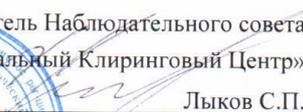


Центральный Банк
Российской Федерации (Банк России)
ЗАРЕГИСТРИРОВАНО
Дата 27 октября 2014
РБ-52-2/806

УТВЕРЖДЕНЫ

решением Наблюдательного совета
ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр»
от «30» октября 2014 года (Протокол № 7)

Председатель Наблюдательного совета
ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр»
 Лыков С.П.

ПРАВИЛА КЛИРИНГА
ЗАО АКБ «НАЦИОНАЛЬНЫЙ КЛИРИНГОВЫЙ ЦЕНТР»
НА СРОЧНОМ РЫНКЕ

Москва, 2014 г.

СОДЕРЖАНИЕ

РАЗДЕЛ I. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ.....	5
Статья 1. Термины и определения	5
Статья 2. Общие положения.....	9
Статья 3. Права и обязанности Участников клиринга и Клирингового центра.....	11
Статья 4. Конфиденциальность.....	13
Статья 5. Порядок использования Аналога собственноручной подписи	13
Статья 6. Торговые счета	15
Статья 7. Клиринговые регистры.....	16
Статья 8. Порядок открытия и закрытия клиринговых регистров Участникам клиринга	17
РАЗДЕЛ II. ТРЕБОВАНИЯ К УЧАСТНИКАМ КЛИРИНГА	23
Статья 9. Требования к Участникам клиринга	23
Статья 10. Условия клирингового обслуживания. Порядок предоставления допуска к клиринговому обслуживанию	24
Статья 11. Порядок регистрации Участников клиринга и их Клиентов.....	26
Статья 12. Порядок приостановления и прекращения допуска к клиринговому обслуживанию.....	27
РАЗДЕЛ III. МЕРЫ, НАПРАВЛЕННЫЕ НА УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ ПРИ ОСУЩЕСТВЛЕНИИ КЛИРИНГА.....	31
Статья 13. Перечень мер, направленных на управление рисками при осуществлении клиринга	31
Статья 14. Торговый лимит	32
Статья 15. Порядок подачи и исполнения Поручений на управление риском	34
РАЗДЕЛ IV. ПОРЯДОК И УСЛОВИЯ ДОПУСКА ОБЯЗАТЕЛЬСТВ К КЛИРИНГУ	36
Статья 16. Возможность заключения Срочного контракта. Изменение Спецификации	36
Статья 17. Порядок взаимодействия с Биржей.....	36
Статья 18. Порядок взаимодействия с Биржей при подаче и отзыве Заявок и заключении сделок, допуске к клирингу обязательств по сделкам.....	38
Статья 19. Порядок проверки возможности объявления Заявки на заключение Срочных контрактов.....	39
Статья 20. Порядок определения и учета обязательств по Срочным контрактам	41
Статья 21. Порядок изменения учета обязательств по Срочным контрактам.....	42
РАЗДЕЛ V. ПОРЯДОК ПРОВЕДЕНИЯ КЛИРИНГА	44
ПОДРАЗДЕЛ V-I. ПОРЯДОК ВНЕСЕНИЯ И ВОЗВРАТА СРЕДСТВ ГАРАНТИЙНОГО ОБЕСПЕЧЕНИЯ, ОБЕСПЕЧЕНИЯ ПОД СТРЕСС И ВЗНОСА В ГАРАНТИЙНЫЙ ФОНД.....	44
Статья 22. Порядок внесения и возврата Средств гарантийного обеспечения в денежных средствах	44
Статья 23. Изменение учета денежных средств Участником клиринга	49
Статья 24. Порядок внесения и возврата Средств гарантийного обеспечения в ценных бумагах	51

Статья 25. Порядок исключения иностранной валюты / ценной бумаги из Перечня .	53
Статья 26. Замена иностранной валюты / ценных бумаг, учитываемых в качестве Средств гарантийного обеспечения, денежными средствами в российских рублях	53
Статья 27. Порядок внесения взноса в Гарантийный фонд и Обеспечения под стресс	54
Статья 28. Порядок возврата взноса в Гарантийный фонд и Обеспечения под стресс	55
ПОДРАЗДЕЛ V-II. КЛИРИНГОВЫЕ СЕССИИ.....	57
Статья 29. Порядок проведения клиринговых сессий	57
Статья 30. Маржинальные требования по Обеспечению под стресс и Маржинальные требования по фондам	58
ПОДРАЗДЕЛ V-III. ПОРЯДОК ОПРЕДЕЛЕНИЯ И ИСПОЛНЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ, ВКЛЮЧЕННЫХ В КЛИРИНГОВЫЙ ПУЛ ДНЕВНОЙ ИЛИ ВЕЧЕРНЕЙ КЛИРИНГОВОЙ СЕССИИ	61
Статья 31. Вариационная маржа и премия.....	61
Статья 32. Порядок исполнения обязательств по уплате вариационной маржи, премии, штрафов, пени, неустоек и комиссионных вознаграждений	61
Статья 33. Гарантийное обеспечение	63
Статья 34. Порядок возникновения и исполнения Маржинальных требований.....	64
Статья 35. Процедура принудительного закрытия позиций	68
Статья 36. Порядок использования иностранной валюты / ценных бумаг с целью погашения Задолженности Участника клиринга	71
Статья 37. Порядок использования и возмещения гарантийных фондов и иных средств в целях погашения Задолженностей Участников клиринга	72
ПОДРАЗДЕЛ V-IV. ПОРЯДОК ИСПОЛНЕНИЯ СРОЧНЫХ КОНТРАКТОВ	78
Статья 38. Порядок исполнения опционных контрактов, базовым активом которых является фьючерсный контракт.....	78
Статья 39. Порядок исполнения расчетных фьючерсных контрактов.....	79
Статья 40. Порядок исполнения поставочных Срочных контрактов.....	79
Статья 41. Особенности исполнения поставочных Срочных контрактов режима T+. 80	
ПОДРАЗДЕЛ V-V. ПОРЯДОК ВЗАИМОДЕЙСТВИЯ С РАСЧЕТНОЙ ОРГАНИЗАЦИЕЙ И РАСЧЕТНЫМ ДЕПОЗИТАРИЕМ	84
Статья 42. Порядок взаимодействия с Расчетной организацией	84
Статья 43. Порядок взаимодействия с Расчетным депозитарием и иными депозитариями.....	
РАЗДЕЛ VI. ПОРЯДОК ОПЛАТЫ УСЛУГ. ОТЧЕТЫ ПО ИТОГАМ КЛИРИНГА	86
Статья 44. Порядок оплаты услуг Клирингового центра, Биржи и Технического центра	86
Статья 45. Порядок представления отчетов по итогам клиринга.....	87
РАЗДЕЛ VII. ПРОЧИЕ УСЛОВИЯ	90
Статья 46. Перевод позиций и Перевод Средств гарантийного обеспечения клиента Участника клиринга от одного Участника клиринга другому Участнику клиринга.....	90
Статья 47. Порядок действий в случае включения Участника клиринга или Доверенного владельца счетов в перечень организаций, в отношении которых имеются сведения об их причастности к экстремистской деятельности или терроризму.....	94

Статья 48. Порядок урегулирования обязательств в случае прекращения допуска к клиринговому обслуживанию	96
Статья 49. Взаимодействие с Биржей при возникновении обстоятельств, которые могут повлиять на возможность проведения Торгов	107
Статья 50. Чрезвычайные ситуации.....	107
Статья 51. Порядок разрешения споров	109
Приложение № 1	111
Приложение № 2	112
Приложение № 3	120
Приложение № 4	126
Приложение № 5	128
Приложение № 6	133
Приложение № 7	134

РАЗДЕЛ I. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ

Настоящие Правила клиринга ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр» на срочном рынке регулируют отношения, связанные с заключением и исполнением договоров, являющихся производными финансовыми инструментами, заключаемых на торгах ОАО Московская Биржа, ОАО «Мосэнергобиржа», а также в Секции стандартных контрактов на зерновые, зернобобовые и технические культуры ЗАО НТБ.

В случае внесения изменений и дополнений в настоящие Правила клиринга, в том числе путем принятия Правил клиринга в новой редакции, соответствующие изменения и дополнения с даты введения их в действие распространяются на отношения по вышеуказанным договорам, заключенным до введения в действие соответствующих изменений и дополнений (новой редакции), и не исполненным (не прекращенным) на дату введения в действие изменений и дополнений 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, полученный в результате присвоения Участнику клиринга / Клиринговому центру Уникального персонального идентификатора, Имени, Пароля и позволяющий идентифицировать Участника клиринга / Клиринговый центр, а также установить отсутствие искажения информации в заявке или ином электронном документе.

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

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

Биржа – биржа, заключившая договор о порядке взаимодействия с Клиринговым центром.

Базовый размер гарантийного обеспечения - рассчитываемый Клиринговым центром для каждого Срочного контракта размер средств в российских рублях, необходимых для расчета гарантийного обеспечения по совокупности обязательств по Срочным контрактам.

Брокерская фирма / Расчетная фирма – группа разделов клиринговых регистров, объединенных в учете Клирингового центра. Для одного Участника клиринга может быть зарегистрировано несколько Расчетных фирм. Для одного Участника клиринга в рамках одной Расчетной фирмы может быть зарегистрировано несколько Брокерских фирм, каждая из которых может являться Собственной Брокерской фирмой, Клиентской Брокерской фирмой, Обособленной Брокерской фирмой или Брокерской фирмой ДУ.

Верхний/Нижний лимит колебаний цен сделок - значение, выше (больше) / ниже (меньше) которого не может быть цена заключения фьючерсного контракта, за исключением случаев, прямо предусмотренных в Правилах клиринга и/или Правилах торгов.

Временной регламент - внутренний документ Клирингового центра, устанавливающий сроки исполнения обязательств, определенных Правилами клиринга, время проведения клиринговых сессий, а также сроки проведения клиринговых операций, сроки предоставления документов Клиринговому центру / Клиринговым центром в процессе взаимодействия с Участниками клиринга при проведении клиринга и расчетов.

Гарантийное обеспечение – сумма в российских рублях, рассчитываемая в соответствии с Правилами клиринга, необходимая для оценки достаточности Средств гарантийного обеспечения для обеспечения исполнения обязательств по совокупности обязательств по Срочным контрактам.

Гарантийный фонд - коллективное клиринговое обеспечение, сформированное Клиринговым центром за счет взносов Участников клиринга в целях обеспечения исполнения обязательств по Срочным контрактам.

Добросовестный участник клиринга – Участник клиринга, не имеющий неисполненного Маржинального требования и Задолженности перед Клиринговым центром.

Доверенный владелец счетов - лицо, предоставляющее имущество в целях обеспечения исполнения и/или исполнения обязательств Участников клиринга, и выполняющее иные функции в соответствии с Правилами клиринга.

Задолженность – неисполненные обязательства Участника клиринга, в том числе обязательства по уплате вариационной маржи, обязательства по уплате комиссионных вознаграждений 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 № 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».

Имя – пользовательское имя (логин), представляющее собой уникальное условное обозначение, однозначно определяющее Участника клиринга или Клиринговый центр, содержащее Уникальный персональный идентификатор, присвоенное Участнику клиринга / Клиринговому центру для доступа к Клиринговой системе.

Исполнение Срочного контракта / исполнение - прекращение, в том числе надлежащим исполнением, следующего обязательства (обязательств) по Срочному контракту, предусмотренного Спецификацией:

- для поставочного фьючерсного контракта – Обязательства по поставке;
- для расчетного фьючерсного контракта – Обязательства по расчетам;
- для опционного контракта, базовым активом которого является фьючерсный контракт, – обязательство по заключению фьючерсного контракта, предусмотренного Спецификацией такого опционного контракта;
- для поставочного опционного контракта, базовым активом которого не является фьючерсный контракт, – Обязательства по поставке;
- для расчетного опционного контракта, базовым активом которого не является фьючерсный контракт, – Обязательства по расчетам.

Клиент Участника клиринга – юридическое или физическое лицо, зарегистрированное Клиринговым центром в качестве клиента Участника клиринга. Клиентом Участника клиринга может быть как клиент Участника клиринга, так и клиент брокера, в том числе иностранного юридического лица, управляющего, являющегося клиентом Участника клиринга.

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

Клиринговый центр – ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр», являющееся клиринговой организацией и действующее в соответствии с Законом о клиринге.

Коэффициент ликвидности - используемое при расчете Торгового лимита минимально допустимое значение отношения суммы денежных средств в российских рублях, учитываемых в качестве Средств гарантийного обеспечения, и оценочной стоимости ценных бумаг и иностранных валют, учитываемых в качестве Средств гарантийного обеспечения, предельная доля которых установлена в размере 100%, по разделу клирингового регистра / Брокерской фирме / Расчетной фирме, к общей сумме (стоимости) всех Средств гарантийного обеспечения, учитываемой по данному разделу клирингового регистра / Брокерской фирме / Расчетной фирме, выраженной в российских рублях.

Лимит колебаний цен сделок - значение, используемое для ограничения цен заключаемых сделок и расчета Базового размера гарантийного обеспечения по фьючерсному контракту.

Маржинальное требование - требование Клирингового центра к Участнику клиринга об обеспечении обязательств по Срочным контрактам, заключенным Клиринговым центром с Участником клиринга, предъявляемое в порядке и случае, определенных Правилами клиринга.

Маржинальное требование по обеспечению под стресс - требование Клирингового центра к Участнику клиринга о приведении размера средств, внесенных Участником клиринга в качестве Обеспечения под стресс, в соответствие размеру Обеспечения под стресс, установленному Клиринговым центром для Участника клиринга.

Маржинальное требование по фондам - требование Клирингового центра к Участнику клиринга о приведении взносов Участника клиринга в гарантийные фонды в соответствие размерам взносов в гарантийные фонды, установленным Клиринговым центром.

Методика определения размера Обеспечения под стресс - внутренний документ Клирингового центра, устанавливающий порядок определения размера Обеспечения под стресс Участников клиринга.

Недобросовестный участник клиринга – Участник клиринга, не исполнивший Маржинальное требование и/или имеющий Задолженность перед Клиринговым центром.

Нерезидент - юридическое лицо, являющееся нерезидентом в соответствии с законодательством Российской Федерации о валютном регулировании и валютном контроле.

Обеспечение под стресс - индивидуальное клиринговое обеспечение Участников клиринга в российских рублях и/или иностранной валюте и/или ценных бумагах, которое используется для обеспечения исполнения обязательств Участника клиринга по Срочным контрактам.

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

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 клиринга – настоящие Правила клиринга ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр» на срочном рынке.

Правила клиринга на валютном рынке - действующие 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 торгов – Правила организованных торгов на Срочном рынке ОАО Московская Биржа, или Правила биржевой торговли в Секции срочного рынка Открытого акционерного общества «Московская энергетическая биржа», или Правила организованных торгов в Секции стандартных контрактов на зерновые, зернобобовые и технические культуры Закрытого акционерного общества «Национальная товарная биржа».

Правила торгов на валютном рынке - Правила организованных торгов ОАО Московская Биржа на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.

Правила торгов на фондовом рынке - Правила проведения торгов по ценным бумагам в Закрытом акционерном обществе «Фондовая биржа ММВБ».

Принципы расчета гарантийного обеспечения - внутренний документ Клирингового центра, определяющий принципы расчета Гарантийного обеспечения.

Расчетная организация – организация, в которой Клиринговым центром открыты клиринговые банковские счета.

Расчетный день - день, в том числе выходной или праздничный нерабочий день по законодательству Российской Федерации, в который Биржа проводит торги, и в который Расчетный депозитарий и Расчетная организация осуществляют расчеты по итогам клиринга.

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.

Расчетный депозитарий - расчетный депозитарий, осуществляющий операции, связанные с исполнением обязательств по передаче ценных бумаг по итогам клиринга, осуществляемого Клиринговым центром.

Режим закрытия позиций – установленное Клиринговым центром в отношении Участника клиринга ограничение, при котором могут заключаться сделки, стороной которых является указанный Участник клиринга, приводящие только к уменьшению Гарантийного обеспечения такого Участника клиринга.

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.nkcsbank.ru, на котором осуществляется раскрытие информации Клиринговым центром.

Средства гарантийного обеспечения - индивидуальное клиринговое обеспечение Участника клиринга в российских рублях, иностранной валюте и/или ценных бумагах, используемое для обеспечения исполнения обязательств Участника клиринга по заключенным Срочным контрактам. Средства гарантийного обеспечения используются для исполнения обязательств Участника клиринга по Срочным контрактам и обязательств Участника клиринга по уплате комиссионных вознаграждений.

Срочный контракт - договор, являющийся производным финансовым инструментом, заключаемый в соответствии с Правилами торгов в порядке, определенном Правилами торгов и/или Правилами клиринга.

Счет зачисления - зарегистрированный в Клиринговом центре счет, предназначенный для перечисления на него денежных средств / ценных бумаг с целью исполнения обязательств Клирингового центра по возврату денежных средств, учитываемых в качестве Средств гарантийного обеспечения / Обеспечения под стресс / взноса в Гарантийный фонд или ценных бумаг, учитываемых в качестве взноса в Гарантийный фонд.

Технический центр – ООО «МБ Технологии», обеспечивающее Участникам клиринга и Клиринговому центру технический доступ к соответствующей Клиринговой системе на основании соответствующего договора.

Торговый лимит - сумма, выраженная в российских рублях, определяемая Клиринговым центром в соответствии с Правилами клиринга на основании стоимости Средств гарантийного обеспечения, в пределах которой Участник клиринга вправе заключать Срочные контракты

Уникальный персональный идентификатор / УПИ - известная Участнику клиринга / Клиринговому центру и предназначенная для идентификации Техническим центром Участника клиринга / Клирингового центра в Клиринговой системе уникальная последовательность символов, состоящая из двух знаков, каждый из которых может быть прописной буквой латинского алфавита или цифрой.

Участник клиринга - юридическое лицо - Резидент, 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 Правилами клиринга на валютном рынке, Правилами клиринга на рынке ценных бумаг, иными внутренними документами Клирингового центра, Правилами торгов, Спецификациями, законами Российской Федерации и нормативными актами Банка России.

Статья 2. Общие положения

- 2.1. Клиринговый центр осуществляет клиринг, выполняя функции центрального контрагента, по Срочным контрактам.
- 2.2. В качестве способов обеспечения исполнения допущенных к клирингу обязательств по Срочным контрактам Клиринговый центр использует Средства

- гарантийного обеспечения, Обеспечение под стресс Участников клиринга, а также Гарантийный фонд.
- 2.3. Средства гарантийного обеспечения в российских рублях или иностранной валюте учитываются на соответствующем клиринговом банковском счете Клирингового центра, открытом в Расчетной организации и предназначенном для учета Средств гарантийного обеспечения.
 - 2.4. Средства гарантийного обеспечения в ценных бумагах учитываются на торговых счетах депо, открытых в Расчетном депозитарии с указанием Клирингового центра в качестве клиринговой организации, которая вправе давать распоряжения по этим счетам.
 - 2.5. Перечень видов используемых торговых счетов приведен в статье 6 Правил клиринга.
 - 2.6. 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).
 - 2.7. 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.
 - 2.8. 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.
 - 2.9. Обеспечение под стресс в ценных бумагах учитывается на клиринговом счете депо Клирингового центра, открытом в Расчетном депозитарии и предназначенном для учета Обеспечения под стресс.
 - 2.10. Информация о реквизитах клиринговых счетов Клирингового центра, предназначенных для учета Средств гарантийного обеспечения, Обеспечения под стресс и Гарантийного фонда, размещаются на Сайте Клирингового центра.
Об изменениях реквизитов указанных счетов Клиринговый центр извещает Участников клиринга путем направления им новых реквизитов в форме электронного документа и путем размещения соответствующей информации на Сайте Клирингового центра не позднее, чем за 3 (три) рабочих дня до введения этих изменений в действие.
 - 2.11. Клиринговый центр вправе использовать в своих интересах денежные средства, составляющие Средства гарантийного обеспечения, Обеспечения под стресс и средства Гарантийного фонда с учетом ограничений, установленных внутренним документом Клирингового центра, определяющим критерии размещения временно свободных денежных средств Клирингового центра.

Доходы от такого использования указанных денежных средств не включаются в состав Средств гарантийного обеспечения, Обеспечения под стресс и Гарантийного фонда.

- 2.12. Обмен электронными документами между Участником клиринга и Клиринговым центром осуществляется посредством Подсистемы ЭДО НКЦ и/или системы S.W.I.F.T. (в случаях, установленных Правилами клиринга).

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

Электронные документы, направляемые посредством Системы S.W.I.F.T., формируются в форматах, установленных стандартами S.W.I.F.T., с учетом особенностей, установленных внутренними документами Клирингового центра.

В случае несоответствия информации, содержащейся в электронном документе, направленном посредством Подсистемы ЭДО НКЦ, и электронном документе, направленном посредством системы 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 S.W.I.F.T.

- 2.13. 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.

- 2.14. Формы документов, предоставляемых Участниками клиринга, клиентами Участников клиринга, Доверенными владельцами счетов, Клиринговому центру в соответствии с Правилами клиринга, и способ их предоставления установлены документом «Формы документов, предоставляемых Участниками клиринга, Клиентами Участников клиринга, Доверенными владельцами счетов в соответствии с Правилами клиринга ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр» на срочном рынке», если иное не установлено Правилами клиринга.

Указанный документ раскрывается на Сайте Клирингового центра.

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 Участниками клиринга в соответствии с Правилами клиринга, определен Тарифами Клирингового центра на срочном рынке, являющимися приложением № 2 к Правилам клиринга (далее – Тарифы Клирингового центра).
- 3.5. Порядок оплаты клиринговых услуг Клирингового центра определен в статье 44 Правил клиринга.
- 3.6. Клиринговые услуги Клирингового центра считаются оказанными надлежащим образом, если в течение 5 (пяти) рабочих дней после окончания месяца, в течение которого оказывались услуги, Участник клиринга письменно не заявит об обратном.
- 3.7. Участник клиринга вправе отказаться от исполнения Договора об оказании клиринговых услуг только при отсутствии у него имущественных обязательств по указанному договору, а также неисполненных им обязательств, допущенных к клирингу, письменно уведомив об этом Клиринговый центр не позднее, чем за 5 (пять) дней до даты прекращения действия Договора об оказании клиринговых услуг.
- 3.8. Клиринговый центр вправе отказаться от исполнения Договора об оказании клиринговых услуг с Участником клиринга в случае нарушения Участником клиринга требований, предъявляемых к нему правилами клиринга 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 на основании ни одних правил 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:
- прекращения допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию в соответствии со всеми правилами клиринга Клирингового центра, на основании которых Участник клиринга был допущен к клиринговому обслуживанию;
 - ликвидации Участника клиринга, а также в случае реорганизации Участника клиринга при условии, что деятельность Участника клиринга в результате реорганизации прекращается;
 - отзыва (аннулирования) лицензии на осуществление банковских операций у Участника клиринга (для кредитных организаций).

- 3.11. Прекращение действия Договора об оказании клиринговых услуг не освобождает Участника клиринга и Клиринговый центр от исполнения обязательств, возникших до прекращения действия Договора об оказании клиринговых услуг.
- 3.12. Клиринговый центр вправе на своем Сайте раскрывать информацию о нарушениях Участниками клиринга требований Правил клиринга, в том числе, о фактах неисполнения ими обязательств в порядке, предусмотренном Правилами клиринга.

Статья 4. Конфиденциальность

- 4.1. Участник клиринга и Клиринговый центр обязуются рассматривать содержание Договора об оказании клиринговых услуг и условия заключенных Срочных контрактов как конфиденциальную информацию и не будут раскрывать ее третьим лицам (за исключением аудиторов Участника клиринга или Клирингового центра, уполномоченных государственных органов, Клиентов Участников клиринга, в интересах которых заключены указанные сделки, а также случаев раскрытия информации в соответствии с требованиями 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 Срочных контрактов, заключенных в рамках Договора об оказании клиринговых услуг, будут рассматриваться как конфиденциальные.
- 4.3. Участники клиринга соглашаются с тем, что Клиринговый центр на основании договора, заключенного с Банком России, передает Банку России по его запросу информацию о ходе и итогах клиринга.

Статья 5. Порядок использования Аналога собственноручной подписи

- 5.1. Аналог собственноручной подписи используется при подаче (направлении) с использованием Клиринговой системы электронных сообщений, предусмотренных Правилами клиринга. Электронное сообщение, подписанное АСП, признается электронным документом, равнозначным документу на бумажном носителе, подписанному Участником клиринга / Клиринговым центром.
- 5.2. Электронное сообщение считается подписанным АСП, с момента отправки Участником клиринга / Клиринговым центром в Клиринговую систему такого электронного сообщения при условии успешного прохождения Участником клиринга / Клиринговым центром процедуры аутентификации в порядке, предусмотренном настоящей статьёй.
- 5.3. Присвоение УПИ, Имени и Пароля Участнику клиринга или Клиринговому центру осуществляется Техническим центром посредством внесения указанных УПИ, Имени и Пароля в базу данных Клиринговой системы.
- 5.4. Имя и соответствующий ему Пароль, необходимые для входа в Клиринговую систему, формируются Техническим центром в соответствии с его внутренними документами.

После присвоения Имени и (или) Пароля Участнику клиринга или Клиринговому центру Технический центр по заявлению данного Участника клиринга или Клирингового центра может изменить Имя и (или) Пароль.

Сформированные Техническим центром Имя и Пароль передаются Участнику клиринга или Клиринговому центру в закрытом конверте или посредством Системы ЭДО.

- 5.5. Процедура аутентификации осуществляется Техническим центром с использованием Клиринговой системы при осуществлении технического доступа Участника клиринга или Клирингового центра в Клиринговую систему путем сопоставления введенных Имени и Пароля соответствующим Имени 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 доступа к Клиринговой системе.

- 5.6. По письменному запросу Участника клиринга / Клирингового центра Технический центр предоставляет Участнику клиринга / Клиринговому центру копию направленного Участником (Участнику) клиринга / Клиринговым центром (Клиринговому центру) электронного сообщения, изготовленного (распечатанного) на бумажном носителе.

Запрос Участника клиринга / Клирингового центра должен содержать дату, на которую, либо период времени, за который предоставляются электронные сообщения.

- 5.7. Участник клиринга и Клиринговый центр соглашаются с тем, что Техническим центром могут быть изготовлены (распечатаны) копии электронных сообщений (подписанных АСП) на бумажном носителе, которые удостоверяются подписью уполномоченного лица Технического центра и являются доказательством факта направления электронного сообщения с использованием Клиринговой системы, а также подтверждают соответствие электронного сообщения содержанию копии электронного сообщения, изготовленного (распечатанного) на бумажном носителе.

Участник клиринга обязуется хранить в тайне присвоенный ему Пароль (Пароли) и несет риск последствий, вызванных нарушением тайны Пароля (Паролей). В случае нарушения тайны Пароля Участник клиринга обязан незамедлительно уведомить об этом Технический центр. Технический центр в этом случае не позднее окончания следующего рабочего дня присваивает Участнику клиринга новый Пароль.

- 5.8. Участник клиринга и Клиринговый центр соглашаются с тем, что все возникшие конфликтные ситуации, связанные с использованием АСП, будут стремиться решить в досудебном порядке.

- 5.9. В случае возникновения конфликтных ситуаций в связи с использованием АСП разрешение разногласий проводится в соответствии с приложением № 6 к Правилам клиринга.

Статья 6. Торговые счета

6.1. При осуществлении клиринга в соответствии с Правилами клиринга Клиринговый центр использует следующие типы торговых счетов депо, открытых в Расчетном депозитарии с указанием Клирингового центра в качестве клиринговой организации, которая вправе давать распоряжения по этим счетам:

- торговый счет депо владельца;
- торговый счет депо номинального держателя;
- торговый счет депо иностранного номинального держателя;
- торговый счет депо доверительного управляющего.

6.2. При осуществлении клиринга в соответствии с Правилами клиринга Клиринговый центр использует торговые разделы, предназначенные для учета Средств гарантийного обеспечения в ценных бумагах (далее – Счета FORTS, торговые счета), открытые в Расчетном депозитарии.

6.3. Ценные бумаги, учитываемые на Счете FORTS, владельцем которого не является Участник клиринга или Доверенный владелец счетов, учитываются Клиринговым центром в качестве Средств гарантийного обеспечения при наличии между Клиринговым центром и владельцем указанного Счета FORTS заключенного договора по установленной Клиринговым центром форме, определяющего порядок распоряжения такими ценными бумагами в соответствии с Правилами клиринга (далее в настоящей статье - Договор).

Для заключения Договора владелец Счета FORTS, являющийся Резидентом, представляет в Клиринговый центр комплект документов в соответствии с перечнем, приведенным в разделе I приложения № 3 к Правилам клиринга (за исключением отчетности, предусмотренной приложением № 4 к Правилам клиринга), являющийся Нерезидентом - комплект документов в соответствии с перечнем, приведенным в разделе II приложения № 3 к Правилам клиринга.

6.4. Для торгового счета может учитываться Доверенный владелец счетов.

6.5. Для установления для торгового счета Доверенного владельца счетов владелец торгового счета предоставляет Клиринговому центру Заявление на изменение параметров Счета FORTS.

Для возможности подачи указанного заявления владелец торгового счета, не являющийся Участником клиринга или Доверенным владельцем счетов, - Резидент, должен предоставить Клиринговому центру комплект документов в соответствии с перечнем, приведенным в разделе I приложения № 3 к Правилам клиринга (за исключением отчетности, предусмотренной приложением № 4 к Правилам клиринга), Нерезидент - комплект документов в соответствии с перечнем, приведенным в разделе II приложения № 3 к Правилам клиринга.

6.6. За разделом клиринговых регистров могут быть закреплены торговые счета, предназначенные для обеспечения исполнения обязательств по Срочным контрактам, .

Один торговый счет может быть закреплен либо за разделами клиринговых регистров, имеющих коды Собственных Брокерских фирм, или Клиентских Брокерских фирм, или Брокерских фирм ДУ, открытых одному Участнику

клиринга, либо за разделами клиринговых регистров, имеющих коды Обособленных Брокерских фирм, открытых одному Участнику клиринга, и для которых учитывается один и тот же Доверенный владелец счетов.

- 6.7. Закрепление зарегистрированного торгового счета осуществляется Клиринговым центром на основании Заявления на закрепление Счета FORTS за разделом клиринговых регистров, предоставленного Участником клиринга или Доверенным владельцем счетов, в соответствии со следующим условием:
- 6.7.1. Заявление на закрепление Счета FORTS за разделом клиринговых регистров, имеющим код Собственной Брокерской фирмы, или Клиентской Брокерской фирмы, или Брокерской фирмы ДУ, вправе подавать Участник клиринга, зарегистрировавший указанную Брокерскую фирму, учитываемый Клиринговым центром для данного торгового счета как лицо, для обеспечения исполнения обязательств которого используются ценные бумаги, учитываемые на торговом счете.
- 6.7.2. Заявление на закрепление торгового счета за разделом клиринговых регистров, имеющим код Обособленной Брокерской фирмы, вправе подавать Доверенный владелец счетов, закрепленный за данной Обособленной Брокерской фирмой и учитываемый Клиринговым центром для данного торгового счета как Доверенный владелец счетов.
- 6.8. Аннулирование закрепления торгового счета за разделом клиринговых регистров осуществляется Клиринговым центром на основании Заявления на аннулирование закрепления Счета FORTS за разделом клиринговых регистров или при закреплении нового Счета FORTS за разделом клиринговых регистров.
- Заявления на аннулирование закрепления Счета FORTS за разделом клиринговых регистров вправе предоставлять Клиринговому центру Участник клиринга, для обеспечения исполнения обязательств которого используются ценные бумаги, учитываемые на данном торговом счете, или Доверенный владелец счетов, учитываемый для данного торгового счета.
- 6.9. Торговый счет, закрепленный за разделом клиринговых регистров, имеющим код Обособленной Брокерской фирмы, не используется для исполнения обязательств Участника клиринга, учитываемым на данном разделе регистра учета позиций, если Доверенный владелец счетов, закрепленный за данной Обособленной Брокерской фирмой, не совпадает с Доверенным владельцем счетов, учитываемым для данного торгового счета.

Статья 7. Клиринговые регистры

- 7.1. Клиринговый центр осуществляет внутренний учет, предусмотренный Законом о клиринге, на клиринговых регистрах. Клиринговые регистры ведутся Клиринговым центром в Клиринговой системе.
- 7.2. Клиринговый центр открывает и ведет следующие клиринговые регистры:
- денежный регистр обеспечения (в российских рублях и в иностранной валюте);
 - депо регистр обеспечения;
 - регистр учета позиций;

- регистр учета позиций по управлению риском.
- 7.3. Денежный регистр обеспечения - клиринговый регистр, предназначенный для учета Средств гарантийного обеспечения в российских рублях или иностранной валюте.
- Депозитарий обеспечения – клиринговый регистр, открытый к Счету FORTS Участника клиринга, клиента Участника клиринга или Доверенного владельца счетов, предназначенный для учета полученного от Расчетного депозитария значения количества ценных бумаг, учитываемых на Счете FORTS.
- Депозитарий обеспечения далее также именуется регистром обеспечения.
- 7.4. Регистр учета позиций - клиринговый регистр, предназначенный для учета допущенных к клирингу обязательств и требований Участника клиринга по заключенным им Срочным контрактам.
- 7.5. Регистр учета позиций по управлению риском - клиринговый регистр, предназначенный для учета нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга по Поручениям на управление риском.
- 7.6. Для каждого Участника клиринга Клиринговый центр также учитывает денежные средства и/или ценные бумаги, внесенные Участником клиринга в качестве взноса в Гарантийный фонд и/или в качестве Обеспечения под стресс.
- 7.7. Порядок ведения клиринговых регистров определен в соответствующих статьях разделов IV и V Правил клиринга.

Статья 8. Порядок открытия и закрытия клиринговых регистров Участникам клиринга

- 8.1. В рамках каждого кода Расчетной фирмы Участнику клиринга Клиринговым центром открываются следующие разделы клиринговых регистров:
- основной собственный раздел Расчетной фирмы с кодом ХХ00000 (на каждом из указанных в пункте 7.2 Правил клиринга клиринговых регистров);
 - ликвидационный раздел регистра учета позиций Расчетной фирмы.
- 8.2. В рамках каждого кода Расчетной фирмы Участнику клиринга Клиринговым центром на клиринговых регистрах, указанных в пункте 7.2 Правил клиринга, могут быть открыты дополнительные собственные разделы, и/или клиентские разделы, и/или разделы ДУ на основании заявления на открытие соответствующего раздела клиринговых регистров в соответствии с условиями, указанными в настоящей статье Правил клиринга.
- При регистрации раздела (группы разделов) клиринговых регистров за этим разделом (группой разделов) закрепляется лицо, в интересах и/или за счет которого будут заключаться сделки с указанием кода соответствующего клирингового регистра. Информация о таком лице указывается Участником клиринга в соответствующем заявлении на открытие раздела клиринговых регистров.
- За дополнительным собственным разделом в качестве такого лица может быть закреплен только Участник клиринга, которому присвоен код Расчетной фирмы, в рамках которой открывается указанный раздел, за клиентским разделом - только

Клиент такого Участника клиринга, за разделом ДУ - только такой Участник клиринга, действующий в качестве управляющего.

- 8.3. Код раздела клиринговых регистров состоит из семи символов, разбитых на три группы. Группы символов в коде раздела клиринговых регистров располагаются в следующем порядке - ХХУУZZZ.

Первая группа является кодом Расчетной фирмы (обозначение - ХХ). В учете Клирингового центра объединяются разделы, имеющие один и тот же код Расчетной фирмы.

Вторая группа состоит из двух символов (обозначение - УУ). Последовательность символов ХХУУ является кодом Брокерской фирмы. В учете Клирингового центра объединяются разделы, имеющие один и тот же код Брокерской фирмы.

Третья группа состоит из трех символов (обозначение - ZZZ). Последовательность символов ХХУУZZZ является кодом раздела клиринговых регистров, указываемым Участником клиринга в заявлениях на открытие раздела клиринговых регистров.

Допустимыми символами кода раздела являются цифры и буквы латинского алфавита.

- 8.4. Брокерская фирма может иметь один из следующих типов:

- Собственная Брокерская фирма;
- Клиентская Брокерская фирма;
- Брокерская фирма ДУ;
- Обособленная Брокерская фирма.

В рамках Собственной Брокерской фирмы открывается основной собственный раздел и могут быть открыты дополнительные собственные разделы. В рамках Клиентской Брокерской фирмы могут быть открыты только клиентские разделы. В рамках Брокерской фирмы ДУ могут быть открыты только разделы ДУ.

- 8.5. В рамках Обособленной Брокерской фирмы открывается ликвидационный раздел регистра учета позиций.

- 8.6. Участником клиринга должны быть открыты отдельные Расчетные коды:

- для всех Собственных Брокерских фирм;
- для всех Клиентских Брокерских фирм;
- для каждой Брокерской фирмы ДУ;
- для каждой Обособленной Брокерской фирмы.

- 8.7. Участнику клиринга могут быть открыты Расчетные коды следующих типов:

- собственный – для учета денежных средств Участника клиринга;
- клиентский – для учета денежных средств Клиента Участника клиринга / Клиентов Участника клиринга;
- ДУ – для учета денежных средств, находящихся в доверительном управлении Участника клиринга.

- 8.8. Клиринговый центр осуществляет учет обязательств по Срочным контрактам и Средств гарантийного обеспечения, являющихся предметом обеспечения

указанных обязательств, по каждому Расчетному коду, открытому Участнику клиринга.

Клиринговый центр не осуществляет зачет (неттинг) обязательств, учитываемых по разным Расчетным кодам, за исключением случаев, установленных в статье 48 Правил клиринга.

- 8.9. Участник клиринга обязан информировать своих Клиентов о предусмотренном Правилами клиринга порядке ведения Клиринговым центром учета обязательств по Срочным контрактам, заключенным в интересах и (или) за счет Клиентов Участников клиринга, и Средств гарантийного обеспечения, являющихся предметом обеспечения указанных обязательств, в том числе о типах Брокерских фирм, в рамках которых открываются различные виды разделов клиринговых регистров, и о типах Расчетных кодов, с которыми могут быть связаны различные типы Брокерских фирм, а также о возможности и порядке открытия Обособленных Брокерских фирм, для которых существует возможность Перевода позиций и Перевода Средств гарантийного обеспечения, по основаниям и в порядке, установленным в статье 46 Правил клиринга.
- 8.10. Открытие Расчетных кодов осуществляется в порядке и случаях, установленных настоящей статьей Правил клиринга.
- 8.11. Участнику клиринга может быть открыто неограниченное количество Расчетных кодов.
- 8.12. Участник клиринга обязан открыть отдельную Клиентскую Брокерскую фирму и отдельный клиентский Расчетный код для Клиента Участника клиринга, для которого в соответствии с действующими нормативными актами Российской Федерации Участник клиринга требует от клиринговой организации ведения отдельного учета денежных средств и иного имущества этого Клиента Участника клиринга, переданных клиринговой организации в индивидуальное клиринговое обеспечение.
- 8.13. Каждая Брокерская фирма должна быть связана с Расчетным кодом, имеющим тип, соответствующий типу Брокерской фирмы. Обособленная Брокерская фирма должна быть связана с отдельным клиентским Расчетным кодом.
- 8.14. С одним Расчетным кодом может быть связана одна Брокерская фирма или несколько Брокерских фирм соответствующего типа.
- 8.15. По каждому Расчетному коду учитываются денежные средства, учитываемые на разделах денежного регистра обеспечения, имеющих код Брокерских фирм, связанных с данным Расчетным кодом.
- 8.16. Брокерская фирма с кодом ХХ00 открывается при присвоении Участнику клиринга кода Расчетной фирмы (далее – основная Брокерская фирма) с типом Собственная. Участник клиринга вправе изменить тип основной Брокерской фирмы, предоставив Клиринговому центру соответствующее заявление.
- Одновременно с открытием основной Брокерской фирмы Клиринговый центр открывает Участнику клиринга Расчетный код соответствующего типа и связывает с ним такую Брокерскую фирму.

Для открытия других Брокерских фирм в рамках Расчетной фирмы Участник клиринга предоставляет в Клиринговый центр Заявление на открытие Брокерской фирмы / Заявление на открытие Обособленной Брокерской фирмы.

- 8.17. Заявление на открытие Брокерской фирмы / Заявление на открытие Обособленной Брокерской фирмы, предоставляемое Участником клиринга в Клиринговый центр, должно содержать код и тип Брокерской фирмы, заявление об открытии Расчетного кода соответствующего типа, с которым должна быть связана Брокерская фирма, либо указание на открытый Расчетный код соответствующего типа, с которым должна быть связана Брокерская фирма.

Одновременно с открытием Брокерской фирмы Клиринговый центр открывает Участнику клиринга основной раздел Брокерской фирмы с кодом вида ХХУУ000.

- 8.18. Для того чтобы связать открытые Брокерские фирмы с Расчетным кодом Участник клиринга предоставляет Клиринговому центру:

- Заявление об открытии Расчетного кода для Брокерской фирмы / Брокерских фирм;
- Заявление о соответствии Брокерской фирмы / Брокерских фирм Расчетному коду.

Заявление об открытии Расчетного кода для Брокерской фирмы / Брокерских фирм должно содержать указание на тип Расчетного кода.

- 8.18.1. На основании Заявления об открытии Расчетного кода для Брокерской фирмы / Брокерских фирм Клиринговый центр открывает Участнику клиринга Расчетный код и связывает с ним Брокерскую фирму / Брокерские фирмы, указанные в заявлении.

- 8.18.2. На основании Заявления о соответствии Брокерской фирмы / Брокерских фирм Расчетному коду Клиринговый центр связывает Брокерскую фирму / Брокерские фирмы, указанные в заявлении, с Расчетным кодом, указанным в заявлении.

- 8.19. Для регистрации Обособленной Брокерской фирмы в Заявлении на открытие Обособленной Брокерской фирмы должно быть указано лицо (лица), входящее (входящие) в список Доверенных владельцев счетов Клирингового центра. Указанный Доверенный владелец счетов закрепляется за данной Обособленной Брокерской фирмой.

- 8.20. Доверенным владельцем счетов по торговому счету депо и депо регистру обеспечения может являться:

- Участник клиринга, которому присвоен код Расчетной фирмы, в рамках которой регистрируется Обособленная Брокерская фирма;
- иное юридическое лицо.

Доверенным владельцем счетов по денежному регистру обеспечения может являться иное юридическое лицо, не являющееся Участником клиринга.

- 8.21. Участник клиринга для получения статуса Доверенного владельца счетов (включения в список Доверенных владельцев счетов Клирингового центра) должен предоставить Клиринговому центру Заявление на получение статуса Доверенного владельца счетов.

Юридическое лицо, не являющееся Участником клиринга, для получения статуса Доверенного владельца счетов должно заключить с Клиринговым центром договор о получении статуса Доверенного владельца счетов (далее в настоящей статье - Договор). Для заключения Договора юридическое лицо, являющееся Резидентом, должно предоставить в Клиринговый центр комплект документов в соответствии с перечнем, приведенным в разделе I приложения № 3 к Правилам клиринга, являющееся Нерезидентом - комплект документов в соответствии с перечнем, приведенным в разделе II приложения № 3 к Правилам клиринга (за исключением отчетности, указанной в приложении № 4 к Правилам клиринга), если такой комплект документов не предоставлялся в Клиринговый центр ранее.

Список Доверенных владельцев счетов публикуется Клиринговым центром на Сайте Клирингового центра.

- 8.21.1. Аннулирование статуса Доверенного владельца счетов у Участника клиринга осуществляется Клиринговым центром при расторжении Договора об оказании клиринговых услуг, при прекращении допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию в соответствии с Правилами клиринга или на основании заявления, полученного от Участника клиринга. Аннулирование статуса Доверенного владельца счетов у лица, не являющегося Участником клиринга, осуществляется Клиринговым центром при расторжении Договора с этим лицом.
- 8.22. Заявление на открытие Собственной Брокерской фирмы, Клиентской Брокерской фирмы или Брокерской фирмы ДУ подписывается Участником клиринга, которому присвоен код Расчетной фирмы, в рамках которой открывается данная Брокерская фирма.
- 8.23. Заявление на открытие Обособленной Брокерской фирмы подписывается Участником клиринга, которому присвоен код Расчетной фирмы, в рамках которой открывается данная Обособленная Брокерская фирма, и Доверенным владельцем счетов / Доверенными владельцами счетов, указанными в заявлении.
- 8.23.1. Указанное заявление может быть оформлено как единый документ, подписанный всеми указанными лицами, или как два (три) идентичных документа, подписанных каждым из указанных лиц.
- 8.24. Доверенный владелец счетов, закрепленный за Обособленной Брокерской фирмой, вправе аннулировать статус Доверенного владельца счетов по данной Обособленной Брокерской фирме, предоставив Клиринговому центру Заявление об аннулировании статуса Доверенного владельца счетов. Обособленная Брокерская фирма, статус Доверенного владельца счетов, закрепленного за которой, аннулирован на основании его заявления, далее именуется Обособленной Брокерской фирмой без Доверенного владельца счетов.
- 8.24.1. Закрепление нового Доверенного владельца счетов за Обособленной Брокерской фирмой без Доверенного владельца счетов осуществляется на основании Заявления на закрепление Доверенного владельца счетов, подписанного Участником клиринга, которому присвоен код Расчетной фирмы, в рамках которой открыта данная Обособленная Брокерская фирма, и новым Доверенным владельцем счетов. Указанное заявление подается в Клиринговый центр в порядке, указанном в пункте 8.23.1 Правил клиринга.

8.25. Участник клиринга вправе изменить тип Клиентской Брокерской фирмы на Обособленную Брокерскую фирму.

Изменение типа Брокерской фирмы осуществляется Клиринговым центром на основании предоставляемого Участником клиринга Клиринговому центру Заявления на изменение типа Брокерской фирмы, подписанного Участником клиринга и Доверенным владельцем счетов и подаваемого в порядке, указанном в пункте 8.23.1 настоящей статьи Правил клиринга.

Заявление на изменение типа Брокерской фирмы исполняется при соблюдении следующих условий:

- до изменения типа Брокерской фирмы отсутствует Маржинальное требование, учитываемое по Расчетной фирме, в рамках которой открыта данная Брокерская фирма, и Маржинальное требование, учитываемое по данной Брокерской фирме;
- после изменения типа Брокерской фирмы не возникает Маржинальное требование, учитываемое по Расчетной фирме, в рамках которой открыта данная Брокерская фирма, и Маржинальное требование, учитываемое по данной Брокерской фирме.

8.26. Для закрытия клиентских разделов и дополнительных собственных разделов Участник клиринга предоставляет в Клиринговый центр Заявление на закрытие разделов клиринговых регистров, которое должно содержать номера закрываемых разделов и дату закрытия. Закрытие указанных разделов клиринговых регистров возможно только при отсутствии открытых позиций по Срочным сделкам и нулевых остатках денежных средств и ценных бумаг, учитываемых на данных разделах денежного регистра обеспечения и депо регистра обеспечения.

8.27. Закрытие основного раздела Брокерской фирмы осуществляется на основании Заявления на закрытие разделов клиринговых регистров Участника клиринга после закрытия всех остальных разделов данной Брокерской фирмы.

8.28. Закрытие основного собственного раздела клиринговых регистров Расчетной фирмы осуществляется Клиринговым центром после закрытия всех остальных разделов клиринговых регистров данной Расчетной фирмы при аннулировании кода Расчетной фирмы.

РАЗДЕЛ II. ТРЕБОВАНИЯ К УЧАСТНИКАМ КЛИРИНГА

Статья 9. Требования к Участникам клиринга

9.1. Для заключения Договора об оказании клиринговых услуг юридическое лицо предоставляет Клиринговому центру:

- Договор об оказании клиринговых услуг по форме, предусмотренной приложением № 1 к Правилам клиринга, в 2 (двух) экземплярах, подписанный уполномоченным лицом юридического лица и скрепленный печатью юридического лица;
- комплект документов в соответствии с перечнем, приведенным в разделе I приложения № 3 к Правилам клиринга.

В случае если какой-либо из документов, указанных в приложении № 3 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.

9.2. Клиринговый центр вправе потребовать от юридического лица предоставления дополнительных документов. При этом юридическое лицо обязано предоставить данные документы в срок, указанный в запросе, а если такой срок не указан, то в течение 5 (пяти) рабочих дней со дня получения им запроса Клирингового центра.

9.3. 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.

9.4. 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.

9.5. 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 в соответствии с разделом I приложения № 3 к Правилам клиринга.

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

- 9.6. Одновременно с ежегодным предоставлением Клиринговому центру Анкеты Участника клиринга (клиента) (Регистрационной карточки) Участник клиринга 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 отзывов о деловой репутации Участник клиринга направляет Клиринговому центру письмо об отсутствии возможности их получения.
- 9.7. Для подтверждения своего финансового состояния Участники клиринга обязаны в течение всего срока действия Договора об оказании клиринговых услуг предоставлять Клиринговому центру отчетность в соответствии с приложением № 4 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 № 4 к Правилам клиринга.
- 9.8. Участник клиринга предоставляет Клиринговому центру Анкету FATCA в форме электронного документа, а также иные прилагаемые к Анкете FATCA документы и сведения, предоставляемые для целей Закона FATCA, необходимость представления которых следует из Анкеты FATCA и (или) действующего законодательства, в том числе согласие на передачу информации в иностранный налоговый орган.
- 9.8.1. 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 и сведениями в форме электронного документа.
- 9.8.2. Форма для заполнения Анкеты FATCA Участниками клиринга размещается на сайте Клирингового центра. При этом документы и сведения, прилагаемые к Анкете FATCA, заполняются Участником клиринга и предоставляются в Клиринговый центр в виде PDF файлов, содержащих скан-копии этих документов.

Статья 10. Условия клирингового обслуживания. Порядок предоставления допуска к клиринговому обслуживанию

- 10.1. Допуск к клиринговому обслуживанию в соответствии с Правилами клиринга предоставляется Участнику клиринга, соответствующему требованиям, установленным пунктом 10.2 Правил клиринга, на основании соответствующего Заявления о предоставлении допуска к клиринговому обслуживанию.
- 10.2. Для допуска к клиринговому обслуживанию в соответствии с Правилами клиринга Участник клиринга должен соответствовать следующим требованиям:
- 10.2.1. иметь действующий Договор об оказании клиринговых услуг, заключенный с Клиринговым центром;

- 10.2.2. иметь действующую лицензию на осуществление банковских операций, выданную Банком России (для кредитных организаций);
- 10.2.3. являться участником Подсистемы ЭДО НКЦ;
- 10.2.4. выполнять требования Клирингового центра по предоставлению информации и отчетности, предусмотренные пунктами 9.5-9.8 Правил клиринга;
- 10.2.5. выполнять требования Клирингового центра к финансовой устойчивости Участника клиринга, предусмотренные пунктом 10.3 или 10.4 Правил клиринга;
- 10.2.6. внести взнос в Гарантийный фонд в соответствии с пунктом 13.3 Правил клиринга;
- 10.2.7. 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 Срочным контрактам, Маржинальные требования и/или иные обязательства Участника клиринга, возникающие из Правил клиринга.
- 10.3. Участники клиринга - кредитные организации должны соответствовать следующим требованиям к финансовой устойчивости:
 - 10.3.1. соблюдать обязательные нормативы Банка России, установленные для кредитных организаций;
 - 10.3.2. в деятельности Участников клиринга должны отсутствовать основания для осуществления мер по предупреждению банкротства в соответствии с законодательством Российской Федерации о несостоятельности (банкротстве), а также основания для отзыва Банком России лицензии на осуществление банковских операций в соответствии с законодательством Российской Федерации о банковской деятельности.
- 10.4. Участники клиринга, не являющиеся кредитными организациями (далее – Участники клиринга – некредитные организации), должны соответствовать следующим требованиям к финансовой устойчивости:
 - 10.4.1. в деятельности Участников клиринга должны отсутствовать основания для осуществления мер по предупреждению банкротства в соответствии с законодательством Российской Федерации о несостоятельности (банкротстве).
- 10.5. Участники клиринга должны соответствовать требованиям к финансовой устойчивости, приведенным в пунктах 10.3-10.4 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.
- 10.6. Клиринговый центр вправе не предоставлять допуск к клиринговому обслуживанию Участникам клиринга, не соответствующим следующим требованиям:
 - 10.6.1. 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;

10.6.2. некредитные организации – наличие по балансу на последнюю отчетную дату положительного финансового результата деятельности, определяемого как прибыль после налогообложения.

10.7. 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.

Статья 11. Порядок регистрации Участников клиринга и их Клиентов

11.1. Клиринговый центр осуществляет регистрацию Участников клиринга, а также по требованию Участника клиринга, - Клиентов Участника клиринга, и присваивает каждому Участнику клиринга / Клиенту Участника клиринга код Участника клиринга и/или код Клиента Участника клиринга, соответственно. Код Участника клиринга присваивается при заключении Участником клиринга с Клиринговым центром Договора об оказании клиринговых услуг.

11.2. Регистрация Клиентов Участника клиринга осуществляется на основании информации, полученной от Участника клиринга.

11.3. Регистрация Участников клиринга и Клиентов Участника клиринга осуществляется Клиринговым центром в соответствии с требованиями нормативных актов Банка России. Участнику клиринга может быть присвоен в Клиринговой системе только один код Участника клиринга.

11.4. Сведения, необходимые для регистрации Участника клиринга / Клиента Участника клиринга, предоставляются Участником клиринга в Клиринговый центр в форме электронного документа.

Технологические особенности присвоения кодов Участникам клиринга и Клиентам Участника клиринга раскрываются на Сайте Клирингового центра.

11.5. Процедура регистрации Участника клиринга предусматривает присвоение Участнику клиринга следующих кодов:

- код Участника клиринга (присваивается в соответствии с нормативными актами Банка России);
- код Расчетной фирмы (присваивается Клиринговым центром).

11.5.1. 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).

- 11.6. Код Расчетной фирмы присваивается Клиринговым центром Участнику клиринга, внесшему взнос в Гарантийный фонд в соответствии с требованием пункта 13.2 Правил клиринга.
- Одному Участнику клиринга может быть присвоено несколько кодов Расчетной фирмы.
- 11.7. Процедура регистрации Клиентов Участника клиринга предусматривает присвоение Клиринговым центром таким Клиентам Участника клиринга следующих уникальных кодов:
- код Клиента Участника клиринга (присваивается в соответствии с нормативными актами Банка России);
 - код раздела клиринговых регистров (указывается Участником клиринга самостоятельно).
- 11.8. Клиринговый центр информирует Участников клиринга о присвоении им, а также их Клиентам кодов путем направления соответствующих уведомлений.
- 11.9. Для регистрации Биржей Участника клиринга / Клиента Участника клиринга в качестве Участника торгов / клиента Участника торгов Клиринговый центр вправе передавать Бирже имеющуюся у него информацию об Участниках клиринга и их Клиентах, а также о присвоенных им кодах.
- 11.10. Клиринговый центр вправе самостоятельно аннулировать регистрацию Клиентов Участника клиринга в случае несоблюдения требований, установленных Правилами клиринга.
- 11.11. Участник клиринга самостоятельно отслеживает полноту и актуальность информации, предоставляемой в целях регистрации кодов Участника клиринга и кодов Клиента Участника клиринга. Клиринговый центр не несет ответственности за актуальность и достоверность информации, предоставленной Участником клиринга, а также за нарушение Участником клиринга порядка предоставления таких сведений.

Статья 12. Порядок приостановления и прекращения допуска к клиринговому обслуживанию

- 12.1. Клиринговый центр вправе приостановить допуск к клиринговому обслуживанию Участника клиринга по любому из следующих оснований:
- 12.1.1. на основании соответствующего уведомления Биржи;
- 12.1.2. при нарушении Участником клиринга установленных Правилами клиринга требований;
- 12.1.3. при применении Банком России к Участнику клиринга – кредитной организации санкций за нарушение банковского законодательства, в том числе: введение запрета на осуществление Участником клиринга отдельных банковских операций, если это приведет к невозможности заключения и/или исполнения Участником клиринга сделок и назначение временной администрации по управлению кредитной организацией – Участником клиринга в рамках мер по предупреждению банкротства кредитной организации;

- 12.1.4. при применении к Участнику клиринга санкций уполномоченных органов за нарушение законодательства Российской Федерации, в том числе при применении административных наказаний;
- 12.1.5. по результатам рассмотрения Клиринговым центром предоставленных Участником клиринга в соответствии с пунктами 9.5-9.8 Правил клиринга информации и документов, а также в случае их непредоставления в надлежащий срок;
- 12.1.6. в случае отсутствия в отчетности Участника клиринга положительного финансового результата, предусмотренного пунктом 10.6 Правил клиринга, по состоянию на две и более последовательные отчетные даты;
- 12.1.7. 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 Срочным контрактам, Маржинальные требования и/или иные обязательства Участника клиринга, возникающие из Правил клиринга;
- 12.1.8. при наличии фактов неисполнения или ненадлежащего исполнения Участником клиринга обязательств перед Клиринговым центром, возникших из Договора об оказании клиринговых услуг при оказании Клиринговым центром услуг в соответствии с иными правилами клиринга, утвержденными Клиринговым центром и регламентирующими различные направления клиринговой деятельности;
- 12.1.9. в случае непредоставления Участником клиринга Анкеты FATCA в соответствии с пунктом 9.8 Правил клиринга;
- 12.1.10. в случае получения от иностранного налогового органа уведомления о невыполнении Участником клиринга требований законодательства иностранного государства;
- 12.1.11. при несоответствии размера вноса Участника клиринга в Гарантийный фонд размеру, установленному в соответствии с пунктом 13.3 Правил клиринга;
- 12.1.12. при несоответствии размера Обеспечения под стресс Участника клиринга размеру, установленному в соответствии с пунктом 13.4 Правил клиринга.
- 12.2. При наличии оснований, указанных в пункте 12.1 Правил клиринга, Клиринговый центр вправе установить для Участника клиринга Режим закрытия позиций..
 - 12.2.1. После получения информации о прекращении действия оснований, указанных в пункте 12.1 Правил клиринга, Клиринговый центр вправе принять решение об отмене Режима закрытия позиций, установленного для Участника клиринга.
 - 12.2.2. Клиринговый центр с использованием Торговой системы Биржи уведомляет Биржу об установлении / об отмене для Участника клиринга Режима закрытия позиций.
- 12.3. В случае если действие оснований для установления Участнику клиринга Режима закрытия позиций не прекращено в течение 3-х рабочих дней после установления указанного Режима в соответствии с пунктами 12.2, 30.8 или 37.9 Правил клиринга, Клиринговый центр вправе приостановить допуск к клиринговому обслуживанию Участника клиринга, начиная с 4-го рабочего дня с даты установления указанного Режима.

- 12.4. В случае приостановления допуска к клиринговому обслуживанию Клиринговый центр продолжает осуществлять клиринг и иные функции, связанные с осуществлением клиринга по сделкам, заключенным данным Участником клиринга до момента приостановления допуска к клиринговому обслуживанию Участника клиринга и/или по сделкам, приводящим к закрытию позиций Участника клиринга.
- 12.5. В случае приостановления допуска к клиринговому обслуживанию Клиринговый центр вправе применить к Участнику клиринга процедуру принудительного закрытия позиций в соответствии со статьей 35 Правил клиринга.
- 12.6. 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.
- 12.7. Клиринговый центр прекращает допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию по любому из следующих оснований:
- 12.7.1. в случае прекращения действия Договора об оказании клиринговых услуг;
- 12.7.2. в случае отзыва (аннулирования) Банком России лицензии на осуществление банковских операций у Участника клиринга – кредитной организации;
- 12.7.3. в случае назначения временной администрации или принятия арбитражным судом решения о введении в отношении Участника клиринга – некредитной организации, одной из процедур банкротства;
- 12.7.4. ликвидации Участника клиринга, а также в случае реорганизации Участника клиринга при условии, что деятельность Участника клиринга в результате реорганизации прекращается;
- 12.7.5. 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.
- 12.8. Клиринговый центр вправе прекратить допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию по любому из следующих оснований:
- при поступлении в Клиринговый центр уведомления от Биржи о прекращении допуска Участника клиринга к участию в торгах на Бирже;
 - неоднократного (два и более раза) в течение одного года неисполнения Участником клиринга своих обязательств, допущенных к клирингу, и/или иных денежных обязательств Участника клиринга, возникающих на основании Правил клиринга;
 - неоднократного (два и более раза) в течение одного года нарушения Участником клиринга установленных Правилами клиринга требований.

- 12.9. Клиринговый центр извещает Участника клиринга и Биржу о приостановлении / прекращении или возобновлении приостановленного допуска к клиринговому обслуживанию не позднее рабочего дня, следующего за днем приостановления / прекращения или возобновления приостановленного допуска к клиринговому обслуживанию.

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

Статья 13. Перечень мер, направленных на управление рисками при осуществлении клиринга

- 13.1. В целях снижения рисков, связанных с осуществлением клиринга, Клиринговый центр:
- предъявляет требования к финансовой устойчивости Участников клиринга;
 - предъявляет к Участникам клиринга требование о внесении Средств гарантийного обеспечения и Обеспечения под стресс;
 - устанавливает Лимит колебаний цен сделок для каждого фьючерсного контракта, за пределы которого не может выходить цена фьючерсного контракта, указанная в Заявке;
 - осуществляет предварительный контроль достаточности Средств гарантийного обеспечения Участника клиринга при подаче заявок на заключение Срочных контрактов;
 - устанавливает предельные доли иностранных валют и ценных бумаг, принимаемых в качестве Средств гарантийного обеспечения. Для иностранной валюты или ценной бумаги, предельная доля которой меньше 100%, устанавливает коэффициент ликвидности и учитывает его при расчете Торгового лимита;
 - осуществляет расчет и контроль Торгового лимита по Срочным контрактам;
 - два раза в каждый Расчетный день осуществляет переоценку стоимости Средств гарантийного обеспечения Участника клиринга и контроль их достаточности для обеспечения исполнения обязательств по заключенным Участником клиринга Срочным контрактам, и в случае недостаточности – предъявляет Участнику клиринга Маржинальное требование;
 - формирует Гарантийный фонд;
 - не реже, чем каждый Расчетный день, осуществляет переоценку стоимости ценных бумаг и иностранной валюты, учитываемых в качестве взносов в Гарантийный фонд и Обеспечения под стресс и в случае недостаточности – предъявляет Участнику клиринга Маржинальное требование по фондам и (или) Маржинальное требование по обеспечению под стресс.
- 13.2. Предельные доли иностранных валют и ценных бумаг, принимаемых в качестве Средств гарантийного обеспечения, и коэффициенты ликвидности для иностранной валюты или ценной бумаги, предельная доля которой меньше 100%, устанавливаются решением Клирингового центра.
- 13.3. Гарантийный фонд формируется Клиринговым центром за счет взносов в Гарантийный фонд всех Участников клиринга.
- 13.3.1. Размер взноса в Гарантийный фонд по Расчетной фирме (далее – Размер взноса) зависит от категории Расчетной фирмы, которая определяется перечнем Рынков, на которых могут заключаться сделки с указанием кода данной Расчетной фирмы. Порядок определения Размера взноса, категории Расчетных фирм и перечень

Рынков устанавливаются Методикой определения размера взноса в Гарантийный фонд, являющейся приложением № 7 к Правилам клиринга.

- 13.4. Обеспечение под стресс обязаны вносить все Участники клиринга.
Порядок определения размера Обеспечения под стресс Участника клиринга установлен Методикой определения размера Обеспечения под стресс.
- 13.5. 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.
- 13.5.1. Перечень ценных бумаг, принимаемых Клиринговым центром в качестве взноса в Гарантийный фонд и/или Обеспечения под стресс, устанавливается решением Клирингового центра.
- 13.5.2. Предельная доля иностранной валюты, принимаемой в качестве взноса в Гарантийный фонд и/или Обеспечения под стресс Участника клиринга, составляет 100%.
Предельная доля ценных бумаг, принимаемых Клиринговым центром в качестве взноса в Гарантийный фонд и/или Обеспечения под стресс, составляет 100%.
- 13.6. Информация о текущем размере Гарантийного фонда раскрывается на Сайте Клирингового центра.
- 13.7. Порядок установления и изменения Лимита колебаний цен сделок определен в приложении №5 к Правилам клиринга.

Статья 14. Торговый лимит

- 14.1. Торговый лимит по разделу клиринговых регистров рассчитывается по формуле:

$$TL_R = \begin{cases} M_R + S_{2R} + \min(S_{1R}; \max(0; M_R + S_{2R}) \times (\frac{1}{k_R} - 1)), & \text{если } 0 < k_R \leq 1 \\ M_R + S_{2R} + S_{1R} & \text{если } k_R = 0 \end{cases}, \text{ где}$$

TL_R – Торговый лимит по разделу клиринговых регистров,

M_R – денежные средства в российских рублях, учитываемые на разделе денежного регистра обеспечения в качестве Средств гарантийного обеспечения,

S_{1R} – оценочная стоимость ценных бумаг и иностранных валют, учитываемых на разделе депо регистра обеспечения / денежного регистра обеспечения в качестве Средств гарантийного обеспечения, и предельная доля которых установлена в размере, меньшем 100%,

k_R – коэффициент ликвидности, установленный Клиринговым центром или Участником клиринга в соответствии с пунктом 15.4 Правил клиринга, для ценных бумаг и иностранных валют, предельная доля которых установлена в размере, меньшем 100%;

S_{2R} – оценочная стоимость ценных бумаг и иностранных валют, учитываемых на разделе депо регистра обеспечения / денежного регистра обеспечения в качестве

Средств гарантийного обеспечения, и предельная доля которых установлена в размере 100%.

- 14.2. Торговый лимит Брокерской фирмы (Собственной, Клиентской, ДУ, Обособленной) рассчитывается по формуле:

$$TL_B = \begin{cases} M + S_2 + \min(S_1; \max(0; M + S_2) \times (\frac{1}{k} - 1)), & \text{если } 0 < k \leq 1 \\ M + S_2 + S_1 & \text{, если } k = 0 \end{cases}, \text{ где}$$

TL_B – Торговый лимит Брокерской фирмы,

M – сумма денежных средств в российских рублях, учитываемых на всех разделах денежного регистра обеспечения, имеющих код Брокерской фирмы, в качестве Средств гарантийного обеспечения,

S_1 – оценочная стоимость ценных бумаг и иностранных валют, учитываемых на всех разделах депо регистра обеспечения / денежного регистра обеспечения, имеющих код Брокерской фирмы, в качестве Средств гарантийного обеспечения, и предельная доля которых установлена в размере, меньшем 100%,

k – коэффициент ликвидности, установленный Клиринговым центром для ценных бумаг и иностранных валют, предельная доля которых установлена в размере, меньшем 100%;

S_2 – оценочная стоимость ценных бумаг и иностранных валют, учитываемых на всех разделах депо регистра обеспечения / денежного регистра обеспечения, имеющих код Брокерской фирмы, в качестве Средств гарантийного обеспечения, и предельная доля которых установлена в размере 100%.

- 14.3. Торговый лимит по всем Собственным и Клиентским Брокерским фирмам, открытым в рамках одной Расчетной фирмы, рассчитывается по формуле:

$$TL_{BA} = \begin{cases} \sum_B M_B + \sum_B S_{2B} + \sum_B (\min(S_{1B}; \max(0; M_B + S_{2B}) \times (\frac{1}{k} - 1))), & \text{если } 0 < k \leq 1 \\ \sum_B (M_B + S_{2B} + S_{1B}) & \text{, если } k = 0 \end{cases}, \text{ где}$$

TL_{BA} – Торговый лимит по Собственным и Клиентским Брокерским фирмам,

\sum_B - суммирование по Собственным и Клиентским Брокерским фирмам,

M_B – денежные средства в российских рублях, учитываемые на всех разделах денежного регистра обеспечения, имеющих код Собственной или Клиентской Брокерской фирмы, в качестве Средств гарантийного обеспечения,

S_{1B} – оценочная стоимость ценных бумаг и иностранных валют, учитываемых на всех разделах депо регистра обеспечения / денежного регистра обеспечения, имеющих код Собственной или Клиентской Брокерской фирмы, в качестве Средств гарантийного обеспечения, и предельная доля которых установлена в размере, меньшем 100%,

k – коэффициент ликвидности, установленный Клиринговым центром для ценных бумаг и иностранных валют, предельная доля которых установлена в размере, меньшем 100%;

S_{2B} – оценочная стоимость ценных бумаг и иностранных валют, учитываемых на всех разделах депо регистра обеспечения / денежного регистра обеспечения, имеющих код Собственной или Клиентской Брокерской фирмы, в качестве Средств гарантийного обеспечения, и предельная доля которых установлена в размере 100%.

- 14.4. Участник клиринга вправе устанавливать (изменять) значения денежных средств / оценочной стоимости ценных бумаг и иностранных валют, учитываемых на разделе клиринговых регистров (значения M_R / S_R) (далее - Клиентский лимит), а также значение коэффициента ликвидности для определенных разделов клиринговых регистров в Торговой системе Биржи в ходе проведения Торгов.
- 14.4.1. Установленные (измененные) Клиентские лимиты и значения коэффициентов ликвидности для разделов клиринговых регистров незамедлительно передаются Биржей Клиринговому центру посредством Торговой системы.

Статья 15. Порядок подачи и исполнения Поручений на управление риском

- 15.1. Для получения возможности подачи Участником клиринга Поручения на управление риском Участник клиринга обязан предоставить Клиринговому центру Заявление о соответствии Брокерской фирмы Расчетному коду валютного рынка.

В Заявлении о соответствии Брокерской фирмы Расчетному коду валютного рынка Участник клиринга указывает Расчетный код, открытый в соответствии с Правилами клиринга на валютном рынке (далее – Расчетный код валютного рынка), код Брокерской фирмы, по которым Участником клиринга будут подаваться и исполняться Поручения на управление риском, а также признак Расчетного кода валютного рынка и тип Брокерской фирмы.

- 15.2. Клиринговый центр утверждает перечень инструментов по управлению риском, в отношении которых возможна подача Поручений на управление риском, а также список параметров инструментов по управлению риском, который содержит:

- код инструмента по управлению риском;
- код и наименование базисного актива инструмента по управлению риском;
- лот инструмента по управлению риском.

- 15.3. Участник клиринга, предоставивший Клиринговому центру Заявление о соответствии Брокерской фирмы Расчетному коду валютного рынка, вправе с использованием Клиринговой системы предоставить Клиринговому центру Поручение на управление риском.

Поручения на управление риском принимаются Клиринговым центром в период времени, установленный Временным регламентом.

В Поручении на управление риском Участник клиринга указывает инструмент управления риском, количество инструментов по управлению риском, код раздела регистра учета позиций по управлению риском, Расчетный код валютного рынка и направленность Поручения на управление риском: на покупку или на продажу.

- 15.4. Поручение на управление риском исполняется при одновременном исполнении следующих условий:
- 1) при условии невозникновения Маржинального требования по разделу регистра учета позиций, имеющих такой же код, как раздел регистра учета позиций по управлению риском, указанный в Поручении на управление риском, а также по Брокерской фирме и Расчетной фирме, соответствующим разделу регистра учета позиций по управлению риском, указанному в Поручении на управление риском;
 - 2) если Единый лимит Участника клиринга, рассчитываемый Клиринговым центром в соответствии с Правилами клиринга на валютном рынке по Расчетному коду валютного рынка, указанному в Поручении на управление риском, в результате исполнения Поручения не станет отрицательным, или отрицательный Единый лимит Участника клиринга по такому Расчетному коду валютного рынка в результате исполнения Поручения не уменьшится.
- 15.5. Клиринговый центр учитывает совокупность поданных Участником клиринга Поручений на управление риском по каждой валюте по каждому инструменту управления риском по разделу регистра учета позиций по управлению риском, указанному в Поручении на управление риском, с датой исполнения в Расчетный день, следующий за текущим Расчетным днем, и учитывает их при расчете Гарантийного обеспечения Участника клиринга по разделу регистра учета позиций, имеющих такой же код, как раздел регистра учета позиций по управлению риском, в соответствии со статьей 33 Правил клиринга.
- 15.6. Поручение на управление риском является бессрчным и не может быть отменено (аннулировано) Участником клиринга.

РАЗДЕЛ IV. ПОРЯДОК И УСЛОВИЯ ДОПУСКА ОБЯЗАТЕЛЬСТВ К КЛИРИНГУ

Статья 16. Возможность заключения Срочного контракта. Изменение Спецификации

- 16.1. Спецификацией или решением Биржи должны быть установлены:
- код (обозначение) Срочного контракта;
 - первый и последний Торговые дни, в которые может быть заключен Срочный контракт.
- 16.1.1. Если в соответствии с условиями Срочного контракта, установленными соответствующей Спецификацией, Правилами клиринга, Правилами торгов необходимо определение расчетной цены и/или Лимитов колебаний цен сделок, то решением Биржи должны быть также установлены:
- начальная расчетная цена в первый день заключения Срочного контракта; и/или
 - начальный Лимит колебаний цен сделок в первый день заключения Срочного контракта.
- 16.2. При получении от Биржи информации о дате первого Торгового дня, в который может быть заключен Срочный контракт на условиях Спецификации, Клиринговый центр устанавливает минимальный Базовый размер гарантийного обеспечения для всех Срочных контрактов, возможность заключения которых будет предоставляться на условиях данной Спецификации, и уведомляет об этом Биржу.
- 16.3. Клиринговый центр вправе изменить в порядке, установленном приложением № 5 к Правилам клиринга, минимальный Базовый размер гарантийного обеспечения для Срочного контракта с определенным кодом.
- 16.4. Биржа вправе по согласованию с Клиринговым центром внести изменения и/или дополнения в Спецификацию, изменяющие условия заключения Срочного контракта и/или условия ранее заключенных Срочных контрактов.
- Последствия внесения изменений и/или дополнений в Спецификацию устанавливаются этой Спецификацией.
- Уведомление Участников клиринга о внесении изменений и/или дополнений в Спецификацию осуществляется Клиринговым центром не позднее, чем за 1 (один) Расчетный день до введения в действие Спецификации с внесенными в нее изменениями и дополнениями путем ее раскрытия на Сайте Клирингового центра.

Статья 17. Порядок взаимодействия с Биржей

- 17.1. Каждый Расчетный день до начала Торгового дня Клиринговый центр передает Бирже следующую информацию:
- а) список зарегистрированных Клиентов;
 - б) значения Торговых лимитов;
 - в) дополнительные параметры.

Значения Торговых лимитов для каждого Участника клиринга передаются Бирже по каждому присвоенному ему коду Расчетной фирмы и каждому коду Брокерской фирмы.

17.2. Дополнительными параметрами, передаваемыми Бирже, оказывающей услуги, способствующие заключению Срочных контрактов, являются:

- перечень разделов клиринговых регистров по каждой Расчетной фирме;
- объем обязательств, учитываемых на каждом разделе регистра учета позиций;
- Гарантийное обеспечение, рассчитанное по каждому разделу регистра учета позиций, по каждой Брокерской фирме и по каждой Расчетной фирме;
- сумма денежных средств в российских рублях, учитываемых в качестве Средств гарантийного обеспечения, по группе разделов денежного регистра обеспечения, имеющих одинаковый код Брокерской фирмы ($\sum_i M_i$) (далее – Брокерский лимит);
- где M_i – денежные средства, учитываемые на i -м разделе денежного регистра обеспечения;
- сумма оценочной стоимости ценных бумаг и иностранных валют, учитываемых в качестве Средств гарантийного обеспечения, предельная доля которых установлена в размере, меньшем 100%, суммарно по группе разделов депо регистра обеспечения / денежного регистра обеспечения, имеющих одинаковый код Брокерской фирмы ($\sum_i S_{1i}$);

где

S_{1i} – оценочная стоимость ценных бумаг и иностранных валют, учитываемых в качестве Средств гарантийного обеспечения на i -м разделе депо регистра обеспечения / денежного регистра обеспечения, предельная доля которых установлена в размере, меньшем 100% (суммирование осуществляется по всем разделам, входящим в группу);

- сумма оценочной стоимости ценных бумаг и иностранных валют, учитываемых в качестве Средств гарантийного обеспечения, предельная доля которых установлена в размере 100%, суммарно по группе разделов депо регистра обеспечения / денежного регистра обеспечения, имеющих одинаковый код Брокерской фирмы ($\sum_i S_{2i}$);

где

S_{2i} – оценочная стоимость ценных бумаг и иностранной валюты, учитываемых в качестве Средств гарантийного обеспечения на i -м разделе депо регистра обеспечения / денежного регистра обеспечения, предельная доля которых установлена в размере 100% (суммирование осуществляется по всем разделам, входящим в группу);

- Лимит колебаний цен сделок в ходе одного Расчетного периода для каждого фьючерсного контракта;
- Базовый размер гарантийного обеспечения для каждого фьючерсного контракта;

- Нижний и Верхний лимиты колебаний цен каждого фьючерсного контракта.
- 17.3. По итогам дневной клиринговой сессии Клиринговый центр передает Бирже следующую информацию:
- объем обязательств, учитываемых на каждом разделе регистра учета позиций;
 - Гарантийное обеспечение, рассчитанное по каждому разделу регистра учета позиций, по каждой Брокерской фирме и по каждой Расчетной фирме;
 - изменение суммы денежных средств в российских рублях, учитываемых в качестве Средств гарантийного обеспечения, по группе разделов денежного регистра обеспечения, имеющих одинаковый код Брокерской фирмы;
 - изменение размера оценочной стоимости ценных бумаг и иностранной валюты, учитываемых в качестве Средств гарантийного обеспечения, предельная доля которых установлена в размере, меньшем 100%, суммарно по группе разделов депо регистра обеспечения / денежного регистра обеспечения, имеющих одинаковый код Брокерской фирмы;
 - изменение размера оценочной стоимости ценных бумаг и иностранных валют, учитываемых в качестве Средств гарантийного обеспечения, предельная доля которых установлена в размере 100%, суммарно по группе разделов депо регистра обеспечения / денежного регистра обеспечения, имеющих одинаковый код Брокерской фирмы;
 - Лимит колебаний цен сделок в ходе одного Расчетного периода для каждого фьючерсного контракта;
 - Базовый размер гарантийного обеспечения для каждого фьючерсного контракта;
 - Нижний и Верхний лимиты колебаний цен каждого фьючерсного контракта;
 - изменение значения Торговых лимитов для каждой Расчетной фирмы и Брокерской фирмы.
- 17.4. В случае изменения значений Торгового лимита или дополнительных параметров Клиринговый центр незамедлительно передает Бирже указанные измененные значения.
- 17.5. Перед началом каждой дневной и вечерней клиринговой сессии Биржа передает Клиринговому центру для каждого Срочного контракта расчетную цену, а также расчетную цену без учета ограничений на отклонение от предыдущей расчетной цены.

Статья 18. Порядок взаимодействия с Биржей при подаче и отзыве Заявок и заключении сделок, допуске к клирингу обязательств по сделкам

- 18.1. Предусмотренный настоящей статьей порядок взаимодействия Клирингового центра с Биржей применяется при подаче Заявок на заключение Срочных контрактов.
- 18.2. При подаче участником торгов Заявки Биржа посредством Торговой системы направляет Клиринговому центру информацию о поданной Заявке.

- 18.3. Клиринговый центр посредством Торговой системы направляет Бирже отказ в объявлении поданной Заявки в случаях, установленных Правилами клиринга.
- 18.4. При получении информации о поданной Заявке на заключение Срочных контрактов Клиринговый центр немедленно в порядке, определенном в статье 19 Правил клиринга, проверяет возможность объявления Заявки.
- 18.5. В случае положительного результата проверки, указанной в пункте 18.4 настоящей статьи, Клиринговый центр посредством Торговой системы направляет Бирже подтверждение возможности объявления Заявки, в случае отрицательного результата - отказ в объявлении Заявки.
- 18.6. В ходе вечерней клиринговой сессии, после выполнения всех операций, изменяющих регистры учета позиций, денежные регистры обеспечения, депо регистр обеспечения, Клиринговый центр проверяет для каждой Активной заявки, поданной от имени Участника клиринга с указанием кода Расчетной фирмы, соблюдение условий возможности объявления Заявок, предусмотренных статьей 19 Правил клиринга. При отрицательном результате проверки Клиринговый центр посредством Торговой системы направляет Бирже уведомление о необходимости удаления данной Активной заявки.
- 18.7. Клиринговый центр посредством Торговой системы направляет Бирже уведомление о необходимости удаления Активной заявки в иных случаях, установленных Правилами клиринга.
- 18.8. Биржа посредством Торговой системы незамедлительно сообщает Клиринговому центру об отзыве / удалении Активной заявки.
- 18.9. По встречным Активным заявкам, для которых выполняются условия, установленные Правилами торгов, Клиринговый центр совершает сделку с каждым из Участников клиринга, подавшим данные Заявки.
- 18.10. В целях создания условий для исполнения обязательств по Срочным контрактам Клиринговый центр вправе заключать Срочные контракты на основании Заявок, поданных в Торговую систему Клиринговым центром.
- 18.11. После регистрации сделки в Торговой системе Биржа посредством Торговой системы передает Клиринговому центру информацию о заключенных Срочных контрактах.
- После получения указанной информации Клиринговый центр допускает к клирингу обязательства по заключенным Срочным контрактам.

Статья 19. Порядок проверки возможности объявления Заявки на заключение Срочных контрактов

- 19.1. Клиринговый центр по указанию Участника клиринга осуществляет расчет Торгового лимита по разделу клиринговых регистров в целях контроля возможности объявления Заявки. Данное указание передается Участником клиринга через Торговую систему Биржи.

19.2. Клиринговый центр в порядке, определенном в статье 34 Правил клиринга, производит расчет следующих величин:

- рассчитывается величина SZ_R по разделу регистра учета позиций, указанному в Заявке, в случае получения соответствующего указания от Участника клиринга;
- рассчитывается величина SZ_B для Брокерской фирмы (Собственной, Клиентской, ДУ, Обособленной), код которой определяется по коду раздела регистра учета позиций, указанному в Заявке;
- рассчитывается величина SZ для Расчетной фирмы, код которой определяется по коду раздела регистра учета позиций, указанному в Заявке.

При этом, указанные величины SZ_B и SZ рассчитываются на основании:

- Торговых лимитов на момент расчета;
- Гарантийного обеспечения, рассчитываемого по обязательствам по Срочным контрактам и Активным Заявкам, учитываемым Клиринговым центром на момент расчета, а также по поданной Заявке в следующем порядке:
 - по каждой комбинации из обязательств по Срочным контрактам, Активных заявок и поданной Заявки рассчитывается сумма Гарантийного обеспечения (G_i) в порядке, установленном статьей 33 Правил клиринга. При этом, Активная и поданная Заявка рассматриваются как заключенные Срочные контракты;
 - из рассчитанных значений сумм Гарантийного обеспечения (G_i) выбирается максимальное значение ($\max_i G_i$).

19.3. Заявка на заключение Срочных контрактов не может быть объявлена, если выполняется хотя бы одно из следующих условий:

- Заявка подана на заключение сделки с указанием раздела регистра учета позиций, имеющего код Расчетной фирмы, категория которой (как она определена в Методике расчета размера вноса в Гарантийный фонд) не допускает заключение таких сделок;
- Клиринговый центр установил запрет на объявление поданных от имени Участника клиринга с использованием определенного кода Расчетной фирмы Заявок на заключение Срочных контрактов в соответствии с требованиями Правил клиринга;
- возникновение или увеличение Маржинального требования, учитываемого по разделу регистра учета позиций, определяемого в соответствии со статьей 34 Правил клиринга на основании рассчитанной величины SZ_R , в случае получения от Участника клиринга указания в соответствии с пунктом 19.1 Правил клиринга;
- возникновение или увеличение Маржинального требования, учитываемого по Брокерской фирме, определяемого в соответствии со статьей 34 Правил клиринга на основании рассчитанной величины SZ_B ;
- возникновение или увеличение Маржинального требования, учитываемого по Расчетной фирме, определяемого в соответствии со статьей 34 Правил клиринга на основании рассчитанной величины SZ ;

- Заявка подана в нарушение установленного в отношении Участника клиринга Режима закрытия позиций.

19.4. В случае если ни одно из условий, указанных в пункте 19.3 Правил клиринга, не выполняется, Заявка на заключение Срочных контрактов может быть объявлена.

Статья 20. Порядок определения и учета обязательств по Срочным контрактам

20.1. Клиринговый центр осуществляет определение обязательств по Срочным контрактам и их учет в соответствии со Спецификациями и Правилами клиринга.

20.1.1. Определение обязательств по Срочным контрактам осуществляется Клиринговым центром в следующем порядке:

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

20.2. Срочные контракты учитываются Клиринговым центром в составе позиций после первого определения обязательства по перечислению вариационной маржи / премии по данному Срочному контракту в ходе дневной или вечерней клиринговой сессии.

Каждая позиция по Срочным контрактам определяется:

- кодом Срочного контракта и кодом раздела регистра учета позиций, с указанием которого заключены Срочные контракты с данным кодом (далее указанные Срочные контракты именуются Срочными контрактами, составляющими позицию, указанный раздел регистра учета позиций именуется разделом регистра учета позиций, на котором учитывается позиция по Срочным контрактам);
- положением стороны (Покупатель / Держатель или Продавец / Подписчик), которой является Участник клиринга и Клиринговый центр по обязательствам по Срочным контрактам, составляющим позицию (далее – сторона позиции по Срочным контрактам);
- количеством Срочных контрактов, составляющих позицию (далее – размер позиции по Срочным контрактам).

Положение стороны и количество Срочных контрактов, учитываемых в составе позиции, определяются в предположении, что указанные Срочные контракты были расторгнуты (прекращены) как это определено далее в настоящем пункте Правил клиринга.

Два Срочных контракта, учитываемых в составе позиции, по одному из которых Участник клиринга является Покупателем / Держателем, а по другому - Продавцом / Подписчиком, считаются расторгнутыми (прекращенными), за исключением случая, когда одновременно выполняются следующие условия:

- клиринговая сессия является дневной;
- Спецификацией указанных Срочных контрактов предусмотрено, что сумма вариационной маржи, подлежащая перечислению в вечернюю клиринговую сессию, зависит от суммы вариационной маржи, перечисленной в дневную

клиринговую сессию.

При расторжении (прекращении) Срочных контрактов ранее возникшие обязательства по таким Срочным контрактам не прекращаются.

Срочная сделка является офсетной сделкой по отношению к учитываемой позиции по Срочным контрактам, если в результате ее заключения размер позиции уменьшается и не изменяются стороны позиции (далее – закрытие позиции по Срочному контракту). Закрытие позиции по Срочному контракту происходит также в результате прекращения обязательств по Срочным контрактам в порядке, установленном Правилами клиринга.

Увеличение размера позиции в результате заключения Срочного контракта именуется открытием позиции.

Две позиции по Срочным контрактам с одним кодом, учитываемые на разных разделах регистра учета позиций, являются противоположными, если по одной из них Участник клиринга является Покупателем / Держателем, а по другой этот или иной Участник клиринга является Продавцом / Подписчиком.

Обязательства по заключенному Срочному контракту и обязательства по позиции по Срочному контракту с тем же кодом являются противоположными, если сторона, которой является Клиринговый центр в указанном Срочном контракте, и сторона, которой является Клиринговый центр в указанной позиции, являются противоположными.

Обязательства по заключенному Срочному контракту и позиция по Срочному контракту с тем же кодом являются однонаправленными, если сторона, которой является Клиринговый центр в указанном Срочном контракте, и сторона, которой является Клиринговый центр в указанной позиции, совпадают.

Статья 21. Порядок изменения учета обязательств по Срочным контрактам

- 21.1. Участник клиринга вправе поручить Клиринговому центру изменить порядок учета обязательств по Срочным контрактам на разделах регистра учета позиций.
- 21.2. Изменение учета обязательств по Срочным контрактам осуществляется Клиринговым центром в ближайшую дневную или вечернюю клиринговую сессию на основании Поручения на перевод позиций, подаваемого Участником клиринга.
- 21.3. Поручение на перевод позиций содержит:
 - код Срочного контракта;
 - код раздела для прекращения учета обязательств;
 - код раздела для начала учета обязательств;
 - количество Срочных контрактов.
- 21.4. В Поручении на перевод позиций в качестве раздела для прекращения учета обязательств можно указывать раздел регистра учета позиций, раздел Брокерской фирмы или ликвидационный раздел регистра учета позиций, в качестве раздела для начала учета обязательств - раздел регистра учета позиций.
- 21.5. Необходимым условием исполнения Поручения на перевод позиций между разделами регистра учета позиций является совпадение лиц, в интересах и/или за

счет которых заключаются сделки с указанием кода соответствующего раздела регистра учета позиций, закрепленных за обоими разделами.

- 21.6. Изменение учета обязательств по Срочным контрактам осуществляется Клиринговым центром только в случае, если это не приводит к возникновению или увеличению Маржинального требования, определяемого в соответствии с Правилами клиринга, у Участника клиринга по разделам регистра учета позиций, указанным в Поручении на перевод позиций, а также по Брокерским фирмам и Расчетным фирмам, соответствующим разделам регистра учета позиций, указанным в Поручении на перевод позиций.
- 21.7. Для исполнения Поручения на перевод позиций Клиринговый центр прекращает учитывать обязательства по Срочным контрактам по разделу регистра учета позиций для прекращения учета обязательств в количестве, указанном в поручении, и начинает учитывать указанные обязательства по разделу регистра учета позиций для начала учета обязательств.
- 21.8. За исполнение Поручения на перевод позиций с Участника клиринга взимается плата в размере, установленном приложением № 2 к Правилам клиринга.
- 21.8.1. Порядок исполнения обязательства Участника клиринга по внесению платы за исполнение Поручения на перевод позиций определен в статье 32 Правил клиринга.

РАЗДЕЛ V. ПОРЯДОК ПРОВЕДЕНИЯ КЛИРИНГА

ПОДРАЗДЕЛ V-I. ПОРЯДОК ВНЕСЕНИЯ И ВОЗВРАТА СРЕДСТВ ГАРАНТИЙНОГО ОБЕСПЕЧЕНИЯ, ОБЕСПЕЧЕНИЯ ПОД СТРЕСС И ВЗНОСА В ГАРАНТИЙНЫЙ ФОНД

Статья 22. Порядок внесения и возврата Средств гарантийного обеспечения в денежных средствах

22.1. В качестве Средств гарантийного обеспечения принимаются российские рубли, а также иностранная валюта и ценные бумаги, входящие в установленный решением Клирингового центра Перечень иностранной валюты и ценных бумаг, принимаемых в качестве Средств гарантийного обеспечения (далее - Перечень).

Перечень формируется в соответствии с Методикой выбора и оценки иностранных валют и ценных бумаг, принимаемых в качестве Средств гарантийного обеспечения, утвержденной Клиринговым центром.

Указанная методика также устанавливает порядок определения ограничения на максимальную сумму иностранной валюты каждой страны, принимаемой в качестве Средств гарантийного обеспечения одной Расчетной фирмы, ставки дисконта, применяемой при расчете оценочной стоимости иностранной валюты, принимаемой в качестве Средств гарантийного обеспечения, а также порядок определения указанной оценочной стоимости.

22.2. Денежные средства в соответствующей валюте, предоставляемые в качестве Средств гарантийного обеспечения, перечисляются на клиринговый счет Клирингового центра по реквизитам, размещенным на сайте Клирингового центра, с обязательным указанием в назначении платежа кода раздела клиринговых регистров и номера Договора об оказании клиринговых услуг, заключенного между Участником клиринга и Клиринговым центром, если код указанного раздела клиринговых регистров имеет код Собственной Брокерской фирмы, Клиентской Брокерской фирмы или Брокерской фирмы ДУ, или номера договора, заключенного между Доверенным владельцем счетов, закрепленным за Обособленной Брокерской фирмой, и Клиринговым центром, если код указанного раздела клиринговых регистров имеет код данной Обособленной Брокерской фирмы.

Пример назначения платежа для зачисления денежных средств в российских рублях: «Перечисление средств гарантийного обеспечения по договору N ДКУ/XXXXX/XX от DD.MM.YYYY. Код раздела клирингового регистра RRRRRRR. НДС не облагается».

Пример назначения платежа для зачисления денежных средств в иностранной валюте: «FORTSRRRRRR UNDER AGR DKU/XXXXX/XX FROM DD.MM.YYYY».

22.3. В случае поступления денежных средств на клиринговый счет Клирингового центра по поручению на перевод денежных средств с неправильно или неполно указанным назначением платежа, соответствующее поручение на перевод денежных средств подлежит ручной обработке.

- 22.3.1. Проведение ручной обработки поручения на перевод денежных средств с неправильным или неполным назначением платежа осуществляется Клиринговым центром в следующем порядке:
- а) если по назначению платежа, указанному в поручении на перевод денежных средств, можно однозначно определить раздел денежного регистра обеспечения, то обязательства по возврату указанных денежных средств учитываются на таком разделе денежного регистра обеспечения;
 - б) если по назначению платежа, указанному в поручении на перевод денежных средств, можно однозначно определить Расчетную фирму, код которой присвоен Участнику клиринга, то обязательства по возврату указанных денежных средств учитываются на основном собственном разделе денежного регистра обеспечения, имеющего код данной Расчетной фирмы;
 - в) в противном случае Клиринговый центр учитывает обязательства по возврату указанных денежных средств на разделе денежного регистра обеспечения только после получения надлежащим образом оформленного документа, содержащего правильное назначение платежа.
- 22.3.2. Правильное назначение платежа может быть доведено до Клирингового центра двумя способами:
- путем подачи плательщиком в банк плательщика надлежащим образом оформленного письма с указанием правильного назначения платежа;
 - путем подачи надлежащим образом оформленного письма непосредственно в Клиринговый центр.
- 22.3.3. В случае подачи письма непосредственно в Клиринговый центр плательщики, являющиеся юридическими лицами, должны оформить письмо на фирменном бланке организации, заверив его подписями руководителя и главного бухгалтера организации и печатью организации. Если при этом плательщик не является Участником клиринга, то он обязан приложить к письму нотариально заверенную копию карточки с образцами подписей и оттиском печати организации (по форме 0401026).
- 22.3.4. В случае подачи письма непосредственно в Клиринговый центр плательщики, являющиеся физическими лицами, должны либо лично предоставить в Клиринговый центр письмо, указав свои паспортные данные и заверив его собственноручной подписью, либо приложить к письму нотариально заверенную копию паспорта.
- 22.3.5. Если в течение 5 (пяти) Расчетных дней с даты, следующей за датой зачисления денежных средств в российских рублях на клиринговый счет Клирингового центра, или в течение 1 (одного) месяца с даты зачисления денежных средств в иностранной валюте на клиринговый счет Клирингового центра плательщик не предоставит правильное назначение платежа, Клиринговый центр возвращает указанные денежные средства по реквизитам плательщика.
- 22.4. После идентификации раздела денежного регистра обеспечения в соответствии с пунктом 22.3 Правил клиринга, Клиринговый центр начинает учитывать свое обязательство по возврату денежных средств на соответствующем разделе денежного регистра обеспечения.

- 22.4.1. Клиринговый центр обязан по требованию Участника клиринга перечислить с клирингового счета Клирингового центра денежные средства, обязательства по возврату которых учитываются на разделах денежного регистра обеспечения, имеющих код Собственной Брокерской фирмы, Клиентской Брокерской фирмы или Брокерской фирмы ДУ.
- 22.4.2. Клиринговый центр обязан по требованию Доверенного владельца счетов перечислить с клирингового счета Клирингового центра денежные средства, обязательства по возврату которых учитываются на разделах денежного регистра обеспечения, имеющих код Обособленной Брокерской фирмы.
- 22.4.3. Исполнение обязательства Клирингового центра по возврату денежных средств в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга осуществляется в Расчетные дни, в порядке, установленном пунктами 22.5-22.12 настоящей статьи Правил клиринга, в сроки, установленные Временным регламентом, в случае предоставления Клиринговому центру Заявления на возврат денежных средств из Средств гарантийного обеспечения.
- 22.5. Заявление на возврат денежных средств из Средств гарантийного обеспечения, может быть подано при условии регистрации Клиринговым центром Счетов зачисления в соответствующей валюте. Регистрация Счетов зачисления осуществляется Клиринговым центром в соответствии со следующими условиями.
- 22.5.1. Счет зачисления, на который возможно перечисление (возврат) денежных средств, обязательства по возврату которых учитываются на разделах денежного регистра обеспечения, имеющих коды Собственной Брокерской фирмы, Клиентской Брокерской фирмы или Брокерской фирмы ДУ, открытых в рамках одной Расчетной фирмы, регистрируется Клиринговым центром на основании Заявления на регистрацию Счета зачисления, подаваемого Участником клиринга, к которому относится данная Расчетная фирма.
- 22.5.2. Счет зачисления, на который возможно перечисление (возврат) денежных средств, обязательства по возврату которых учитываются на разделах денежного регистра обеспечения, имеющих код Обособленной Брокерской фирмы, регистрируется Клиринговым центром:
- 1) на основании Заявления на регистрацию Счета зачисления, подаваемого Доверенным владельцем счетов, закрепленным за данной Обособленной Брокерской фирмой, при условии, что владельцем такого счета является указанный Доверенный владелец счетов;
 - 2) на основании Заявления на регистрацию Счета зачисления, подаваемого совместно Доверенным владельцем счетов, закрепленным за данной Обособленной Брокерской фирмой, и Участником клиринга, зарегистрировавшим данную Обособленную Брокерскую фирму, при условии, что владельцем такого счета является указанный Участник клиринга. Указанное заявление может быть подано в Клиринговый центр как единый документ, подписанный указанными лицами, или как два идентичных документа, подписанных каждым из указанных лиц.
- 22.5.3. В случае если владельцем Счета зачисления является не Участник клиринга и не Доверенный владелец счетов, Участник клиринга обязан предоставить 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 зачисления является Нерезидент);
 - иные документы (по требованию Клирингового центра).
- 22.5.4. Клиринговый центр вправе отказать в регистрации Счета зачисления и (или) не удовлетворить требование Участника клиринга о возврате денежных средств, составляющих Средства гарантийного обеспечения, в случае, если по заключению Клирингового центра регистрация Счета зачисления на основании Заявления или удовлетворение требования Участника клиринга может повлечь увеличение принимаемых Клиринговым центром рисков и/или нарушение правил и порядка внутреннего контроля, осуществляемого Клиринговым центром в соответствии с нормативными актами в сфере финансовых рынков.
- 22.5.5. В случае если между Участником клиринга / Доверенным владельцем счетов и Клиринговым центром предусмотрен обмен сообщениями по системе S.W.I.F.T., Участник клиринга / Доверенный владелец счетов вправе направить Заявление на возврат денежных средств из Средств гарантийного обеспечения в форме сообщения по системе S.W.I.F.T.
- 22.5.6. В случае изменения реквизитов Счета зачисления Участник клиринга / Доверенный владелец счетов обязан предоставить Клиринговому центру Заявление на регистрацию Счета зачисления, содержащего информацию о новых реквизитах счета.
- Новые реквизиты Счета зачисления действуют с Рабочего дня, следующего за днем получения Клиринговым центром Заявления на регистрацию Счета зачисления.
- Участник клиринга несет риск последствий, вызванных непредоставлением (несвоевременным представлением) Клиринговому центру Заявления на регистрацию Счета зачисления, содержащего информацию о новых реквизитах счета, в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга.
- 22.6. Для Обособленной Брокерской фирмы должен быть зарегистрирован хотя бы один Счет зачисления в каждой валюте, владельцем которого является Доверенный владелец счетов.
- 22.7. Аннулирование регистрации Счета зачисления осуществляется Клиринговым центром:
- на основании заявления Участника клиринга и/или Доверенного владельца счетов, имеющих право подавать Заявление на регистрацию Счета зачисления, подаваемого в Клиринговый центр в том же порядке, что и заявление на регистрацию Счета зачисления;
 - для Счета зачисления, владельцем которого является Доверенный владелец счетов, закрепленный за Обособленной Брокерской фирмой, при прекращении выполнения им функций Доверенного владельца счетов по данной Обособленной Брокерской фирме.
- 22.8. Заявление на возврат денежных средств из Средства гарантийного обеспечения подается в соответствии со следующими условиями:

- 22.8.1. Участник клиринга вправе подавать Заявление на возврат денежных средств из Средств гарантийного обеспечения с указанием разделов денежного регистра обеспечения, имеющих коды Собственной Брокерской фирмы, Клиентской Брокерской фирмы или Брокерской фирмы ДУ, зарегистрированной данным Участником клиринга, с указанием Счета зачисления, зарегистрированного в соответствии с подпунктом 22.5.1 Правил клиринга.
- 22.8.2. Доверенный владелец счетов, закрепленный за Обособленной Брокерской фирмой, вправе подавать Заявление на возврат денежных средств из Средств гарантийного обеспечения с указанием разделов денежного регистра обеспечения, имеющих код данной Обособленной Брокерской фирмы, с указанием Счета зачисления, зарегистрированного в соответствии с подпунктом 1) или подпунктом 2) подпункта 22.5.2 Правил клиринга. При этом, если возврат денежных средств, обязательства по возврату которых учитываются на разделе денежного регистра обеспечения, имеющем код Обособленной Брокерской фирмы, зарегистрированной Участником клиринга, осуществляется на Счет зачисления, зарегистрированный в соответствии с подпунктом 2) пункта 22.5.2 настоящей статьи, Заявление на возврат денежных средств из Средств гарантийного обеспечения должно быть согласовано с указанным Участником клиринга. Такое согласование осуществляется путем проставления подписи Участника клиринга на Заявлении на возврат денежных средств из Средств гарантийного обеспечения или путем представления идентичного Заявления на возврат денежных средств из Средств гарантийного обеспечения, подписанного Участником клиринга.
- 22.9. Заявление на возврат денежных средств в российских рублях из Средств гарантийного обеспечения, в котором указан код раздела денежного регистра обеспечения, содержащий код Собственной Брокерской фирмы, Клиентской Брокерской фирмы или Брокерской фирмы ДУ, исполняется при условии, что такой возврат не приведет к возникновению или увеличению Маржинального требования, учитываемого по Расчетной фирме, а сумма возврата не превышает сумм денежных средств в российских рублях, являющихся Средствами гарантийного обеспечения, учитываемыми на всех разделах денежного регистра обеспечения такой Брокерской фирмы.
- 22.10. Заявление на возврат денежных средств в российских рублях из Средств гарантийного обеспечения, в котором указан код раздела денежного регистра обеспечения, содержащий код Обособленной Брокерской фирмы, исполняется при условии, что такой возврат не приведет к возникновению или увеличению Маржинального требования, учитываемого по такой Брокерской фирме, а сумма возврата не превышает сумм денежных средств в российских рублях, являющихся Средствами гарантийного обеспечения, учитываемыми на всех разделах денежного регистра обеспечения такой Брокерской фирмы.
- 22.11. Заявление на возврат денежных средств в иностранной валюте из Средств гарантийного обеспечения исполняется при выполнении одного из следующих условий:
- если иностранная валюта, указанная в заявлении, не входит в Перечень;
 - если иностранная валюта в сумме, указанной в заявлении, обязательства по возврату которой учитываются на разделе денежного регистра обеспечения, указанном в заявлении, не учитывается в качестве Средств гарантийного обеспечения;

- если уменьшение оценочной стоимости иностранной валюты с учетом возврата суммы иностранной валюты, указанной в заявлении, в котором указан код раздела денежного регистра обеспечения, содержащий код Собственной Брокерской фирмы, Клиентской Брокерской фирмы или Брокерской фирмы ДУ, не приведет к возникновению или увеличению Маржинального требования, учитываемого по Расчетной фирме, и Маржинального требования, учитываемого по указанной Брокерской фирме;
 - если уменьшение оценочной стоимости иностранной валюты с учетом возврата суммы иностранной валюты, указанной в заявлении, в котором указан код раздела денежного регистра обеспечения, содержащий код Обособленной Брокерской фирмы, не приведет к возникновению или увеличению Маржинального требования, учитываемого по такой Брокерской фирме.
- 22.12. При исполнении Заявления на возврат денежных средств из Средств гарантийного обеспечения Участника клиринга / Доверенного владельца счетов Клиринговый центр прекращает учет данных денежных средств в качестве Средств гарантийного обеспечения.
- 22.13. Клиринговый центр вправе осуществить в любое время зачет денежных требований Участника клиринга по возврату ему денежных средств, учитываемых в качестве Средств гарантийного обеспечения, учитываемых по Расчетному коду, с денежными требованиями Клирингового центра к этому Участнику клиринга, учитываемыми по тому же Расчетному коду.
- 22.14. Клиринговый центр осуществляет ежегодную сверку остатков Средств гарантийного обеспечения Участника клиринга в российских рублях и иностранной валюте путем направления соответствующего уведомления Участнику клиринга не позднее десятого рабочего дня года, следующего за отчетным годом.
- Если в течение десяти рабочих дней после направления Участнику клиринга указанного уведомления, Участник клиринга не уведомит Клиринговый центр о наличии расхождений, остатки Средств гарантийного обеспечения Участника клиринга в российских рублях и/или иностранной валюте считаются подтвержденными.

Статья 23. Изменение учета денежных средств Участником клиринга

- 23.1. Участник клиринга вправе изменять учет Клиринговым центром денежных средств, составляющих Средства гарантийного обеспечения по Расчетной фирме.
- 23.2. Изменение учета денежных средств, составляющих Средства гарантийного обеспечения в российских рублях, осуществляется на основании Заявления на перевод денежных средств, составляющих Средства гарантийного обеспечения, предоставляемого Участником клиринга в Клиринговый центр и содержащего указание на:
- код раздела денежного регистра обеспечения, на котором уменьшается сумма денежных средств;
 - код раздела денежного регистра обеспечения, на котором увеличивается сумма денежных средств;

- код валюты (российские рубли);
- сумму денежных средств.

Указанное заявление не принимается Клиринговым центром к исполнению, если на момент его получения Клиринговым центром разделы клиринговых регистров, указанные в заявлении, не зарегистрированы.

- 23.3. Изменение учета денежных средств, составляющих Средства гарантийного обеспечения, осуществляется Клиринговым центром при условии, что сумма денежных средств, указанная в Заявлении на перевод денежных средств, составляющих Средства гарантийного обеспечения, не превышает суммы денежных средств в соответствующей валюте, учитываемых по разделу денежного регистра обеспечения, на котором уменьшается сумма денежных средств.
- 23.4. Заявления на перевод денежных средств, составляющих Средства гарантийного обеспечения, исполняются в ходе вечерней клиринговой сессии.
- 23.5. Для исполнения Заявления на перевод денежных средств, составляющих Средства гарантийного обеспечения, Клиринговый центр на сумму денежных средств в соответствующей валюте, указанную в Заявлении на перевод денежных средств, составляющих Средства гарантийного обеспечения, уменьшает значение раздела денежного регистра обеспечения, на котором уменьшается сумма денежных средств, и увеличивает значение раздела денежного регистра обеспечения, на котором увеличивается сумма денежных средств.
- 23.6. Участник клиринга вправе с использованием Клиринговой системы предоставить Клиринговому центру поручение на изменение Брокерских лимитов, содержащее:
- код Брокерской фирмы, по которой уменьшается Брокерский лимит;
 - код Брокерской фирмы, по которой увеличивается Брокерский лимит;
 - сумму денежных средств в российских рублях, на которую изменяются Брокерские лимиты.
- 23.7. Изменение Брокерских лимитов осуществляется Клиринговым центром при выполнении следующих условий:
- 23.7.1. При уменьшении Брокерского лимита Собственной Брокерской фирмы, Клиентской Брокерской фирмы или Брокерской фирмы ДУ и увеличении Брокерского лимита Собственной или Клиентской Брокерской фирмы: сумма денежных средств в российских рублях, являющихся Средствами гарантийного обеспечения, на всех разделах денежного регистра обеспечения, имеющих код Брокерской фирмы, по которой уменьшается Брокерский лимит, не станет меньше нуля.
- 23.7.2. При уменьшении Брокерского лимита Собственной Брокерской фирмы, Клиентской Брокерской фирмы или Брокерской фирмы ДУ и увеличении Брокерского лимита Брокерской фирмы ДУ или Обособленной Брокерской фирмы: указанное изменение не приведет к возникновению или увеличению Маржинального требования, учитываемого по Расчетной фирме, код которой содержит код Брокерской фирмы, по которой уменьшается Брокерский лимит, и сумма денежных средств в российских рублях, являющихся Средствами гарантийного обеспечения, на всех разделах денежного регистра обеспечения,

- имеющих код Брокерской фирмы, по которой уменьшается Брокерский лимит, не станет меньше нуля.
- 23.7.3. При уменьшении Брокерского лимита Обособленной Брокерской фирмы и увеличении Брокерского лимита Собственной или Клиентской Брокерской фирмы: сумма денежных средств в российских рублях, на которую изменяются Брокерские лимиты, не превышает сумм денежных средств в российских рублях, являющихся Средствами гарантийного обеспечения, учитываемыми на всех разделах денежного регистра обеспечения, имеющих код Брокерской фирмы, по которой уменьшается Брокерский лимит.
- 23.7.4. При уменьшении Брокерского лимита Обособленной Брокерской фирмы и увеличении Брокерского лимита Брокерской фирмы ДУ или Обособленной Брокерской фирмы: сумма денежных средств в российских рублях, на которую изменяются Брокерские лимиты, не превышает сумм денежных средств в российских рублях, являющихся Средствами гарантийного обеспечения, учитываемыми на всех разделах денежного регистра обеспечения, имеющих код Брокерской фирмы, по которой уменьшается Брокерский лимит, и указанное изменение не приводит к возникновению или увеличению Маржинального требования по Расчетной фирме, код которой содержит код Брокерской фирмы, по которой уменьшается Брокерский лимит.
- 23.8. Изменение учета денежных средств в соответствии с изменениями Брокерских лимитов, выполненными в течение торгового дня, отражается в ходе вечерней клиринговой сессии по основным разделам Брокерских фирм денежного регистра обеспечения.

Статья 24. Порядок внесения и возврата Средств гарантийного обеспечения в ценных бумагах

- 24.1. В качестве Средств гарантийного обеспечения могут быть приняты только ценные бумаги, входящие в Перечень.
- 24.2. Методика выбора и оценки иностранных валют и ценных бумаг, принимаемых в качестве Средств гарантийного обеспечения, устанавливает порядок определения ограничения на максимальное количество ценных бумаг определенного эмитента (управляющей компании паевого инвестиционного фонда, управляющего ипотечным покрытием), вида, категории, типа, принимаемых в качестве Средств гарантийного обеспечения одной Расчетной фирмы (далее – Максимальное количество), ставки дисконта, применяемой при расчете оценочной стоимости ценных бумаг, принимаемых в качестве Средств гарантийного обеспечения, а также порядок определения указанной оценочной стоимости.
- 24.3. Для внесения ценных бумаг в качестве Средств гарантийного обеспечения Участники клиринга, Клиенты и Доверенные владельцы счетов перечисляют ценные бумаги на Счета FORTS.
- 24.4. Клиринговый центр на основании информации о количестве ценных бумаг, учитываемых на Счетах FORTS, полученной от Расчетного депозитария в Выписке по Счетам FORTS, и с учетом ограничения на Максимальное количество, установленное в соответствии с пунктом 24.2 Правил клиринга, в порядке,

установленном настоящей статьей Правил клиринга, учитывает ценные бумаги, входящие в Перечень, в качестве Средств гарантийного обеспечения.

- 24.4.1. При превышении количества ценных бумаг на Счетах FORTS Максимального количества, выбор Счетов FORTS и количества ценных бумаг на них, учитываемых в качестве Средств гарантийного обеспечения, определяется Клиринговым центром.
- 24.4.2. Количество ценных бумаг каждого эмитента (управляющей компании паевого инвестиционного фонда, управляющего ипотечным покрытием), вида, категории, типа, а также оценочная стоимость ценных бумаг, принятых Клиринговым центром в качестве Средств гарантийного обеспечения, учитываются на разделе депо регистра обеспечения, за которым закреплен Счет FORTS.
- 24.4.3. За исключением отдельных случаев, прямо предусмотренных Правилами клиринга, оценочная стоимость ценной бумаги, учитываемой Клиринговым центром в качестве Средств гарантийного обеспечения, определяется в соответствии с Методикой выбора и оценки иностранных валют и ценных бумаг, принимаемых в качестве Средств гарантийного обеспечения.
- 24.4.4. Расчет (установление) оценочной стоимости ценных бумаг, учитываемых в качестве Средств гарантийного обеспечения, осуществляется Клиринговым центром ежедневно во время проведения вечерней клиринговой сессии.
- 24.5. Возврат Клиринговым центром Участнику клиринга ценных бумаг, учитываемых в качестве Средств гарантийного обеспечения, осуществляется в Расчетные дни, на основании поручения на списание ценных бумаг со Счета FORTS, поданного в Расчетный депозитарий. Исполнение указанного поручения осуществляется в порядке, установленном статьей 43 Правил клиринга.
- 24.6. Клиринговый центр дает согласие на списание ценных бумаг со Счета FORTS при выполнении одного из следующих условий:
 - если уменьшение оценочной стоимости ценных бумаг с учетом возврата ценных бумаг в количестве, указанном в заявлении, в котором указан код раздела депо регистра обеспечения, содержащий код Собственной Брокерской фирмы, Клиентской Брокерской фирмы или Брокерской фирмы ДУ, не приведет к возникновению или увеличению Маржинального требования, учитываемого по Расчетной фирме, и Маржинального требования, учитываемого по указанной Брокерской фирме;
 - если уменьшение оценочной стоимости ценных бумаг с учетом возврата ценных бумаг в количестве, указанном в заявлении, в котором указан код раздела депо регистра обеспечения, содержащий код Обособленной Брокерской фирмы, не приведет к возникновению или увеличению Маржинального требования, учитываемого по указанной Брокерской фирме.
- 24.7. В случае направления в Расчетный депозитарий согласия на списание ценных бумаг со Счета FORTS Клиринговый центр прекращает учет данных ценных бумаг в качестве Средств гарантийного обеспечения и направляет в Расчетный депозитарий распоряжение на списание указанных ценных бумаг со Счета FORTS.

Статья 25. Порядок исключения иностранной валюты / ценной бумаги из Перечня

- 25.1. При вступлении в силу решения Клирингового центра об исключении ценной бумаги или иностранной валюты из Перечня Клиринговый центр устанавливает ее оценочную стоимость равной нулю.
- 25.2. Исключение иностранной валюты / ценной бумаги из Перечня осуществляется Клиринговым центром при отсутствии у Участника клиринга Маржинального требования, учитываемого по Расчетной фирме, у которой указанная иностранная валюта / ценная бумага учитывалась в качестве Средств гарантийного обеспечения. С момента исключения иностранной валюты / ценной бумаги из Перечня Клиринговый центр прекращает учет данной иностранной валюты / ценной бумаги в качестве Средства гарантийного обеспечения.
- 25.3. При наличии у Участника клиринга Маржинального требования, учитываемого по Расчетной фирме, указанной в предыдущем пункте настоящей статьи, и при его неисполнении в установленном Правилами клиринга порядке, указанная иностранная валюта / ценная бумага может быть использована для исполнения Маржинального требования в порядке, установленном Правилами клиринга.

Статья 26. Замена иностранной валюты / ценных бумаг, учитываемых в качестве Средств гарантийного обеспечения, денежными средствами в российских рублях

- 26.1. Клиринговый центр вправе потребовать от Участника клиринга замены ценных бумаг / иностранной валюты, учитываемых в качестве Средств гарантийного обеспечения, денежными средствами в российских рублях:
- при получении информации об обстоятельствах, которые могут привести к ограничению или изменению порядка проведения операций с ценными бумагами / иностранной валютой, являющимися Средствами гарантийного обеспечения;
 - в случае уменьшения Максимальной суммы / Максимального количества данной иностранной валюты / данной ценной бумаги.
- 26.2. С момента предъявления указанного требования о замене Клиринговый центр устанавливает оценочную стоимость иностранных валют / ценных бумаг, указанных в требовании о замене, равной нулю.
- 26.3. При наличии у Участника клиринга Маржинального требования, учитываемого по Расчетной фирме, и при его неисполнении в установленном Правилами клиринга порядке, указанная иностранная валюта / ценные бумаги могут быть использованы для исполнения Маржинального требования в порядке, установленном Правилами клиринга.
- 26.4. Клиринговый центр прекращает учет иностранной валюты / ценной бумаги в качестве Средств гарантийного обеспечения, требование о замене которой предъявлено, при отсутствии у Участника клиринга Маржинального требования, учитываемого по Расчетной фирме.

Статья 27. Порядок внесения взноса в Гарантийный фонд и Обеспечения под стресс

27.1. Для учета денежных средств в качестве взноса в Гарантийный фонд Участник клиринга обязан перечислить денежные средства в российских рублях на клиринговый банковский счет Клирингового центра, открытый в Расчетной организации, по реквизитам, размещенным на сайте Клирингового центра, с обязательным указанием в назначении платежа номера Договора об оказании клиринговых услуг, заключенного между Участником клиринга и Клиринговым центром, и категории Расчетной фирмы.

Пример назначения платежа: «Перечисление взноса в Гарантийный фонд для Участника клиринга категории **CATEGORY** по договору N ДКУ/XXXXX/XX от **DD.MM.YYYY**. НДС не облагается».

27.2. Обязательство Участника клиринга по внесению взноса в Гарантийный фонд считается исполненным, если сумма денежных средств, перечисленных Участником клиринга на клиринговый банковский счет Клирингового центра, предназначенный для учета коллективного клирингового обеспечения, больше либо равна установленному Клиринговым центром размеру взноса в Гарантийный фонд.

27.3. После перечисления Участником клиринга денежных средств на клиринговый банковский счет, открытый в Расчетной организации и предназначенный для учета коллективного клирингового обеспечения, и учета их в качестве взноса Участника клиринга в Гарантийный фонд, у Клирингового центра возникает обязательство вернуть Участнику клиринга денежные средства в размере взноса Участника клиринга в Гарантийный фонд.

27.4. С даты, установленной решением Клирингового центра, внесение денежных средств / ценных бумаг в качестве взноса в Гарантийный фонд и/или Обеспечение под стресс осуществляется на соответствующие клиринговые счета Клирингового центра в порядке, определенном Правилами клиринга на рынке ценных бумаг.

27.5. Обязательство Участника клиринга по внесению взноса в Гарантийный фонд считается исполненным, 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.

27.6. 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.

27.6.1. 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 28. Порядок возврата взноса в Гарантийный фонд и Обеспечения под стресс

- 28.1. Участник клиринга вправе предоставить Клиринговому центру Заявление на возврат средств из Гарантийного фонда.
- 28.2. Заявление на возврат средств из Гарантийного фонда исполняется Клиринговым центром при соблюдении следующих условий:
- 1) обязательство Участника клиринга по внесению взноса в Гарантийный фонд будет являться исполненным в соответствии с пунктом 27.2 Правил клиринга без учета суммы денежных средств / количества ценных бумаг, указанных в заявлении, и
 - 2) у Участника клиринга отсутствует Маржинальное требование, учитываемое по Расчетной фирме, и
 - 3) 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, и
 - 4) на момент подачи Участником клиринга Заявления на возврат средств из Гарантийного фонда Клиринговый центр не осуществлял два раза увеличение Лимита колебаний цен сделок хотя бы по одному Срочному контракту / одной ценной бумаге в течение текущего Расчетного периода.
- 28.3. При получении от Участника клиринга Заявления на возврат средств из Гарантийного фонда и при наличии у Участника клиринга непрекращенных обязательств по сделкам, заключенным с использованием кода данной Расчетной фирмы, Клиринговый центр вправе направить Бирже уведомление о приостановлении возможности заключения указанных сделок от имени Участника клиринга с использованием кода данной Расчетной фирмы и выполнить процедуру принудительного закрытия позиций в порядке, установленном статьей 35 Правил клиринга, для прекращения указанных обязательств.
- 28.4. Возврат денежных средств / ценных бумаг из Гарантийного фонда осуществляется на соответствующий Счет зачисления, зарегистрированный в соответствии с пунктом 22.5 Правил клиринга с учетом особенности, установленной подпунктом 28.4.1 Правил клиринга.
- 28.4.1. Счет зачисления, на который возможно перечисление (возврат) денежных средств, составляющих взнос Участника клиринга в Гарантийный фонд, регистрируется Клиринговым центром на основании Заявления на регистрацию Счета зачисления, подаваемого Участником клиринга, при условии, что владельцем такого счета является указанный Участник клиринга.
- 28.5. Заявление Участника клиринга на возврат средств из Гарантийного фонда исполняется Клиринговым центром при выполнении условий, указанных в настоящей статье Правил клиринга, не позднее Расчетного дня, следующего за датой получения указанного заявления.
- 28.6. При исполнении Заявления на возврат средств из Гарантийного фонда Клиринговый центр уменьшает сумму денежных средств, учитываемых в качестве взноса Участника клиринга в Гарантийный фонд, и размер своего обязательства по возврату Участнику клиринга денежных средств в размере его взноса в

- Гарантийный фонд на сумму возвращенных Участнику клиринга денежных средств.
- 28.7. Клиринговый центр вправе осуществить в любое время зачет требований Участника клиринга по возврату ему денежных средств, учитываемых в качестве взноса в Гарантийный фонд, с требованиями Клирингового центра к этому Участнику клиринга в соответствующих денежных средствах.
- 28.8. С даты, установленной решением Клирингового центра, 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.
- 28.9. В случае прекращения допуска к клиринговому обслуживанию Клиринговый центр возвращает Участнику клиринга / Доверенному владельцу счетов 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, не позднее 3 (трех) рабочих дней с даты прекращения допуска к клиринговому обслуживанию, но не позднее 3 (трех) рабочих дней с даты расторжения Договора об оказании клиринговых услуг, денежные средства в российских рублях и иностранной валюте - по реквизитам Счета зачисления в соответствующей валюте, зарегистрированного Участником клиринга и/или Доверенным владельцем счетов в соответствии с пунктом 22.5 Правил клиринга, ценные бумаги – на основной раздел торгового счета депо, на котором открыт раздел FORTS, с учетом положений статьи 48 Правил клиринга.

ПОДРАЗДЕЛ V-II. КЛИРИНГОВЫЕ СЕССИИ

Статья 29. Порядок проведения клиринговых сессий

29.1. В течение Расчетного дня Клиринговый центр проводит следующие клиринговые сессии:

- дневную клиринговую сессию;
- вечернюю клиринговую сессию.

Для каждой клиринговой сессии формируется клиринговый пул, в который включаются обязательства, подлежащие исполнению в ходе такой клиринговой сессии.

Обязательства, включенные в клиринговый пул каждой клиринговой сессии, прекращаются в клиринговом пуле данной клиринговой сессии.

29.2. Клиринговые сессии проводятся Клиринговым центром каждый Расчетный день в сроки, установленные Временным регламентом.

29.3. В ходе дневной клиринговой сессии Клиринговый центр:

- 1) проводит исполнение обязательств по опционным контрактам, включенных в клиринговый пул дневной клиринговой сессии;
- 2) изменяет учет обязательств по Срочным контрактам на разделах регистра учета позиций при выполнении процедуры принудительного закрытия позиций;
- 3) определяет объем обязательств по Срочным контрактам, учитываемых на каждом разделе регистра учета позиций Участника клиринга;
- 4) проводит исполнение обязательств по уплате вариационной маржи, включенных в клиринговый пул дневной клиринговой сессии;
- 5) проводит исполнение обязательств по уплате премии, включенных в клиринговый пул дневной клиринговой сессии;
- 6) учитывает расторжение (прекращение) обязательств по Срочным контрактам на разделах регистра учета позиций Участников клиринга;
- 7) проводит исполнение обязательств Участников клиринга по уплате комиссионных вознаграждений Клирингового центра, Биржи и Технического центра;
- 8) изменяет учет обязательств по Срочным контрактам на разделах регистра учета позиций на основании заявления Участника клиринга;
- 9) устанавливает Лимит колебания цен сделок для каждого фьючерсного контракта в порядке, установленном приложением № 5 к Правилам клиринга;
- 10) рассчитывает Гарантийное обеспечение;
- 11) рассчитывает Торговый лимит;
- 12) формирует отчеты для Участников клиринга и их Клиентов.

29.4. В ходе вечерней клиринговой сессии Клиринговый центр кроме действий, перечисленных в пункте 29.3 Правил клиринга, включая исполнение соответствующих обязательств, включенных в клиринговый пул вечерней клиринговой сессии:

- 1) прекращает учет обязательств по опционным контрактам, дата исполнения которых наступила, и право требования по которым не осуществлено их Держателями;
- 2) проводит исполнение Срочных контрактов с текущей датой исполнения, Спецификациями которых и/или Временным регламентом предусмотрено их исполнение в ходе вечерней клиринговой сессии;
- 3) осуществляет расчет и удержание с Участника клиринга неустоек (штрафов, пени), предусмотренных Правилами клиринга и/или Спецификациями;
- 4) определяет оценочную стоимость ценных бумаг и иностранных валют, составляющих Средства гарантийного обеспечения;
- 5) осуществляет перевод денежных средств, составляющих Средства гарантийного обеспечения, в Гарантийный фонд;
- 6) присваивает Участникам клиринга коды Расчетной фирмы и осуществляет регистрацию клиентов Участников клиринга с целью заключения за счет этих клиентов Срочных контрактов;
- 7) осуществляет открытие и закрытие разделов клиринговых регистров для Участников клиринга.

Статья 30. Маржинальные требования по Обеспечению под стресс и Маржинальные требования по фондам

30.1. В ходе клиринговой сессии, проводимой в соответствии с Правилами клиринга на рынке ценных бумаг, Клиринговый центр определяет Участников клиринга, у которых возникли Маржинальные требования по Обеспечению под стресс и Маржинальные требования по фондам и суммы указанных Маржинальных требований.

30.2. 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.

30.3. 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.

- 30.4. В случае неисполнения Участником клиринга Маржинального требования по фондам в срок, установленный пунктом 30.2 Правил клиринга, и/или Маржинального требования по Обеспечению под стресс в срок, установленный пунктом 30.3 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 гарантийного обеспечения Участника клиринга, учитываемых по собственным Расчетным кодам в соответствии с Правилами клиринга, и/или из средств, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга по собственным Расчетным кодам в соответствии с иными правилами клиринга Клирингового центра.
- 30.5. В случае неисполнения Участником клиринга Маржинального требования по фондам в срок, установленный пунктом 30.2 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.
- 30.6. В случае неисполнения Участником клиринга Маржинального требования по Обеспечению под стресс, возникшего в связи с переоценкой стоимости ценных бумаг и иностранной валюты, учитываемых в качестве взносов в Гарантийный фонд и Обеспечения под стресс, в срок, установленный пунктом 30.3 Правил клиринга, считается, что Участник клиринга не исполнил обязательства по внесению Обеспечения под стресс в соответствии со всеми правилами клиринга Клирингового центра, согласно которым 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.
- 30.7. В случае неисполнения Участником клиринга Маржинального требования по Обеспечению под стресс, возникшего в связи с изменением размера Обеспечения под стресс, считается, что Участник клиринга не исполнил обязательства по

внесению Обеспечения под стресс в соответствии с теми правилами клиринга, согласно которым размер Обеспечения под стресс был увеличен.

- 30.8. При неисполнении Участником клиринга в соответствии с Правилами клиринга Маржинального требования по фондам и/или Маржинального требования по Обеспечению под стресс, Участнику клиринга устанавливается Режим закрытия позиций.

ПОДРАЗДЕЛ V-III. ПОРЯДОК ОПРЕДЕЛЕНИЯ И ИСПОЛНЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ, ВКЛЮЧЕННЫХ В КЛИРИНГОВЫЙ ПУЛ ДНЕВНОЙ ИЛИ ВЕЧЕРНЕЙ КЛИРИНГОВОЙ СЕССИИ

Статья 31. Вариационная маржа и премия

31.1. Вариационная маржа определяется по каждому фьючерсному контракту или опционному контракту в соответствии со Спецификацией фьючерсного контракта или Спецификацией опционного контракта.

В соответствии со Спецификацией стороной, обязанной исполнить обязательство по уплате вариационной маржи, является Участник клиринга или Клиринговый центр.

31.1.1. Если по окончании Расчетного периода Клиринговым центром не получены от Биржи все необходимые для определения вариационной маржи параметры по Срочному контракту, предусмотренные Спецификацией, Клиринговый центр не осуществляет определение вариационной маржи по Срочному контракту в ходе дневной или вечерней клиринговой сессии, проводимой по окончании указанного Расчетного периода.

31.2. Премия по опционному контракту определяется в соответствии с условиями данного опционного контракта.

В соответствии со Спецификацией опционного контракта стороной, обязанной исполнить обязательство по уплате премии, является Участник клиринга или Клиринговый центр.

31.3. Определенные в соответствии с пунктами 31.1 и 31.2 Правил клиринга обязательства по уплате вариационной маржи и премии допускаются к клирингу и включаются в клиринговый пул соответствующей дневной или вечерней клиринговой сессии.

31.4. Для исполнения обязательства Участника клиринга по уплате вариационной маржи и/или премии используются Средства гарантийного обеспечения в российских рублях.

31.5. Порядок исполнения обязательства / требования Участника клиринга по уплате / получению вариационной маржи / премии определен в статье 32 Правил клиринга.

Статья 32. Порядок исполнения обязательств по уплате вариационной маржи, премии, штрафов, пени, неустоек и комиссионных вознаграждений

32.1. Клиринговый центр осуществляет зачет обязательства в российских рублях по уплате вариационной маржи, премии, штрафа, пени, неустойки, биржевого сбора, комиссионного вознаграждения, иного сбора или платежа и обязательство по оплате клиринговых услуг (далее – денежное обязательство) Участника клиринга, возникшие по разделу регистра учета позиций, имеющему код Собственной Брокерской фирмы, Клиентской Брокерской фирмы или Брокерской фирмы ДУ, с требованием Участника клиринга по возврату Средств гарантийного обеспечения, учитываемым по разделу денежного регистра обеспечения в российских рублях,

код которого совпадает с кодом раздела регистра учета позиций, на котором учтена позиция по Срочным контрактам, по которым возникло денежное обязательство.

При этом значение указанного раздела денежного регистра обеспечения уменьшается на сумму денежного обязательства.

- 32.2. Денежное обязательство Участника клиринга, которому присвоен код Расчетной фирмы, возникшее по разделу регистра учета позиций, имеющему код Обособленной Брокерской фирмы, исполняется за счет Средств гарантийного обеспечения, внесенных Доверенным владельцем счетов, обязательства по возврату которых учитываются на разделе денежного регистра обеспечения в российских рублях, код которого совпадает с кодом раздела регистра учета позиций, на котором учтена позиция по Срочным контрактам, по которым возникло денежное обязательство.

При этом значение указанного раздела денежного регистра обеспечения в российских рублях уменьшается на сумму денежного обязательства.

- 32.3. Денежное обязательство Участника клиринга считается исполненным, если сумма значений разделов денежного регистра обеспечения в российских рублях, связанных с одним Расчетным кодом не является отрицательной.

- 32.4. Абсолютное значение отрицательной суммы значений разделов денежного регистра обеспечения в российских рублях, связанных с одним Расчетным кодом, учитывается Клиринговым центром как Задолженность Участника клиринга перед Клиринговым центром по Расчетному коду.

- 32.4.1. Информация о наличии у Участника клиринга Задолженности и ее размере передается Участнику клиринга в составе отчета о денежных средствах в российских рублях, иностранной валюте и ценных бумагах, являющихся Средствами гарантийного обеспечения, предоставляемого в соответствии со статьей 45 Правил клиринга.

- 32.4.2. За возникновение Задолженности по Расчетному коду, Участник клиринга обязан уплатить Клиринговому центру штраф в размере, установленном решением Клирингового центра.

Сумма штрафа, рассчитанная в соответствии с настоящим подпунктом Правил клиринга, не облагается НДС.

Обязательство по уплате штрафа, рассчитанное в соответствии с настоящим подпунктом Правил клиринга, учитывается по тому же Расчетному коду, что и Задолженность.

Исполнение обязательства по уплате штрафа осуществляется в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга.

- 32.4.3. Участник клиринга обязан погасить Задолженность до 16:00 по московскому времени рабочего дня, следующего за днем ее возникновения.

Задолженность Участника клиринга может быть погашена, в том числе, за счет требования Участника клиринга по получению вариационной маржи, исполненного в ходе дневной клиринговой сессии.

Задолженность Участника клиринга, учитываемая по Расчетному коду, считается погашенной, если на момент времени, установленный в качестве времени ее погашения, сумма значений разделов денежного регистра обеспечения в

российских рублях, связанных с Расчетным кодом, по которому учитывалась Задолженность, является неотрицательной.

32.4.4. Если Задолженность Участника клиринга не погашена в срок, установленный подпунктом 32.4.2 Правил клиринга, для ее погашения Клиринговый центр вправе предпринять действия, предусмотренные статьями 36-37 Правил клиринга.

32.5. Требование в российских рублях по получению вариационной маржи, премии, штрафов, пени, неустоек (далее – денежное требование) Участника клиринга, возникшие по разделу регистра учета позиций, имеющему код Собственной Брокерской фирмы, Клиентской Брокерской фирмы или Брокерской фирмы ДУ, прекращается возникновением обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга Средств гарантийного обеспечения, учитываемого по разделу денежного регистра обеспечения в российских рублях, код которого совпадает с кодом раздела регистра учета позиций, на котором учтена позиция по Срочным контрактам, по которым возникло денежное требование.

При этом значение указанного раздела денежного регистра обеспечения в российских рублях увеличивается на сумму денежного требования.

32.6. Денежное требование Участника клиринга, которому присвоен код Расчетной фирмы, возникшее по разделу регистра учета позиций, имеющему код Обособленной Брокерской фирмы, прекращается возникновением обязательства Клирингового центра по возврату Средств гарантийного обеспечения на Счет зачисления Доверенного владельца счетов, учитываемого по разделу денежного регистра обеспечения в российских рублях, код которого совпадает с кодом раздела регистра учета позиций, на котором учтена позиция по Срочным контрактам, по которым возникло денежное требование.

При этом значение указанного раздела денежного регистра обеспечения в российских рублях увеличивается на сумму денежного требования.

Статья 33. Гарантийное обеспечение

33.1. Размер Гарантийного обеспечения (G) определяется на основании:

- Базового размера гарантийного обеспечения каждого Срочного контракта;
- оценки Клиринговым центром риска неисполнения обязательств по совокупности обязательств по Срочным контрактам, учитываемых по Расчетной фирме на разделах регистра учета позиций (портфельная оценка риска).

33.1.1. Гарантийное обеспечение по совокупности обязательств по Срочным контрактам не может быть больше суммы Базовых размеров гарантийного обеспечения, установленных по каждому Срочному контракту из данной совокупности обязательств.

33.2. Клиринговый центр осуществляет расчет Гарантийного обеспечения:

- по совокупности обязательств по Срочным контрактам, учитываемых на одном разделе регистра учета позиций, и нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга по Поручениям на управление риском, учитываемых на разделе регистра учета позиций по управлению риском с таким же кодом раздела (далее – Гарантийное обеспечение по разделу, G_R);

- по совокупности обязательств по Срочным контрактам, учитываемых на группе разделов регистра учета позиций, имеющих одинаковый код Брокерской фирмы, и нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга по Поручениям на управление риском, учитываемых на разделах регистра учета позиций по управлению риском, имеющих такой же код Брокерской фирмы (далее – Гарантийное обеспечение по Брокерской фирме, G_B);
- по совокупности обязательств по Срочным контрактам, учитываемых на группе разделов регистра учета позиций, имеющих одинаковый код Расчетной фирмы, и нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга по Поручениям на управление риском, учитываемых на разделах регистра учета позиций по управлению риском, имеющих такой же код Расчетной фирмы, как сумму Гарантийного обеспечения всех Брокерских фирм (далее – Гарантийное обеспечение по Расчетной фирме, $G = \sum_B G_B$).

33.2.1. Клиринговый центр осуществляет расчет Гарантийного обеспечения в ходе дневной и вечерней клиринговой сессии.

33.2.2. Информация о Гарантийном обеспечении отражается Клиринговым центром в отчетах, предоставляемых по итогам дневной и вечерней клиринговой сессии в соответствии со статьей 45 Правил клиринга.

33.3. Базовый размер гарантийного обеспечения по Срочному контракту, за исключением опционных контрактов, рассчитывается на основании Лимита колебаний цен сделок, установленного для этого Срочного контракта.

Базовый размер гарантийного обеспечения по опционному контракту рассчитывается на основании Лимита колебаний цен сделок, устанавливаемого Клиринговым центром для базового актива этого опционного контракта.

33.3.1. Информация о Базовом размере гарантийного обеспечения по каждому Срочному контракту указывается Клиринговым центром в отчетах, предоставляемых Участникам клиринга в соответствии со статьей 45 Правил клиринга, и раскрывается на Сайте Клирингового центра.

33.4. Клиринговый центр осуществляет расчет Базового размера гарантийного обеспечения по каждому Срочному контракту, а также Гарантийного обеспечения по совокупности обязательств по Срочным контрактам в соответствии с Принципами расчета гарантийного обеспечения.

33.5. Участникам клиринга и их клиентам может быть предоставлена возможность самостоятельного расчета Гарантийного обеспечения с помощью специального программного обеспечения.

Принципы расчета Базового размера гарантийного обеспечения и Гарантийного обеспечения по совокупности обязательств по Срочным контрактам указываются в описании к указанному специальному программному обеспечению.

Статья 34. Порядок возникновения и исполнения Маржинальных требований

34.1. Наличие у Участника клиринга Маржинального требования определяется следующим образом:

Рассчитывается величина SZ:

$$SZ = (TL_{BA} - \sum_B G_B) + \sum_{OB} \min(0; TL_{OB} - G_{OB}), \text{ где}$$

\sum_B - суммирование по Собственным и Клиентским Брокерским фирмам, зарегистрированным в рамках данной Расчетной фирмы;

\sum_{OB} - суммирование по Брокерским фирмам ДУ и Обособленным Брокерским фирмам, зарегистрированным в рамках данной Расчетной фирмы.

Если значение SZ отрицательное ($SZ < 0$), это означает наличие у Участника клиринга Маржинального требования, учитываемого по Расчетной фирме.

Если значение $SZ_B = TL_B - G_B$ или $SZ_{OB} = TL_{OB} - G_{OB}$ отрицательное ($SZ_B < 0 / SZ_{OB} < 0$), это означает наличие у Участника клиринга Маржинального требования, учитываемого по Собственным и Клиентским Брокерским фирмам, Брокерской фирме ДУ / Обособленной Брокерской фирме.

Если значение $SZ_R = TL_R - G_R$ отрицательное ($SZ_R < 0$), это означает наличие у Участника клиринга Маржинального требования, учитываемого по разделу регистра учета позиций.

Маржинальное требование, учитываемое по Брокерской фирме, и Маржинальное требование, учитываемое по разделу регистра учета позиций, не предъявляется Клиринговым центром Участнику клиринга.

Величины TL_R , TL_{OB} , TL_B , TL_{BA} являются величинами соответствующего Торгового лимита, рассчитываемыми в соответствии со статьей 14 Правил клиринга.

Величины G_R , G_B , G_{OB} , G являются величинами соответствующего Гарантийного обеспечения, определяемого в соответствии со статьей 33 Правил клиринга.

- 34.1.1. Величина SZ, рассчитываемая в целях определения наличия у Участника клиринга Маржинального требования, учитываемого по Расчетной фирме, рассчитывается на основании:
- в ходе дневной клиринговой сессии – на основании обязательств по Срочным контрактам, учитываемых по Расчетной фирме, относящейся к Участнику клиринга, и Активных заявок, поданных от имени Участника клиринга с указанием кода Расчетной фирмы по состоянию на момент начала дневной клиринговой сессии;
 - в ходе вечерней клиринговой сессии - на основании обязательств по Срочным контрактам, учитываемых по Расчетной фирме.
- 34.2. Клиринговый центр направляет информацию о возникновении Маржинального требования, учитываемого по Расчетной фирме, Доверенным владельцам счетов, закрепленным за Обособленными Брокерскими фирмами, открытыми в рамках Расчетной фирмы.
- 34.3. Маржинальное требование, учитываемое по Расчетной фирме и возникшее у Участника клиринга по итогам дневной или вечерней клиринговой сессии, должно быть исполнено Участником клиринга не позднее, чем за 45 (сорок пять) минут до начала ближайшей следующей дневной или вечерней клиринговой сессии.

Клиринговый центр вправе продлить указанный срок исполнения Маржинального требования до начала ближайшей следующей дневной или вечерней клиринговой сессии, в случае невозможности предоставления Расчетной организацией / Расчетным депозитарием в Клиринговый центр информации о зачислении денежных средств / ценных бумаг на клиринговые счета Клирингового центра / Счета FORTS в соответствии с договором, заключенным между Клиринговым центром и Расчетной организацией / Расчетным депозитарием.

- 34.4. Маржинальное требование, учитываемое по Расчетной фирме, должно быть исполнено Участником клиринга путем перечисления денежных средств в российских рублях на клиринговый счет Клирингового центра в порядке, определенном статьей 22 Правил клиринга.
- 34.5. Маржинальное требование, учитываемое по Расчетной фирме, может быть также прекращено полностью или в части в случаях:
- внесения иностранной валюты и/или ценных бумаг в качестве Средств гарантийного обеспечения, приводящего к увеличению Торгового лимита;
 - изменения обязательств по Срочным контрактам, приводящего к уменьшению Гарантийного обеспечения;
 - удаления Активных заявок, поданных от имени Участника клиринга с использованием кода Расчетной фирмы, приводящих к уменьшению Гарантийного обеспечения.
- 34.6. Маржинальное требование, учитываемое по Расчетной фирме и возникшее у Участника клиринга, считается прекращенным в момент времени, когда величина SZ , рассчитанная в соответствии с пунктом 34.1 Правил клиринга, станет неотрицательной ($SZ \geq 0$). При этом, для расчета Базового размера гарантийного обеспечения каждого Срочного контракта, на основании которого определяется размер Гарантийного обеспечения (G), используется значение Лимита колебания цен сделок (L), установленное в последнюю проведенную дневную или вечернюю клиринговую сессию.
- 34.7. В случае неисполнения Участником клиринга Маржинального требования, учитываемого по Расчетной фирме, в срок, установленный пунктом 34.3 Правил клиринга, Клиринговый центр:
- направляет Бирже уведомление о необходимости приостановить возможность заключения Срочных контрактов от имени такого Участника клиринга с указанием кодов Собственных Брокерских фирм, Клиентских Брокерских фирм и Брокерских фирм ДУ, а также Обособленных Брокерских фирм, по которым учитывается неисполненное Маржинальное требование, открытых в рамках Расчетной фирмы, по которой учитывается неисполненное Маржинальное требование;
 - при наличии в Торговой системе Биржи Активных заявок, поданных от имени такого Участника клиринга с указанием кода Собственной Брокерской фирмы, Клиентской Брокерской фирмы, Брокерской фирмы ДУ или Обособленной Брокерской фирмы, по которой учитывается неисполненное Маржинальное требование, открытых в рамках Расчетной фирмы, по которой учитывается неисполненное Маржинальное требование, Клиринговый центр направляет Бирже поручение на их удаление.

Начиная с момента направления уведомления и при наличии позиций, учитываемых на разделах регистра учета позиций Собственных или Клиентских, или Брокерских фирм ДУ, или Обособленных Брокерских фирм, по которым учитывается неисполненное Маржинальное требование, открытых в рамках Расчетной фирмы, по которой учитывается неисполненное Маржинальное требование, Клиринговый центр применяет к Участнику клиринга, не исполнившему Маржинальное требование, процедуру принудительного закрытия позиций по коду Расчетной фирмы, по которой учитывается неисполненное Маржинальное требование, в порядке, установленном статьей 35 Правил клиринга.

- 34.7.1. За применение к Участнику клиринга процедуры принудительного закрытия позиций при открытии / закрытии позиций по Срочным контрактам с Участника клиринга взимается плата в размере, установленном приложением № 2 к Правилам клиринга.

Порядок исполнения обязательства Участника клиринга по внесению платы за применение к Участнику клиринга процедуры принудительного закрытия определен в статье 32 Правил клиринга.

- 34.8. В случае если по итогам процедуры принудительного закрытия позиций, примененной Клиринговым центром к Участнику клиринга, у Участника клиринга остались неисполненные обязательства, для исполнения которых недостаточно денежных средств в российских рублях, учитываемых по совокупности Брокерских фирм, связанных с одним Расчетным кодом, указанные обязательства учитываются как Задолженность Участника клиринга перед Клиринговым центром по такому Расчетному коду.

Погашение указанной Задолженности осуществляется в соответствии с подпунктами 32.4.1-32.4.4 Правил клиринга.

- 34.9. Если в результате действий, указанных в пункте 34.7 Правил клиринга, Маржинальное требование Участника клиринга, учитываемое по Расчетной фирме, будет исполнено (прекращено), и Задолженность у Участника клиринга не возникнет, либо Задолженность, возникшая по итогам применения к Участнику клиринга процедуры принудительного закрытия позиций, будет погашена в результате действий, предпринятых Клиринговым центром в соответствии с пунктом 34.8 Правил клиринга, Клиринговый центр направляет Бирже уведомление о предоставлении возможности заключения Срочных контрактов от имени такого Участника клиринга с указанием кода такой Расчетной фирмы.

- 34.9.1. Если в результате действий, указанных в пунктах 34.7, 34.8 Правил клиринга, Маржинальное требование Участника клиринга, учитываемое по Обособленной Брокерской фирме, открытой в рамках Расчетной фирмы, по которой учитывалось неисполненное Маржинальное требование, будет исполнено (прекращено), Задолженность Участника клиринга по Расчетному коду, связанному с такой Обособленной Брокерской фирмой не возникнет или будет погашена, а Задолженность Участника клиринга, учитываемая по другому Расчетному коду Участника клиринга, - не погашена, Клиринговый центр направляет Бирже уведомление о предоставлении возможности заключения Срочных контрактов от имени такого Участника клиринга с указанием кода такой Обособленной Брокерской фирмы.

- 34.10. Для погашения Задолженности Участника клиринга, учитываемой по Расчетному коду, не погашенной после выполнения действий, предусмотренных пунктами 34.7, 34.8 настоящей статьи, в ходе ближайшей следующей дневной или вечерней клиринговой сессии Клиринговый центр использует средства индивидуального клирингового обеспечения и средства Гарантийных фондов в порядке, предусмотренном статьей 37 Правил клиринга.
- 34.11. При наличии позиций по Срочным контрактам, учитываемых на разделах регистра учета позиций Обособленных Брокерских фирм, открытых в рамках Расчетной фирмы, по которой учитывается Задолженность Участника клиринга, указанные позиции должны быть закрыты Участником клиринга в течение двух Расчетных периодов, следующих за дневной или вечерней клиринговой сессией, в ходе которой были использованы средства Гарантийного фонда, за исключением обязательств по Срочным контрактам, срок исполнения которых наступил.
- Клиринговый центр направляет Доверенному владельцу счетов / Доверенным владельцам счетов, закрепленному(-ым) за Обособленной Брокерской фирмой, уведомление о возможности в соответствии с Правилами клиринга принудительного закрытия позиций, учитываемых на разделах регистра учета позиций, имеющих код Обособленной Брокерской фирмы, в случае невыполнения Участником клиринга требования, установленного настоящим пунктом Правил клиринга.
- 34.12. В случае невыполнения требования, установленного пунктом 34.11 Правил клиринга, Клиринговый центр направляет Бирже уведомление о необходимости приостановить возможность заключения Срочных контрактов от имени Участника клиринга с указанием кода Расчетной фирмы, по которой учитывается Задолженность.
- С момента направления указанного уведомления, Клиринговый центр осуществляет закрытие всех позиций по Срочным контрактам, учитываемым на разделах регистра учета позиций Обособленных Брокерских фирм, открытых в рамках Расчетной фирмы, по которой учитывается Задолженность Участника клиринга, в порядке, установленном процедурой принудительного закрытия позиций, приведенной в статье 35 Правил клиринга.

Статья 35. Процедура принудительного закрытия позиций

- 35.1. Принудительное закрытие позиций в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга осуществляется в отношении:
- а) Недобросовестного участника клиринга, имеющего неисполненное Маржинальное требование, или
 - б) Участника клиринга, клиринговое обслуживание которого приостановлено по решению Клирингового центра, или
 - в) Недобросовестного участника клиринга, имеющего непогашенную Задолженность, в случаях, установленных пунктами 37.6, 37.7 Правил клиринга, или
 - г) Участника клиринга, на имущество которого, учитываемое на торговом и/или клиринговом счете, обращено взыскание в соответствии с пунктами 42.2, 43.12 Правил клиринга.

- 35.1.1. Принудительное закрытие позиций Недобросовестного участника клиринга, имеющего неисполненное Маржинальное требование, осуществляется по всем разделам регистра учета позиций Недобросовестного участника клиринга с учетом особенности, установленной пунктом 35.2 Правил клиринга, до момента исполнения указанного Маржинального требования или до закрытия всех позиций, учитываемых на разделах регистра учета позиций Недобросовестного участника клиринга.
- 35.1.2. Принудительное закрытие позиций Участника клиринга, клиринговое обслуживание которого приостановлено по решению Клирингового центра, осуществляется по всем разделам регистра учета позиций такого Участника клиринга, за исключением разделов, имеющих код Обособленной Брокерской фирмы, до закрытия всех позиций, учитываемых на разделах регистра учета позиций такого Участника клиринга.
- 35.1.3. Принудительное закрытие позиций Недобросовестного участника клиринга, имеющего непогашенную Задолженность, в случаях, установленных пунктами 37.6, 37.7 Правил клиринга, осуществляется по разделам регистра учета позиций Недобросовестного участника клиринга, имеющим коды Брокерских фирм, связанных с соответствующим Расчетным кодом, до погашения Задолженности Недобросовестного участника клиринга или до закрытия всех позиций, учитываемых на указанных разделах регистра учета позиций.
- 35.1.4. Принудительное закрытие позиций Участника клиринга, на имущество которого обращено взыскание, осуществляется по всем разделам регистра учета позиций, имеющим код Собственной Брокерской фирмы, до момента достижения (превышения) величины SZ, рассчитанной в соответствии с пунктом 34.1 Правил клиринга, суммы взыскания или до закрытия всех позиций, учитываемых на указанных разделах регистра учета позиций.
- 35.2. Закрытие / открытие позиций, учитываемых на разделах регистра учета позиций, имеющих код Обособленной Брокерской фирмы, зарегистрированной в рамках Расчетной фирмы, по которой учитывается неисполненное Маржинальное требование Недобросовестного участника клиринга, осуществляется только при наличии Маржинального требования, учитываемого по данной Обособленной Брокерской фирме.
- 35.3. В ходе процедуры принудительного закрытия позиций Клиринговый центр вправе в одностороннем порядке прекратить обязательства Участника клиринга по противоположным позициям по Срочным контрактам, за исключением обязательств, учитываемых на разделах регистра учета позиций, имеющих код Брокерской фирмы ДУ или Обособленной Брокерской фирмы.
- 35.4. В ходе процедуры принудительного закрытия позиций Клиринговый центр вправе аннулировать действующие Поручения на управление риском Участника клиринга. При аннулировании Поручений на управление риском Клиринговый центр прекращает учитывать их при расчете Гарантийного обеспечения такого Участника клиринга.
- 35.5. В ходе процедуры принудительного закрытия позиций, проводимой в отношении Участника клиринга в случаях, установленных подпунктами а), в), г) пункта 35.1 Правил клиринга, в период времени до окончания текущего Расчетного периода,

между Клиринговым центром и Недобросовестным участником клиринга в Торговой системе Биржи без подачи заявок заключаются Срочные контракты, приводящие к уменьшению Гарантийного обеспечения по Расчетной фирме Недобросовестного участника клиринга.

- 35.6. В ходе процедуры принудительного закрытия позиций, проводимой в отношении Участника клиринга в случае, установленном подпунктом б) пункта 35.1 Правил клиринга, в период времени до окончания текущего Расчетного периода, между Клиринговым центром и таким Участником клиринга в Торговой системе Биржи без подачи заявок заключаются Срочные контракты, противоположные позициям, учитываемым на соответствующих разделах регистра учета позиций такого Участника клиринга.
- 35.7. Условия Срочных контрактов, указанных в пунктах 35.5, 35.6 Правил клиринга, соответствуют условиям Срочных контрактов, заключаемых Клиринговым центром с Добросовестными участниками клиринга в соответствии с пунктом 35.8 или пунктом 35.9 Правил клиринга.
- 35.8. В ходе проведения процедуры принудительного закрытия позиций Клиринговый центр на основании пункта 18.10 Правил клиринга заключает с Добросовестными участниками клиринга Срочные контракты с целью минимизации рисков по позициям Клирингового центра по Срочным контрактам на основании Заявок, поданных в Торговую систему Биржи Добросовестными участниками клиринга и/или Клиринговым центром.
- 35.9. В случае незаключения Срочных контрактов в соответствии с пунктом 35.8 Правил клиринга, между Клиринговым центром и Добросовестными участниками клиринга в Торговой системе Биржи без подачи заявок заключаются Срочные контракты, противоположные позициям Участника клиринга, в отношении которого проводится процедура принудительного закрытия позиций, по следующим ценам:
- цена заключения фьючерсных контрактов, в которых Добросовестный участник клиринга является Покупателем, равна Нижнему лимиту колебаний цен сделок по указанным фьючерсным контрактам, установленному на момент окончания текущего Расчетного периода;
 - цена заключения фьючерсных контрактов ликвидации позиции, в которых Добросовестный участник клиринга является Продавцом, равна Верхнему лимиту колебаний цен сделок по указанным фьючерсным контрактам, установленному на момент окончания текущего Расчетного периода;
 - цены заключения опционных контрактов определяются на момент окончания текущего Расчетного периода в соответствии с [Методикой расчета теоретической цены опциона и коэффициента "дельта"](#), утверждаемой ОАО Московская Биржа и раскрываемой на сайте ОАО Московская Биржа в сети Интернет.

Обязательства по заключенным в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга Срочным контрактам учитываются на ликвидационных разделах регистра учета позиций Добросовестных участников клиринга.

- 35.10. Участник клиринга обязан обеспечить исполнение обязательств по Срочным контрактам, учитываемых на ликвидационном разделе регистра учета позиций, в

порядке, аналогичном для обязательств по Срочным контрактам, учитываемых на других разделах регистра учета позиций.

- 35.11. Клиринговый центр вправе определить опцион, Держателем по которому является Участник клиринга, в отношении которого проводится процедура принудительного закрытия позиций, который подлежит исполнению в порядке, установленном Правилами клиринга, в ходе ближайшей дневной или вечерней клиринговой сессии.

Статья 36. Порядок использования иностранной валюты / ценных бумаг с целью погашения Задолженности Участника клиринга

- 36.1. Погашение Задолженности Недобросовестного участника клиринга по Расчетному коду, по которому учитываются Средства гарантийного обеспечения в иностранной валюте / ценных бумагах, осуществляется путем заключения сделок купли-продажи иностранной валюты / ценных бумаг за российские рубли между Недобросовестным участником клиринга и Клиринговым центром, направленных на покупку Клиринговым центром иностранной валюты / ценных бумаг у Недобросовестного участника клиринга.
- 36.2. Условия сделок купли-продажи иностранной валюты / ценных бумаг, заключаемых между Клиринговым центром и Недобросовестным участником клиринга в целях погашения Задолженности Недобросовестного участника клиринга, соответствуют определенным Правилами торгов на валютном рынке / Правилами торгов на фондовом рынке условиям сделок купли-продажи иностранной валюты / ценных бумаг и условиям сделок, заключенных Клиринговым центром с Добросовестными участниками клиринга в соответствии с Правилами клиринга на валютном рынке / Правилами торгов на фондовом рынке в целях создания условий для исполнения обязательств по сделкам.
- 36.3. Сумма в российских рублях, полученная Недобросовестным участником клиринга по сделкам купли-продажи иностранной валюты / ценных бумаг, заключенным в соответствии с пунктами 36.1-36.2 Правил клиринга, от продажи иностранной валюты / ценных бумаг, учитываемой в качестве Средств гарантийного обеспечения, засчитывается Клиринговым центром в счет погашения Задолженности Недобросовестного участника клиринга.
- 36.4. Погашение Задолженности Недобросовестного участника клиринга за счет иностранной валюты / ценных бумаг, учитываемых в качестве Средств гарантийного обеспечения, осуществляется Клиринговым центром без предварительного уведомления Недобросовестного участника клиринга.
- 36.5. Последовательность выбора раздела денежного регистра обеспечения, имеющего код Брокерской фирмы, связанной с Расчетным кодом, по которому учитывается Задолженность Участника клиринга, и иностранной валюты / ценных бумаг определяется Клиринговым центром.
- 36.6. При использовании иностранной валюты / ценных бумаг для погашения Задолженности Участника клиринга, учитываемой по Расчетному коду, Клиринговый центр уменьшает значение раздела денежного регистра обеспечения в иностранной валюте / депо регистра обеспечения, на котором учитывались

обязательства по возврату такой иностранной валюты / таких ценных бумаг, на сумму использованной иностранной валюты / количество использованных ценных бумаг, и увеличивает значение раздела денежного регистра обеспечения в российских рублях на сумму денежных средств в российских рублях, полученную от продажи иностранной валюты / ценных бумаг.

Статья 37. Порядок использования и возмещения гарантийных фондов и иных средств в целях погашения Задолженностей Участников клиринга

- 37.1. Настоящая статья Правил клиринга применяется, если Задолженность Недобросовестного участника клиринга, учитываемая по Расчетному коду, не погашена в результате действий, предпринятых Клиринговым центром в соответствии со статьей 36 Правил клиринга.
- 37.2. Индивидуальное клиринговое и иное обеспечение Недобросовестного участника клиринга, Обеспечение под стресс, средства Гарантийного фонда и гарантийных фондов, созданных в соответствии с иными правилами клиринга Клирингового центра, используются для погашения Задолженности Недобросовестного участника клиринга, учитываемой по Расчетному коду, в следующей очередности:
- 1) Средства гарантийного обеспечения Недобросовестного участника клиринга, учитываемые по собственным Расчетным кодам Недобросовестного участника клиринга;
 - 2) индивидуальное клиринговое и иное обеспечение (за исключением вноса в Гарантийный фонд и Обеспечения под стресс) Недобросовестного участника клиринга в денежных средствах / драгоценных металлах, учитываемое Клиринговым центром в соответствии с иными правилами клиринга Клирингового центра по собственным Расчетным кодам Недобросовестного участника клиринга по выбору Клирингового центра, и индивидуальное клиринговое обеспечение Недобросовестного участника клиринга в ценных бумагах, учитываемое в соответствии с иными правилами клиринга Клирингового центра по Разделам, 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 37.11 Правил клиринга).
- 37.3. Взносы в гарантийные фонды и иные средства Участников клиринга каждой очереди, указанной в пункте 37.2 Правил клиринга, используются в следующей очередности:

- 1) российские рубли;
 - 2) иностранная валюта;
 - 3) ценные бумаги;
 - 4) драгоценные металлы.
- 37.4. Использование средств Гарантийных фондов и иных средств следующей очереди в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга осуществляется в случае, если Задолженность Недобросовестного участника клиринга не погашена в результате использования средств предыдущей очереди.
- 37.5. В случае использования для погашения Задолженности Недобросовестного участника клиринга индивидуального клирингового и иного 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.
- 37.6. Если после использования индивидуального клирингового и иного обеспечения (за исключением вноса в Гарантийный фонд и Обеспечения под стресс) Недобросовестного участника клиринга, учитываемого по всем собственным Расчетным кодам Задолженность Участника клиринга не погашена, к Недобросовестному участнику клиринга применяется предусмотренная статьей 35 Правил клиринга процедура принудительного закрытия позиций по собственным Расчетным кодам (если по разделам регистра учета позиций Недобросовестного участника клиринга, имеющих коды Брокерских фирм, связанных с таким Расчетным кодом, на этот момент учитываются позиции), затем – между Клиринговым центром и Недобросовестным участником клиринга заключаются сделки по собственным Расчетным кодам, присвоенным в соответствии с иными правилами клиринга Клирингового центра, направленные на прекращение обязательств Недобросовестного участника клиринга, учитываемых в соответствии с иными правилами клиринга Клирингового центра, и увеличение объема свободного индивидуального клирингового и иного обеспечения Недобросовестного участника клиринга, за исключением вноса в Гарантийный фонд и Обеспечения под стресс, учитываемого по таким расчетным кодам.
- Индивидуальное клиринговое и иное 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.
- Процедура принудительного закрытия позиций проводится и/или указанные 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).

- 37.7. 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, к Недобросовестному участнику клиринга применяется предусмотренная статьей 35 Правил клиринга процедура принудительного закрытия позиций по клиентским Расчетным кодам и Расчетным кодам ДУ, присвоенным в соответствии с Правилами клиринга.
- После закрытия всех позиций Недобросовестного участника клиринга, учитываемых в соответствии с Правилами клиринга, для погашения его Задолженности используется 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.
- 37.8. Если после использования Обеспечения под стресс и вноса 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, в порядке, определенном такими правилами клиринга, заключаются сделки, 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.
- 37.9. При использовании вноса Участника клиринга в Гарантийный фонд и/или Обеспечения под стресс, учитываемых в соответствии с Правилами клиринга, клиринговое обслуживание Участника клиринга приостанавливается.
- 37.10. В случае использования вноса 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 30.2/30.3 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, клиринговое обслуживание Участника клиринга возобновляется.
- 37.11. 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 1 500 000 000 (один миллиард пятьсот миллионов) российских рублей.

- 37.12. Для погашения задолженности одного Недобросовестного участника клиринга используется не более $\frac{1}{2}$ (одной второй) Гарантийного фонда, учитываемого в соответствии с Правилами клиринга.
- 37.13. 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, учитываемой в соответствии с Правилами клиринга, во вторую – задолженностей, учитываемых в соответствии с иными правилами клиринга Клирингового центра.
- 37.14. Взносы в Гарантийный фонд / Обеспечение под стресс Недобросовестного участника клиринга используются для удовлетворения требований Клирингового центра по Задолженности Недобросовестного участника клиринга путем передачи денежных средств / ценных бумаг, учитываемых в качестве вноса в Гарантийный фонд / Обеспечение под стресс Недобросовестного участника клиринга, Клиринговому центру в счет погашения Задолженности Недобросовестного участника клиринга.
- 37.14.1. При этом сумма денежных средств в иностранной валюте и/или количество ценных бумаг, подлежащих передаче Клиринговому центру из вноса 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.
- 37.14.2. Удовлетворение требований за счет вноса в Гарантийный фонд / Обеспечение под стресс Недобросовестного участника клиринга осуществляется Клиринговым центром без предварительного уведомления Недобросовестного участника клиринга.
- 37.14.3. При этом размер вноса в Гарантийный фонд / Обеспечения под стресс Недобросовестного участника клиринга уменьшается в порядке, установленном Правилами клиринга на рынке ценных бумаг.
- 37.15. Взносы в Гарантийный фонд Добросовестных участников клиринга используются в размере превышения суммы Задолженностей Недобросовестных участников клиринга величины, установленной в соответствии с пунктом 37.11 Правил клиринга, при этом обязательства Недобросовестных участников клиринга по погашению Задолженностей перед Клиринговым центром в размере, установленном в соответствии с пунктом 37.11 Правил клиринга, сохраняются.
- 37.15.1. Использование взносов в Гарантийный фонд Добросовестных участников клиринга осуществляется в равных долях.
- 37.15.2. Взносы в Гарантийные фонды Добросовестного участника клиринга используются 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 вноса Добросовестного участника клиринга в Гарантийный фонд, рассчитывается исходя из суммы Задолженности в порядке, установленном Правилами клиринга на рынке ценных бумаг.

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

37.16. 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.

37.17. 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 вноса каждого Добросовестного участника клиринга.

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

37.18. 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.

37.19. 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 30.2 Правил клиринга восполнить 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 один раз в Расчетный день и 7 (семь) раз в течение календарного года.

- 37.20. В случае невыполнения Участником клиринга требования, указанного в пункте 37.19 Правил клиринга, в указанный срок, Клиринговый центр вправе удержать необходимую сумму денежных средств из Средств гарантийного обеспечения Участника клиринга, учитываемых по собственным Расчетным кодам.
- 37.21. В случае невозмещения Недобросовестным участником клиринга использованных средств Гарантийного фонда в течение 3 (трех) Расчетных дней после использования взносов в Гарантийный фонд Добросовестных участников клиринга, Клиринговый центр аннулирует код (коды) Расчетной фирмы Недобросовестного участника клиринга.

ПОДРАЗДЕЛ V-IV. ПОРЯДОК ИСПОЛНЕНИЯ СРОЧНЫХ КОНТРАКТОВ

Статья 38. Порядок исполнения опционных контрактов, базовым активом которых является фьючерсный контракт

- 38.1. Исполнение опционного контракта осуществляется при заявлении Держателем требования об исполнении опционного контракта путем заключения без подачи заявок между Клиринговым центром и Участником клиринга – Держателем фьючерсного контракта, являющегося базовым активом опционного контракта (далее в настоящей статье – фьючерсный контракт исполнения).
- 38.2. Участник клиринга вправе предоставить Клиринговому центру заявление об отказе от исполнения опционного контракта в случаях, установленных Спецификацией.
- 38.3. Требование Держателя об исполнении опционного контракта считается заявленным в следующих случаях:
- если Держателем является Участник клиринга:
 - в случае предоставления Держателем заявления об исполнении опционного контракта;
 - в случаях, предусмотренных Спецификацией опционного контракта, для Участников клиринга, не предоставивших заявления в соответствии с пунктом 38.2 Правил клиринга;
 - в случае применения в отношении данного Участника клиринга процедуры принудительного закрытия позиций - в отношении опционного контракта, определенного Клиринговым центром в соответствии с Правилами клиринга;
 - если Держателем является Клиринговый центр - при исполнении Клиринговым центром опционного контракта с тем же кодом, по которому он являлся Подписчиком (далее в настоящей статье - связанный опционный контракт).
- 38.4. Фьючерсный контракт исполнения между Клиринговым центром и Участником клиринга – Держателем заключается в случае заявления Участником клиринга – Держателем требования об исполнении опционного контракта.
- 38.4.1. Цена заключения фьючерсного контракта исполнения может быть выше / ниже Верхнего лимита колебаний цен сделок / Нижнего лимита колебаний цен сделок для фьючерсного контракта исполнения.
- 38.5. Заключение фьючерсного контракта исполнения между Клиринговым центром и Участником клиринга – Подписчиком осуществляется без подачи заявок, в случае заявления Клиринговым центром требования об исполнении опционного контракта, направляемого Участнику клиринга – Подписчику. При этом Участник клиринга – Подписчик и опционный контракт, подлежащий исполнению, выбираются по времени заключения данных опционных контрактов, начиная с самого раннего. Обязательства по заключенному фьючерсному контракту допускаются к клирингу.

- 38.6. Исполнение опционного контракта, заключенного Клиринговым центром с Участником клиринга – Держателем, осуществляется Клиринговым центром:
- в ходе ближайшей следующей дневной или вечерней клиринговой сессии - на основании заявления, поданного Участником клиринга – Держателем;
 - в соответствии с условиями Спецификации соответствующего контракта в срок, установленный Временным регламентом, – при заявлении требования об исполнении опционного контракта в случаях, предусмотренных Спецификацией опционного контракта, за исключением требования, заявленного путем подачи Заявления;
 - в сроки, установленные статьей 35 Правил клиринга - при осуществлении процедуры принудительного закрытия позиций.

Исполнение опционного контракта, заключенного Клиринговым центром с Участником клиринга – Подписчиком, осуществляется Клиринговым центром одновременно с исполнением связанного опционного контракта.

Статья 39. Порядок исполнения расчетных фьючерсных контрактов

- 39.1. Исполнение расчетных фьючерсных контрактов осуществляется в соответствии с условиями Спецификации соответствующего контракта в срок, установленный Временным регламентом.

Обязательства по расчетам по расчетным фьючерсным контрактам допускаются к клирингу и включаются в клиринговый пул соответствующей вечерней клиринговой сессии.

Статья 40. Порядок исполнения поставочных Срочных контрактов

- 40.1. Под поставочными Срочными контрактами в целях Правил клиринга понимаются поставочные фьючерсные контракты или поставочные опционные контракты, базовым активом которых не являются фьючерсные контракты.
- 40.2. Спецификацией может быть установлен штраф (пени) за ненадлежащее исполнение или неисполнение поставочного Срочного контракта.
- 40.3. Порядок исполнения обязательства / требования Участника клиринга по уплате / получению штрафа (пени) определен в статье 32 Правил клиринга.
- 40.4. Исполнение поставочного Срочного контракта осуществляется в соответствии с требованиями и в порядке, установленном Спецификацией данного поставочного Срочного контракта. Если Спецификацией поставочного Срочного контракта не установлен порядок исполнения, указанный поставочный Срочный контракт исполняется в порядке, установленном Правилами клиринга.
- 40.5. Особенности исполнения поставочных Срочных контрактов, базовым активом которых являются ценные бумаги, допущенные по состоянию на день исполнения к заключению сделок купли-продажи ценных бумаг в Режиме торгов «Режим основных торгов T+» в соответствии с Правилами торгов на фондовом рынке (далее – поставочные Срочные контракты режима T+), определяются статьей 41 Правил клиринга, если иное не установлено Спецификацией такого поставочного Срочного контракта.

Статья 41. Особенности исполнения поставочных Срочных контрактов режима T+

- 41.1. Исполнение поставочных Срочных контрактов режима T+ осуществляется в день исполнения контракта в соответствии с условиями Спецификации соответствующего контракта в срок, установленный Временным регламентом.
- 41.2. Исполнению подлежат одновременно все поставочные Срочные контракты режима T+ с одним кодом, Обязательства по поставке по которым учитываются Клиринговым центром на одном разделе регистра учета позиций Участника клиринга по состоянию на момент времени исполнения поставочных Срочных контрактов режима T+, установленный Временным регламентом.
- 41.3. Необходимым условием исполнения Обязательства по поставке по поставочным Срочным контрактам режима T+ является наличие у Клирингового центра информации о Торгово-клиринговом счете, зарегистрированном в соответствии с Правилами клиринга на рынке ценных бумаг и с указанием которого возможно заключение Сделок T+ в Секторе рынка Основной рынок ЗАО «ФБ ММВБ» (далее – Торгово-клиринговый счет для поставки).
- 41.4. Информация о Торгово-клиринговом счете для поставки должна быть предоставлена Участником клиринга Клиринговому центру в срок, установленный Временным регламентом, в Заявлении о соответствии Торгово-клирингового счета для поставки Брокерской фирме, либо в Заявлении о соответствии Торгово-клирингового счета для поставки разделу регистра учета позиций, либо в Заявлении на регистрацию Торгово-клиринговых счетов для поставки.
- 41.4.1. Заявление о соответствии Торгово-клирингового счета для поставки Брокерской фирме содержит:
- код Брокерской фирмы;
 - тип Брокерской фирмы;
 - идентификатор, присвоенный Участнику клиринга в соответствии с Правилами клиринга на рынке ценных бумаг;
 - код Торгово-клирингового счета для поставки;
 - признак Расчетного кода, входящего в состав Торгово-клирингового счета для поставки;
 - код раздела клирингового регистра (не обязательно);
 - краткий код клиента Участника торгов, зарегистрированного в соответствии с Правилами торгов на фондовом рынке (не обязательно).
- Тип Брокерской фирмы (Собственная, Клиентская, ДУ, Обособленная), указанный в заявлении, должен соответствовать признаку Расчетного кода, входящего в состав Торгово-клирингового счета для поставки.
- 41.4.2. Заявление о соответствии Торгово-клирингового счета для поставки разделу регистра учета позиций содержит:
- код раздела регистра учета позиций;
 - тип раздела регистра учета позиций;
 - идентификатор, присвоенный Участнику клиринга в соответствии с Правилами клиринга на рынке ценных бумаг;

- код Торгово-клирингового счета для поставки;
- признак Расчетного кода, входящего в состав Торгово-клирингового счета для поставки;
- краткий код клиента Участника торгов, зарегистрированного в соответствии с Правилами торгов на фондовом рынке (не обязательно).

Тип Брокерской фирмы (Собственная, Клиентская, ДУ, Обособленная), в рамках которой открыт раздел регистра учета позиций, указанный в заявлении, должен соответствовать признаку Расчетного кода, входящего в состав Торгово-клирингового счета для поставки.

41.4.3. Заявление на регистрацию Торгово-клирингового счета для поставки содержит:

- код Расчетной фирмы;
- идентификатор, присвоенный Участнику клиринга в соответствии с Правилами клиринга на рынке ценных бумаг;
- код Торгово-клирингового счета для поставки, соответствующий собственным Расчетным кодам;
- код Торгово-клирингового счета для поставки, соответствующий клиентским Расчетным кодам;
- код Торгово-клирингового счета для поставки, соответствующий Расчетным кодам ДУ.

41.4.4. Торгово-клиринговый счет для поставки, соответствующий Расчетному коду с определенным признаком, указанный в Заявлении на регистрацию Торгово-клиринговых счетов для поставки, используется для заключения сделок купли-продажи ценных бумаг в целях исполнения поставочных Срочных контрактов режима Т+, обязательства по которым учитываются на разделах регистра учета позиций, имеющих коды Брокерских фирм соответствующего типа, открытых в рамках Расчетной фирмы, за исключением Брокерских фирм / разделов регистра учета позиций, для которых Участник клиринга предоставил Заявление о соответствии Торгово-клирингового счета для поставки Брокерской фирме / разделу регистра учета позиций.

41.5. Исполнением поставочных Срочных контрактов режима Т+ является заключение между Участником клиринга и Клиринговым центром сделки купли-продажи ценных бумаг в Режиме торгов «Исполнение обязательств по срочным контрактам» в Секторе рынка Основной рынок ЗАО «ФБ ММВБ», на следующих условиях:

- сделка заключается в отношении ценных бумаг, являющихся базовым активом поставочных Срочных контрактов режима Т+;
- количество ценных бумаг по сделке равно произведению Лота поставочных Срочных контрактов режима Т+ и количества поставочных Срочных контрактов режима Т+, Обязательства по поставке по которым учитывается Клиринговым центром;
- цена одной ценной бумаги по сделке определяется в порядке, установленном Спецификацией поставочных Срочных контрактов режима Т+;
- срок исполнения обязательств по сделке определяется в соответствии с Правилами торгов на фондовом рынке;
- Участник клиринга является Покупателем по сделке, если он является Покупателем по поставочным Срочным контрактам режима Т+. Участник

клиринга является Продавцом по сделке, если он является Продавцом по поставочным Срочным контрактам режима T+.

41.6. В день исполнения контракта Клиринговый центр с использованием Системы торгов направляет Бирже Уведомление о необходимости заключения на торгах ЗАО «ФБ ММВБ» сделки купли-продажи ценных бумаг в целях исполнения обязательств по поставочным Срочным контрактам режима T+, содержащее условия заключаемой сделки, указанные в пункте 41.3 Правил клиринга, а также информацию об определенных в соответствии с пунктом 41.4 Правил клиринга:

- идентификаторе, присвоенном Участнику клиринга в соответствии с Правилами клиринга на рынке ценных бумаг;
- коде Торгово-клирингового счета для поставки;
- коде раздела клирингового регистра (при наличии);
- кратком коде клиента Участника торгов, зарегистрированного в соответствии с Правилами торгов на фондовом рынке (при наличии).

Указанные сделки заключаются на торгах ЗАО «ФБ ММВБ» без подачи заявок.

41.6.1. Плата за клиринговые услуги Клирингового центра, связанные с исполнением поставочных Срочных контрактов режима T+, взимается в соответствии с Правилами клиринга на рынке ценных бумаг как плата за клиринговое обслуживание Участников клиринга по биржевым сделкам с соответствующими ценными бумагами, являющимися базовым активом поставочных Срочных контрактов режима T+.

41.7. Исполнение обязательств по сделкам купли-продажи ценных бумаг, заключенным на торгах ЗАО «ФБ ММВБ» в целях исполнения поставочных Срочных контрактов режима T+, осуществляется в порядке, установленном Правилами клиринга на рынке ценных бумаг для исполнения обязательств по Сделкам T+.

41.8. Если в результате заключения Сделки T+ в целях исполнения обязательств по поставочным Срочным контрактам режиме T+ Единый лимит Участника клиринга по Расчетному коду, рассчитываемый в соответствии с Правилами клиринга на рынке ценных бумаг, станет отрицательным, и Участник клиринга не исполнит возникшее Маржинальное требование в срок, установленный Правилами клиринга на рынке ценных бумаг, Клиринговый центр вправе для погашения Задолженности по Расчетному коду, возникшей у Участника клиринга в соответствии с Правилами клиринга на рынке ценных бумаг, использовать Средства гарантийного обеспечения данного Участника клиринга, учитываемые на разделах денежного регистра обеспечения и депо регистра обеспечения, имеющих код Брокерской фирмы, в рамках которых открыт раздел регистра учета позиций, на котором учитывались Обязательства по поставке по указанным поставочным Срочным контрактам режима T+, связанной / связанный с Расчетным кодом, по которому учитывается Задолженность в соответствии с Правилами клиринга на рынке ценных бумаг.

41.9. Участник клиринга, не допущенный к заключению сделок купли-продажи ценных бумаг в Режиме торгов «Режим основных торгов T+» Сектора рынка Основной рынок ЗАО «ФБ ММВБ», или не предоставивший Клиринговому центру информацию, указанную в пункте 41.4 в срок, установленный Временным регламентом, признается неисполнившей стороной по поставочным Срочным

контрактам режима T+ и обязан уплатить Клиринговому центру неустойку, а Обязательства по поставке по поставочным Срочным контрактам режима T+ прекращаются уплатой неустойки. Размер неустойки по каждому такому Срочному контракту равен Базовому размеру гарантийного обеспечения, установленному в дневной клиринговой сессии дня исполнения такого Срочного контракта.

- 41.10. Порядок исполнения обязательства / требования Участника клиринга по уплате неустойки определен в статье 32 Правил клиринга.

ПОДРАЗДЕЛ V-V. ПОРЯДОК ВЗАИМОДЕЙСТВИЯ С РАСЧЕТНОЙ ОРГАНИЗАЦИЕЙ И РАСЧЕТНЫМ ДЕПОЗИТАРИЕМ

Статья 42. Порядок взаимодействия с Расчетной организацией

- 42.1. Клиринговый центр взаимодействует с Расчетной организацией по клиринговым банковским счетам в соответствии с условиями договора банковского счета.
- 42.2. В случае обращения взыскания на имущество Участника клиринга, находящееся на клиринговом банковском счете, Клиринговый центр вправе принять решение о применении к Участнику процедуры принудительного закрытия позиций в Расчетный день, когда Клиринговый центр получил от Расчетной организации копию документа, являющегося основанием для указанного обращения взыскания.

Статья 43. Порядок взаимодействия с Расчетным депозитарием и иными депозитариями

- 43.1. Перечень документов, которыми обмениваются Клиринговый центр и Расчетный депозитарий в процессе взаимодействия при осуществлении клиринга и расчетов по ценным бумагам по итогам клиринга, а также форматы указанных документов и сроки их предоставления определяются договором, заключенным между Клиринговым центром и Расчетным депозитарием.
- 43.2. Списание ценных бумаг с торговых счетов депо осуществляется на основании распоряжений Клирингового центра или на основании распоряжений лица, которому открыт такой торговый счет депо с согласия Клирингового центра.
- 43.3. Клиринговый центр соглашается с проведением любых операций зачисления на торговый счет депо на основании распоряжений лица, которому открыт такой торговый счет депо.
- 43.4. В случае если торговые счета депо Участников клиринга, Клиентов и иных лиц открыты в депозитарии, открывшем в Расчетном депозитарии торговый счет депо номинального держателя, Клиринговый центр соглашается с проведением любых операций по таким торговым счетам депо, включая закрытие таких торговых счетов депо. Указанное согласие Клирингового центра действует до момента его отзыва Клиринговым центром в указанном депозитарии или до момента направления Клиринговым центром указанному депозитарию распоряжения, устанавливающего иные условия проведения операций по таким торговым счетам депо.
- 43.5. Каждый Расчетный день до начала Торгового дня, Клиринговый центр направляет Расчетному депозитарию запрос выписки по торговым счетам депо, в ответ на который Расчетный депозитарий передает Клиринговому центру список торговых счетов депо и выписку по торговым счетам депо.
- 43.6. После получения от Расчетного депозитария выписки по Счетам FORTS Клиринговый центр устанавливает значения разделов депо регистра обеспечения в соответствии с информацией о количестве ценных бумаг, учитываемых на Счетах FORTS, полученной от Расчетного депозитария в выписке по Счетам FORTS.

- 43.7. При увеличении в ходе торгов количества ценных бумаг, учитываемых на торговом счете депо, Расчетный депозитарий передает Клиринговому центру информацию о таком увеличении, а Клиринговый центр учитывает это увеличение на разделе депо регистра обеспечения.
- 43.8. В случае необходимости в ходе Торгов списания ценных бумаг с торгового счета депо, Расчетный депозитарий направляет Клиринговому центру запрос согласия Клирингового центра на списание ценных бумаг с торговых счетов депо.
Клиринговый центр дает согласие на списание ценных бумаг со Счета FORTS при выполнении условий, указанных в пункте 24.6 Правил клиринга.
- 43.9. Проведение расчетов по ценным бумагам по итогам клиринга осуществляется Расчетным депозитарием на основании полученного от Клирингового центра распоряжения на проведение операций по торговым счетам депо.
- 43.10. Исполнение распоряжения на проведение операций по торговым счетам депо, полученного от Клирингового центра, осуществляется Расчетным депозитарием в корреспонденции с субсчетом депо Клирингового центра, открытым в рамках клирингового счета депо Клирингового центра в Расчетном депозитарии.
- 43.11. После исполнения распоряжения на проведение операций по торговым счетам депо, полученного от Клирингового центра, Расчетный депозитарий направляет Клиринговому центру отчет о проведении операций по торговым счетам депо.
- 43.12. В случае обращения взыскания на имущество Участника клиринга, находящееся на торговом счете депо и/или на клиринговом счете депо, Клиринговый центр вправе принять решение о применении к Участнику клиринга процедуры принудительного закрытия позиций в Расчетный день, когда Клиринговый центр получил от Расчетного депозитария копию документа, являющегося основанием для указанного обращения взыскания.

РАЗДЕЛ VI. ПОРЯДОК ОПЛАТЫ УСЛУГ. ОТЧЕТЫ ПО ИТОГАМ КЛИРИНГА

Статья 44. Порядок оплаты услуг Клирингового центра, Биржи и Технического центра

- 44.1. Клиринговый центр взимает с Участников клиринга следующие комиссионные вознаграждения:
- комиссионное вознаграждение за оказание клиринговых услуг в пользу Клирингового центра;
 - биржевой сбор за заключение Срочных контрактов в пользу Биржи;
 - плата за абонентское обслуживание на Срочном рынке ОАО Московская Биржа в пользу Биржи (по Срочным контрактам);
 - сбор за неэффективные транзакции и сбор за ошибочные транзакции в пользу Технического центра.
- 44.2. Размер комиссионного вознаграждения за оказание клиринговых услуг, подлежащего уплате Участником клиринга, рассчитывается Клиринговым центром в соответствии с Тарифами Клирингового центра.
- 44.3. Биржевой и иные сборы в пользу Биржи, включая неустойку за нарушение порядка и сроков их уплаты, взимаются Клиринговым центром в соответствии с действующими тарифами Биржи (далее – Тарифы Биржи) на основании договора, заключенного с Биржей.
- 44.4. Сбор за неэффективные транзакции и сбор за ошибочные транзакции в пользу Технического центра взимается Клиринговым центром в соответствии с действующими тарифами Технического центра (далее – Тарифы Технического центра), на основании договора, заключенного с Техническим центром.
- 44.5. Участник клиринга исполняет обязательства по уплате комиссионных вознаграждений Клирингового центра, Биржи, Технического центра и иных лиц в российских рублях.
- 44.5.1. Если тарифы Клирингового центра, Биржи, Технического центра и иных лиц и/или рассчитанные в соответствии с тарифами суммы комиссионного вознаграждения / суммы штрафов выражены в долларах США, оплата услуг Клирингового центра / штрафов Участником клиринга осуществляется в российских рублях по курсу Банка России на день платежа - в случаях, когда услуги подлежат оплате в авансовом порядке, а при оплате за оказанные услуги за очередной отчетный период - по курсу, установленному Банком России на последний день отчетного периода.
- 44.6. Обязательства Участника клиринга по оплате клиринговых услуг в соответствии с Тарифами Клирингового центра, по уплате биржевых сборов за заключение Срочных контрактов, платы за абонентское обслуживание на Срочном рынке ОАО Московская Биржа, комиссионного вознаграждения Биржи за организацию торгов, а также по уплате сбора за неэффективные транзакции и сбора за ошибочные транзакции, исполняются в ходе дневной или вечерней клиринговой сессии

соответствующего Расчетного дня в порядке, определенном в статье 32 Правил клиринга.

- 44.6.1. Комиссионное вознаграждение, установленное от суммы сделки или за один Срочный контракт, подлежит уплате Участником клиринга в дату заключения сделки (Срочного контракта) по разделу денежного регистра обеспечения, код которого совпадает с кодом раздела регистра учета позиций, с указанием которого был заключен Срочный контракт.
- 44.6.2. Плата за абонентское обслуживание на Срочном рынке ОАО Московская Биржа, определенная в соответствии с Тарифами Биржи, подлежит уплате Участником клиринга, являющимся Участником торгов Биржи, в первый Расчетный день календарного квартала, следующего за кварталом, за который взимается указанная плата, по основному собственному разделу денежного регистра обеспечения.
- 44.6.3. Определенный в соответствии с Тарифами Технического центра, отличный от нуля сбор за неэффективные транзакции, рассчитанный в отношении Участника клиринга / Клиента Участника клиринга, подлежит уплате Участником клиринга в Расчетный день, по итогам которого указанный сбор рассчитан, по разделу денежного регистра обеспечения, код которого совпадает с кодом раздела регистра учета позиций, с указанием которого Участником клиринга в течение данного Расчетного дня были совершены транзакции в своих интересах или в интересах указанного Клиента, если такой раздел регистра учета позиций – единственный, либо по разделам денежного регистра обеспечения, коды которых совпадают с кодами разделов регистра учета позиций, с указанием которого Участником клиринга в течение данного Расчетного дня были совершены транзакции в своих интересах или в интересах указанного Клиента, в суммах, пропорциональных количеству транзакций, совершенных с указанием соответствующих разделов регистра учета позиций, если Участником клиринга в течение данного Расчетного дня транзакции в своих интересах или в интересах указанного Клиента были совершены с указанием нескольких разделов регистра учета позиций.
- 44.6.4. Определенный в соответствии с Тарифами Технического центра, отличный от нуля сбор за ошибочные транзакции, рассчитанный в отношении логина Участника клиринга, подлежит уплате Участником клиринга в Расчетный день, по итогам которого указанный сбор рассчитан, по разделу денежного регистра обеспечения, которому соответствует логин, в отношении которого определен сбор за ошибочные транзакции.

Статья 45. Порядок представления отчетов по итогам клиринга

- 45.1. Клиринговый центр формирует следующие отчеты по итогам клиринга для Участников клиринга, которым присвоен код Расчетной фирмы:
- отчеты о заключенных Срочных контрактах, содержащие информацию об обязательствах по сделкам, допущенных к клирингу;
 - отчеты об обязательствах по Срочным контрактам, содержащие информацию об обязательствах, определенных по результатам клиринга;
 - отчеты о денежных средствах в российских рублях, иностранной валюте и ценных бумагах, являющихся Средствами гарантийного обеспечения, содержащие информацию о размере Средств гарантийного обеспечения и об изменениях их размера;

- отчет об операциях по разделам денежного регистра обеспечения и депо регистра обеспечения;
- отчет о разделах клиринговых регистров;
- отчет о торговых счетах, закрепленных за разделом регистра учета позиций;
- отчет о сборе за неэффективные транзакции и сборе за ошибочные транзакции;
- сводная финансовая ведомость.

Указанные в настоящем пункте отчеты Клиринговый центр направляет Участникам клиринга и/или уполномоченным ими организациям.

45.2. В случае указания Участником клиринга в Заявлении на открытие клиентского раздела клиринговых регистров на необходимость формирования отчетов по разделу клиринговых регистров или в случае предоставления Участником клиринга Заявления на формирование отчетов по разделу клиринговых регистров, Клиринговый центр формирует следующие отчеты по итогам клиринга для Клиентов Участников клиринга:

- отчеты о заключенных Срочных контрактах, содержащие информацию об обязательствах по сделкам, допущенных к клирингу;
- отчеты об обязательствах по Срочным контрактам, содержащие информацию об обязательствах, определенных по результатам клиринга;
- отчеты о денежных средствах в российских рублях, иностранной валюте и ценных бумагах, являющихся Средствами гарантийного обеспечения, содержащие информацию о размере Средств гарантийного обеспечения и об изменениях их размера;
- отчет об операциях по разделам денежного регистра обеспечения и депо регистра обеспечения.

Указанные в настоящем пункте отчеты Клиринговый центр направляет Клиентам Участников клиринга или Участникам клиринга для передачи Клиентам Участников клиринга.

За предоставление отчетов Клиентам Участников клиринга в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга с Участников клиринга взимается плата в соответствии с Тарифами Клирингового центра.

45.3. Форматы отчетов, предоставляемых Участникам клиринга и их Клиентам, определяются документом «Форматы отчетов, предоставляемых Участникам клиринга в соответствии с Правилами клиринга ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр» на срочном рынке», утверждаемым Клиринговым центром и раскрываемом на Сайте Клирингового центра.

45.4. Клиринговый центр вправе предоставлять отчеты Доверенному владельцу счетов, закрепленному за Обособленной Брокерской фирмой, по клиентам Участника клиринга, для которых открыты разделы клиринговых регистров, имеющие коды данной Обособленной Брокерской фирмы, в разрезе указанных разделов.

45.5. Отчеты, указанные в настоящей статье Правил клиринга, направляются Участнику клиринга, Доверенному владельцу счетов, Клиенту в форме электронных документов с использованием Подсистемы ЭДО НКЦ.

Отчеты в форме электронных документов направляются Участнику клиринга, Доверенному владельцу счетов, Клиенту ежедневно при условии совершения им в этот день (по его поручению / с использованием его торговых счетов) соответствующих операций в Клиринговой системе.

- 45.6. Участнику клиринга на основании его письменного запроса могут быть изготовлены (распечатаны) копии электронных документов на бумажном носителе либо предоставлены копии отчетов в форме электронных документов.

Копии электронных документов на бумажном носителе подписываются уполномоченным лицом Клирингового центра и передаются сотруднику Участника клиринга, действующему на основании Доверенности на получение и предоставление документов, либо направляются Участнику клиринга по почте заказным письмом с уведомлением.

Указанные копии отчетов предоставляются Клиринговым центром в течение 3 (трех) Расчетных дней после получения запроса. За предоставление указанных копий отчетов с Участника клиринга взимается плата в соответствии с Тарифами Клирингового центра.

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

РАЗДЕЛ VII. ПРОЧИЕ УСЛОВИЯ

Статья 46. Перевод позиций и Перевод Средств гарантийного обеспечения клиента Участника клиринга от одного Участника клиринга другому Участнику клиринга

- 46.1. Клиринговый центр осуществляет перевод долга и уступку требований одного Участника клиринга (далее – Базовый Участник клиринга) по обязательствам, допущенным к клирингу, учитываемым по разделам регистра учета позиций, имеющим код Обособленной Брокерской фирмы, открытой такому Участнику клиринга, (далее – Перевод позиций), другому Участнику клиринга (далее – Участник клиринга – реципиент) при наличии Заявления на перевод позиций (далее также – Заявление), предоставляемого Доверенным владельцем счетов, закрепленным за указанной Обособленной Брокерской фирмой. В Заявлении должны быть указаны наименование Участника клиринга – реципиента, а также не менее чем одно из следующих оснований в отношении Базового Участника клиринга для осуществления Перевода позиций:
- 46.1.1. основания, предусмотренные подпунктами 12.1.2, 12.1.4, 12.1.5, 12.1.6, 12.1.7, 12.1.8, пунктом 12.8 Правил клиринга;
 - 46.1.2. наличие в деятельности Базового Участника клиринга оснований для осуществления мер по предупреждению банкротства в соответствии с законодательством Российской Федерации о несостоятельности (банкротстве), а также оснований для отзыва (аннулирования) Банком России / уполномоченным федеральным органом исполнительной власти лицензии на осуществление соответствующего вида деятельности в соответствии с законодательством Российской Федерации;
 - 46.1.3. наличие дела о банкротстве в отношении Базового Участника клиринга в производстве арбитражного суда более 2 (двух) месяцев с момента подачи соответствующего заявления;
 - 46.1.4. нарушение Базовым Участником клиринга правил российских или иностранных организатора торгов или клиринговой организации;
 - 46.1.5. включение в повестку дня органов управления Базового Участника клиринга вопроса либо принятие решения органами управления Базового Участника клиринга о ликвидации Базового Участника клиринга;
 - 46.1.6. принятие органами управления Базового Участника клиринга решения о реорганизации Базового Участника клиринга (за исключением случаев реорганизации, которые не влекут прекращения деятельности Базового Участника клиринга);
 - 46.1.7. принятие судебного акта о взыскании, наложении ареста либо ином обременении в отношении имущества Базового Участника клиринга;
 - 46.1.8. предоставление Базовым Участником клиринга Клиринговому центру поручения на перевод позиций и Средств гарантийного обеспечения;
 - 46.1.9. наличие Задолженности Базового Участника клиринга после выполнения Клиринговым центром действий, предусмотренных статьей 35 Правил клиринга.

46.2. Заявление на открытие Обособленной Брокерской фирмы, предоставленное Базовым участником клиринга Клиринговому центру в порядке, предусмотренном подпунктом 8.23 Правил клиринга, является основанием для перевода Средств гарантийного обеспечения, учитываемых на разделах денежного регистра обеспечения и разделах депо регистра обеспечения, имеющих код данной Обособленной Брокерской фирмы (далее – Перевод Средств гарантийного обеспечения) при подаче соответствующим Доверенным владельцем счетов, закрепленным за данной Обособленной Брокерской фирмой Базового участника клиринга Заявления в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга.

Перевод Средств гарантийного обеспечения осуществляется одновременно с Переводом позиций в порядке и на условиях, предусмотренных настоящей статьей Правил клиринга.

Подача Базовым Участником клиринга Заявления на открытие Обособленной Брокерской фирмы является безусловным согласием Базового участника клиринга на перевод Клиринговым центром Участнику клирингу – реципиенту Средств гарантийного обеспечения в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга, а также согласием на предоставление Клиринговым центром Участнику клиринга – реципиенту информации о Базовом участнике, предусмотренной пунктом 46.6 Правил клиринга. Такое согласие не может быть отозвано Базовым Участником клиринга.

46.3. Перевод позиций и Перевод Средств гарантийного обеспечения не осуществляется:

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

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

46.3.3. при отсутствии согласия Участника клиринга – реципиента, предусмотренного пунктом 46.7 Правил клиринга.

46.4. Предоставление Доверенным владельцем счетов Заявления на перевод позиций является безусловным согласием Доверенного владельца счетов на предоставление Клиринговым центром Участнику клиринга – реципиенту информации, предусмотренной пунктом 46.6 Правил клиринга.

46.4.1. Клиринговый центр не осуществляет проверку достоверности оснований для Перевода позиций, указанных Доверенным владельцем счетов в Заявлении. При этом Клиринговый центр вправе отказать Доверенному владельцу счетов в исполнении Заявления на перевод позиций при наличии информации об отсутствии указанных в Заявлении оснований.

46.4.2. Клиринговый центр не несет ответственности за убытки, понесенные Базовым участником клиринга / Доверенным владельцем счетов в случае исполнения / неисполнения Клиринговым центром Заявления, поданного Доверенным владельцем счетов в соответствии с пунктом 46.1 Правил клиринга.

46.5. Если Клиринговому центру стало известно о наступлении в отношении Базового Участника клиринга одного или нескольких оснований для Перевода позиций, предусмотренных пунктом 46.1 Правил клиринга, а Заявление на перевод позиций от Доверенного владельца счетов, закрепленного за Обособленной Брокерской

фирмой Базового участника клиринга, не получено, Клиринговый центр вправе сообщить Доверенному владельцу счетов о наличии таких оснований.

46.5.1. Заявление на перевод позиций подтверждает, что согласие Клиентов Базового Участника клиринга на Перевод позиций и Перевод Средств гарантийного обеспечения Участнику клиринга – реципиенту Доверенным владельцем счетов получено.

46.6. При получении от Доверенного владельца счетов Заявления на перевод позиций и при отсутствии у Клирингового центра оснований для отказа в исполнении Заявления, Клиринговый центр передает с использованием Подсистемы ЭДО НКЦ Участнику клиринга – реципиенту сообщение об открытых позициях по Срочным контрактам и Средствах гарантийного обеспечения, учитываемых на разделах клиринговых регистров, имеющих коды Обособленной Брокерской фирмы, за которой закреплен данный Доверенный владелец счетов, предоставивший Заявление на перевод позиций (далее – Сообщение об открытых позициях и Средствах гарантийного обеспечения).

46.7. Участник клиринга – реципиент обязан предоставить Клиринговому центру согласие на прием позиций по Срочным контрактам, определенных в пункте 46.6 Правил клиринга (далее – Согласие на прием), не позднее, чем за 30 (тридцать) минут до окончания основной торговой сессии, определенной Правилами организованных торгов на Срочном рынке ОАО Московская Биржа, Торгового дня получения Сообщения об открытых позициях и Средствах гарантийного обеспечения от Клирингового центра в соответствии с пунктом 46.6 Правил клиринга.

Предоставление указанного Согласия на прием является также согласием Участника клиринга – реципиента на перевод ему Средств гарантийного обеспечения, определенных в пункте 46.6 Правил клиринга, и предоставляет Участнику клиринга – реципиенту право требовать от Клирингового центра перевода таких Средств гарантийного обеспечения.

46.8. Для исполнения Заявления на перевод позиций после получения согласия Участника клиринга – реципиента в соответствии с пунктом 46.7 Правил клиринга Клиринговый центр:

46.8.1. незамедлительно:

- уведомляет Биржу о необходимости установления запрета на подачу Базовым Участником клиринга Заявок на заключение Срочных контрактов с указанием кодов Обособленной Брокерской фирмы;
- посредством Торговой системы направляет Бирже уведомление о необходимости удаления Активных заявок, поданных с указанием кодов Обособленной Брокерской фирмы, открытой Базовому Участнику клиринга.

46.8.2. до начала вечерней клиринговой сессии Торгового дня получения указанного Согласия на прием – в рамках Расчетной фирмы Участника клиринга – реципиента, код которой указан в Заявлении на перевод позиций:

- открывает разделы клиринговых регистров Обособленной Брокерской фирмы. Плата за открытие разделов клиринговых регистров Обособленной Брокерской фирмы в соответствии с настоящим подпунктом Правил клиринга не взимается;

- закрепляет за данной Обособленной Брокерской фирмой Доверенного владельца счетов, предоставившего Заявление на перевод позиций;
- открывает клиентский Расчетный код Участнику клиринга – реципиенту и закрепляет за ним Обособленную Брокерскую фирму, за которой закреплен Доверенный владелец счетов, предоставивший Заявление на перевод позиций;
- в рамках данной Обособленной Брокерской фирмы открывает тот же набор разделов клиринговых регистров, который открыт в рамках Обособленной Брокерской фирмы, открытой Базовому Участнику клиринга;
- закрепляет разделы FORTS за разделом клиринговых регистров, имеющим код Обособленной Брокерской фирмы, открытой Участнику клиринга – реципиенту.

46.8.3. В течение 30 минут с начала вечерней дополнительной торговой сессии Торгового дня, следующего за Торговым днем получения согласия Участника клиринга – реципиента в соответствии с пунктом 46.7 Правил клиринга – изменяет учет позиций по Срочным контрактам, а также учет Средств гарантийного обеспечения следующим образом:

- на разделах регистра учета позиций, имеющих код Обособленной Брокерской фирмы, открытой Участнику клиринга – реципиенту, начинает учитывать позиции по Срочным контрактам, равные позициям по Срочным контрактам, учитываемым на соответствующих разделах регистра учета позиций, имеющих код Обособленной Брокерской фирмы, открытой Базовому Участнику клиринга, и одновременно перестает учитывать данные позиции по Срочным контрактам, учитываемые на разделах регистра учета позиций, имеющих код Обособленной Брокерской фирмы, открытой Базовому Участнику клиринга;
- значения разделов денежного регистра обеспечения и депо регистра обеспечения, имеющих код Обособленной Брокерской фирмы, открытой Участнику клиринга – реципиенту, устанавливает равным значениям соответствующих разделов денежного регистра обеспечения и депо регистра обеспечения, имеющих код Обособленной Брокерской фирмы, за которой закреплен Доверенный владелец счетов, предоставивший Заявление на перевод позиций и Средств гарантийного обеспечения, и одновременно значения разделов денежного регистра обеспечения и депо регистра обеспечения, имеющих код Обособленной Брокерской фирмы, открытой Базовому Участнику клиринга, устанавливает равными нулю.

46.9. В течение 5 (пяти) Расчетных дней после Перевода позиций и Средств гарантийного обеспечения Клиринговым центром Участник клиринга – реципиент обязан в соответствии с порядком, определенном в статье 11 Правил клиринга, зарегистрировать Клиентов Участников клиринга, в интересах и/или за счет которых будут заключаться сделки с указанием кодов разделов клиринговых регистров, открытых Участнику клиринга – реципиенту в соответствии с подпунктом 46.8.1 Правил клиринга.

46.10. Доверенный владелец счетов вправе до получения Клиринговым центром от Участника клиринга – реципиента Согласия на прием отозвать свое Заявление о переводе позиций путем направления Клиринговому центру соответствующего заявления (далее – Заявление об отзыве).

- 46.11. Доверенный владелец счетов вправе до получения Клиринговым центром от Участника клиринга – реципиента Соглашения на прием заменить первоначально указанного Участника клиринга – реципиента на другого Участника клиринга – реципиента путем направления Клиринговому центру Заявления на перевод позиций с указанием наименования нового Участника клиринга – реципиента.
- 46.12. Клиринговый центр, Базовый Участник клиринга, Участник клиринга – реципиент и Доверенный владелец счетов вправе осуществлять обмен сообщениями, предусмотренными настоящей статьей Правил клиринга, с использованием Подсистемы ЭДО НКЦ или системы S.W.I.F.T., если такой обмен сообщениями предусмотрен между ними, включая, но не ограничиваясь, предоставлением Заявления на перевод позиций, Соглашения на прием, Заявления об отзыве.
- 46.13. За осуществление процедуры Перевода позиций и Перевода Средств гарантийного обеспечения с Участника клиринга – реципиента взимается плата в размере, установленном приложением № 2 к Правилам клиринга.
- 46.13.1. Порядок исполнения обязательства Участника клиринга – реципиента по внесению платы за осуществление процедур Перевода позиций и Перевода Средств гарантийного обеспечения определен в статье 32 Правил клиринга.

Статья 47. Порядок действий в случае включения Участника клиринга или Доверенного владельца счетов в перечень организаций, в отношении которых имеются сведения об их причастности к экстремистской деятельности или терроризму

- 47.1. В дату включения Участника клиринга в перечень организаций, указанных в подпункте 12.7.5 (далее – Перечень), Клиринговый центр незамедлительно:
- блокирует (замораживает) денежные средства, учитываемые на счетах Клирингового центра в качестве Средств гарантийного обеспечения, Обеспечения под стресс и вноса в Гарантийный фонд Участника клиринга, за исключением денежных средств, учитываемых на разделах клиринговых регистров, открытых в рамках Обособленных Брокерских фирм, за которыми закреплены Доверенные владельцы счетов, не являющиеся Участником клиринга, включенным в Перечень, денежные средства / ценные бумаги, учитываемые на счетах Клирингового центра в качестве вноса в Гарантийный фонд Участника клиринга, а также блокирует операции с указанными средствами и иные операции такого Участника клиринга, предусмотренные Правилами клиринга;
 - прекращает допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию;
 - уведомляет Биржу о необходимости установления запрета на подачу указанным Участником клиринга заявок на заключение сделок и о необходимости снятия таких зарегистрированных заявок.
- 47.2. В дату включения Участника клиринга в Перечень обязательства такого Участника клиринга по Срочным контрактам, за исключением обязательств Участника клиринга, учитываемых на разделах клиринговых регистров, открытых в рамках Обособленных Брокерских фирм, за которыми закреплены Доверенные владельцы счетов, не являющиеся Участниками клиринга, прекращаются полностью

возникновением нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга, рассчитываемого в российских рублях как сумма с учетом знака:

- по каждому Срочному контракту суммы позиций по Срочным контрактам по всем разделам регистра учета позиций Участника клиринга, учитываемых на дату включения Участника клиринга в Перечень, пересчитанной в российские рубли по Расчетной цене соответствующего Срочного контракта, установленной Клиринговым центром 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.

47.3. Клиринговый центр вправе в порядке, предусмотренном статьей 37 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 47.2 Правил клиринга.

47.4. После исключения Участника клиринга из Перечня:

47.4.1. в случае если для исполнения нетто-обязательства Участника клиринга, рассчитанного в порядке, предусмотренном пунктом 47.2 Правил клиринга, не были использованы средства Гарантийного фонда, и по Участнику клиринга учитываются Средства гарантийного обеспечения, Обеспечения 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;

47.4.2. в случае если для исполнения нетто-обязательства Участника клиринга, рассчитанного в порядке, предусмотренном пунктом 47.2 Правил клиринга, были использованы средства Гарантийного фонда, и по Участнику клиринга учитываются Средства гарантийного обеспечения, Обеспечения 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.

47.5. В дату включения Доверенного владельца счетов, за исключением Доверенных владельцев счетов, являющихся Участниками клиринга, в Перечень Клиринговый центр незамедлительно:

- блокирует (замораживает) денежные средства, учитываемые на счетах Клирингового центра в качестве Средств гарантийного обеспечения на разделах клиринговых регистрах, открытых в рамках Обособленных Брокерских фирм, за которой закреплен указанный Доверенный владелец счетов, а также блокирует операции с указанными средствами;
- уведомляет Биржу о необходимости установления запрета на подачу заявок с

указанием кодов Обособленных Брокерских фирм, за которыми закреплен такой Доверенный владелец счетов, и о необходимости снятия таких зарегистрированных заявок.

47.6. В дату включения Доверенного владельца счетов, за исключением Доверенных владельцев счетов, являющихся Участниками клиринга, в Перечень обязательства Участника клиринга по Срочным контрактам, учитываемые на разделах регистра учета позиций, имеющих коды Обособленных Брокерских фирм, за которыми закреплен такой Доверенный владелец счетов, прекращаются полностью возникновением нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга, рассчитываемого в российских рублях как сумма с учетом знака:

- по каждому Срочному контракту суммы позиций по Срочным контрактам, учитываемых на дату включения Доверенного владельца счетов в Перечень по разделам регистра учета позиций Участника клиринга, имеющим коды Обособленных Брокерских фирм, за которыми закреплен Доверенный владелец счетов, включенный в Перечень, пересчитанной в российские рубли по Расчетной цене соответствующего Срочного контракта, установленной Клиринговым центром на дату включения Доверенного владельца счетов 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.

47.7. Нетто-обязательство Участника клиринга, рассчитанное в соответствии с пунктом 47.6 Правил клиринга, исполняется за счет Средств гарантийного обеспечения Участника клиринга, учитываемых по Собственным Брокерским фирмам Участника клиринга, и за счет вноса Участника клиринга в Гарантийный фонд.

Статья 48. Порядок урегулирования обязательств в случае прекращения допуска к клиринговому обслуживанию

48.1. 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 48.3 Правил клиринга.

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

содержащее информацию об отзыве (аннулировании) у Участника клиринга - кредитной организации лицензии на осуществление банковских операций.

- 48.1.2. В случае отзыва (аннулирования) лицензии на осуществление банковских операций у Участника клиринга – кредитной организации, обязательства по Срочным контрактам, заключенным до даты отзыва (аннулирования) такой лицензии, прекращаются полностью в Расчетный день, предшествующий дате отзыва лицензии на осуществление банковских операций у Участника клиринга – кредитной организации.

Указанные обязательства по Срочным контрактам прекращаются возникновением нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга – кредитной организации, рассчитанного в соответствии с пунктом 48.3 Правил клиринга.

- 48.1.3. В случае отзыва (аннулирования) лицензии на осуществление банковских операций у Участника клиринга – кредитной организации, Срочные контракты, заключенные в дату отзыва (аннулирования) такой лицензии и (или) после нее, являются недействительными.

Клиринговый центр или Участник клиринга – контрагент по указанным сделкам вправе предъявить к Участнику клиринга – кредитной организации, у которого отозвана (аннулирована) лицензия на осуществление банковских операций, 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).

- 48.1.4. Клиринговый центр совершает сделки с иными Участниками клиринга на основании пункта 18.10 Правил клиринга с целью минимизации рисков по позициям Клирингового центра по Срочным контрактам и в порядке, предусмотренном пунктом 48.3 Правил клиринга, рассчитывает сумму нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга - кредитной организации.

- 48.1.5. Клиринговый центр направляет Участнику клиринга - кредитной организации, у которого отозвана (аннулирована) лицензия на осуществление банковских операций, уведомление о прекращении обязательств по Срочным контрактам в течение 3 (трех) рабочих дней, следующих за датой отзыва (аннулирования) такой лицензии. Указанное уведомление также содержит информацию о рассчитанном в соответствии с пунктом 48.3 Правил клиринга нетто-обязательстве / нетто-требовании Участника клиринга – кредитной организации в отношении Клирингового центра.

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

- 48.1.6. Клиринговый центр направляет Доверенному владельцу счетов в форме электронного документа уведомление о рассчитанной в соответствии с пунктом 48.3 Правил клиринга сумме обязательства или требования Участника клиринга, исполнение которого обеспечивается за счет Доверенного владельца счетов.

Доверенный владелец счетов вправе подать в Клиринговый центр Заявление на возврат денежных средств, составляющих Средства гарантийного обеспечения, обязательства по возврату которых учитываются на разделах денежного регистра обеспечения, имеющих код Обособленной Брокерской фирмы, за которой

закреплен указанный Доверенный владелец счетов, в сумме, оставшейся после погашения обязательства Участника клиринга, исполнение которого обеспечивается за счет Доверенного владельца счетов. Возврат указанных денежных средств осуществляется в порядке, установленном статьей 22 Правил клиринга.

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

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

Возврат денежных средств Участнику клиринга – кредитной организации осуществляется Клиринговым центром в сумме нетто-требования Участника клиринга, рассчитанного соответственно в порядке, предусмотренном пунктом 48.3 Правил клиринга.

Возврат ценных бумаг с клирингового счета депо Клирингового центра Участнику клиринга – кредитной организации осуществляется Клиринговым центром в количестве, оставшемся после определения нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в порядке, предусмотренном пунктом 48.3 Правил клиринга.

Ценные бумаги, оставшиеся после определения нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в порядке, предусмотренном пунктом 48.3 Правил клиринга, списываются с торговых счетов депо Участника клиринга / Доверенного владельца счетов / Клиента Участника клиринга без согласия Клирингового центра.

- 48.1.8. Клиринговый центр вправе предъявить к Участнику клиринга требование о взыскании нетто-обязательства Участника клиринга, рассчитанного соответственно в порядке, предусмотренном пунктом 48.3 Правил клиринга, в общем порядке, предусмотренном законодательством о несостоятельности (банкротстве).

- 48.2. 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 арбитражным судом решения о введении в отношении Участника клиринга одной из процедур банкротства, в зависимости от того, какая дата наступила ранее, за исключением расчета Клиринговым центром нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в соответствии с пунктом 48.4 Правил клиринга.

- 48.2.1. В случае назначения временной администрации или принятия арбитражным судом решения о введении в отношении Участника клиринга – некредитной организации

одной из процедур банкротства, обязательства по Срочным контрактам 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.

Указанные обязательства по Срочным контрактам Участника клиринга – некредитной организации прекращаются возникновением нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга – некредитной организации, рассчитанных в соответствии с пунктом 48.4 Правил клиринга.

48.2.2. Клиринговый центр заключает сделки с иными Участниками клиринга на основании пункта 18.10 Правил клиринга с целью минимизации рисков по позициям Клирингового центра по Срочным контрактам и в порядке, предусмотренном пунктом 48.4 Правил клиринга, рассчитывает сумму нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга - некредитной организации.

48.2.3. Клиринговый центр направляет такому Участнику клиринга – некредитной организации уведомление о прекращении обязательств по Срочным контрактам не позднее Рабочего дня, следующего за датой прекращения обязательств по указанным сделкам.

48.2.4. Клиринговый центр направляет Доверенному владельцу счетов в форме электронного документа уведомление о рассчитанной в соответствии с пунктом 48.4 Правил клиринга сумме обязательства или требования Участника клиринга, исполнение которого обеспечивается за счет Доверенного владельца счетов.

Доверенный владелец счетов вправе подать в Клиринговый центр Заявление на возврат денежных средств, составляющих Средства гарантийного обеспечения, обязательства по возврату которых учитываются на разделах денежного регистра обеспечения, имеющих код Обособленной Брокерской фирмы, за которой закреплен указанный Доверенный владелец счетов, в сумме, оставшейся после погашения обязательства Участника клиринга, исполнение которого обеспечивается за счет Доверенного владельца счетов. Возврат указанных денежных средств осуществляется в порядке, установленном статьей 22 Правил клиринга.

48.2.5. Возврат денежных средств и/или ценных бумаг Участнику клиринга – некредитной организации, осуществляется Клиринговым центром не позднее 3 (трех) рабочих дней с даты прекращения Договора об оказании клиринговых услуг по реквизитам соответствующего Счета зачисления, зарегистрированного для основной Брокерской фирмы Участника клиринга, или по реквизитам, указанным в письме о возврате денежных средств и/или ценных бумаг, в случае если это письмо получено Клиринговым центром от уполномоченного органа Участника клиринга до момента перечисления Участнику клиринга денежных средств и/или ценных бумаг в соответствии с настоящим подпунктом Правил клиринга.

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

Возврат денежных средств Участнику клиринга – некредитной организации, осуществляется Клиринговым центром в сумме нетто-требования Участника

клиринга, рассчитанного в порядке, предусмотренном пунктом 48.4 Правил клиринга.

Возврат ценных бумаг с клирингового счета депо Клирингового центра Участнику клиринга – некредитной организации осуществляется Клиринговым центром в количестве, оставшемся после определения нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в порядке, предусмотренном пунктом 48.4 Правил клиринга.

Ценные бумаги, оставшиеся после определения нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в порядке, предусмотренном пунктом 48.4 Правил клиринга, списываются с торговых счетов депо Участника клиринга / Доверенного владельца счетов / Клиента Участника клиринга без согласия Клирингового центра.

48.2.6. Клиринговый центр вправе предъявить к Участнику клиринга требование о взыскании нетто-обязательства Участника клиринга, рассчитанного в порядке, предусмотренном пунктом 48.4 Правил клиринга, а также неустоек (штрафов, пеней), и комиссионных вознаграждений, подлежащих уплате в соответствии с Правилами клиринга, в общем порядке, предусмотренном законодательством о несостоятельности (банкротстве).

48.3. 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 48.3.1-48.3.3 Правил клиринга.

48.3.1. Клиринговый центр для каждого Доверенного владельца счетов рассчитывает обязательство / требование Участника клиринга, исполнение которого обеспечивается за счет Доверенного владельца счетов, следующим образом:

- 1) для каждого Доверенного владельца счетов и Срочного контракта рассчитывает нетто-позицию Участника клиринга по Срочному контракту по разделам регистра учета позиций, имеющим коды Обособленных Брокерских фирм, за которыми закреплен данный Доверенный владелец счетов (далее – нетто-позиция по Срочному контракту Доверенного владельца счетов), как сумму (с учетом знака) позиций по Срочным контрактам, учитываемых на всех разделах регистра учета позиций Участника клиринга, имеющих коды указанных Обособленных Брокерских фирм, на конец дня, предшествующего дате отзыва (аннулирования) у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций;
- 2) если нетто-позиция по Срочному контракту Доверенного владельца счетов является позицией на продажу, Клиринговый центр рассчитывает произведение абсолютной величины нетто-позиции по Срочному контракту Доверенного владельца счетов и разности Расчетной цены Срочного контракта, определенной в ходе последней дневной или вечерней клиринговой сессии, и цены сделки, заключенной Клиринговым центром в соответствии с подпунктом 48.1.4 Правил клиринга в объеме, равном нетто-позиции по Срочному контракту Доверенного владельца счетов, с направленностью, противоположной направленности нетто-позиции по Срочному контракту Доверенного владельца счетов (на покупку);
- 3) если нетто-позиция по Срочному контракту Доверенного владельца счетов является позицией на покупку, Клиринговый центр рассчитывает произведение нетто-позиции по Срочному контракту Доверенного владельца

счетов и разности цены сделки, заключенной Клиринговым центром в соответствии с подпунктом 48.1.4 Правил клиринга в объеме, равном нетто-позиции по Срочному контракту Доверенного владельца счетов, с направленностью, противоположной направленности нетто-позиции по Срочному контракту Доверенного владельца счетов (на продажу) и Расчетной цены Срочного контракта, определенной в ходе последней дневной или вечерней клиринговой сессии;

- 4) по каждому Доверенному владельцу счетов рассчитывает сумму с учетом знака:
- по всем Срочным контрактам, произведений, рассчитанных в соответствии с пунктами 2, 3 настоящего подпункта Правил клиринга;
 - обязательств Участников клиринга по уплате вариационной маржи, премии, учитываемых по разделам регистра учета позиций, имеющим код Обособленной Брокерской фирмы, за которой закреплен данный Доверенный владелец счетов, исполненных в дату отзыва (аннулирования) у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций (учитываются со знаком «плюс»);
 - требований Участников клиринга по получению вариационной маржи, премии, учитываемых по разделам регистра учета позиций, имеющим код Обособленной Брокерской фирмы, за которой закреплен данный Доверенный владелец счетов, исполненных в дату отзыва (аннулирования) у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций (учитываются со знаком «минус»);
 - Задолженности Участника клиринга в российских рублях, возникшей до даты отзыва (аннулирования) у Участника клиринга указанной лицензии, и учитываемой по Расчетному коду, связанному с Обособленной Брокерской фирмой (учитывается со знаком «минус»).

Если указанная сумма отрицательная, это означает наличие обязательства Участника клиринга, исполнение которого обеспечивается за счет Доверенного владельца счетов, если положительная – наличие требования Участника клиринга, исполнение которого обеспечивается за счет Доверенного владельца счетов.

При этом обязательство Участника клиринга, исполнение которого обеспечивается за счет Доверенного владельца счетов, погашается за счет Средств гарантийного обеспечения, обязательства по возврату которых учитываются на разделах денежного регистра обеспечения, за которыми закреплен указанный Доверенный владелец счетов, в российских рублях, при их недостаточности - за счет Средств гарантийного обеспечения в иностранной валюте, обязательства по возврату которых учитываются на разделах денежного регистра обеспечения, за которыми закреплен указанный Доверенный владелец счетов, пересчитанных в российские рубли по курсу, установленному Банком России на день отзыва (аннулирования) у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций, а при недостаточности Средств гарантийного обеспечения в иностранной валюте - за счет Средств гарантийного обеспечения в ценных бумагах, обязательства по возврату которых учитываются на разделах депо регистра обеспечения, за которыми закреплен указанный Доверенный владелец счетов, пересчитанных в российские рубли по Расчетной цене соответствующей ценной бумаги, установленной Клиринговым центром на день отзыва (аннулирования) у

Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций.

Удовлетворение требований за счет Средств гарантийного обеспечения в иностранной валюте и/или ценных бумагах осуществляется Клиринговым центром по его выбору одним из следующих способов:

- путем передачи иностранной валюты / ценных бумаг Клиринговому центру в счет исполнения требования;
- путем продажи иностранной валюты / ценных бумаг с передачей вырученных средств Клиринговому центру.

Сумма, полученная от продажи иностранной валюты / ценных бумаг, учитываемых в качестве Средств гарантийного обеспечения, засчитывается Клиринговым центром в счет исполнения требования.

48.3.2. Клиринговый центр рассчитывает:

- 1) по каждому коду Срочного контракта, нетто-позицию Участника клиринга по Срочному контракту как сумму (с учетом знака) позиций по Срочному контракту, учитываемых на всех разделах регистра учета позиций Участника клиринга, имеющих код Собственной Брокерской фирмы, Клиентской Брокерской фирмы и Брокерской фирмы ДУ, на конец дня, предшествующего дате отзыва (аннулирования) у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций;
- 2) если нетто-позиция по Срочному контракту Участника клиринга является позицией на продажу, Клиринговый центр рассчитывает произведение абсолютной величины нетто-позиции по Срочному контракту Участника клиринга и разности Расчетной цены Срочного контракта, определенной в ходе последней дневной или вечерней клиринговой сессии, и цены сделки, заключенной Клиринговым центром в соответствии с подпунктом 48.1.4 Правил клиринга в объеме, равном нетто-позиции по Срочному контракту Участника клиринга, с направленностью, противоположной направленности нетто-позиции по Срочному контракту Участника клиринга (на покупку);
- 3) если нетто-позиция по Срочному контракту Участника клиринга является позицией на покупку, Клиринговый центр рассчитывает произведение нетто-позиции по Срочному контракту Участника клиринга и разности цены сделки, заключенной Клиринговым центром в соответствии с подпунктом 48.1.4 Правил клиринга в объеме, равном нетто-позиции по Срочному контракту Участника клиринга, с направленностью, противоположной направленности нетто-позиции по Срочному контракту Участника клиринга (на продажу) и Расчетной цены Срочного контракта, определенной в ходе последней дневной или вечерней клиринговой сессии;
- 4) для каждого Участника клиринга рассчитывает величину, равную сумме с учетом знака:
 - по всем Срочным контрактам, произведений, рассчитанных в соответствии с пунктами 2, 3 настоящего пункта Правил клиринга;
 - обязательств Участников клиринга по уплате вариационной маржи, премии, исполненных в дату отзыва (аннулирования) у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций, не учтенных при расчете обязательств / требований Участника клиринга, исполнение которых обеспечивается за счет Доверенных владельцев счетов (учитываются со знаком «плюс»);

- требований Участников клиринга по получению вариационной маржи, премии, исполненных в дату отзыва (аннулирования) у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций, не учтенных при расчете обязательств / требований Участника клиринга, исполнение которых обеспечивается за счет Доверенному владельцу счетов (учитываются со знаком «минус»);
- требований Участника клиринга, исполнение которых обеспечивается за счет Доверенных владельцев счетов (учитываются со знаком «плюс»);
- обязательств Участника клиринга, исполнение которых обеспечивается за счет Доверенных владельцев счетов и непогашенных за счет Средств гарантийного обеспечения, обязательства по возврату которых учитываются на разделах денежного регистра обеспечения / депо регистра обеспечения, за которыми закреплен Доверенный владелец счетов (учитываются со знаком «минус»);
- Задолженностей Участника клиринга в российских рублях, возникших до даты отзыва (аннулирования) у Участника клиринга указанной лицензии, и учитываемых по Расчетным кодам, связанным с Брокерскими фирмами, за исключением Обособленных Брокерских фирм (учитывается со знаком «минус»).

Если величина, рассчитанная в соответствии с настоящим пунктом 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 48.3.3 Правил клиринга.

48.3.3. Клиринговый центр рассчитывает сумму с учетом знака отрицательной величины, рассчитанной в соответствии с подпунктом 48.3.2 Правил клиринга, и следующих величин, учитываемых на конец дня, предшествующего дате отзыва (аннулирования) у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций, в следующей очередности и размере:

- 1) величины обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга Средств гарантийного обеспечения в российских рублях, учитываемого на разделах денежного регистра обеспечения Участника клиринга, имеющих коды Собственных Брокерских фирм, Клиентских Брокерских фирм и Брокерских фирм ДУ, 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, равной минимальной из двух величин: (1) величине обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга его Средств гарантийного обеспечения в иностранной валюте, учитываемого на разделах денежного регистра обеспечения Участника клиринга, имеющих коды Собственных Брокерских фирм, Клиентских Брокерских фирм и Брокерских фирм ДУ, пересчитанной в российские рубли по курсу, 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»);
- 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, равной минимальной из двух величин: (1) величине обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга его взноса в Гарантийный фонд в ценных бумагах, 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, равной минимальной из двух величин: (1) величине обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга его Средств

гарантийного обеспечения в ценных бумагах, 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»).

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, а 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.

- 48.4. 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 пунктом 48.3 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.
- 48.4.1. 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 дня, предшествующего дате принятия арбитражным судом решения о признании

Участника клиринга банкротом и об открытии конкурсного производства, в порядке, аналогичном предусмотренному пунктом 48.3 Правил клиринга.

48.5. В случае отзыва (аннулирования) лицензии на осуществление банковских операций у Клирингового центра, обязательства по Срочным, 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 48.6 Правил клиринга.

48.5.1. В случае отзыва (аннулирования) лицензии на осуществление банковских операций у Клирингового центра, обязательства по Срочным контрактам, 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).

48.6. В случае отзыва (аннулирования) лицензии на осуществление банковских операций у Клирингового центра размер нетто-обязательства / нетто-требования Клирингового центра в российских рублях в отношении Участника клиринга рассчитывается как сумма учитываемых на дату отзыва (аннулирования) лицензии на осуществление банковских операций у Клирингового центра:

- 1) Средств гарантийного обеспечения в российских рублях на всех разделах денежного регистра обеспечения Участника клиринга (учитывается со знаком «плюс»);
- 2) Средств гарантийного обеспечения в иностранной валюте на всех разделах денежного регистра обеспечения Участника клиринга, пересчитанных в российские рубли по курсу, установленному Банком России на дату отзыва (аннулирования) лицензии Клирингового центра на осуществление банковских операций (учитывается со знаком «плюс»);
- 3) Средств гарантийного обеспечения в ценных бумагах на всех разделах депо регистра обеспечения Участника клиринга, пересчитанных 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»);
- 4) Обеспечения под стресс и взноса Участника клиринга в Гарантийный фонд в российских рублях (учитывается со знаком «плюс»);
- 5) Обеспечения под стресс и взноса Участника клиринга в Гарантийный фонд в иностранной валюте, пересчитанных в российские рубли по курсу, установленному Банком России на дату отзыва (аннулирования) лицензии Клирингового центра на осуществление банковских операций (учитывается со знаком «плюс»);
- 6) Обеспечения под стресс и взноса Участника клиринга в Гарантийный фонд в ценных бумагах, пересчитанных 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»);
- 7) исполненных в дату отзыва (аннулирования) лицензии Клирингового центра на осуществление банковских операций требований Участника клиринга по получению Вариационной маржи, премии (учитывается со знаком «минус»);
 - 8) исполненных в дату отзыва (аннулирования) лицензии Клирингового центра на осуществление банковских операций обязательств Участника клиринга по уплате Вариационной маржи, премии (учитывается со знаком «плюс»);
 - 9) Задолженностей Участника клиринга, возникших до даты отзыва (аннулирования) лицензии Клирингового центра на осуществление банковских операций (учитывается со знаком «минус»).

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.

- 48.7. Информация о размере нетто-обязательства / нетто-требования Клирингового центра в российских рублях в отношении Участника клиринга, определенных в соответствии с пунктом 48.6 Правил клиринга направляется Клиринговым центром Участнику клиринга.

Статья 49. Взаимодействие с Биржей при возникновении обстоятельств, которые могут повлиять на возможность проведения Торгов

- 49.1. 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; сбой и ошибки программного обеспечения; сбой, неисправности и отказы систем связи, энергоснабжения, кондиционирования и других систем жизнеобеспечения, а также иные обстоятельства, такие как случаи нарушения правил разграничения доступа и/или попыток несанкционированного доступа к Клиринговой системе, Клиринговый центр незамедлительно уведомляет об этом Биржу и/или Расчетную организацию и/или Расчетный депозитарий любым из доступных средств связи и предпринимает все возможные меры, направленные на устранение указанных обстоятельств.

Статья 50. Чрезвычайные ситуации

- 50.1. 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; сбой и ошибки программного обеспечения; сбой, неисправности и отказы систем связи,

энергоснабжения, кондиционирования и других систем жизнеобеспечения, а также иные обстоятельства, такие как случаи нарушения правил разграничения доступа и/или попыток несанкционированного доступа к Клиринговой системе, последствия которых не устранены в течение 3 (трех) часов со времени окончания торгов;

- военные действия, акты террора, диверсии и саботажа, массовые беспорядки, забастовки, смена политического режима, 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;
- получение сообщения Биржи о возникновении чрезвычайной ситуации, которая может привести к нарушению клирингового обслуживания Участников клиринга;
- иные обстоятельства, препятствующие клиринговому обслуживанию Участников клиринга, которые, находятся вне контроля Клирингового центра.

50.2. Признание ситуации чрезвычайной осуществляется по решению Клирингового центра.

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

- уведомляет Биржу с использованием доступных средств связи о возникновении чрезвычайной ситуации и о мерах, необходимых для ее устранения;
- уведомляет Участников клиринга с использованием доступных средств связи о возникновении чрезвычайной ситуации и предпринимаемых действиях;
- на основании решения Клирингового центра, согласованного (если таковое согласование с учетом сложившихся обстоятельств было возможным) с Банком России и с Биржей, не осуществляет клиринговое обслуживание Участников клиринга.

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

- об изменении времени проведения операций в Клиринговой системе и/или сроков осуществления документооборота в процессе взаимодействия Клирингового центра с Участниками клиринга, Расчетной организацией, Расчетным депозитарием и Биржей;
- об исключении из клирингового пула обязательств по некоторым или всем сделкам;
- об изменении способа, порядка и даты исполнения обязательств Участников клиринга и/или и Клирингового центра;

- о проведении дополнительной дневной или вечерней клиринговой сессии;
- об увеличении минимального Базового размера гарантийного обеспечения по одному или нескольким Срочным контрактам;
- об осуществлении иных действий, направленных на урегулирование чрезвычайной ситуации.

После принятия Клиринговым центром соответствующих решений по урегулированию чрезвычайной ситуации в Клиринговой системе производится корректировка соответствующих клиринговых регистров.

В случае исключения из клирингового пула обязательств по некоторым или всем сделкам в качестве меры по урегулированию чрезвычайной ситуации, Клиринговый центр направляет Участникам клиринга отчеты об обязательствах по сделкам и Срочным контрактам, исключенных из клирингового пула, в форме электронных документов с использованием Подсистемы ЭДО НКЦ или системы S.W.I.F.T.

- 50.5. При принятии решений по урегулированию чрезвычайных ситуаций (при необходимости по согласованию с Биржей) Клиринговый центр вправе:
- устанавливать сроки и порядок исполнения своих решений Участниками клиринга;
 - обуславливать порядок вступления в силу своих решений определенными обстоятельствами.
- 50.6. О мерах, предпринятых по решению Клирингового центра в целях урегулирования чрезвычайной ситуации, Участники клиринга и Биржа оповещаются имеющимися доступными средствами связи не позднее дня принятия данных мер.
- 50.7. Клиринговый центр не несет ответственности за убытки, которые могут возникнуть в связи с нарушением клирингового обслуживания Участников клиринга в случае признания ситуации чрезвычайной в связи с обстоятельствами, предусмотренными пунктом 50.1 Правил клиринга.

Статья 51. Порядок разрешения споров

- 51.1. 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»).
- 51.2. Все споры и разногласия, возникающие между Участниками 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.

- 51.3. 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 срочном рынке

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 срочном рынке

Тарифы Клирингового центра на срочном рынке

	Наименование операции	Тариф (НДС не облагается)	Примечание
1.	Комиссионное вознаграждение 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	Взимается с указанного в запросе Участника клиринга раздела денежного регистра обеспечения или оплачивается на основании выставленного Клиринговым центром счета
	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 вноса в Гарантийный фонд, в случае несоблюдения Участником клиринга (клиентом Участника клиринга) правил заполнения назначения платежа.	100 рублей за каждый платежный документ	Взимается с раздела денежного регистра обеспечения Участника клиринга, на котором будут учтены денежные средства (или с любого собственного раздела денежного регистра обеспечения)
1.6.	Предоставление по запросу Участника клиринга реквизитов платежного	250 рублей за каждый запрос	Взимается с указанного в запросе Участника

	документа по возврату Участнику клиринга денежных средств, учитываемых в качестве обеспечения или взноса в Гарантийный фонд.		клиринга раздела денежного регистра обеспечения или оплачивается на основании выставленного Клиринговым центром счета
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	
2.	Формирование отчетов по разделу клиринговых регистров, за раздел в месяц	120 руб.	Взимается с указанного в заявлении Участника клиринга раздела денежного регистра обеспечения не позднее рабочего дня, следующего за днем отправки первого отчета, или в первый рабочий день месяца. В случае взимания тарифа за неполный месяц сумма рассчитывается пропорционально отношению оставшихся рабочих дней и общего количества рабочих дней в текущем месяце.
3.	Открытие (регистрация) разделов клиринговых регистров Обособленной Брокерской фирмы, за исключением открытия разделов клиринговых регистров Обособленной Брокерской фирмы в рамках процедуры Перевода позиций и Перевода Средств гарантийного обеспечения	50 000 руб.	Взимается с раздела денежного регистра обеспечения, указанного в заявлении на регистрацию Обособленной Брокерской фирмы в дату открытия (регистрации) Обособленной Брокерской фирмы
4.	Ведение учета и формирование отчетов по разделам клиринговых регистров Обособленной Брокерской фирмы, в месяц	50 000 руб.	Взимается с раздела денежного регистра обеспечения, указанного в заявлении на регистрацию Обособленной Брокерской фирмы не позднее рабочего дня, следующего за днем отправки первого отчета, или в первый рабочий день месяца. В случае взимания тарифа за неполный месяц сумма рассчитывается пропорционально отношению оставшихся рабочих дней и общего количества рабочих дней в

			текущем месяце
5.	Процедура принудительного закрытия позиций при проведении клиринга, за один Срочный контракт	5 биржевых сборов, установленных для Срочного контракта, заключаемого в целях открытия / закрытия позиций при выполнении указанных Процедур	Взимается с Участника клиринга, к которому была применена процедура принудительного закрытия позиций, в дату проведения процедуры принудительного закрытия позиций. Взимается с раздела денежного регистра обеспечения, код которого совпадает с кодом раздела регистра учета позиций, на котором учитываются / учитывались открытые / закрытые позиции по Срочным контрактам
6.	Процедура Перевода позиций и Перевода Средств гарантийного обеспечения по Срочным контрактам	3 000 руб.	Взимается с Участника клиринга – реципиента, к которому были переведены позиции и Средства гарантийного обеспечения
7.	Исполнение Поручения на перевод позиций	1 биржевой сбор, установленный для Срочного контракта, учет обязательств по которым изменяется	Взимается с Участника клиринга, учет обязательств которого изменяется, в дату выполнения операции. Взимается с раздела денежного регистра обеспечения, код которого совпадает с кодом раздела регистра учета позиций, на котором учитывались обязательства до изменения их учета
8.	Клиринг при исполнении фьючерсных контрактов, за один контракт:		Взимается с Участника клиринга, являющегося стороной фьючерсного контракта, в дату исполнения фьючерсных контрактов. Взимается с раздела денежного регистра обеспечения, код которого совпадает с кодом раздела регистра учета позиций, на котором учитывались обязательства по исполненному фьючерсному контракту
	- на ставку трехмесячного кредита MosPrime; - на среднюю ставку однодневного кредита MosPrime; - на ставку однодневных рублевых кредитов RUONIA;	0,3 руб.	
	- на Индекс РТС нефти и газа; - на Индекс РТС потребительских товаров и розничной торговли;	0,5 руб.	
	- на «двухлетние», «четырёхлетние», «шестилетние», «десятилетние», «пятнадцатилетние» облигации федерального займа;	0,8 руб.	
	- на курс доллар США – российский рубль;	1 руб.	

	<ul style="list-style-type: none"> - на курс евро – доллар США; - на курс евро – российский рубль; - на курс фунт стерлингов – доллар США; - на курс австралийский доллар – доллар США; - на курс доллар США – японская йена; - на курс доллар США – швейцарский франк; - на сырую нефть сорта «BRENT»; - на аффинированное золото в слитках; - на обыкновенные акции Deutsche Bank AG; - на сахар-сырец; - на медь; - на курс доллар США – турецкая лира; - на курс доллар США – канадский доллар; 		
	- на обыкновенные акции Daimler AG;	1,50 руб.	
	<ul style="list-style-type: none"> - на Индекс РТС; - на обыкновенные акции ОАО «Газпромнефть»; - на аффинированное серебро в слитках; - на аффинированную платину в слитках; - на аффинированный палладий в слитках; - на Индекс РТС Стандарт; - на Российский индекс волатильности; - на обыкновенные акции Yandex; - на курс китайский юань – российский рубль; 	2 руб.	
	- на еврооблигации Российской Федерации;	2,40 руб.	
	<ul style="list-style-type: none"> - на обыкновенные акции Siemens AG; - на обыкновенные акции BMW AG; - на пропан-бутан; 	2,50 руб.	
	- на Индекс ММББ;	3 руб.	
	<ul style="list-style-type: none"> - на привилегированные акции Volkswagen AG; - на Индекс BOVESPA; - на Индекс SENSEX; - на Индекс Hang Seng; - на Индекс FTSE/JSE Top40; 	4 руб.	
	<ul style="list-style-type: none"> - на курс доллар США – украинская гривна; - на волатильность российского рынка; 	10 руб.	
	- на сахар.	25 руб.	
9.	Клиринг при исполнении маржируемых опционных контрактов, за один контракт:		Взимается с Участника клиринга, являющегося стороной опционного контракта в дату

<ul style="list-style-type: none"> - на фьючерсный контракт на Индекс РТС нефти и газа; - на фьючерсный контракт на Индекс РТС потребительских товаров и розничной торговли; - на фьючерсный контракт на привилегированные акции ОАО «Сбербанк России»; 	<p>0,5 руб.</p>	<p>исполнения маржируемых опционных контрактов. Взимается с раздела денежного регистра обеспечения, код которого совпадает с кодом раздела регистра учета позиций, на котором учитывались</p>
<ul style="list-style-type: none"> - на фьючерсный контракт на обыкновенные акции ОАО «Ростелеком»; - на фьючерсный контракт на обыкновенные акции ОАО «Сбербанк России»; - на фьючерсный контракт на обыкновенные акции ОАО «Гатнефть»; - на фьючерсный контракт на обыкновенные акции ОАО «Газпромнефть»; - на фьючерсный контракт на обыкновенные акции ОАО «МТС»; - на фьючерсный контракт на обыкновенные акции ОАО «НОВАТЭК»; - на фьючерсный контракт на привилегированные акции ОАО «Сургутнефтегаз»; - на фьючерсный контракт на обыкновенные акции ОАО Банк ВТБ; - на фьючерсный контракт на обыкновенные акции ОАО «РусГидро»; - на фьючерсный контракт на курс доллар США - российский рубль; - на фьючерсный контракт на курс евро - российский рубль; 	<p>1 руб.</p>	<p>обязательства по исполненному опционному контракту</p>
<ul style="list-style-type: none"> - на фьючерсный контракт на обыкновенные акции ОАО «Газпром»; - на фьючерсный контракт на обыкновенные акции ОАО «ЛУКОЙЛ»; - на фьючерсный контракт на обыкновенные акции ОАО «НК «Роснефть»; - на фьючерсный контракт на обыкновенные акции ОАО «Сургутнефтегаз»; - на фьючерсный контракт на обыкновенные акции ОАО «Северсталь»; - на фьючерсный контракт на сахар; - на фьючерсный контракт на сырую нефть сорта «BRENT»; - на фьючерсный контракт на курс евро-доллар США; - на фьючерсный контракт на аффинированное золото в слитках; 	<p>2 руб.</p>	

	<ul style="list-style-type: none"> - на фьючерсный контракт на Индекс РТС; - на фьючерсный контракт на Индекс РТС Стандарт; - на фьючерсный контракт на привилегированные акции ОАО АК «Транснефть»; - на фьючерсный контракт на обыкновенные акции ОАО «ГМК «Норильский никель»; - на фьючерсный контракт на аффинированное серебро в слитках; - на фьючерсный контракт на аффинированную платину в слитках; 	4 руб.	
	<ul style="list-style-type: none"> - на фьючерсный контракт на Индекс ММВБ. 	6 руб.	
10.	Клиринг при исполнении опционных контрактов, за один контракт:		Взимается с Участника клиринга, являющегося стороной опционного контракта в дату исполнения опционных контрактов. Взимается с раздела денежного регистра обеспечения, код которого совпадает с кодом раздела регистра учета позиций, на котором учитывались обязательства по исполненному опционному контракту
	<ul style="list-style-type: none"> - на фьючерсный контракт на курс доллар США – российский рубль; - на фьючерсный контракт на облигации ОАО «ФСК ЕЭС»; - на фьючерсный контракт на облигации ОАО «Газпром»; - на фьючерсный контракт на облигации Московских областных внутренних облигационных займов; - на фьючерсный контракт на Индекс РТС нефти и газа; - на фьючерсный контракт на Индекс РТС потребительских товаров и розничной торговли; - на фьючерсный контракт на обыкновенные акции ОАО «Сбербанк России»; - на фьючерсный контракт на привилегированные акции ОАО «Сбербанк России»; 	0,5 руб.	
	<ul style="list-style-type: none"> - на фьючерсный контракт на обыкновенные акции ОАО «Газпром»; - на фьючерсный контракт на обыкновенные акции ОАО «ЛУКОЙЛ»; - на фьючерсный контракт на обыкновенные акции ОАО «Ростелеком»; - на фьючерсный контракт на обыкновенные акции ОАО «НК «Роснефть»; - на фьючерсный контракт на обыкновенные акции ОАО «Татнефть»; - на фьючерсный контракт на обыкновенные акции ОАО «Газпромнефть»; 	1 руб.	

	<ul style="list-style-type: none"> - на фьючерсный контракт на обыкновенные акции ОАО «МТС»; - на фьючерсный контракт на обыкновенные акции ОАО «НОВАТЭК»; - на фьючерсный контракт на привилегированные акции ОАО «Сургутнефтегаз»; - на фьючерсный контракт на обыкновенные акции ОАО Банк ВТБ; - на фьючерсный контракт на обыкновенные акции ОАО «РусГидро»; - на фьючерсный контракт на аффинированное золото в слитках; - на фьючерсный контракт на сырую нефть сорта «BRENT»; - на фьючерсный контракт на курс евро- доллар США; на фьючерсный контракт на курс евро- российский рубль; 		
	<ul style="list-style-type: none"> - на фьючерсный контракт на обыкновенные акции ОАО «ГМК «Норильский никель»; - на фьючерсный контракт на Индекс РТС; - на фьючерсный контракт на обыкновенные акции ОАО «Сургутнефтегаз»; - на фьючерсный контракт на привилегированные акции ОАО АК «Транснефть»; - на фьючерсный контракт на обыкновенные акции ОАО «Северсталь»; 	2 руб.	
	<ul style="list-style-type: none"> - на фьючерсный контракт на сахар; - на фьючерсный контракт на аффинированное серебро в слитках; - на фьючерсный контракт на Индекс РТС Стандарт. - на фьючерсный контракт на аффинированную платину в слитках. 		
11.	Клиринг при исполнении фьючерсных контрактов, заключенных на Торгах Открытого акционерного общества "Московская энергетическая биржа", за один контракт:		Взимается с раздела денежного регистра обеспечения, код которого совпадает с кодом раздела регистра учета позиций, на котором учитывались обязательства по исполненному фьючерсному контракту
	- на Индекс средней цены электроэнергии, часы типа «пик».	1 руб.	
	- на Индекс средней цены электроэнергии, часы всех типов (базовые часы).	2 руб.	
12.	Клиринг при исполнении фьючерсных контрактов,		Взимается с Участника клиринга, являющегося

	<p>заключенных на Торгах ЗАО НТБ, за один фьючерсный контракт, учитываемый в составе позиции на одном разделе регистра учета позиций в день исполнения фьючерсных контрактов:</p>		<p>стороной фьючерсного контракта в дату исполнения фьючерсных контрактов. Взимается с раздела денежного регистра обеспечения, код которого совпадает с кодом раздела регистра учета позиций, на котором учитывались обязательства по исполненному фьючерсному контракту</p>
	<p>- на поставочный фьючерсный контракт на рис на условиях EXW;</p>	<p>80 руб.</p>	
	<p>- на поставочный фьючерсный контракт на крупу рисовую на условиях EXW;</p>	<p>160 руб.</p>	
	<p>- на поставочный фьючерсный контракт на пшеницу на условиях EXW.</p>	<p>300 руб.</p>	

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

I. Список документов, предоставляемых Резидентом

- 1) Анкета Участника клиринга (клиента) (Регистрационная карточка), являющаяся приложением к Порядку предоставления информации и отчетности и размещенная на сайте Клирингового центра в форме электронного документа (в случае если юридическое лицо не является Участником СЭД, то в форме электронного сообщения с подтверждением на бумажном носителе).
- 2) Копии учредительных документов юридического лица с изменениями и дополнениями с отметкой о регистрации федеральным органом исполнительной власти, уполномоченным на осуществление государственной регистрации юридических лиц. Указанные копии должны быть заверены федеральным органом исполнительной власти, уполномоченным на осуществление государственной регистрации юридических лиц, или нотариально (указанные документы не предоставляются государственными корпорациями).
- 3) Нотариально удостоверенные копии свидетельств о внесении записей в Единый государственный реестр юридических лиц (ЕГРЮЛ), выданных уполномоченным органом, осуществляющим государственную регистрацию юридических лиц, и подтверждающих факт внесения в ЕГРЮЛ записей о государственной регистрации юридического лица (либо о юридическом лице, зарегистрированном до 1 июля 2002 года), а также записей о государственной регистрации изменений, вносимых в учредительные документы юридического лица или листы записи ЕГРЮЛ.
- 4) Заверенная подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица копия свидетельства о постановке на учет в налоговом органе юридического лица.
- 5) Нотариально удостоверенная копия лицензии Банка России на осуществление банковских операций со средствами в рублях и иностранной валюте (для кредитных организаций).
- 6) Нотариально удостоверенные копии лицензий на право осуществления деятельности, подлежащей лицензированию (если имеются).
- 7) 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, о 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).

- 8) 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).

- 9) Карточка с образцами подписей и оттиска печати юридического лица, оформленная в соответствии с требованиями нормативных актов Банка России (либо нотариально удостоверенная копия карточки)
- 10) 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).
- 11) Отзывы о деловой репутации юридического лица в соответствии с пунктом 9.6 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 1) - 2) приложения № 4 к Правилам клиринга в форме электронного документа (в случае если юридическое лицо не является Участником СЭД, то в форме электронного сообщения с подтверждением на бумажном носителе):

- Кредитные организации предоставляют месячные формы отчетности на три последние отчетные даты, квартальные формы отчетности - на последнюю отчетную дату;
- Некредитные организации предоставляют квартальные формы отчетности за два последних отчетных квартала, месячные формы отчетности – на три последние отчетные даты;
- для Кредитных организаций, не являющихся профессиональными участниками рынка ценных бумаг, список аффилированных лиц (форма 0409051), актуальный по состоянию на дату предоставления документов¹.

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

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

Документы, 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 Нерезидентом

- 1) Анкета Участника клиринга (клиента) (Регистрационная карточка), являющаяся приложением к Порядку предоставления информации и отчетности и размещенная на сайте Клирингового центра в форме электронного документа (в случае если юридическое лицо не является Участником СЭД, то в форме электронного сообщения с подтверждением на бумажном носителе).
- 2) Опросная Анкета банка-нерезидента.
- 3) 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 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 9.6 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) Анкета физического лица – бенефициарного владельца в случае, если юридическое лицо не является Участником СЭД, в форме электронного сообщения с подтверждением на бумажном носителе за подписью руководителя юридического

лица или иного уполномоченного лица (с приложением нотариально удостоверенной копии доверенности, подтверждающей полномочия лица на подписание данной анкеты) и печатью юридического лица и в электронном виде.³

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

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

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

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

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

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.

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

**Отчетность, предоставляемая Участниками клиринга
Клиринговому центру**

- 1) Кредитные организации предоставляют Клиринговому центру:
 - оборотную ведомость по счетам бухгалтерского учета кредитной организации (форма 0409101) – ежемесячно;
 - информацию об обязательных нормативах и о других показателях деятельности кредитной организации (форма 0409135) – ежемесячно;
 - расчет собственных средств (капитала) («Базель III») (форма 0409123) – ежемесячно;
 - отчет о финансовых результатах кредитной организации (форма 0409102) – ежеквартально;
 - справку о численном значении норматива максимального размера риска на одного заемщика или группу связанных заемщиков (Н6) (по данным формы 0409118) – ежемесячно;
 - кредитные организации, являющиеся профессиональными участниками рынка ценных бумаг, квартальный отчет профессионального участника рынка ценных бумаг (форма №1100) – ежеквартально;
 - кредитные организации, не являющиеся профессиональными участниками рынка ценных бумаг, список аффилированных лиц (форма 0409051) – ежеквартально.

- 2) Некредитные организации предоставляют Клиринговому центру:
 - бухгалтерский баланс (форма 0710001) – ежеквартально;
 - отчет о финансовых результатах (форма 0710002) – ежеквартально;
 - расчет размера собственных средств (капитала) для профессиональных участников рынка ценных бумаг – ежемесячно;
 - некредитные организации, являющиеся профессиональными участниками рынка ценных бумаг, квартальный отчет профессионального участника рынка ценных бумаг (форма №1100) – ежеквартально.

- 3) Участники клиринга обязаны предоставлять отчетность, указанную в пунктах 1) -2) 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);
 - 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 кварталом⁴.
- 4) Форматы предоставления отчетности, указанной в настоящем приложении к Правилам клиринга, определены Порядком предоставления информации и отчетности.

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

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

**МЕТОДИКА УСТАНОВЛЕНИЯ И ИЗМЕНЕНИЯ
ЛИМИТОВ КОЛЕБАНИЙ ЦЕН СДЕЛОК**

1. Лимит колебаний цен сделок фьючерсного контракта в первый день проведения торгов, на которых может быть заключен фьючерсный контракт, устанавливается решением Биржи.
2. Верхний Лимит колебаний цен сделок устанавливается равным сумме расчетной цены фьючерсного контракта (если Спецификацией фьючерсного контракта не предусмотрено иное) и Лимита колебаний цен сделок, установленного для данного фьючерсного контракта, за исключением случаев, прямо предусмотренных настоящим приложением к Правилам клиринга.
3. Нижний Лимит колебаний цен сделок устанавливается равным разности расчетной цены фьючерсного контракта (если Спецификацией фьючерсного контракта не предусмотрено иное) и Лимита колебаний цен сделок, установленного для данного фьючерсного контракта, за исключением случаев, прямо предусмотренных настоящей статьей Правил клиринга.
4. Значения верхнего и нижнего Лимита колебаний цен сделок устанавливаются при установлении (изменении) Лимита колебаний цен сделок.
5. Изменение Лимита колебаний цен сделок осуществляется Клиринговым центром в ходе дневной или вечерней клиринговой сессии или в течение Расчетного периода в порядке, установленном настоящим приложением к Правилам клиринга.
 - 5.1. При изменении Лимита колебаний цен сделок для каждого фьючерсного контракта, для которых данный Лимит колебаний цен сделок является параметром расчета Базового размера гарантийного обеспечения, осуществляется перерасчет Базового размера гарантийного обеспечения.
 - 5.2. Новые значения Лимита колебаний цен сделок и Базового размера гарантийного обеспечения начинают действовать с момента их установления (расчета).
6. При изменении Лимита колебаний цен сделок по фьючерсному контракту с определенным кодом (далее – Основной контракт) Клиринговый центр изменяет Лимиты колебаний цен сделок по фьючерсным контрактам, входящим в одну группу с Основным контрактом (далее – Дополнительный контракт), в случаях, установленных настоящим приложением к Правилам клиринга, в следующем порядке: Лимит колебаний цен сделок Дополнительного контракта равен Лимиту колебаний цен сделок Основного контракта, умноженному на коэффициент.

Объединение фьючерсных контрактов в указанную группу, установление Основного контракта для группы и указанных коэффициентов осуществляется Клиринговым центром и раскрывается на Сайте Клирингового центра.

7. Клиринговый центр увеличивает в ходе Расчетного периода Лимит колебаний цен сделок по фьючерсному контракту при регистрации в Торговой системе Биржи в ходе Расчетного периода хотя бы одной безадресной Заявки на покупку (продажу) данного фьючерсного контракта с ценой равной Верхнему (Нижнему) Лимиту колебаний цен сделок, установленному для данного фьючерсного, контракта и наличию в Торговой системе Биржи непрерывно в течение 15 (пятнадцати) минут с момента регистрации указанной безадресной Заявки хотя бы одной безадресной Активной заявки на покупку (продажу) данного фьючерсного контракта с ценой, отличной от верхнего (нижнего) Лимита колебаний цен сделок не более, чем на пороговое значение, при условии, что количество открытых позиций по данному фьючерсному контракту составляет более 25 (двадцати пяти) процентов от суммарного количества открытых позиций по всем фьючерсным контрактам, заключенным на основании той же Спецификации, что и данный фьючерсный контракт.

Пороговое значение устанавливается Клиринговым центром в процентах от Лимита колебаний цен сделок и раскрывается на Сайте Клирингового центра. Новое пороговое значение вступает в силу с начала ближайшего Расчетного периода, следующего за моментом его раскрытия.

Если условие, указанное в первом абзаце настоящем пункте 7 настоящего приложения, соблюдается для фьючерсного контракта, являющегося Основным контрактом, то одновременно с увеличением Лимита колебаний цен сделок по данному Основному контракту увеличиваются Лимиты колебаний цен сделок по Дополнительным контрактам в порядке, указанном в пункте 6 настоящего приложения, за исключением случая, когда Лимит колебаний цен сделок по Дополнительному контракту уже был увеличен по основанию, указанному в первом абзаце настоящего пункта 7 настоящего приложения, и число таких увеличений по Дополнительному контракту превышает число увеличений по Основному контракту.

8. Клиринговый центр увеличивает в ходе проводимой дневной или вечерней клиринговой сессии Лимит колебаний цен сделок по фьючерсному контракту в следующих случаях:
- 1) по фьючерсному контракту - при наличии в Торговой системе Биржи непрерывно в течение последних 5 (пяти) минут перед окончанием Расчетного периода хотя бы одной Активной заявки на покупку (продажу) фьючерсного контракта с ценой, равной верхнему (нижнему) Лимиту колебаний цен сделок данного фьючерсного контракта, при условии, что количество открытых позиций по фьючерсному контракту составляет не более 25 (двадцати пяти) процентов от суммарного количества открытых позиций по всем фьючерсным контрактам, заключенным на основании той же Спецификации, что и данный фьючерсный контракт;
 - 2) если для каждого из двух ближайших Расчетных периодов, предшествующих проводимой дневной или вечерней клиринговой сессии, выполняется следующее условие:
 - изменение Расчетной цены данного Расчетного периода к Расчетной цене предыдущего Расчетного периода по данному фьючерсному контракту составляет не менее 75 (семидесяти пяти) процентов от Лимита колебаний цен сделок по данному фьючерсному контракту, установленного Клиринговым центром в ходе дневной или вечерней

клиринговой сессии, предыдущей по отношению к проводимой дневной или вечерней клиринговой сессии;

- 3) Базовый размер гарантийного обеспечения по фьючерсному оказался меньше минимального Базового размера гарантийного обеспечения по фьючерсному контракту, установленного Клиринговым центром.

Основания, указанные в подпунктах 1) и 2) настоящего пункта, не применяются к Дополнительным фьючерсным контрактам.

9. Клиринговый центр вправе увеличить Лимиты колебаний цен сделок по фьючерсному контракту в вечернюю клиринговую сессию, увеличив минимальный Базовый размер гарантийного обеспечения по данному фьючерсному контракту, в следующих случаях:

- 1) не более чем за 5 (пять) торговых дней до последнего дня заключения фьючерсного контракта;
- 2) перед праздничными днями, когда торги Биржей не проводятся в течение 3 (трех) и более дней подряд;
- 3) перед выходными (праздничными) днями, если хотя бы в один день, в который торги по фьючерсным контрактам не проводятся, предполагается проведение торгов на рынке базового актива фьючерсных контрактов.

Если минимальный Базовый размер гарантийного обеспечения увеличивается на определенный период времени, то по истечению указанного периода времени минимальный Базовый размер гарантийного обеспечения уменьшается до значения, установленного перед увеличением.

10. Клиринговый центр вправе изменить минимальный Базовый размер гарантийного обеспечения по фьючерсному контракту.

11. Клиринговый центр уменьшает в ходе проводимой дневной или вечерней клиринговой сессии Лимит колебаний цен сделок по фьючерсному контракту, если для каждого из последних десяти Расчетных периодов, предшествующих проводимой дневной или вечерней клиринговой сессии изменение Расчетной цены данного Расчетного периода к Расчетной цене предыдущего Расчетного периода по данному фьючерсному контракту составляет менее 50 (пятидесяти) % от Лимита колебаний цен сделок по данному фьючерсному контракту, установленного Клиринговым центром в ходе дневной или вечерней клиринговой сессии, предыдущей по отношению к проводимой дневной или вечерней клиринговой сессии.

Указанное основание не применяется к Дополнительным контрактам.

12. Клиринговый центр вправе изменить Лимит колебаний цен сделок по фьючерсному контракту.

13. В случае необходимости увеличения Лимита колебаний цен сделок по фьючерсному контракту в течение Расчетного периода, торги по данному фьючерсному контракту, а также по связанным фьючерсным контрактам приостанавливаются на срок до 15 (пятнадцати) минут. В целях указанной приостановки торгов Клиринговый центр с использованием Торговой системы Биржи направляет Бирже уведомление о необходимости приостановки торгов. После увеличения Лимита колебания цен сделок по указанным фьючерсным

контрактам Клиринговый центр с использованием Торговой системы Биржи направляет Бирже уведомление о возможности возобновления торгов.

Связанными являются фьючерсные контракты с одинаковым базовым активом и разными сроками исполнения, возможность заключения которых предоставляется на условиях одной Спецификации, а также опционные контракты, базовым активом которых являются указанные фьючерсные контракты.

В течение одного Расчетного периода увеличение Лимита колебаний цен сделок по фьючерсному контракту может производиться не более двух раз.

13.1. Если на момент приостановки торгов для первого увеличения Лимита колебаний цен сделок по фьючерсному контракту у всех Участников клиринга отсутствуют Маржинальные требования, учитываемые по Расчетной фирме, то для данного фьючерсного контракта Лимит колебаний цен сделок увеличивается на 50 (пятьдесят) процентов.

13.2. Если на момент приостановки торгов для первого увеличения Лимита колебаний цен сделок по фьючерсному контракту хотя бы у одного Участника клиринга есть Маржинальное требование, учитываемое по Расчетной фирме, то увеличение Лимита колебаний цен сделок по данному фьючерсному контракту осуществляется Клиринговым центром в соответствии с принципами, утвержденными Клиринговым центром, но не более чем на 50 (пятьдесят) процентов.

14. Если после первого увеличения Лимита колебаний цен сделок в ходе Расчетного периода вновь возникают условия, предусмотренные пунктом 7 настоящего приложения, то Клиринговый центр повторно изменяет Лимит колебаний цен сделок в соответствии с принципами, утвержденными Клиринговым центром по согласованию с Комитетом по срочному рынку.

В случае роста цен: нижний Лимит колебаний цен сделок увеличивается до значения, установленного на начало Расчетного периода, а верхний Лимит колебаний цен сделок устанавливается Клиринговым центром в соответствии с указанными принципами.

В случае снижения цен: верхний Лимит колебаний цен сделок уменьшается до значения, установленного на начало Расчетного периода, а нижний Лимит колебаний цен сделок устанавливается Клиринговым центром в соответствии с указанными принципами.

Новое значение Лимита колебаний цен сделок (L) устанавливается равным половине разности верхнего и нижнего Лимитов колебаний цен сделок.

15. Клиринговый центр учитывает в ходе дневной или вечерней клиринговой сессии увеличение Лимитов колебаний цен сделок по фьючерсному контракту, осуществленное в ходе Расчетного периода, за исключением следующих случаев:

- фьючерсный контракт является Дополнительным фьючерсным контрактом;
- Расчетная цена фьючерсного контракта, определенная по итогам Расчетного периода без учета ограничений на отклонение от предыдущей Расчетной цены, не выходит за пределы верхнего или нижнего Лимита колебаний цен сделок по данному фьючерсному контракту, установленных на начало Расчетного периода.

- 15.1. При выполнении условий подпунктов 1) или 2) пункта 8 настоящего приложения к Правилам клиринга Лимит колебаний цен сделок увеличивается на 50 (пятьдесят) процентов от последнего установленного значения.
- 15.2. Если в результате осуществленных увеличений Лимит колебаний цен сделок по фьючерсному контракту превышает Лимит колебаний цен сделок по этому фьючерсному контракту, установленный по итогам предыдущей дневной или вечерней клиринговой сессии, более чем на 50 (пятьдесят) процентов, то Лимит колебаний цен сделок по этому фьючерсному контракту устанавливается равным Лимиту колебаний цен сделок по этому фьючерсному контракту, установленному по итогам предыдущей дневной или вечерней клиринговой сессии, увеличенному на 50 (пятьдесят) процентов.
- 15.3. При выполнении условия пункта 11 настоящего приложения Лимит колебаний цен сделок уменьшается на 25 (двадцать пять) процентов от последнего установленного значения.
- 15.4. Клиринговый центр устанавливает Лимит колебаний цен сделок **Дополнительных фьючерсных контрактов** в порядке, указанном в пункте 6 настоящего приложения.
16. По каждому фьючерсному контракту Клиринговый центр осуществляет сравнение Базового размера гарантийного обеспечения, рассчитанного на основании установленного Лимита колебаний цен сделок по фьючерсному контракту, и минимального Базового размера гарантийного обеспечения. Если Базовый размер гарантийного обеспечения меньше минимального Базового размера гарантийного обеспечения, то Лимит колебаний цен сделок по фьючерсному контракту увеличивается до уровня, при котором Базовый размер гарантийного обеспечения равен минимальному Базовому размеру гарантийного обеспечения.

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

ПРОЦЕДУРА РАЗРЕШЕНИЯ РАЗНОГЛАСИЙ

1. В случае возникновения споров, связанных с использованием АСП, стороны обязаны соблюсти претензионный порядок урегулирования споров.
2. В претензии указываются:
 - 1) требования заявителя;
 - 2) сумма претензии и ее обоснованный расчет, если претензия подлежит денежной оценке;
 - 3) обстоятельства, на которых основываются требования, и доказательства, подтверждающие их;
 - 4) перечень прилагаемых к претензии документов и других доказательств;
 - 5) иные сведения, необходимые для урегулирования спора.
3. Претензия рассматривается в течение 7 (семи) рабочих дней со дня получения.
4. В ответе на претензию указываются признанные и непризнанные требования, содержащиеся в претензии.
5. При полном или частичном отказе в удовлетворении претензии в ответе на претензию указываются:
 - 1) обоснованные мотивы отказа со ссылкой на соответствующие нормативные правовые акты;
 - 2) доказательства, обосновывающие отказ;
 - 3) перечень прилагаемых к ответу на претензию документов, других доказательств.
6. Претензия и ответ на претензию направляются в письменной форме, с использованием средств связи, обеспечивающих фиксирование их отправления, либо вручаются под расписку.
7. В случае полного или частичного отказа в удовлетворении претензии, фактического неудовлетворения претензии или неполучения в срок ответа на претензию спор подлежит рассмотрению в Третейском суде Саморегулируемой организации «Национальная ассоциация участников фондового рынка» в соответствии с его Регламентом.

Приложение № 7
к Правилам клиринга ЗАО АКБ «Национальный
Клиринговый Центр» на срочном рынке

МЕТОДИКА ОПРЕДЕЛЕНИЯ РАЗМЕРА ВЗНОСА В ГАРАНТИЙНЫЙ ФОНД

1. Категории Участников клиринга

- 1.1. Клиринговый центр устанавливает следующие категории Участников клиринга в целях определения размера взноса в Гарантийный фонд:

Категория	Доступ к рынкам				
	1	2	3	4	5
I	√	√	√	√	√
II		√	√	√	√
III			√	√	√

где

- 1 - Фондовый рынок Секции срочного рынка,
 - 2 - Денежный рынок Секции срочного рынка,
 - 3 - Товарный рынок Секции срочного рынка,
 - 4 - Секция срочного рынка ОАО «Мосэнергобиржа»,
 - 5 - Секция стандартных контрактов на зерновые, зернобобовые и технические культуры ЗАО «Национальная товарная биржа».
- 1.2. После внесения взноса в Гарантийный фонд в порядке, установленном Правилами клиринга, в размере, установленном настоящей методикой, Клиринговый центр может осуществлять клиринг по Срочным контрактам, заключенным на рынках, отмеченных знаком «√» в Таблице пункта 1.1 настоящей методики.

2. Размеры взноса в Гарантийный фонд

- 2.1. Размер взноса в Гарантийный фонд Участника клиринга третьей категории устанавливается равным 500 тыс. руб.
- 2.2. Размер взноса в Гарантийный фонд Участника клиринга второй категории, являющегося профессиональным участником рынка ценных бумаг, устанавливается равным 1 млн. руб., не являющегося профессиональным участником рынка ценных бумаг - 2 млн. руб.
- 2.3. Размер взноса в Гарантийный фонд Участника клиринга первой категории устанавливается равным 10 млн. руб.

3. Уведомление Участников клиринга

- 3.1. Информация об изменении размера взноса в Гарантийный фонд размещается на Сайте Клирингового центра, а также направляется каждому Участнику клиринга.