оснований путем направления сообщения с использованием Подсистемы ЭДО НКЦ или по системе S.W.I.F.T.

27.6. При получении от Обособленного клиента Заявления на перевод обязательств и при отсутствии у Клирингового центра оснований для отказа в исполнении Заявления, Клиринговый центр передает с использованием Подсистемы ЭДО НКЦ Участнику клиринга – реципиенту сообщение о размере обязательств / требований Базового Участника клиринга в каждой валюте / каждом драгоценном металле по обязательствам по Сделкам, а также о размере Обеспечения Базового Участника клиринга в каждой валюте / каждом драгоценном металле, учитываемых по Расчетному коду Базового Участника клиринга, за которым закреплен Обособленный клиент, предоставивший Заявление на перевод обязательств.

27.7. Участник клиринга – реципиент обязан предоставить Клиринговому центру согласие на прием обязательств / требований Базового Участника клиринга в каждой валюте / каждом драгоценном металле по обязательствам, определенным в пункте 27.6 Правил клиринга (далее – Согласие на прием), не позднее 20:00 по московскому времени Расчетного дня получения информации от Клирингового центра в соответствии с пунктом 27.6 Правил клиринга. Указанное согласие направляется с использованием Подсистемы ЭДО НКЦ.

Предоставление указанного Согласия на прием является также согласием Участника клиринга – реципиента на перевод ему Обеспечения, определенного в пункте 27.6 Правил клиринга, и предоставляет Участнику клиринга – реципиенту право требовать от Клирингового центра перевода такого Обеспечения.

27.8. Для исполнения Заявления на перевод обязательств Участник клиринга – реципиент обязан заблаговременно предпринять действия, необходимые для открытия Счетов обеспечения в драгоценных металлах для учета Обеспечения в драгоценных металлах, учитываемого по Расчетному коду Обособленного клиента (в случае Перевода Обеспечения в драгоценных металлах).

27.9. Для исполнения Заявления на перевод обязательств Клиринговый центр:

27.9.1. Незамедлительно после получения согласия Участника клиринга – реципиента в соответствии с пунктом 27.7 Правил клиринга уведомляет Биржу о необходимости установления запрета на подачу Базовым Участником клиринга заявок на заключение Сделок с указанием Расчетного кода, за которым закреплен Обособленный клиент, предоставивший Заявление на перевод обязательств, и о необходимости снятия зарегистрированных заявок, поданных Базовым Участником клиринга с использованием указанного Расчетного кода.

27.9.2. После получения от Участника клиринга - реципиента Согласия на прием в соответствии с пунктом 27.7 Правил клиринга и до начала клиринговой сессии следующего Расчетного дня:

- открывает Расчетный код клиента Участнику клиринга – реципиенту и закрепляет за ним Обособленного клиента, предоставившего Заявление на перевод обязательств;
- списывает драгоценные металлы со Счета обеспечения Базового Участника

клиринга, соответствующего Расчетному коду, за которым закреплен Обособленный клиент, предоставивший Заявление на перевод обязательств, и зачисляет на Счет обеспечения Участника клиринга – реципиента, соответствующий Расчетному коду, за которым закреплен Обособленный клиент, предоставивший Заявление на перевод обязательств;

- прекращает учитывать обязательства / требования, определенные в пункте 27.6 Правил клиринга, как обязательства и требования Базового Участника клиринга в отношении Клирингового центра по Расчетному коду, за которым закреплен Обособленный клиент, предоставивший Заявление на перевод обязательств;
- начинает учитывать обязательства / требования, определенные в пункте 27.6 Правил клиринга, как обязательства и требования Участника клиринга – реципиента в отношении Клирингового центра по Расчетному коду, за которым закреплен Обособленный клиент, предоставивший Заявление на перевод обязательств.

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

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

27.11. Обособленный клиент вправе до получения Клиринговым центром от Участника клиринга – реципиента Согласия на прием заменить первоначально указанного Участника клиринга – реципиента на другого Участника клиринга – реципиента путем направления Клиринговому центру Заявления на перевод обязательств с указанием наименования нового Участника клиринга – реципиента. Такое Заявление на перевод обязательств должно содержать сведения, предусмотренные пунктом 27.1 Правил клиринга и предоставляться в порядке, предусмотренном настоящей статьей Правил клиринга.

27.12. За осуществление процедуры Перевода обязательств и Перевод Обеспечения с Участника клиринга – реципиента взимается плата в размере, установленном приложением № 2 к Правилам клиринга.

Порядок исполнения обязательства Участника клиринга – реципиента по внесению платы за осуществление процедуры Перевода обязательств и Перевода Обеспечения определен в статье 25 Правил клиринга.

Статья 28. Порядок действий в случае включения Участника клиринга в перечень организаций, в отношении которых имеются сведения об их причастности к экстремистской деятельности или терроризму

28.1. В дату включения Участника клиринга в перечень организаций, указанных в подпункте 11.8.10 Правил клиринга (далее – Перечень), Клиринговый центр незамедлительно:

- блокирует (замораживает) операции с денежными средствами / драгоценными металлами, учитываемыми в качестве Обеспечения, Обеспечения под стресс и взноса в Гарантийный фонд Участника клиринга, и иные операции такого Участника клиринга, предусмотренные Правилами клиринга;
- прекращает допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию;
- уведомляет Биржу о необходимости установления запрета на подачу Участниками торгов заявок на заключение Сделок, стороной по которым будет являться Участник клиринга, и о необходимости снятия таких зарегистрированных заявок.

28.2. В дату включения Участника клиринга в Перечень обязательства такого Участника клиринга по Сделкам прекращаются полностью возникновением нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга, рассчитываемого в российских рублях как сумма с учетом знака:

- по каждой иностранной валюте / драгоценному металлу суммы (с учетом знака) Нетто-обязательств / Нетто-требований в соответствующей валюте / соответствующем драгоценном металле Участника клиринга по всем Расчетным кодам и всем Датам исполнения, учитываемых на дату включения Участника клиринга в Перечень, пересчитанной в российские рубли по Центральному курсу соответствующей иностранной валюты / драгоценного металла, установленному Клиринговым центром на дату включения Участника клиринга в перечень;
- суммы (с учетом знака) Нетто-обязательств / Нетто-требований в российских рублях Участника клиринга по всем Расчетным кодам и всем Датам исполнения, учитываемых на дату включения Участника клиринга в Перечень.

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

28.3. Клиринговый центр вправе в порядке, предусмотренном статьей 24 Правил клиринга, использовать средства Гарантийного фонда, за исключением средств Участника клиринга, включенного в Перечень, для исполнения нетто-обязательства Участника клиринга, рассчитанного в порядке, предусмотренном пунктом 28.2 Правил клиринга.

28.4. После исключения Участника клиринга из Перечня:

28.4.1. в случае если для исполнения нетто-обязательства Участника клиринга, рассчитанного в порядке, предусмотренном пунктом 28.2 Правил клиринга, не были использованы средства Гарантийного фонда, и по Участнику клиринга

учитывается Обеспечение, Обеспечение под стресс и/или взнос в Гарантийный фонд, Клиринговый центр осуществляет действия, необходимые для исполнения указанного нетто-обязательства за счет указанных средств, полностью или частично, а в случае, если указанных средств недостаточно, - направляет Участнику клиринга уведомление с требованием о погашении указанного нетто-обязательства в неисполненной части;

28.4.2. в случае если для исполнения нетто-обязательства Участника клиринга, рассчитанного в порядке, предусмотренном пунктом 28.2 Правил клиринга, были использованы средства Гарантийного фонда, и по Участнику клиринга учитывается Обеспечение, Обеспечение под стресс и/или взнос в Гарантийный фонд, Клиринговый центр осуществляет действия, необходимые для возмещения средств Гарантийного фонда за счет указанных средств, полностью или частично, а в случае, если указанных средств недостаточно, - направляет Участнику клиринга уведомление с требованием о возмещении средств Гарантийного фонда.

Статья 29. Порядок урегулирования обязательств в случае прекращения допуска к клиринговому обслуживанию

29.1. В случае отзыва (аннулирования) Банком России у Участника клиринга – кредитной организации лицензии на осуществление банковских операций, допуск к клиринговому обслуживанию и клиринговое обслуживание 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 29.6 Правил клиринга.

29.1.1. 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 Банком России на его сайте в сети Интернет информация о решении Банка России об отзыве (аннулировании) выданной Участнику клиринга - кредитной организации лицензии на осуществление банковских операций и/или направленное Банком России по электронному адресу Клирингового центра электронное сообщение, содержащее информацию об отзыве (аннулировании) у Участника клиринга - кредитной организации лицензии на осуществление банковских операций.

29.1.2. В случае отзыва (аннулирования) лицензии на осуществление банковских операций у Участника клиринга – кредитной организации, обязательства по Сделкам, стороной по которым является Участник клиринга - кредитная организация, заключенным до даты отзыва (аннулирования) такой лицензии, прекращаются полностью в Расчетный день, предшествующий 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 29.6 Правил клиринга.

29.1.3. В случае отзыва (аннулирования) лицензии на осуществление банковских операций

у Участника клиринга – кредитной организации, Сделки, стороной по которым является Участник клиринга - кредитная организация, заключенные в дату отзыва (аннулирования) такой лицензии и (или) после нее, являются недействительными.

Клиринговый центр вправе предъявить к Участнику клиринга – кредитной организации требование о взыскании убытков, связанных с недействительностью указанных Сделок, а также неустоек (штрафов, пеней) и комиссионных вознаграждений, подлежащих уплате в соответствии с Правилами клиринга, в общем порядке, предусмотренном законодательством о несостоятельности (банкротстве).

29.1.4. Клиринговый центр заключает сделки в порядке, предусмотренном пунктом 15.8 Правил клиринга, и/или внебиржевые сделки с целью обеспечения равенства суммы обязательств и суммы требований Клирингового центра в иностранных валютах / драгоценных металлах по всем Датам исполнения и в порядке, предусмотренном пунктом 29.6 Правил клиринга, рассчитывает сумму нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга - кредитной организации.

29.1.5. Клиринговый центр направляет Участнику клиринга - кредитной организации, у которого отозвана (аннулирована) лицензия на осуществление банковских операций, уведомление о прекращении обязательств по Сделкам в течение 3 (трех) рабочих дней, следующих за датой отзыва (аннулирования) такой лицензии. Указанное уведомление также содержит информацию о рассчитанном в соответствии с пунктом 29.6 Правил клиринга нетто-обязательстве / нетто-требовании Участника клиринга – кредитной организации в отношении Клирингового центра.

Клиринговый центр также направляет такому Участнику клиринга - кредитной организации уведомление о прекращении действия Договора об оказании клиринговых услуг.

29.1.6. Возврат денежных средств Участнику клиринга – кредитной организации осуществляется Клиринговым центром не позднее 3 (трех) рабочих дней с даты прекращения Договора об оказании клиринговых услуг, российских рублей - на корреспондентский счет Участника клиринга – кредитной организации, открытый в Банке России, иностранной валюты - по реквизитам Счета для возврата в соответствующей валюте, зарегистрированного для основного Расчетного кода основного Идентификатора Участника клиринга, или по реквизитам, указанным в письме о возврате денежных средств, в случае если это письмо получено Клиринговым центром от уполномоченного органа Участника клиринга до момента перечисления Участнику клиринга денежных средств в соответствии с настоящим подпунктом Правил клиринга.

Совместно с письмом о возврате денежных средств Клиринговому центру должны быть предоставлены документы, подтверждающие полномочия указанного органа кредитной организации (если они ранее не были переданы Клиринговому центру).

Возврат денежных средств в российских рублях Участнику клиринга – кредитной организации осуществляется Клиринговым центром в сумме нетто-требования Участника клиринга, рассчитанного в порядке, предусмотренном пунктом 29.6 Правил клиринга, возврат денежных средств в иностранной валюте - в размере обязательств Клирингового центра по возврату Обеспечения / Обеспечения под стресс / взноса в Гарантийный фонд Участника клиринга в соответствующей валюте, оставшихся после определения нетто-обязательства / нетто-требования

Участника клиринга в порядке, предусмотренном пунктом 29.6 Правил клиринга.

Драгоценные металлы, оставшиеся после определения нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в порядке, предусмотренном пунктом 29.6 Правил клиринга, списываются со Счета обеспечения Участника клиринга без согласия Клирингового центра.

29.1.7. Клиринговый центр вправе предъявить к Участнику клиринга – кредитной организации требование о взыскании нетто-обязательства Участника клиринга, рассчитанного в порядке, предусмотренном пунктом 29.6 Правил клиринга, в общем порядке, предусмотренном законодательством о несостоятельности (банкротстве).

29.2. 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 и клиринговое обслуживание Участника клиринга - некредитной организации прекращается с даты назначения временной администрации или даты принятия компетентным судом решения о введении в отношении Участника клиринга одной из процедур банкротства, в зависимости от того, какая дата наступила ранее, а допуск к клиринговому обслуживанию и клиринговое обслуживание Нерезидента – некредитной организации прекращается со дня, в который Клиринговый центр узнал о назначении временной администрации или принятии арбитражным судом решения о введении в отношении Нерезидента – некредитной организации одной из процедур банкротства, за исключением расчета Клиринговым центром нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга – некредитной организации в соответствии с пунктом 29.7 / 29.8 Правил клиринга.

29.2.1. Подтверждением факта назначении временной администрации или принятия компетентным судом решения о введении в отношении Нерезидента – некредитной организации одной из процедур банкротства является письменное уведомление компетентного органа государства учреждения Нерезидента – некредитной организации, направленное Клиринговому центру (в том числе, посредством факсимильной связи), и/или размещенная компетентным органом государства учреждения Нерезидента – некредитной организации на сайте вышеуказанного компетентного органа в сети Интернет информация о назначении временной администрации или принятии компетентным судом решения о введении в отношении Нерезидента – некредитной организации одной из процедур банкротства.

29.2.2. 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, стороной по которым является Участник клиринга - некредитная организация, прекращаются полностью на дату прекращения допуска к клиринговому обслуживанию или в Расчетный день, предшествующий дате принятия арбитражным судом решения о признании Участника клиринга банкротом и об открытии конкурсного производства, в зависимости от того, какая из указанных дат наступила ранее.

В случае назначения временной администрации или принятия компетентным судом решения о введении в отношении Участника клиринга - Нерезидента – некредитной организации одной из процедур банкротства, обязательства по

Сделкам прекращаются полностью в дату прекращения допуска к клиринговому обслуживанию.

Указанные обязательства по Сделкам Участника клиринга – некредитной организации прекращаются возникновением нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга – некредитной организации, рассчитанных в соответствии с пунктом 29.7 Правил клиринга.

Указанные обязательства по Сделкам Участника клиринга – Нерезидента - некредитной организации прекращаются возникновением нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга – Нерезидента - некредитной организации, рассчитанных в соответствии с пунктом 29.8 Правил клиринга.

29.2.3. Клиринговый центр заключает сделки в порядке, предусмотренном пунктом 15.8 Правил клиринга, и/или внебиржевые сделки с целью обеспечения равенства суммы обязательств и суммы требований Клирингового центра в иностранных валютах / драгоценных металлах по всем Датам исполнения и в порядке, предусмотренном пунктом 29.7 или пунктом 29.8 Правил клиринга, рассчитывает сумму нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга - некредитной организации / Участника клиринга – Нерезидента - некредитной организации.

29.2.4. Клиринговый центр направляет такому Участнику клиринга – некредитной организации / Участнику клиринга – Нерезиденту – некредитной организации уведомление о прекращении обязательств по Сделкам в течение 3 (трех) рабочих дней, следующих за датой прекращения обязательств по указанным Сделкам. Указанное уведомление также содержит информацию о рассчитанной в соответствии с пунктом 29.7 / 29.8 Правил клиринга сумме нетто-обязательства или нетто-требования Участника клиринга в отношении Клирингового центра.

Клиринговый центр также направляет такому Участнику клиринга - некредитной организации / Участнику клиринга – Нерезиденту - некредитной организации уведомление о прекращении действия Договора об оказании клиринговых услуг.

29.2.5. Возврат денежных средств Участнику клиринга – некредитной организации / Участнику клиринга – Нерезиденту - некредитной организации осуществляется Клиринговым центром не позднее 3 (трех) рабочих дней с даты прекращения Договора об оказании клиринговых услуг по реквизитам Счета для возврата в соответствующей валюте, зарегистрированного для основного Расчетного кода основного Идентификатора Участника клиринга, или по реквизитам, указанным в письме о возврате денежных средств, в случае если это письмо получено Клиринговым центром от уполномоченного органа Участника клиринга до момента перечисления Участнику клиринга денежных средств в соответствии с настоящим подпунктом Правил клиринга.

Совместно с письмом о возврате денежных средств Клиринговому центру должны быть предоставлены документы, подтверждающие полномочия указанного органа Участника клиринга (если они ранее не были переданы Клиринговому центру).

Возврат денежных средств в российских рублях Участнику клиринга – некредитной организации / Участнику клиринга – Нерезиденту – некредитной организации осуществляется Клиринговым центром в сумме нетто-требования Участника клиринга, рассчитанного в порядке, предусмотренном пунктом 29.7 / 29.8 Правил клиринга, возврат денежных средств в иностранной валюте - в размере обязательств Клирингового центра по возврату Обеспечения / Обеспечения под стресс / взноса в Гарантийный фонд Участника клиринга в соответствующей

валюте, оставшихся после определения нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в порядке, предусмотренном пунктом 29.7 / 29.8 Правил клиринга.

Драгоценные металлы, оставшиеся после определения нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в порядке, предусмотренном пунктом 29.7 / 29.8 Правил клиринга, списываются со Счета обеспечения Участника клиринга без согласия Клирингового центра.

29.2.6. Клиринговый центр вправе предъявить к Участнику клиринга – некредитной организации / Участнику клиринга – Нерезиденту – некредитной организации требование о взыскании нетто-обязательства Участника клиринга, рассчитанного в порядке, предусмотренном пунктом 29.7 / 29.8 Правил клиринга, а также неустоек (штрафов, пеней), и комиссионных вознаграждений, подлежащих уплате в соответствии с Правилами клиринга и не учтенных при расчете нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга, в общем порядке, предусмотренном законодательством о несостоятельности (банкротстве).

29.3. 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, предусмотренные личным законом Банка-нерезидента, допуск к клиринговому обслуживанию и клиринговое обслуживание Участника клиринга – Банка-нерезидента прекращается со дня, когда Клиринговый центр узнал об отзыве (аннулировании) такого специального разрешения (лицензии или иного основания), за исключением расчета Клиринговым центром нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга – Банка-нерезидента в соответствии с пунктом 29.8 Правил клиринга.

В случае прекращения Международного соглашения для Российской Федерации либо для государства - стороны Международного соглашения, являющегося государством учреждения Участника-клиринга – Банка ЕврАзЭс, допуск к клиринговому обслуживанию и клиринговое обслуживание такого Участника клиринга – Банка ЕврАзЭс с прекращается со дня прекращения Международного соглашения для Российской Федерации либо для государства - стороны Международного соглашения, являющегося государством учреждения такого Участника-клиринга – Банка ЕврАзЭс.

29.3.1. 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.

29.3.2. В случае отзыва (аннулирования) специального разрешения (лицензии или иного

основания) компетентного органа государства учреждения Банка ЕврАзЭс, в соответствии с которым Банк ЕврАзЭс имеет право осуществлять банковские операции, предусмотренные личным законом Банка ЕврАзЭс, обязательства по Сделкам, стороной по которым является Участник клиринга - Банк ЕврАзЭс, прекращаются полностью на дату, в которую Клиринговый центр узнал об отзыве (аннулировании) компетентным органом государства учреждения Банка ЕврАзЭс соответствующего специального разрешения (лицензии или иного основания).

В случае прекращения Международного соглашения для Российской Федерации либо для государства - стороны Международного соглашения, являющегося государством учреждения Участника-клиринга – Банка ЕврАзЭс, обязательства по Сделкам, стороной по которым является Участник клиринга - Банк ЕврАзЭс, прекращаются полностью на дату прекращения Международного соглашения для Российской Федерации либо для государства - стороны Международного соглашения, являющегося государством учреждения такого Участника-клиринга – Банка ЕврАзЭс.

Указанные обязательства прекращаются возникновением нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга – Банка-нерезидента, рассчитанного в соответствии с пунктом 29.8 Правил клиринга.

29.3.3. Клиринговый центр заключает сделки в порядке, предусмотренном пунктом 15.8 Правил клиринга, и/или внебиржевые сделки с целью обеспечения равенства суммы обязательств и суммы требований Клирингового центра в иностранных валютах / драгоценных металлах по всем Датам исполнения и в порядке, предусмотренном пунктом 29.8 Правил клиринга, рассчитывает сумму нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга - Банка-нерезидента.

29.3.4. Клиринговый центр направляет такому Участнику клиринга – Банку-нерезиденту уведомление о прекращении обязательств по Сделкам не позднее третьего рабочего дня, следующего за датой прекращения обязательств по Сделкам. Указанное уведомление также содержит информацию о рассчитанном в соответствии с пунктом 29.8 Правил клиринга нетто-обязательстве / нетто-требовании Участника клиринга – Банка-нерезидента в отношении Клирингового центра.

Клиринговый центр также направляет такому Участнику клиринга - Банку-нерезиденту уведомление о прекращении действия Договора об оказании клиринговых услуг.

29.3.5. Возврат денежных средств Участнику клиринга – Банку-нерезиденту осуществляется Клиринговым центром не позднее 3 (трех) рабочих дней с даты прекращения Договора об оказании клиринговых услуг по реквизитам Счета для возврата в соответствующей валюте, зарегистрированного для основного Расчетного кода основного Идентификатора Участника клиринга, или по реквизитам, указанным в письме о возврате денежных средств, в случае если это письмо получено Клиринговым центром от уполномоченного (в соответствии с личным законом Банка-нерезидента) органа Банка-нерезидента до момента перечисления Участнику клиринга денежных средств в соответствии с настоящим подпунктом Правил клиринга.

Совместно с письмом о возврате денежных средств Клиринговому центру должны быть предоставлены документы, подтверждающие полномочия указанного органа Банка-нерезидента (если они ранее не были переданы Клиринговому центру).

Возврат денежных средств в российских рублях Участнику клиринга – Банку-

нерезиденту осуществляется Клиринговым центром в сумме нетто-требования Участника клиринга, рассчитанного в порядке, предусмотренном пунктом 29.8 Правил клиринга, возврат денежных средств в иностранной валюте - в размере обязательств Клирингового центра по возврату Обеспечения / Обеспечения под стресс / взноса в Гарантийный фонд Участника клиринга в соответствующей валюте, оставшихся после определения нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в порядке, предусмотренном пунктом 29.8 Правил клиринга.

Драгоценные металлы, оставшиеся после определения нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в порядке, предусмотренном пунктом 29.8 Правил клиринга, списываются со Счета обеспечения Участника клиринга без согласия Клирингового центра.

29.3.6. 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 29.8 Правил клиринга, в общем порядке, предусмотренном законодательством о несостоятельности (банкротстве).

29.4. В случае прекращения международного договора, в соответствии с которым учреждена Международная организация, для Российской Федерации либо со дня принятия уполномоченными лицами сторон указанного международного договора решения 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 уполномоченными лицами сторон указанного международного договора решения о прекращении деятельности Международной организации.

29.4.1. После прекращения обязательств по Сделкам, стороной по которым является данный Участник клиринга, заключенным до момента прекращения допуска к клиринговому обслуживанию Участника клиринга, Клиринговый центр в течение 3 (трех) рабочих дней после получения письма о возврате денежных средств от уполномоченного органа Международной организации, содержащего платежные реквизиты, осуществляет возврат денежных средств Участнику клиринга – Международной организации, но не позднее 3 (трех) рабочих дней с даты прекращения Договора об оказании клиринговых услуг, и направляет такому Участнику клиринга – Международной организации уведомление о прекращении действия Договора об оказании клиринговых услуг.

29.4.2. После прекращения допуска к клиринговому обслуживанию Участника клиринга - Международной организации драгоценные металлы списываются со Счета обеспечения Участника клиринга без согласия Клирингового центра.

29.5. В случае принятия федерального закона о ликвидации Государственной корпорации, допуск к клиринговому обслуживанию Государственной корпорации прекращается.

29.5.1. Если иное не предусмотрено федеральным законом о ликвидации Государственной корпорации, после прекращения обязательств по Сделкам, стороной по которым является данный Участник клиринга, заключенным до момента прекращения допуска к клиринговому обслуживанию Участника клиринга, Клиринговый центр в

течение 3 (трех) рабочих дней после получения письма о возврате денежных средств от уполномоченного органа Государственной корпорации, содержащего платежные реквизиты, осуществляет возврат денежных средств Участнику клиринга – Государственной корпорации, но не позднее 3 (трех) рабочих дней с даты прекращения Договора об оказании клиринговых услуг, и направляет такому Участнику клиринга – Государственной корпорации уведомление о прекращении действия Договора об оказании клиринговых услуг.

29.5.2. После прекращения допуска к клиринговому обслуживанию Участника клиринга - Государственной корпорации драгоценные металлы списываются со Счета обеспечения Участника клиринга без согласия Клирингового центра.

29.6. В случае отзыва (аннулирования) Банком России у Участника клиринга – кредитной организации лицензии на осуществление банковских операций Клиринговый центр рассчитывает размер нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в российских рублях в порядке, предусмотренном подпунктами 29.6.1 и 29.6.2 Правил клиринга.

29.6.1. Клиринговый центр рассчитывает величину, равную сумме с учетом знака:

а) величины SUM, рассчитанной по формуле:

$SUM = \sum_i (POS_RUB_i + POS_i \times C_i)$, где

POS_RUB_i - сумма значений (с учетом знака) Нетто-обязательств / Нетто-требований Участника клиринга в российских рублях по Сделкам с i-ой иностранной валютой / драгоценным металлом по всем Расчетным кодам и Датам исполнения, учитываемых на конец Расчетного дня, предшествующего дате отзыва (аннулирования) у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций;

POS_i – сумма значений (с учетом знака) Нетто-обязательств / Нетто-требований Участника клиринга в i-ой иностранной валюте / драгоценном металле по всем Расчетным кодам и Датам исполнения, учитываемых на конец Расчетного дня, предшествующего дате отзыва (аннулирования) у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций;

C_i – курс сделки / средневзвешенный курс сделок, заключенной / заключенных Клиринговым центром в соответствии с пунктом 29.1.4 Правил клиринга с i-ой иностранной валютой / драгоценным металлом (в российских рублях);

$\sum_i$ – сумма по иностранным валютам / драгоценным металлам,

и

б) значения (с учетом знака) обязательства / требования Участника клиринга в российских рублях по возврату Гарантийных переводов, рассчитанного на Расчетный день, предшествующий дате отзыва (аннулирования) у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций, и

в) Задолженности (со знаком «минус») Участника клиринга в российских рублях, возникшей до даты отзыва (аннулирования) у Участника клиринга указанной лицензии, и

г) обязательств Участника клиринга по уплате вариационной маржи, Гарантийных переводов, исполненных в дату отзыва (аннулирования) у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций

(учитываются со знаком «плюс»), и

д) требований Участников клиринга по получению вариационной маржи, Гарантийных переводов, исполненных в дату отзыва (аннулирования) у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций.

Если величина, рассчитанная в соответствии с настоящим подпунктом Правил клиринга, положительная, это означает наличие нетто-требования Участника клиринга по отношению к Клиринговому центру, при этом расчет нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга прекращается, если отрицательная – расчет нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга продолжается в соответствии с подпунктом 29.6.2 Правил клиринга.

29.6.2. Клиринговый центр рассчитывает сумму с учетом знака отрицательной величины, рассчитанной в соответствии с подпунктом 29.6.1 Правил клиринга, и следующих величин, учитываемых на конец Расчетного дня, предшествующего дате отзыва (аннулирования) у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций, в следующей очередности и размере:

1) величины обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга его Обеспечения в российских рублях в полном размере (учитывается со знаком «плюс»);

2) величины обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга его Обеспечения под стресс в российских рублях в размере, равном минимальной из двух величин: (1) величине указанного обязательства или (2) величине текущего размера абсолютного значения отрицательной величины, рассчитанной в соответствии с настоящим подпунктом Правил клиринга (учитывается со знаком «плюс»);

3) величины обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга его взноса в Гарантийный фонд в российских рублях в размере, равном минимальной из двух величин: (1) величине указанного обязательства или (2) величине текущего размера абсолютного значения отрицательной величины, рассчитанной в соответствии с настоящим подпунктом Правил клиринга (учитывается со знаком «плюс»);

4) величины обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга его Обеспечения в иностранной валюте в размере, равном минимальной из двух величин: (1) величине указанного обязательства, пересчитанной в российские рубли по курсу соответствующей иностранной валюты, установленному Банком России на день отзыва у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций, или (2) величине текущего размера абсолютного значения отрицательной величины, рассчитанной в соответствии с настоящим подпунктом Правил клиринг, (учитывается со знаком «плюс»);

5) величины обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга его Обеспечения под стресс в иностранной валюте в размере, равном минимальной из двух величин: (1) величине указанного обязательства, пересчитанной в российские рубли по курсу соответствующей иностранной валюты, установленному Банком России на день отзыва у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций, или (2) величине текущего размера абсолютного значения отрицательной величины, рассчитанной в соответствии с настоящим подпунктом Правил

клиринга (учитывается со знаком «плюс»);

6) величины обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга его взноса в Гарантийный фонд в иностранной валюте в размере, равном минимальной из двух величин: (1) величине указанного обязательства, пересчитанной в российские рубли по курсу соответствующей иностранной валюты, установленному Банком России на день отзыва у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций, или (2) величине текущего размера абсолютного значения отрицательной величины, рассчитанной в соответствии с настоящим подпунктом Правил клиринга (учитывается со знаком «плюс»);

7) величины обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга его Обеспечения под стресс в ценных бумагах в размере, равном минимальной из двух величин: (1) величине указанного обязательства, пересчитанной в российские рубли по Расчетной цене соответствующей ценной бумаги, установленной Клиринговым центром на день отзыва у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций, или (2) величине текущего размера абсолютного значения отрицательной величины, рассчитанной в соответствии с настоящим подпунктом Правил клиринга (учитывается со знаком «плюс»);

8) величины обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга его взноса в Гарантийный фонд в ценных бумагах в размере, равном минимальной из двух величин: (1) величине указанного обязательства, пересчитанной в российские рубли по Расчетной цене соответствующей ценной бумаги, установленной Клиринговым центром на день отзыва у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций, или (2) величине текущего размера абсолютного значения отрицательной величины, рассчитанной в соответствии с настоящим подпунктом Правил клиринга (учитывается со знаком «плюс»);

9) величины обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга его Обеспечения в драгоценных металлах в размере, равном минимальной из двух величин: (1) величине указанного обязательства, пересчитанной в российские рубли по Центральному курсу соответствующего драгоценного металла, установленному Клиринговым центром на день отзыва у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций, или (2) величине текущего размера абсолютного значения отрицательной величины, рассчитанной в соответствии с настоящим подпунктом Правил клиринга (учитывается со знаком «плюс»).

Расчет нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга прекращается, если в результате последовательного выполнения любого из действий, предусмотренных пунктами 1 - 9 настоящего подпункта Правил клиринга, полученное значение является неотрицательной величиной.

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

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

части, равной соответствующей величине в российских рублях, включенной в расчет нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга, пересчитанной в иностранную валюту по курсу, установленному Банком России на день отзыва у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций, обязательство в ценных бумагах прекращается в части, равной соответствующей величине в российских рублях, включенной в расчет нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга, пересчитанной в ценные бумаги по Расчетной цене соответствующей ценной бумаги, установленной Клиринговым центром на день отзыва у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций, а обязательство в драгоценных металлах прекращается в части, равной соответствующей величине в российских рублях, включенной в расчет нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга, пересчитанной в драгоценные металлы по Центральному курсу соответствующего драгоценного металла, установленному Клиринговым центром на день отзыва у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций.

29.7. В случае назначения временной администрации или принятия арбитражным судом решения о введении в отношении Участника клиринга - некредитной организации одной из процедур банкротства (за исключением конкурсного производства), Клиринговый центр рассчитывает размер нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в российских рублях по состоянию на конец дня, в который назначена временная администрация или принято арбитражным судом решение о введении в отношении Участника клиринга - некредитной организации одной из процедур банкротства (за исключением конкурсного производства), в зависимости от того, какая из указанных дат наступила ранее, в порядке, аналогичном предусмотренному пунктами а) - д) подпункта 29.6.1 и подпунктом 29.6.2 Правил клиринга. В случае назначения временной администрации при расчете размера нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга учитываются комиссионные вознаграждения, а также неустойки (штрафы, пени), подлежащие уплате Участником клиринга в соответствии с Правилами клиринга.

29.7.1. В случае принятия арбитражным судом решения о признании Участника клиринга – некредитной организации банкротом и об открытии конкурсного производства, Клиринговый центр рассчитывает размер нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в российских рублях по состоянию на конец Расчетного дня, предшествующего дате принятия арбитражным судом решения о признании Участника клиринга банкротом и об открытии конкурсного производства, в порядке, аналогичном предусмотренному пунктами а) - д) подпункта 29.6.1 и подпунктом 29.6.2 Правил клиринга.

29.8. В случае отзыва (аннулирования) специального разрешения (лицензии или иного основания), выданного компетентным органом государства учреждения Банка-нерезидента, на основании которого Банк-нерезидент имеет право осуществлять банковские операции, предусмотренные личным законом Банка-нерезидента, или в случае назначения временной администрации или принятия компетентным судом решения о введении в отношении Нерезидента – некредитной организации одной из процедур банкротства, Клиринговый центр рассчитывает размер нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в российских рублях по состоянию 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 / по состоянию на конец дня, в который Клиринговый центр узнал о назначении временной администрации или принятии арбитражным судом решения о введении в отношении Нерезидента – некредитной организации одной из процедур банкротства, в порядке, аналогичном предусмотренному пунктами а) - д) подпункта 29.6.1 и подпунктом 29.6.2 Правил клиринга, при этом при расчете размера нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга учитываются комиссионные вознаграждения, а также неустойки (штрафы, пени), подлежащие уплате Участником клиринга в соответствии с Правилами клиринга.

29.9. 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 29.10 Правил клиринга.

29.9.1. 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).

29.10. 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:

а) по каждой иностранной валюте суммы (с учетом знака) Нетто-обязательств / Нетто-требований в иностранной валюте по всем Расчетным кодам и Датам исполнения, учитываемых на конец дня, предшествующего дате отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций, пересчитанной в российские рубли по курсу, установленному Банком России на день отзыва у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций;

б) по каждому драгоценному металлу суммы (с учетом знака) Нетто-обязательств / Нетто-требований в драгоценном металле по всем Расчетным кодам и Датам исполнения, учитываемых на конец дня, предшествующего дате отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций, пересчитанной в российские рубли по Центральному курсу соответствующего драгоценного металла, установленному Клиринговым центром на день отзыва у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций;

в) суммы (с учетом знака) Нетто-обязательств / Нетто-требований Участника клиринга в российских рублях по всем Расчетным кодам и Датам исполнения,

учитываемых на конец дня, предшествующего дате отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций;

г) Обеспечения Участника клиринга в российских рублях (учитывается со знаком «плюс»);

д) 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»);

е) неисполненных Маржинальных требований, возникших до даты отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций (учитываются со знаком «минус»);

ж) Обеспечения под стресс Участника клиринга в российских рублях (учитывается со знаком «плюс»);

з) Обеспечения под стресс 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»);

и) Обеспечения под стресс Участника клиринга в ценных бумагах, пересчитанного в российские рубли по Расчетной цене соответствующей ценной бумаги, установленной Клиринговым центром на день отзыва у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций (учитывается со знаком «плюс»);

к) взноса Участника клиринга в Гарантийный фонд в российских рублях (учитывается со знаком «плюс»);

л) взноса Участника клиринга в Гарантийный фонд 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»);

м) взноса Участника клиринга в Гарантийный фонд в ценных бумагах, пересчитанного в российские рубли по Расчетной цене соответствующей ценной бумаги, установленной Клиринговым центром на день отзыва у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций (учитывается со знаком «плюс»);

н) значения (с учетом знака) обязательства / требования Участника клиринга в российских рублях по возврату Гарантийных переводов, рассчитанного на дату, предшествующую дате отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций;

о) Задолженности (со знаком «минус») Участника клиринга в российских рублях, возникшей до даты отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций;

п) обязательств Участника клиринга по уплате вариационной маржи, Гарантийных переводов, исполненных в дату отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций (учитываются со знаком «плюс»);

р) требований Участников клиринга по получению вариационной маржи, Гарантийных переводов, исполненных в дату 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.

29.11. Информация о размере нетто-обязательства / нетто-требования Клирингового центра в российских рублях в отношении Участника клиринга, определенных в соответствии с пунктом 29.10 Правил клиринга направляется Клиринговым центром Участнику клиринга.

Статья 30. Взаимодействие с Биржей при возникновении обстоятельств, которые могут повлиять на возможность проведения торгов

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

Статья 31. Чрезвычайные ситуации

31.1. Чрезвычайной ситуацией может быть признана ситуация, связанная с наступлением обстоятельств, препятствующих клиринговому обслуживанию Участников клиринга и/или исполнению Клиринговым центром своих обязательств перед Участниками клиринга по возврату им денежных средств, 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 Временным 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, другие политические осложнения,

как в Российской Федерации, так и в иных государствах;

- решения органов государственной власти, иных органов, учреждений и организаций Российской Федерации и/или иных государств;
- пожары или иные несчастные случаи, разрушения или значительные повреждения в занимаемых Клиринговым центром помещениях;
- любые иные обстоятельства, которые создают или могут создать угрозу жизни или здоровью работников Клирингового центра.

31.2. Признание ситуации чрезвычайной осуществляется по решению Клирингового центра.

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

- извещает Биржу 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 Биржей, не осуществляет клиринговое обслуживание Участников клиринга.

31.4. В качестве мер по урегулированию чрезвычайной ситуации по согласованию с Банком России и Биржей Клиринговым центром могут быть приняты следующие решения:

- об утрате силы Биржевых свидетельств, полученных Участниками клиринга в день возникновения чрезвычайной ситуации;
- об изменении способа, порядка и Даты исполнения обязательств Участниками клиринга и/или Клиринговым центром, в том числе в соответствии с пунктом 31.5 Правил клиринга;
- об осуществлении иных действий, направленных на урегулирование чрезвычайной ситуации.

31.5. В случае признания ситуации чрезвычайной в связи с обстоятельствами, предусмотренными пунктом 31.1 Правил клиринга, Клиринговый центр вправе принять решение о том, что Дата исполнения обязательств по Сделкам считается наступившей в Расчетный день, установленный решением Клирингового центра по согласованию с Банком России, и об исполнении обязательств по указанным Сделкам в порядке, установленном настоящим пунктом Правил клиринга.

31.5.1. Обязательства по Сделкам включаются в клиринговый пул, формируемый в Расчетный день, установленный решением Клирингового центра, в соответствии со статьей V-III Правил клиринга.

31.5.2. В случае наличия Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований Участника клиринга в иностранной валюте, между Клиринговым центром и

Участниками клиринга, в том числе без подачи заявок, заключаются сделки купли-продажи иностранной валюты с Датой исполнения в Расчетный день, установленный решением Клирингового центра в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга, таким образом, чтобы по указанной сделке купли-продажи иностранной валюты:

- в случае наличия у Участника клиринга Итогового нетто-обязательства в иностранной валюте, у Участника клиринга возникли требования в соответствующей иностранной валюте, противоположные указанному Итоговому нетто-обязательству Участника клиринга в объеме, равном указанному Итоговому нетто-обязательству Участника клиринга;
- в случае наличия у Участника клиринга Итогового нетто-требования в иностранной валюте, у Участника клиринга возникли обязательства в соответствующей иностранной валюте, противоположные указанному Итоговому нетто-требованию Участника клиринга в иностранной валюте в объеме, равном указанному Итоговому нетто-требованию Участника клиринга.

Курс сделок купли-продажи иностранной валюты, заключаемых в соответствии с настоящим подпунктом Правил клиринга, устанавливается решением Клирингового центра по согласованию с Банком России.

31.5.3. Обязательства по Сделкам, заключенным в соответствии с подпунктом 31.5.2 Правил клиринга, включаются в клиринговый пул, формируемый в Расчетный день, установленный решением Клирингового центра, и прекращаются в указанном клиринговом пуле в соответствии с Правилами клиринга.

31.6. При принятии решений по урегулированию чрезвычайных ситуаций, Клиринговый центр по согласованию с Биржей вправе:

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

31.7. О мерах, предпринятых по решению Клирингового центра в целях урегулирования чрезвычайной ситуации, Банк России, Участники клиринга и Биржа оповещаются имеющимися доступными средствами связи не позднее дня принятия данных мер.

31.8. 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 31.1 Правил клиринга.

Статья 32. Порядок разрешения споров

32.1. 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 (за исключением споров и разногласий, стороной по которым является любая из компаний, входящих в Группу «Московская Биржа»).

32.2. Все споры и разногласия, возникающие между Участником клиринга и любой компанией, входящей в Группу «Московская Биржа» в связи с применением, нарушением, толкованием Правил клиринга, исполнением обязательств, вытекающих из Правил клиринга, признанием недействительными Правил клиринга или их части подлежат рассмотрению в Третейском суде НАУФОР в соответствии с его регламентом, действующим на момент подачи искового заявления.

32.3. Решения Арбитражной комиссии при ОАО Московская Биржа / Третейского суда НАУФОР являются окончательными и обязательными для исполнения. Неисполненное добровольно решение Арбитражной комиссии при ОАО Московская Биржа / Третейского суда НАУФОР 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 и рынке драгоценных металлов

Договор об оказании клиринговых услуг №_____

город Москва **«___» _____20__ года**

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

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

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

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

Тарифы Клирингового центра на валютном рынке и рынке драгоценных металлов

№ п/п	Наименование услуги	Тариф (НДС не облагается)
1.	**Комиссионное вознаграждеие за предоставление отчетов и иной информации по итогам клиринга и иные клиринговые услуги**	
1.1.	Предоставление на бумажном носителе Участнику клиринга по запросу копии отчета по итогам клиринга, предусмотренного Правилами клиринга, за дату, отстоящую от даты получения запроса на срок:	В российских рублях за один лист отчета, но не менее 500 рублей и не более 3000 рублей за один отчет
	а) менее месяца;	100
	б) от одного месяца до одного года;	150
	в) свыше одного года.	200
1.2.	Предоставление в электронном виде Участнику клиринга по запросу копии отчета по итогам клиринга, предусмотренного Правилами клиринга, за дату, отстоящую от даты получения запроса на срок:	В российских рублях за один отчет
	а) менее месяца;	50
	б) от одного месяца до одного года;	100
	в) свыше одного года.	150
1.3.	Предоставление на бумажном носителе по запросу Участника клиринга отчета по итогам клиринга в нестандартной форме.	1000 рублей за один лист отчета, но не более 10000 рублей за один отчет
1.4.	Предоставление по запросу Участника клиринга подтверждений для аудиторов Участника клиринга остатков обеспечения и неисполненных обязательств Участника клиринга.	2000 рублей за каждое подтверждение
1.5.	Ручная обработка входящего платежного документа в целях учета в Клиринговой системе денежных средств, перечисленных в качестве обеспечения или взноса в Гарантийный фонд, в случае несоблюдения Участником клиринга (клиентом Участника клиринга) правил заполнения назначения платежа.	100 рублей за каждый платежный документ
1.6.	Предоставление по запросу Участника клиринга реквизитов платежного документа по возврату Участнику	250 рублей за каждый запрос

	клиринга денежных средств, учитываемых в качестве обеспечения или взноса в Гарантийный фонд.	
1.7.	Отмена подготовленных к исполнению платежных документов на возврат Участнику клиринга денежных средств, учитываемых в качестве обеспечения или взноса в Гарантийный фонд, по запросу Участника клиринга (при наличии возможности).	250 рублей за каждый платежный документ

№ п/п	**Наименование услуги**	**Тариф (НДС не облагается)**
2.	**Комиссионное вознаграждение за клиринговое обслуживание по сделкам спот**	
2.1.	Оборотная часть комиссионного вознаграждения за клиринговое обслуживание по сделкам спот, за исключением сделок спот, заключенных на основании заявок, соответствующих условиям п. 2.2.	В процентах от объема каждой сделки в российских рублях или в долларах США[1], взимается в дату заключения сделки, но не менее 0,43 рубля
	SPT_0	0,0006375
	SPT_1000	0,0004250
	SPT_2000	0,0003400
2.2.	Оборотная часть комиссионного вознаграждения за клиринговое обслуживание по сделке спот, заключенной на основании заявки, не являющейся заявкой типа «скрыть количество», объем которой не менее 10 000 лотов и номер которой меньше номера допустимой встречной заявки (при регистрации которой были заключены Сделки в соответствии с п. 15.7 Правил клиринга).	В процентах от объема каждой сделки в российских рублях или в долларах США[1], взимается в дату заключения сделки
	SPT_0	0,0005525
	SPT_1000	0,0003400
	SPT_2000	0,0002550
2.3.	Постоянная часть комиссионного вознаграждения по сделкам спот	В российских рублях, по одному Идентификатору 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 торгах Биржи
	SPT_0	0
	SPT_1000	425 000
	SPT_2000	850 000
2.4.	Минимальное ежемесячное комиссионное вознаграждение за клиринговое обслуживание для Участника клиринга, в отношении	В российских рублях, по одному Идентификатору за каждый календарный месяц, взимается в последний рабочий день месяца[2] с Участника клиринга, имеющего доступ к клиринговому обслуживанию в течение одного и более дней в календарном месяце,

	которого действует тарифный план SPT_0[3]	вне зависимости от факта подачи заявок, заключения и/или исполнения Участником клиринга Сделок купли-продажи иностранной валюты на торгах Биржи
		8 500

№ п/п	Наименование услуги	Тариф (НДС не облагается)						
3.	**Комиссионное вознаграждение за клиринговое обслуживание по сделкам своп, своп контрактам и фьючерсным контрактам**							
3.1.	Оборотная часть комиссионного вознаграждения по сделкам своп и своп контрактам	В процентах от объема первой части сделки своп в российских рублях или в долларах США[1], взимается в дату заключения сделки, но не менее 0,43 рубля						
		по сделкам своп	по своп контрактам со сроком исполнения[4]					
			7 дней	14 дней	1, 2 месяца	3 месяца	6 месяцев	9 месяцев	12 месяцев
	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 фьючерсным контрактам	В процентах от объема сделки в российских рублях или в долларах США[1], взимается в дату заключения сделки, но не менее 0,43 рубля						
	со сроком исполнения[5]:	от 2 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 Идентификатору 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 торгах Биржи						
	SWP_0	0						
	SWP_300	127 500						
	SWP_600	255 000						
	SWP_1000	425 000						
	SWP_1500	637 500						
	SWP_3500	1 487 500						

№ п/п	Наименование услуги	Тариф (НДС не облагается)
4.	**Комиссионное вознаграждение за клиринговое обслуживание по сделкам с драгоценными металлами**	

<table>
<tr><td rowspan="2">4.1.</td><td>Оборотная часть комиссионного вознаграждения по сделкам спот</td><td colspan="6">В процентах от объема каждой Сделки в российских рублях, но не менее 0,43 рубля, взимается в дату заключения Сделки</td></tr>
<tr><td></td><td colspan="6">0,006375</td></tr>
<tr><td rowspan="3">4.2.</td><td rowspan="3">Оборотная часть комиссионного вознаграждения по сделкам своп и своп контрактам с драгоценным металлом</td><td colspan="6">В процентах от объема первой части сделки своп / своп контракта в российских рублях, но не менее 0,43 рубля, взимается в дату заключения Сделки</td></tr>
<tr><td rowspan="2">по сделкам своп</td><td colspan="5">по своп контрактам со сроком исполнения[4]:</td></tr>
<tr><td>7 дней</td><td colspan="2">1 месяц</td><td>6 месяцев</td></tr>
<tr><td></td><td>0,0002125</td><td colspan="2">0,0008500</td><td>0,0021250</td></tr>
<tr><td rowspan="3">4.3.</td><td rowspan="3">Оборотная часть комиссионного вознаграждения по фьючерсным контрактам</td><td colspan="6">В процентах от объема Сделки в российских рублях, но не менее 0,43 рубля, взимается в дату заключения Сделки</td></tr>
<tr><td>со сроком исполнения[5]:</td><td>от 2 до 6 дней</td><td>от 7 до 29 дней</td><td>от 30 до 89 дней</td><td>от 90 до 179 дней</td><td>от 180 до 269 дней</td><td>от 270 до 364 дней</td></tr>
<tr><td></td><td>0,002125</td><td>0,00425</td><td>0,0085</td><td>0,01275</td><td>0,02125</td><td>0,031875</td></tr>
</table>

№ п/п	Наименование услуги	Тариф (НДС не облагается)
5.	**Комиссионное вознаграждение за процедуру Перевода обязательств и Перевода Обеспечения**	В российских рублях, за одну процедуру, взимается с Участника клиринга – реципиента, к которому были переведены обязательства и Обеспечение
		3 000 руб.
6.	**Комиссионное вознаграждение за учет Обеспечения и Обеспечения под стресс в иностранной валюте[6]**	В российских рублях, по каждому Идентификатру Участника клиринга, взимается с Участника клиринга в первый Рабочий день календарного месяца, следующего за месяцем оказания услуг
	в долларах США и евро	Положительная разность между суммой 0,1% годовых от расчетных сумм Обеспечения и Обеспечения под стресс[7], определенных на каждый календарный день месяца оказания услуг, и суммой всего комиссионного вознаграждения за клиринговое обслуживание, подлежащего уплате Участником клиринга в месяц оказания услуг

[1] от объема каждой Сделки в российских рублях, входящей в Сделку с инструментом Бивалютная корзина; от объема каждой Сделки в долларах США - для сделок купли-продажи евро за доллары США.

[2] В случае расторжения Договора об оказании клиринговых услуг в течение месяца, Минимальное ежемесячное комиссионное вознаграждение за клиринговое обслуживание взимается в последний рабочий день действия указанного договора.

[3] Тариф не применяется для Участников клиринга - Банков ЕврАзЭс**,** являющиеся центральными (национальными) банками государств-членов ЕврАзЭс.
Тариф не применяется к Участнику клиринга – кредитной организации, у которого Банком России отозвана (аннулирована) лицензия на осуществление банковских операций, и к Участнику клиринга – некредитной организации в случае введения в отношении Участника клиринга одной из процедур банкротства, в месяц отзыва (аннулирования) лицензии / введения одной из процедур банкротства.

[4] под сроком исполнения сделки своп и своп контракта понимается количество календарных дней от Даты исполнения обязательств по первой части сделки своп и своп контракта, не включая эту дату, до Даты исполнения обязательств по второй части сделки своп и своп контракта, включая эту дату, указанных при подаче заявки на заключение Сделки.

[5] под сроком исполнения сделки купли-продажи (за исключением сделок своп) и фьючерсного контракта 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.

[6] Тариф не применяется к Участнику клиринга – кредитной организации, у которого Банком России отозвана (аннулирована) лицензия на осуществление банковских операций, и к Участнику клиринга – некредитной организации в случае введения в отношении Участника клиринга одной из процедур банкротства, в месяц отзыва (аннулирования) лицензии / введения одной из процедур банкротства.
Тариф применяется с даты, установленной решением Клирингового центра.

[7] расчетная сумма Обеспечения и Обеспечения под стресс на каждый календарный день месяца оказания услуг определяется как сумма по всем Расчетным кодам Обеспечения Участника клиринга в соответствующей иностранной валюте, учитываемого по каждому Расчетному коду по состоянию на конец каждого дня, уменьшенная на сумму обязательств по передаче иностранной валюты по Сделкам с Датой исполнения Т+1, Т+2, Т+3 (где Т – дата, за которую осуществляется расчет), учитываемых по Расчетному коду, и Обеспечения под стресс Участника клиринга в соответствующей валюте, пересчитанная в российские рубли по курсу, установленному Банком России на рабочий день, следующий за датой расчета. Если календарный день месяца, на который производится расчет, не является Рабочим днем, при определении расчетной суммы Обеспечения и Обеспечения под стресс на такой день используется информация по состоянию на предыдущий Рабочий день. Если расчетная сумма Обеспечения и Обеспечения под стресс за определенный день по определенному Расчетному коду меньше нуля, расчетная сумма Обеспечения и Обеспечения под стресс за этот день по этому Расчетному коду принимается равной нулю.

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

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.

6) 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 и рынке драгоценных металлов

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

I. Список документов, предоставляемых Резидентом

1) Анкета Участника клиринга, являющаяся приложением к Порядку предоставления информации и отчетности и размещенная на сайте Клирингового центра в форме электронного документа (в случае если юридическое лицо не является Участником СЭД, то в форме электронного сообщения с подтверждением на бумажных носителях).

2) Копии учредительных документов юридического лица с изменениями и дополнениями с отметкой о регистрации федеральным органом исполнительной власти, уполномоченным на осуществление государственной регистрации юридических лиц. Указанные копии должны быть заверены федеральным органом исполнительной власти, уполномоченным на осуществление государственной регистрации юридических лиц, или нотариально.

3) Нотариально удостоверенные копии свидетельств о внесении записей в Единый государственный реестр юридических лиц (ЕГРЮЛ), выданных уполномоченным органом, осуществляющим государственную регистрацию юридических лиц, и подтверждающих факт внесения в ЕГРЮЛ записей о государственной регистрации юридического лица (либо о юридическом лице, зарегистрированном до 1 июля 2002 года), а также записей о государственной регистрации изменений, вносимых в учредительные документы юридического лица или листы записи ЕГРЮЛ.

4) Заверенная подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица копия свидетельства о постановке на учет в налоговом органе юридического лица.

5) Нотариально удостоверенная копия информационного письма или копия информационного письма или уведомления о присвоении кодов статистики, заверенная подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица.

6) Нотариально удостоверенная копия лицензии Банка России на осуществление банковских операций со средствами в рублях и иностранной валюте (для кредитных организаций).

7) Нотариально удостоверенные копии иных лицензий на право осуществления деятельности, подлежащей лицензированию (если имеются).

8) В отношении единоличного исполнительного органа (далее по тексту - руководитель):

   - нотариально удостоверенная копия письма Банка России с подтверждением согласования кандидатуры руководителя (для Кредитных организаций и для Некредитных организаций – профессиональных участников рынка ценных бумаг);
   - подлинник или нотариально удостоверенная копия решения уполномоченного органа юридического лица (также могут быть

предоставлены нотариально удостоверенная выписка из решения или подлинник выписки, заверенный подписью лица, уполномоченного на подписание решения) об избрании (назначении) руководителя;

- копия документа, удостоверяющего личность руководителя, заверенная подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица, или письмо юридического лица, содержащее сведения о фамилии, имени, отчестве (при наличии), гражданстве, реквизитах документа, удостоверяющего личность, а также о дате и месте рождения, адресе места жительства (регистрации) или места пребывания, а также копия свидетельства о постановке на учет в налоговом органе (ИНН), заверенная подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица, либо письмо в произвольной форме с указанием ИНН (при наличии).

9) Оригинал доверенности, или нотариально удостоверенная копия, или копия, заверенная лицом, выдавшим указанную доверенность на представителя юридического лица, уполномоченного подписывать необходимые документы во взаимоотношениях с Клиринговым центром. В случае если доверенность предоставляет полномочия на совершение операций с денежными средствами или иным имуществом, дополнительно предоставляются:

   копия документа, удостоверяющего личность представителя юридического лица, заверенная подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица, или письмо юридического лица, содержащее сведения о фамилии, имени, отчестве (при наличии), гражданстве, реквизитах документа, удостоверяющего личность, а также о дате и месте рождения, адресе места жительства (регистрации) или места пребывания, а также копия свидетельства о постановке на учет в налоговом органе (ИНН), заверенная подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица, либо письмо в произвольной форме с указанием ИНН (при наличии).

10) Карточка с образцами подписей и оттиска печати юридического лица, оформленная в соответствии с требованиями нормативных актов Банка России (либо нотариально удостоверенная копия карточки).

11) 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).

12) Отзывы о деловой репутации юридического лица в соответствии с пунктом 7.6 Правил клиринга.

13) Согласие лиц, указанных в документах юридического лица, направляемых 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) В случае если физическое лицо, на которое требуется предоставить копию документа, удостоверяющего личность, является иностранным гражданином (лицом без гражданства), то дополнительно необходимо предоставить:

- заверенную подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица копию документа, подтверждающего право иностранного гражданина (лица без гражданства) на пребывание (проживание) в Российской Федерации (вид на жительство, разрешение на временное проживание, виза, иной документ, подтверждающий в соответствии с законодательством Российской Федерации право иностранного гражданина или лица без гражданства на пребывание (проживание) в Российской Федерации);
- заверенную подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица копию миграционной карты;
- письмо со сведениями об адресе места жительства (регистрации) или места пребывания (если такая информация не содержится в иных документах, предоставленных в соответствии с настоящим списком).

15) Отчетность, указанная в пунктах 1), 3) приложении № 5 к Правилам клиринга в форме электронного документа (в случае если юридическое лицо не является Участником СЭД, то в форме электронного сообщения с подтверждением на бумажных носителях):

- Кредитные организации предоставляют месячные формы отчетности на три последние отчетные даты, квартальные формы отчетности - на последнюю отчетную дату;
- Некредитные организации предоставляют квартальные формы отчетности за два последних отчетных квартала, месячные формы отчетности – на три последние отчетные даты;
- для кредитных организаций, не являющихся профессиональными участниками рынка ценных бумаг, список аффилированных лиц (форма 0409051) актуальный по состоянию на дату предоставления документов[1].

16) Анкета физического лица – бенефициарного владельца в случае, если юридическое лицо не является Участником СЭД, в форме электронного сообщения с подтверждением на бумажных носителях за подписью руководителя юридического лица или иного уполномоченного лица (с приложением нотариально удостоверенной копии доверенности, подтверждающей полномочия лица на подписание данной анкеты) и печатью юридического лица.[2]

---

[1] На дату предоставления списка аффилированных лиц сведения, содержащиеся в нем, должны соответствовать последней актуальной информации об аффилированных лицах, предоставленной в Банк России.

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

В случае если владение юридическим лицом либо контроль за ним осуществляется через третьих лиц необходимо представить документы (при возможности их получения), подтверждающие право бенефициарного владельца в конечном счете прямо или косвенно (через третьих лиц) владеть (иметь

17) Анкета FATCA в форме электронного документа (в случае если юридическое лицо не является Участником СЭД, то в форме электронного сообщения с подтверждением на бумажных носителях), а также иные прилагаемые к Анкете FATCA документы и сведения, предоставляемые для целей FATCA, в том числе согласие на передачу информации в иностранный налоговый орган.

18) Иные документы, которые могут быть запрошены Клиринговым центром в необходимых случаях, также Клиринговый центр вправе потребовать уточнения информации, содержащейся в ранее предоставленных документах.

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

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

II. Список документов, предоставляемых Государственной корпорацией

1) Анкета Участника клиринга, являющаяся приложением к Порядку предоставления информации и отчетности и размещенная на сайте Клирингового центра в форме электронного документа (в случае если юридическое лицо не является Участником СЭД, то в форме электронного сообщения с подтверждением на бумажных носителях).

2) Копия официальной публикации федерального закона, на основании которого учреждена данная Государственная корпорация.

3) Заверенная подписью уполномоченного лица и печатью Государственной корпорации копия свидетельства о постановке на учет в налоговом органе Государственной корпорации.

4) Нотариально удостоверенная копия информационного письма или копия информационного письма или уведомления о присвоении кодов статистики, заверенная подписью уполномоченного лица и печатью Государственной корпорации.

5) В отношении единоличного исполнительного органа (далее - руководитель):

- подлинник или нотариально удостоверенная копия решения уполномоченного органа Государственной корпорации (также могут быть предоставлены нотариально удостоверенная выписка из решения или подлинник выписки, заверенный подписью лица, уполномоченного на подписание решения), предусмотренного федеральным законом, определяющим статус, цели деятельности, функции и полномочия данной Государственной корпорации, о назначении руководителя;

преобладающее участие более 25 процентов в капитале) юридического лица либо имеет возможность контролировать действия юридического лица: договор, на основании которого физическое лицо может оказывать существенное влияние на решения данного юридического лица, и/или учредительные документы юридических лиц, имеющих участие в капитале юридического лица, и/или другие подтверждающие владение данным юридическим лицом документы, и/или может быть представлена ссылка на общедоступные источники информации и/или письмо юридического лица в свободной форме о невозможности представления таких документов.

- копия документа, удостоверяющего личность руководителя Государственной корпорации, заверенная подписью уполномоченного лица и печатью Государственной корпорации, или письмо Государственной корпорации, содержащее сведения о фамилии, имени, отчестве (при наличии), гражданстве, реквизитах документа, удостоверяющего личность, а также о дате и месте рождения, адресе места жительства (регистрации) или места пребывания, а также копия свидетельства о постановке на учет в налоговом органе (ИНН), заверенная подписью уполномоченного лица и печатью Государственной корпорации, либо письмо в произвольной форме с указанием ИНН (при наличии).

6) Оригинал доверенности, или нотариально удостоверенная копия, или копия, заверенная лицом, выдавшим указанную доверенность на представителя Государственной корпорации, уполномоченного подписывать необходимые документы во взаимоотношениях с Клиринговым центром. В случае если доверенность предоставляет полномочия на совершение операций с денежными средствами или иным имуществом, дополнительно предоставляются:

   копия документа, удостоверяющего личность представителя Государственной корпорации, заверенная подписью уполномоченного лица и печатью Государственной корпорации, или письмо Государственной корпорации, содержащее сведения о фамилии, имени, отчестве (при наличии), гражданстве, реквизитах документа, удостоверяющего личность, а также о дате и месте рождения, адресе места жительства (регистрации) или места пребывания, а также копия свидетельства о постановке на учет в налоговом органе (ИНН), заверенная подписью уполномоченного лица и печатью Государственной корпорации, либо письмо в произвольной форме с указанием ИНН (при наличии).

7) Карточка с образцами подписей и оттиска печати Государственной корпорации, оформленная в соответствии с требованиями нормативных актов Банка России (либо нотариально удостоверенная копия карточки).

8) Отзывы о деловой репутации Государственной корпорации в соответствии с пунктом 7.6 Правил клиринга.

9) Согласие лиц, указанных в документах Государственной корпорации, направляемых 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).

10) В случае если физическое лицо, на которое требуется предоставить копию документа, удостоверяющего личность, является иностранным гражданином (лицом без гражданства), то дополнительно необходимо предоставить:

- заверенную подписью уполномоченного лица и печатью государственной корпорации копию документа, подтверждающего право иностранного гражданина (лица без гражданства) на пребывание (проживание) в Российской Федерации (вид на жительство, разрешение на временное проживание, виза, иной документ, подтверждающий в соответствии с законодательством Российской Федерации право иностранного гражданина или лица без гражданства на пребывание (проживание) в Российской

Федерации);

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

11) Отчетность, указанная в пункте 2) приложения № 5 к Правилам клиринга в форме электронного документа (в случае если юридическое лицо не является Участником СЭД, то в форме электронного сообщения с подтверждением на бумажных носителях): месячные формы отчетности на три последние отчетные даты, квартальные формы отчетности - на последнюю отчетную дату.

12) Анкета физического лица – бенефициарного владельца в случае, если юридическое лицо не является Участником СЭД, в форме электронного сообщения с подтверждением на бумажных носителях за подписью руководителя Государственной корпорации или иного уполномоченного лица (с приложением нотариально удостоверенной копии доверенности, подтверждающей полномочия лица на подписание данной анкеты) и печатью Государственной корпорации.[3]

13) Анкета FATCA в форме электронного документа (в случае если юридическое лицо не является Участником СЭД, то в форме электронного сообщения с подтверждением на бумажных носителях), а также иные прилагаемые к Анкете FATCA документы и сведения, предоставляемые для целей FATCA, в том числе согласие на передачу информации в иностранный налоговый орган.

14) Иные документы, которые могут быть запрошены Клиринговым центром в необходимых случаях, также Клиринговый центр вправе потребовать уточнения информации, содержащейся в ранее предоставленных документах.

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

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

III. Список документов, предоставляемых Международной организацией

[3] Сведения о бенефициарных владельцах не предоставляются в случаях, перечисленных в статье 7 Федерального закона от 07.08.2001 №115-ФЗ «О противодействии легализации (отмыванию) доходов, полученных преступным путем, и финансированию терроризма».
В случае если владение юридическим лицом либо контроль за ним осуществляется через третьих лиц необходимо представить документы (при возможности их получения), подтверждающие право бенефициарного владельца в конечном счете прямо или косвенно (через третьих лиц) владеть (иметь преобладающее участие более 25 процентов в капитале) юридического лица либо имеет возможность контролировать действия юридического лица: договор, на основании которого физическое лицо может оказывать существенное влияние на решения данного юридического лица, и/или учредительные документы юридических лиц, имеющих участие в капитале юридического лица, и/или другие подтверждающие владение данным юридическим лицом документы, и/или может быть представлена ссылка на общедоступные источники информации и/или письмо юридического лица в свободной форме о невозможности представления таких документов.

1) Анкета Участника клиринга, являющаяся приложением к Порядку предоставления информации и отчетности и размещенная на Сайте Клирингового центра в форме электронного документа (в случае если юридическое лицо не является Участником СЭД, то в форме электронного сообщения с подтверждением на бумажных носителях).

2) Нотариально удостоверенная копия международного договора, включая учредительные документы (со всеми изменениями и дополнениями), или копия, удостоверенная уполномоченным лицом организации, осуществляющей хранение международных договоров в соответствии с законодательством Российской Федерации.

3) Нотариально удостоверенная копия свидетельства о постановке на учет в налоговом органе (при наличии).

4) Нотариально удостоверенная копия информационного письма или копия информационного письма или уведомления о присвоении кодов статистики, заверенная подписью уполномоченного лица и печатью Международной организации (при наличии).

5) В отношении лица, уполномоченного действовать от имени Международной организации в соответствии с международным договором и/или учредительными документами (далее - руководитель):

   - нотариально удостоверенная копия протокола или выписка из протокола заседания уполномоченного органа Международной организации, содержащая решение уполномоченного органа Международной организации об избрании (назначении) руководителя;
   - копия документа, удостоверяющего личность руководителя, заверенная подписью уполномоченного лица и печатью Международной организации, или письмо Международной организации, содержащее сведения о фамилии, имени, отчестве (при наличии), гражданстве, реквизитах документа, удостоверяющего личность, а также о дате и месте рождения, адресе места жительства (регистрации) или места пребывания, а также копия свидетельства о постановке на учет в налоговом органе (ИНН), заверенная подписью уполномоченного лица и печатью Международной организации, либо письмо в произвольной форме с указанием ИНН (при наличии).

6) Оригинал доверенности, или нотариально удостоверенная копия или копия, заверенная лицом, выдавшим указанную доверенность на представителя Международной организации, уполномоченного подписывать необходимые документы во взаимоотношениях с Клиринговым центром. В случае если доверенность предоставляет полномочия на совершение операций с денежными средствами или иным имуществом, дополнительно предоставляются:

   копия документа, удостоверяющего личность представителя Международной организации, заверенная подписью уполномоченного лица и печатью международной организации, или письмо Международной организации, содержащее сведения о фамилии, имени, отчестве (при наличии), гражданстве, реквизитах документа, удостоверяющего личность, а также о дате и месте рождения, адресе места жительства (регистрации) или места пребывания, а также копия свидетельства о постановке на учет в налоговом органе (ИНН), заверенная подписью уполномоченного лица и печатью Международной организации, либо

письмо в произвольной форме с указанием ИНН (при наличии).

7) Нотариально удостоверенная карточка (либо нотариально удостоверенная копия карточки) или иной документ с образцами подписей и оттиска печати Международной организации (оттиск печати проставляется при наличии).

8) Отзывы о деловой репутации Международной организации в соответствии с пунктом 7.6 Правил клиринга.

9) Согласие лиц, указанных в документах Международной организации, направляемых 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).

10) В случае если физическое лицо, на которое требуется предоставить копию документа, удостоверяющего личность, является иностранным гражданином (лицом без гражданства), то дополнительно необходимо предоставить:

- заверенную подписью уполномоченного лица и печатью Международной организации копию документа, подтверждающего право иностранного гражданина (лица без гражданства) на пребывание (проживание) в Российской Федерации (вид на жительство, разрешение на временное проживание, виза, иной документ, подтверждающий в соответствии с законодательством Российской Федерации право иностранного гражданина или лица без гражданства на пребывание (проживание) в Российской Федерации);
- заверенную подписью уполномоченного лица и печатью Международной организации копию миграционной карты;
- письмо со сведениями об адресе места жительства (регистрации) или места пребывания (если такая информация не содержится в иных документах, предоставленных в соответствии с настоящим списком).

11) Отчетность, указанная в пункте 2) Приложения № 5 к Правилам клиринга в форме электронного документа (в случае если юридическое лицо не является Участником СЭД, то в форме электронного сообщения с подтверждением на бумажных носителях): месячные формы отчетности - на три последние отчетные даты, квартальные формы отчетности - на последнюю отчетную дату.

12) Анкета физического лица – бенефициарного владельца в случае, если юридическое лицо не является Участником СЭД, в форме электронного сообщения с подтверждением на бумажных носителях за подписью руководителя Международной организации или иного уполномоченного лица (с приложением нотариально удостоверенной копии доверенности, подтверждающей полномочия лица на подписание данной анкеты) и печатью международной организации.[4]

[4] Сведения о бенефициарных владельцах не предоставляются в случаях, перечисленных в статье 7 Федерального закона от 07.08.2001 №115-ФЗ «О противодействии легализации (отмыванию) доходов, полученных преступным путем, и финансированию терроризма».
В случае если владение юридическим лицом либо контроль за ним осуществляется через третьих лиц необходимо представить документы (при возможности их получения), подтверждающие право

13) Анкета FATCA в форме электронного документа (в случае если юридическое лицо не является Участником СЭД, то в форме электронного сообщения с подтверждением на бумажных носителях), а также иные прилагаемые к Анкете FATCA документы и сведения, предоставляемые для целей FATCA, в том числе согласие на передачу информации в иностранный налоговый орган.

14) Иные документы, которые могут быть запрошены Клиринговым центром в необходимых случаях, также Клиринговый центр вправе потребовать уточнения информации, содержащейся в ранее предоставленных документах.

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

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

IV. Список документов, предоставляемых Нерезидентом

1) Анкета Участника клиринга, являющаяся приложением к Порядку предоставления информации и отчетности и размещенная на сайте Клирингового центра в форме электронного документа (в случае если юридическое лицо не является Участником СЭД, то в форме электронного сообщения с подтверждением на бумажных носителях).

2) Опросная Анкета Банка-нерезидента (в том числе для Банков ЕврАзЭс).

3) Письмо – подтверждение (в произвольной форме) об осуществлении юридическим лицом мер по противодействию легализации (отмыванию) доходов, полученных преступным путем, и финансированию терроризма, подписанное уполномоченным лицом юридического лица (для Некредитных организаций - нерезидентов).

4) Действующие редакции учредительных документов и все изменения к ним.

5) Документ, подтверждающий государственную регистрацию юридического лица.

6) Документ о постановке на учет в налоговом органе юридического лица (при наличии).

7) Специальное разрешение (лицензия), выданное уполномоченным органом государства юридического лица, на право осуществления деятельности, осуществление которой в соответствии с национальным законодательством государства юридического лица возможно при наличии соответствующего специального разрешения уполномоченного органа.

8) В отношении лица, уполномоченного действовать от имени юридического лица в

бенефициарного владельца в конечном счете прямо или косвенно (через третьих лиц) владеть (иметь преобладающее участие более 25 процентов в капитале) юридического лица либо имеет возможность контролировать действия юридического лица: договор, на основании которого физическое лицо может оказывать существенное влияние на решения данного юридического лица, и/или учредительные документы юридических лиц, имеющих участие в капитале юридического лица, и/или другие подтверждающие владение данным юридическим лицом документы, и/или может быть представлена ссылка на общедоступные источники информации и/или письмо юридического лица в свободной форме о невозможности представления таких документов.

соответствии с учредительными документами (далее по тексту – руководитель):

- документ, подтверждающий согласование кандидатуры руководителя юридического лица уполномоченным органом государства учреждения юридического лица (если такое согласование предусмотрено законодательством государства учреждения юридического лица);
- документ уполномоченного органа юридического лица, подтверждающий избрание (назначение) руководителя;
- копия документа, удостоверяющего личность руководителя, или других документов, которые установлены федеральным законом или признаваемые в соответствии с международным договором Российской Федерации в качестве документа, удостоверяющего личность, а также копия свидетельства о постановке на учет в налоговом органе (ИНН), заверенная подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица, либо письмо в произвольной форме с указанием ИНН (при наличии).

9) Доверенности на представителей юридического лица, уполномоченных подписывать необходимые документы во взаимоотношениях с Клиринговым центром. В случае если доверенность предоставляет полномочия на совершение операций с денежными средствами или иным имуществом, дополнительно предоставляются:

копия документа, удостоверяющего личность представителя, или других документов, которые установлены федеральным законом или признаваемые в соответствии с международным договором Российской Федерации в качестве документа, удостоверяющего личность, а также копия свидетельства о постановке на учет в налоговом органе (ИНН), заверенная подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица, либо письмо в произвольной форме с указанием ИНН (при наличии).

10) Карточка или иной документ с образцами подписей лиц и оттиска печати юридического лица (оттиск печати проставляется при наличии).

11) Отзывы о деловой репутации юридического лица в соответствии с пунктом 7.6 Правил клиринга.

12) Согласие лиц, указанных в документах юридического лица, направляемых им в Клиринговый центр в соответствии с Правилами клиринга, на обработку персональных данных по форме, размещенной на Сайте Клирингового центра (в случае, если документы содержат персональные данные субъекта персональных данных в соответствии с Федеральным законом «О персональных данных» и если иное не вытекает из требований законодательства).

13) В случае если физическое лицо, на которое требуется предоставить копию документа, удостоверяющего личность, является иностранным гражданином (лицом без гражданства), то дополнительно необходимо предоставить:

- заверенную подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица копию документа, подтверждающего право иностранного гражданина (лица без гражданства) на пребывание (проживание) в Российской Федерации (вид на жительство, разрешение на временное проживание, виза, иной документ, подтверждающий в соответствии с законодательством Российской Федерации право иностранного гражданина или лица без гражданства на пребывание

(проживание) в Российской Федерации);

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

14) Отчетность, указанная в пунктах 5)-6) приложения № 5 к Правилам клиринга в форме электронного документа (в случае если юридическое лицо не является Участником СЭД, то в форме электронного сообщения с подтверждением на бумажных носителях): месячные формы отчетности - на три последние отчетные даты, квартальные формы отчетности - на последнюю отчетную дату.

15) Анкета физического лица – бенефициарного владельца в случае, если юридическое лицо не является Участником СЭД, в форме электронного сообщения с подтверждением на бумажных носителях за подписью руководителя юридического лица или иного уполномоченного лица (с приложением нотариально удостоверенной копии доверенности, подтверждающей полномочия лица на подписание данной анкеты) и печатью юридического лица. [5]

16) Анкета FATCA в форме электронного документа (в случае если юридическое лицо не является Участником СЭД, то в форме электронного сообщения с подтверждением на бумажных носителях), а также иные прилагаемые к Анкете FATCA документы и сведения, предоставляемые для целей FATCA, в том числе согласие на передачу информации в иностранный налоговый орган.

17) Иные документы, которые могут быть запрошены Клиринговым центром в необходимых случаях, также Клиринговый центр вправе потребовать уточнения информации, содержащейся в ранее предоставленных документах.

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

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

[5] Сведения о бенефициарных владельцах не предоставляются в случаях, перечисленных в статье 7 Федерального закона от 07.08.2001 №115-ФЗ «О противодействии легализации (отмыванию) доходов, полученных преступным путем, и финансированию терроризма».
В случае если владение юридическим лицом либо контроль за ним осуществляется через третьих лиц необходимо представить документы (при возможности их получения), подтверждающие право бенефициарного владельца в конечном счете прямо или косвенно (через третьих лиц) владеть (иметь преобладающее участие более 25 процентов в капитале) юридического лица либо имеет возможность контролировать действия юридического лица: договор, на основании которого физическое лицо может оказывать существенное влияние на решения данного юридического лица, и/или учредительные документы юридических лиц, имеющих участие в капитале юридического лица, и/или другие подтверждающие владение данным юридическим лицом документы, и/или может быть представлена ссылка на общедоступные источники информации и/или письмо юридического лица в свободной форме о невозможности представления таких документов.

русский язык.

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

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

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

Отчетность, предоставляемая Участниками клиринга Клиринговому центру

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

(кредитными организациями);

- 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 финансовых результатах (форма 0409102) - не позднее 15 рабочего дня месяца, следующего за отчетным кварталом;
- бухгалтерский баланс некредитной организации (форма 0710001), отчет о финансовых результатах некредитной организации (форма 0710002) - не позднее 45 (сорока пяти) календарных дней, следующих за отчетным кварталом, за исключением отчетности по состоянию на 1 января, которая предоставляется не позднее 15 апреля года, следующего за отчетным;
- информацию об обязательных нормативах и о других показателях деятельности кредитной организации (форма 0409135), справку о численном значении норматива максимального размера риска на одного заемщика или группу связанных заемщиков (Н6) кредитной организации (по данным формы 0409118) - не позднее 15 рабочего дня месяца, следующего за отчетным месяцем;
- квартальный отчет профессионального участника рынка ценных бумаг (форма №1100) - за I квартал - не позднее 25 мая текущего года; за II квартал - не позднее 25 августа текущего года; за III квартал - не позднее 25 ноября текущего года; за IV квартал - не позднее 25 апреля следующего года;
- список аффилированных лиц (форма 0409051) - не позднее 15 рабочего дня месяца, следующего за отчетным кварталом[6].

5) Банки ЕврАзЭс не позднее 15 (пятнадцати) рабочих дней с даты сдачи ежемесячной или квартальной отчетности соответственно или с даты, определенной компетентным органом государства учреждения Банка ЕврАзЭс для сдачи ежемесячной или квартальной отчетности соответственно (в случае если сроки сдачи отчетности устанавливаются компетентным органом государства учреждения Банка ЕврАзЭс), 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 ЕврАзЭс 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),

[6] На дату предоставления списка аффилированных лиц сведения, содержащиеся в нем, должны соответствовать последней актуальной информации об аффилированных лицах, предоставленной в Банк России.

отраженных в отчетности Банка ЕврАзЭс – 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 органом – ежемесячно (в случае если в соответствии с национальным законодательством государства учреждения Банка ЕврАзЭс 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 ЕврАзЭс такой расчет устанавливается) – ежемесячно;
- финансовую отчетность по МСФО (при наличии) – ежеквартально.

Банки ЕврАзЭс не позднее 15 (пятнадцати) рабочих дней с даты подписания отчетности организацией, проводившей аудит Банка ЕврАзЭс, 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 предоставляется, начиная с года, следующего за годом предоставления доступа Банку ЕврАзЭс к клиринговому обслуживанию – ежегодно.

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

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

Банки-нерезиденты и Некредитные организации - нерезиденты не позднее 15 (пятнадцати) рабочих дней с даты подписания отчетности организацией,

проводившей аудит, предоставляют Клиринговому центру:

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

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

8) Документы, указанные в пунктах 5)-6), должны быть апостилированы или легализованы в установленном порядке, переведены на русский язык. Верность перевода или подлинность подписи переводчика должна быть засвидетельствована нотариусом.