

ФЕДЕРАЛЬНАЯ СЛУЖБА ПО
ФИНАНСОВЫМ РЫНКАМ
ЗАРЕГИСТРИРОВАНО

Дата: "18" декабря 2012

в реестре за № 12-105/12

Заместитель
руководителя: С. П. Лыков



УТВЕРЖДЕНЫ

решением Наблюдательного совета
ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр»

от 11 декабря 2012 года (Протокол № 9)

Председатель Наблюдательного совета
ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр»



Лыков С.П.

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

Москва, 2012г.



СОДЕРЖАНИЕ

| | | |
|-------------|---|----|
| РАЗДЕЛ I. | ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ..... | 4 |
| Статья 1. | Термины и определения..... | 4 |
| Статья 2. | Общие положения..... | 10 |
| Статья 3. | Права и обязанности Участников клиринга и Клирингового центра..... | 13 |
| Статья 4. | Конфиденциальность и персональные данные..... | 14 |
| Статья 5. | Порядок использования Аналога собственноручной подписи | 15 |
| Статья 6. | Торговые счета..... | 16 |
| Статья 7. | Клиринговые регистры | 20 |
| РАЗДЕЛ II. | ТРЕБОВАНИЯ К УЧАСТНИКАМ КЛИРИНГА | 25 |
| Статья 8. | Требования к Участникам клиринга..... | 25 |
| Статья 9. | Условия клирингового обслуживания. Порядок предоставления допуска к клиринговому обслуживанию | 26 |
| Статья 10. | Порядок регистрации Участников клиринга и их Клиентов..... | 28 |
| Статья 11. | Порядок приостановления и прекращения допуска к клиринговому обслуживанию..... | 31 |
| Статья 12. | Требования к клиентам Участника клиринга | 33 |
| Статья 13. | Требования к Держателям. Порядок получения (лишения) статуса Держателя | 33 |
| Статья 14. | Требования к Банкам..... | 34 |
| РАЗДЕЛ III. | МЕРЫ, НАПРАВЛЕННЫЕ НА УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ ПРИ ОСУЩЕСТВЛЕНИИ КЛИРИНГА..... | 36 |
| Статья 15. | Перечень мер, направленных на управление рисками при осуществлении клиринга | 36 |
| Статья 16. | Единый лимит и риск-параметры | 36 |
| РАЗДЕЛ IV. | ПОРЯДОК И УСЛОВИЯ ДОПУСКА ОБЯЗАТЕЛЬСТВ К КЛИРИНГУ | 40 |
| Статья 17. | Порядок взаимодействия с Биржей при подаче заявок и заключении сделок, допуске к клирингу обязательств по биржевым сделкам и обязательств по внесению компенсационных взносов | 40 |
| Статья 18. | Процедура контроля обеспечения по биржевым сделкам с ценными бумагами, осуществляемая при подаче заявок или заключении сделок | 42 |
| Статья 19. | Порядок допуска к клирингу обязательств по внебиржевым сделкам с ценными бумагами | 45 |
| Статья 20. | Порядок действий Участников клиринга для исполнения обязательств по сделкам и обязательств по внесению компенсационных взносов | 46 |
| Статья 21. | Порядок подачи и регистрации Отчетов на исполнение | 48 |
| Статья 22. | Порядок подачи и регистрации поручений на внесение компенсационных взносов и поручений на отказ от компенсационных взносов | 49 |
| Статья 23. | Порядок подачи и регистрации Специальных отчетов на исполнение..... | 50 |
| Статья 24. | Порядок подачи и регистрации Срочных отчетов на исполнение | 52 |
| РАЗДЕЛ V. | ПОРЯДОК ПРОВЕДЕНИЯ КЛИРИНГА | 55 |
| Статья 25. | Порядок проведения клиринговых сессий..... | 55 |

| | | |
|----------------------|---|-----|
| Статья 26. | Порядок внесения и возврата Обеспечения..... | 58 |
| Статья 27. | Порядок внесения и возврата взноса в Гарантийный фонд | 62 |
| Статья 28. | Порядок исполнения / прекращения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением и обязательств по возврату Гарантийных переводов..... | 63 |
| Статья 29. | Порядок урегулирования случаев неисполнения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением..... | 68 |
| Статья 30. | Порядок использования и возмещения Гарантийного фонда | 73 |
| Статья 31. | Порядок исполнения обязательств и требований Участников клиринга и Клирингового центра, включенных в клиринговый пул | 75 |
| Статья 32. | Порядок определения подлежащих исполнению обязательств Участников клиринга по уплате Возмещения | 80 |
| Статья 33. | Порядок взаимодействия с Расчетной организацией..... | 81 |
| Статья 34. | Порядок взаимодействия с Расчетным депозитарием и иными депозитариями | 83 |
| Статья 35. | Условия Сделок РЕПО Клирингового центра и Договоров займа Клирингового центра, порядок их заключения и исполнения..... | 85 |
| Статья 36. | Порядок передачи Доходов по сделкам РЕПО, заключенным с Клиринговым центром..... | 88 |
| РАЗДЕЛ VI. | ПОРЯДОК ОПЛАТЫ УСЛУГ. ОТЧЕТЫ ПО ИТОГАМ КЛИРИНГА..... | 90 |
| Статья 37. | Порядок оплаты услуг Клирингового центра, Биржи и Технического центра..... | 90 |
| Статья 38. | Порядок представления отчетов по итогам клиринга..... | 95 |
| РАЗДЕЛ VII. | ПРОЧИЕ УСЛОВИЯ | 98 |
| Статья 39. | Порядок урегулирования обязательств в случае прекращения допуска к клиринговому обслуживанию | 98 |
| Статья 40. | Взаимодействие с Биржей при возникновении обстоятельств, которые могут повлиять на возможность проведения Торгов..... | 105 |
| Статья 41. | Чрезвычайные ситуации | 106 |
| Статья 42. | Порядок разрешения споров..... | 107 |
| Приложение № 1 | | 109 |
| Приложение № 2 | | 110 |
| Приложение № 3 | | 114 |
| Приложение № 4 | | 116 |
| Приложение № 5 | | 120 |
| Приложение № 6 | | 122 |
| Приложение № 7 | | 124 |

РАЗДЕЛ I. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ

Настоящие Правила клиринга ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр» на рынке ценных бумаг регулируют отношения, связанные с заключением и исполнением сделок купли-продажи ценных бумаг и сделок репо, заключаемых в Секторе рынка Основной рынок Закрытого акционерного общества «Фондовая биржа ММВБ», а также исполнением внебиржевых сделок купли-продажи ценных бумаг и сделок репо.

Статья 1. Термины и определения

Аналог собственноручной подписи / АСП – реквизит электронного сообщения, направляемого с использованием Клиринговой системы, подтверждающий идентификацию направившего электронное сообщение лица, целостность и неизменность электронных сообщений за счет использования специализированных программно-технических средств и организационных мероприятий. Аналогом собственноручной подписи признается Клиринговый идентификатор, позволяющий однозначно идентифицировать Участника клиринга или Клиринговый центр, направивший электронное сообщение и достоверно установить, что электронное сообщение исходит от Участника клиринга / Клирингового центра, которому присвоен данный Клиринговый идентификатор.

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

Банк – Участник клиринга, являющийся кредитной организацией.

Биржа – фондовая биржа или организатор торговли на рынке ценных бумаг, заключившие договор о взаимодействии с Клиринговым центром.

Биржевая сделка с ценными бумагами / Биржевая сделка – сделка купли-продажи ценных бумаг или сделка РЕПО, заключенная на Бирже, и информация о которой передана Биржей Клиринговому центру в порядке, предусмотренном Правилами клиринга.

Внебиржевая сделка с ценными бумагами / Внебиржевая сделка – сделка купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов В0-В30 или сделка РЕПО с кодом расчетов S0-S2, заключенная между Участниками клиринга, информация о которой получена Клиринговым центром в порядке, предусмотренном Правилами клиринга. Значения кодов расчетов, используемых при заключении внебиржевых сделок, соответствуют значениям кодов расчетов, определенных Правилами торговли. Термины «Дата внесения компенсационного вноса», «Дата прекращения исполнения» для внебиржевых сделок используются в значениях, определенных Правилами торговли, с учетом особенностей внебиржевых сделок.

Возмещение – Переменное возмещение или Фиксированное возмещение, определенные Правилами торговли.

Гарантийный перевод - обеспечение Участника клиринга или Клирингового центра, рассчитываемое в порядке, предусмотренном Правилами клиринга и являющееся обеспечением исполнения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением, заключенным между данным Участником клиринга и Клиринговым центром.

Гарантийный фонд - коллективное клиринговое обеспечение, сформированное Клиринговым центром за счет взносов Участников клиринга в целях обеспечения исполнения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением.

Дата исполнения - дата, в которую Участники клиринга и/или Клиринговый центр обязаны исполнить свои обязательства в соответствии с условиями заключенной сделки с ценными бумагами в порядке, определенном Правилами клиринга.

В случае, если определяемая в настоящем пункте дата выпадает не на Расчетный день, то Датой исполнения сделки считается следующий Расчетный день (с учетом этого пересчитываются обязательства по сделке, в том числе накопленный купонный доход по облигациям (далее – НКД)).

Держатель – организация, получившая статус Держателя в соответствии с Правилами клиринга с целью использования ценных бумаг, учитываемых на Торговых счетах депо номинального держателя Держателя, для проведения Клиринговым центром Процедуры контроля обеспечения по сделкам и расчетов по итогам клиринга сделок Участников клиринга, депозитарное обслуживание которых и/или их клиентов осуществляется Держателем.

Добросовестный участник клиринга - Участник клиринга, надлежащим образом исполнивший свои Итоговые нетто-обязательства по денежным средствам / ценным бумагам перед Клиринговым центром и не имеющий Задолженности перед Клиринговым центром.

Договор займа Клирингового центра - договор займа ценных бумаг, заключаемый Клиринговым центром с Участником клиринга в порядке, определенном Правилами клиринга, с целью исполнения обязательств Клирингового центра по Сделкам с частичным обеспечением.

Доход - суммы денежных средств, соответствующие любым дивидендам, процентам, доходу или иному распределению на ценные бумаги, являющиеся предметом сделок РЕПО, заключенных с Клиринговым центром.

Единый лимит - величина, рассчитываемая Клиринговым центром в российских рублях для каждого Участника клиринга, ограничивающая риски по Сделкам с частичным обеспечением, заключаемым Клиринговым центром с Участником клиринга, для которого рассчитан Единый лимит.

Задолженность – Итоговое нетто-обязательство в российских рублях, не прекращенное после проведения зачета по итогам прекращения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением в порядке, определенном Правилами клиринга.

Задолженность по гарантийным переводам - неисполненное обязательство (неисполненная часть обязательства) Участника клиринга в российских рублях по уплате Гарантийных переводов.

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

Заявление на регистрацию ТКС – Заявление Участника клиринга на регистрацию торгово-клирингового счета.

Индикативные ставки РЕПО – ставки РЕПО, определяемые в соответствии с Методикой определения риск-параметров рынка ценных бумаг и используемые для корректировки Единого лимита Участников клиринга и для определения обязательств по уплате Гарантийных переводов по Сделкам с частичным обеспечением, Дата исполнения которых отстоит от текущей даты более, чем на 1 (один) Расчетный день.

Итоговое нетто-обязательство по денежным средствам - денежное обязательство в российских рублях Участника клиринга перед Клиринговым центром, не прекращенное по

итогам зачета в ходе клиринга в соответствии с Правилами клиринга обязательств с наступившей Датой исполнения по Сделкам с частичным обеспечением и обязательств / требований Участника клиринга по возврату Гарантийных переводов.

Итоговое нетто-обязательство по ценным бумагам - обязательство в ценных бумагах Участника клиринга перед Клиринговым центром, не прекращенное по итогам зачета в ходе клиринга в соответствии с Правилами клиринга обязательств с наступившей Датой исполнения по Сделкам с частичным обеспечением;

Итоговое нетто-требование по денежным средствам - денежное требование в российских рублях Участника клиринга к Клиринговому центру, не прекращенное по итогам зачета в ходе клиринга в соответствии с Правилами клиринга обязательств с наступившей Датой исполнения по Сделкам с частичным обеспечением и обязательств / требований Участника клиринга по возврату Гарантийных переводов.

Итоговое нетто-требование по ценным бумагам – требование в ценных бумагах Участника клиринга перед Клиринговым центром, не прекращенное по итогам зачета в ходе клиринга в соответствии с Правилами клиринга обязательств с наступившей Датой исполнения по Сделкам с частичным обеспечением;

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 комиссия / комиссия за клиринг – плата, взимаемая Клиринговым центром с Участников клиринга в соответствии с Тарифами Клирингового центра (приложение № 1 к Правилам клиринга). Клиринговая комиссия взимается в российских рублях.

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 пул для расчетов в ходе торгов - клиринговый пул, состоящий из обязательств по обеспеченным сделкам с ценными бумагами, подлежащих исполнению в ходе торгов в дату формирования клирингового пула.

Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов - клиринговый пул, состоящий из обязательств по обеспеченным сделкам с ценными бумагами и обязательств, возникших по итогам клиринга, подлежащих исполнению по итогам торгов в дату формирования клирингового пула.

Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов по сделкам с центральным контрагентом - клиринговый пул, состоящий из подлежащих исполнению по итогам торгов в дату формирования клирингового пула обязательств по обеспеченным сделкам с ценными бумагами, заключенным с центральным контрагентом, за исключением Сделок с частичным обеспечением.

Клиринговый пул по Сделкам с частичным обеспечением - клиринговый пул, состоящий из обязательств по Сделкам с частичным обеспечением, подлежащих исполнению в дату формирования клирингового пула.

Клиринговый идентификатор – условное обозначение, однозначно определяющее Участника клиринга / Клиринговый центр.

Клиринговый лист для Сделок с частичным обеспечением – перечень ценных бумаг, с которыми возможно заключение и клиринг Сделок с частичным обеспечением.

Клиринговый центр – ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр», действующий в соответствии с Законом о клиринге.

Код ценной бумаги - код, позволяющий однозначно идентифицировать ценную бумагу в Клиринговой системе.

Комиссионное вознаграждение – клиринговая комиссия и иные виды вознаграждения Биржи, установленные внутренними документами Биржи, и вознаграждения Технического центра, установленное внутренними документами Технического центра, в отношении которых на Клиринговый центр возложены функции по определению соответствующих обязательств Участников клиринга и контролю за порядком их исполнения. Комиссионное вознаграждение взимается в российских рублях. Возложение на Клиринговый центр функций по определению обязательств Участников клиринга по уплате комиссионного вознаграждения (за исключением клиринговой комиссии) и контролю за порядком их исполнения осуществляется на основании соответствующих договоров.

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

Методика определения риск-параметров рынка ценных бумаг - внутренний документ Клирингового центра, устанавливающий порядок определения риск-параметров фондового и денежного рынков ОАО Московская Биржа.

Недобросовестный участник клиринга - Участник клиринга, не исполнивший или ненадлежащим образом исполнивший свои Итоговые нетто-обязательства по денежным средствам / ценным бумагам и/или имеющий Задолженность перед Клиринговым центром.

Необеспеченная сделка – сделка с ценными бумагами, не прошедшая Процедуру контроля обеспечения.

Нетто-обязательство по денежным средствам / ценным бумагам по сделкам клирингового пула - обязательства Участника клиринга или Клирингового центра по оплате / передаче ценных бумаг по всем сделкам клирингового пула, обязательства по которым не прекращены в результате неттинга в ходе клиринга в соответствии с Правилами клиринга, определяемые в отношении позиции Участника клиринга (Клирингового центра) по денежным средствам / ценным бумагам.

Нетто-обязательство по денежным средствам / ценным бумагам по Сделкам с частичным обеспечением - сумма денежных средств в российских рублях или количество ценных бумаг, представляющие собой превышение обязательств Участника клиринга по Сделкам с частичным обеспечением над его требованиями к Клиринговому центру по Сделкам с частичным обеспечением в российских рублях или ценных бумагах, определяемые по каждой Дате исполнения;

Нетто-требование по денежным средствам / ценным бумагам по сделкам клирингового пула - требования Участника клиринга или Клирингового центра по оплате / передаче ценных бумаг по всем сделкам клирингового пула, обязательства по которым не прекращены в результате неттинга в ходе клиринга в соответствии с Правилами клиринга, определяемые в отношении позиции Участника клиринга (Клирингового центра) по денежным средствам / ценным бумагам.

Нетто-требование по денежным средствам / ценным бумагам по Сделкам с частичным обеспечением - сумма денежных средств в российских рублях или количество ценных бумаг, представляющие собой превышение требований Участника клиринга по Сделкам с частичным обеспечением над его обязательствами перед Клиринговым центром по Сделкам с частичным обеспечением в российских рублях или ценных бумагах, определяемые по каждой Дате исполнения;

Обеспечение - индивидуальное клиринговое обеспечение в денежных средствах и/или ценных бумагах, используемое для обеспечения исполнения обязательств Участника клиринга по Сделкам с частичным обеспечением. Обеспечение может использоваться для исполнения обязательств Участника клиринга по Сделкам с частичным обеспечением.

Обеспеченная сделка – сделка с ценными бумагами, прошедшая Процедуру контроля обеспечения.

Ограничительные лимиты - Ограничительный лимит по уплате комиссионного вознаграждения и/или Ограничительный лимит по уплате возмещения.

Ограничительный лимит по уплате комиссионного вознаграждения – клиринговый регистр, предназначенный для учета неисполненных обязательств Участников клиринга по уплате Комиссионного вознаграждения.

Ограничительный лимит по уплате возмещения – клиринговый регистр, предназначенный для учета неисполненных обязательств Участников клиринга по уплате Возмещения.

Отчет на исполнение – поручение Участника клиринга, направляемое Клиринговому центру с использованием Клиринговой системы в форме электронного сообщения, подписанного АСП Участника клиринга, и инициирующее Процедуру контроля обеспечения по сделке с ценными бумагами (первой/второй части сделки РЕПО), не проходящей в соответствии с Правилами клиринга указанную процедуру при подаче заявки и/или заключении сделки, для включения обязательств по такой сделке в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов.

Отчет на исполнение специальный / Специальный отчет на исполнение – поручение Участника клиринга, направляемое Клиринговому центру с использованием Клиринговой системы в форме электронного сообщения, подписанного АСП Участника клиринга, и инициирующее Процедуру контроля обеспечения одновременно по нескольким сделкам с ценными бумагами (первым/вторым частям сделок РЕПО), не проходящим в соответствии с Правилами клиринга указанную процедуру при подаче заявки и/или заключении сделки, и/или компенсационным взносам для включения обязательств по таким сделкам и/или обязательств по внесению компенсационных взносов в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов.

Отчет на исполнение срочный / Срочный отчет на исполнение – поручение Участника клиринга, направляемое Клиринговому центру с использованием Клиринговой системы в форме электронного сообщения, подписанного АСП Участника клиринга, и инициирующее Процедуру контроля обеспечения одновременно по одной или нескольким сделкам с ценными бумагами (первым/вторым частям сделок РЕПО), не проходящим в соответствии с Правилами клиринга указанную процедуру при подаче заявки и/или заключении сделки, и/или компенсационным взносам для включения обязательств по таким сделкам и/или обязательств по внесению компенсационных взносов в Клиринговый пул для расчетов в ходе торгов.

Пароль – уникальная последовательность случайных чисел, используемая для аутентификации Участника клиринга / Клирингового центра.

Период регистрации поручений - период расчетного дня, установленный в соответствии с приложением № 2 к Правилам клиринга, в течение которого Клиринговый центр регистрирует поручения от Участников клиринга и/или Клиринговых организаций.

Поручение на внесение компенсационного взноса - поручение Участника клиринга, направляемое Клиринговому центру с использованием Клиринговой системы в форме электронного сообщения, подписанного АСП Участника клиринга, и иницирующее Процедуру контроля обеспечения по компенсационному взносу для включения обязательства по внесению компенсационного взноса в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов.

Поручение на клиринг внебиржевой сделки - поручение Участника клиринга, направляемое Клиринговому центру с целью осуществления клиринга по внебиржевой сделке и регистрации в Клиринговой системе параметров внебиржевой сделки, в том числе внебиржевой сделки РЕПО.

Поручение на отказ от компенсационного взноса - поручение Участника клиринга, / направляемое Клиринговому центру с использованием Клиринговой системы в форме электронного сообщения, подписанного АСП Участника клиринга, с целью отказа от получения компенсационного взноса.

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 торговли – правила проведения торгов по ценным бумагам Биржи, утвержденные уполномоченным органом Биржи.

Правила клиринга – настоящие Правила клиринга ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр» на рынке ценных бумаг, являющиеся неотъемлемой частью Договора об оказании клиринговых услуг.

Процедура контроля обеспечения по сделке с ценными бумагами / Процедура контроля обеспечения — механизм контроля достаточности индивидуального клирингового обеспечения Участника клиринга для обеспечения и/или исполнения обязательств по денежным средствам и ценным бумагам, возникающих в результате заключения Участником клиринга сделки с ценными бумагами, а также в иных случаях, предусмотренных Правилами клиринга.

Расчетная организация – организация, осуществляющая денежные расчеты по итогам клиринга, осуществленного Клиринговым центром.

Расчетная цена - цена, используемая для установления значений Верхней и Нижней границы ценового коридора, а также Верхней и Нижней границы диапазона оценки рыночных рисков.

Расчетный день - день, в который Клиринговым центром проводится клиринг по сделкам с соответствующей ценной бумагой, который одновременно является днем, включая выходной и праздничный нерабочий день по законодательству Российской Федерации, в который Биржа проводит Торги, и в который Депозитарий и Расчетная организация осуществляют расчеты по итогам клиринга.

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

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.

Регламент клиринга на рынке ценных бумаг / Регламент клиринга – внутренний документ Клирингового центра, устанавливающий порядок кодификации и регистрации в Клиринговой системе Торгово-клиринговых счетов, особенности проведения операций, осуществляемых в Клиринговой системе в соответствии с Правилами клиринга.

Сайт Клирингового центра – сайт в сети Интернет по адресу www.nkcbank.ru, на котором осуществляется раскрытие информации Клиринговым центром.

Сделка с ценными бумагами / Сделка – биржевая сделка, внебиржевая сделка.

Сделка с частичным обеспечением – сделка РЕПО с кодом расчетов T0/Yn, Y0/Yn или сделка купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов Yn, заключенная с Центральным контрагентом в соответствии с Правилами торговли или Правилами клиринга, а также Сделка РЕПО Клирингового центра и Договор займа Клирингового центра.

Сделка РЕПО Клирингового центра – сделка РЕПО, заключаемая Клиринговым центром с Участником клиринга в порядке, определенном Правилами клиринга, с целью исполнения обязательств Клирингового центра по Сделкам с частичным обеспечением.

Технический центр – ОАО Московская Биржа, обеспечивающее Участникам клиринга технический доступ к Клиринговой системе на основании соответствующего договора.

Торгово-клиринговый счет / ТКС – учетный регистр в Клиринговой системе, устанавливающий однозначное соответствие между позицией по денежным средствам и позицией по ценным бумагам Участника клиринга.

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

Ценные бумаги / акции / облигации / инвестиционные паи / депозитарные расписки – ценные бумаги, в том смысле, в котором они определяются законодательством Российской Федерации.

Термины, специально не определенные в Правилах клиринга, используются в значениях, установленных иными внутренними документами Клирингового центра, включая Методику определения риск-параметров рынка ценных бумаг, Правилами торговли, законами, нормативными правовыми актами федерального органа исполнительной власти в области финансовых рынков и иными нормативными правовыми актами Российской Федерации.

Статья 2. Общие положения

2.1. Клиринговый центр осуществляет клиринг, выполняя функции центрального контрагента по:

- сделкам купли-продажи с кодом расчетов T0 (за исключением сделок размещения и выкупа), K0, Yn;
- сделкам РЕПО с кодом расчетов T0/Yn, Y0/Yn.

- 2.2. Клиринговый центр осуществляет клиринг без выполнения функций центрального контрагента по:
- по сделкам купли-продажи с кодом расчетов B0-B30, Z0;
 - по сделкам РЕПО с кодом расчетов Rb, S0-S2, Z0.
- 2.3. Клиринговый центр не осуществляет клиринг по сделкам с ценными бумагами с кодами расчетов, отличными от кодов расчетов, предусмотренных Правилами торговли.
- 2.4. Заключение Сделок с частичным обеспечением возможно только с ценными бумагами, включенными в Клиринговый лист для Сделок с частичным обеспечением.
- Включение ценной бумаги в Клиринговый лист для Сделок с частичным обеспечением осуществляется по решению Клирингового центра на основании информации, полученной от Биржи.
- 2.5. В качестве способов обеспечения исполнения обязательств, допущенных к клирингу, Клиринговый центр использует индивидуальное клиринговое обеспечение Участников клиринга в денежных средствах и ценных бумагах, а также коллективное клиринговое обеспечение (Гарантийный фонд) для обеспечения исполнения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением.
- 2.6. Индивидуальное клиринговое обеспечение в денежных средствах и ценных бумагах учитывается на торговых банковских счетах и торговых счетах депо соответственно, открытых в Расчетной организации / Расчетном депозитарии с указанием Клирингового центра в качестве клиринговой организации, которая вправе давать распоряжения по этим счетам.
- 2.7. Перечень видов используемых торговых счетов приведен в статье 6 Правил клиринга.
- 2.8. Индивидуальное клиринговое обеспечение в российских рублях учитывается также на клиринговом банковском счете Клирингового центра, открытом в Расчетной организации и предназначенном для учета индивидуального клирингового обеспечения рынка ценных бумаг.
- 2.9. Коллективное клиринговое обеспечение (Гарантийный фонд) учитывается на клиринговом банковском счете Клирингового центра в российских рублях, открытом в Расчетной организации и предназначенном для учета коллективного клирингового обеспечения рынка ценных бумаг.
- 2.10. Информация о реквизитах клиринговых счетов Клирингового центра, предназначенных для учета индивидуального или коллективного клирингового обеспечения, 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. Расчеты по результатам клиринга осуществляются в ходе торгов и по итогам торгов.
- 2.12. Обмен электронными документами между Участником клиринга и Клиринговым центром осуществляется посредством Подсистемы ЭДО НКЦ.
Порядок формирования и передачи электронных документов посредством Подсистемы ЭДО НКЦ предусмотрен Порядком ЭДО и Договором об обмене электронными документами, заключенным Участником клиринга с Клиринговым центром.
- 2.13. 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. Форматы электронных документов, предоставляемых Участниками клиринга Клиринговому центру в соответствии с Правилами клиринга и Порядком ЭДО, и формы документов на бумажном носителе, предоставляемых Участниками клиринга Клиринговому центру в соответствии с Правилами клиринга, установлены документом «Формы и форматы документов, предоставляемых Участниками клиринга, клиентами Участников клиринга и Держателями в соответствии с Правилами клиринга ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр» на рынке ценных бумаг», раскрываемом на Сайте Клирингового центра.
- 2.15. Существуют две категории Участников клиринга: Участники клиринга категории «А» и Участники клиринга категории «Б».
Участником клиринга категории «А» является Банк России.
Все остальные Участники клиринга являются Участниками клиринга категории «Б».
- 2.16. Положения Правил клиринга в отношении прав и обязанностей между Участником клиринга категории «А» и Клиринговым центром распространяются на Участника клиринга категории «А», если иные положения в отношении Участника клиринга категории «А» не предусмотрены договором, заключенным Клиринговым центром с таким Участником клиринга.
Требование о внесении индивидуального и коллективного клирингового обеспечения не распространяется на Участников клиринга категории «А».
Участник клиринга категории «А» может принять на себя обязательство по внесению индивидуального клирингового обеспечения в ценных бумагах и/или денежных средствах.
- 2.17. Операции по объединению выпусков эмиссионных ценных бумаг и/или аннулированию индивидуальных номеров (кодов) дополнительных выпусков эмиссионных ценных бумаг осуществляются в Клиринговой системе на следующий Расчетный день после получения соответствующего уведомления от Расчетного депозитария и по окончании расчетов по сделкам с ценными бумагами

по итогам клиринга этого дня. Проведение операций по объединению выпусков эмиссионных ценных бумаг и/или аннулированию индивидуальных номеров (кодов) дополнительных выпусков эмиссионных ценных бумаг в Клиринговой системе сопровождается корректировкой информации по сделкам с ценными бумагами и сделкам РЕПО, Дата исполнения которых еще не наступила. Коды объединяемых выпусков ценных бумаг в реквизитах указанных сделок заменяются кодом объединенного выпуска, а аннулируемый код дополнительного выпуска ценных бумаг - кодом выпуска, по отношению к которому данный выпуск является дополнительным.

- 2.18. Сроки передачи документов Клиринговому центру и сроки получения документов от Клирингового центра в процессе взаимодействия с Участниками клиринга при проведении клиринга и расчетов по сделкам установлены приложением № 6 к Правилам клиринга (далее – Временной регламент).

Установленное Временным регламентом время (сроки) в отношении отдельных операций может быть изменено по решению Клирингового центра. Об изменении времени (сроков) проведения отдельных операций Участники клиринга извещаются средствами Клиринговой системы не менее чем за 2 (два) Расчетных дня, если иной порядок и сроки не определены решением 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.
- 3.2. Форма Договора об оказании клиринговых услуг установлена приложением № 1 к Правилам клиринга.
- 3.3. Заключение Договора об оказании клиринговых услуг осуществляется путем присоединения к договору, условия которого определены Правилами клиринга.
- 3.4. Размер оплаты клиринговых услуг, оказываемых Клиринговым центром Участниками клиринга в соответствии с Правилами клиринга, определен Тарифами Клирингового центра на рынке ценных бумаг, являющимися приложением № 2 к Правилам клиринга (далее – Тарифы Клирингового центра).
- 3.5. Порядок оплаты клиринговых услуг Клирингового центра определен в статье 37 Правил клиринга.
- 3.6. Клиринговые услуги Клирингового центра считаются оказанными надлежащим образом, если в течение 5 (пяти) рабочих дней после окончания месяца, в течение которого оказывались услуги, Участник клиринга письменно не заявит об обратном.
- 3.7. Участник клиринга вправе отказаться от исполнения Договора об оказании клиринговых услуг только при отсутствии у него имущественных обязательств по указанному договору, а также неисполненных им обязательств, допущенных к клирингу, письменно уведомив об этом Клиринговый центр не позднее, чем за 7 (семь) дней до даты прекращения действия Договора об оказании клиринговых услуг.

- 3.8. Клиринговый центр вправе отказаться от исполнения Договора об оказании клиринговых услуг с Участником клиринга в случае нарушения Участником клиринга требований, предъявляемых к нему Правилами клиринга.
- 3.9. Клиринговый центр вправе отказаться от исполнения Договора об оказании клиринговых услуг с Участником клиринга в случае, если в течение 6 (шести) месяцев с момента заключения указанного Договора Участник клиринга не получил допуска к клиринговому обслуживанию, либо в течение 6 (шести) месяцев подряд Участник клиринга не имел допуска к клиринговому обслуживанию на основании ни одних правил клиринга, утвержденных Клиринговым центром, в связи с приостановлением / прекращением / неполучением им допуска к клиринговому обслуживанию.
- 3.10. Действие Договора об оказании клиринговых услуг прекращается в следующих случаях:
- прекращения допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию в соответствии со всеми правилами клиринга, на основании которых Участник клиринга был допущен к клиринговому обслуживанию;
 - ликвидации Участника клиринга, а также в случае реорганизации Участника клиринга при условии, что деятельность Участника клиринга в результате реорганизации прекращается;
 - отзыва (аннулирования) лицензии на осуществление банковских операций у Участника клиринга (для кредитных организаций).
- 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 и персональные данные

- 4.1. Участник клиринга и Клиринговый центр обязуются рассматривать содержание Договора об оказании клиринговых услуг и условия заключенных сделок с ценными бумагами и сделок РЕПО, 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 действующего законодательства Российской Федерации), если иное не будет специально согласовано между Участником клиринга и Клиринговым центром.
- 4.2. Любые документы, предоставленные и подготовленные Участником клиринга и/или Клиринговым центром для исполнения Договора об оказании клиринговых услуг и сделок с ценными бумагами / сделок РЕПО, 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.
- 4.4. Участник клиринга / юридическое лицо подтверждают, что все персональные данные, упоминаемые в Правилах клиринга, Договоре об оказании клиринговых услуг, а также передаваемые Участником клиринга / юридическим лицом и Клиринговым центром друг другу, в случае если это требуется в целях исполнения Договора об оказании клиринговых услуг, достоверны и получены от субъекта персональных данных в законном порядке и передаются с согласия субъекта персональных данных, в случае если такое согласие предусмотрено законодательством Российской Федерации.
- 4.5. Участник клиринга / юридическое лицо и/или Клиринговый центр обязуются не допускать распространения указанных персональных данных без согласия субъекта персональных данных или наличия иного законного основания, обеспечивать конфиденциальность персональных данных и безопасность персональных данных при их обработке в случаях, предусмотренных Правилами клиринга и законодательством Российской Федерации.
- 4.6. Положения, содержащиеся в пунктах 4.4-4.5 Правил клиринга, не распространяются на информацию, которая является общедоступной.

Статья 5. Порядок использования Аналога собственноручной подписи

- 5.1. Аналог собственноручной подписи (АСП) 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. Клиринговый центр обеспечивает защищенность и целостность электронных сообщений Участника клиринга и Клирингового центра в результате применения комплекса организационных и технических мер.
- 5.3. Электронное сообщение считается подписанным АСП, с момента отправки Участником клиринга / Клиринговым центром в Клиринговую систему такого электронного сообщения при условии успешного прохождения Участником клиринга / Клиринговым центром процедуры аутентификации в порядке, предусмотренном настоящей статьей.
- 5.4. Присвоение Клирингового идентификатора Участнику клиринга или Клиринговому центру осуществляется Клиринговым центром.

Уведомление о присвоении Клирингового идентификатора Участнику клиринга передается Участнику клиринга в составе Отчета о торгово-клиринговых счетах и иных реквизитах Участника клиринга, направляемого в соответствии со статьей 38 Правил клиринга.

Сведения о присвоенных Клиринговых идентификаторах относятся к конфиденциальным и не подлежат передаче третьим лицам, за исключением Технического центра, которому такие сведения доступны в связи с проведением

процедуры аутентификации. Участник клиринга и Клиринговый центр обеспечивают соблюдение требований о конфиденциальности и несут риск последствий, связанных с нарушением таких требований.

- 5.5. Процедура аутентификации осуществляется Техническим центром с использованием Клиринговой системы при осуществлении технического доступа Участника клиринга или Клирингового центра в Клиринговую систему через удаленное рабочее место Участника клиринга или Клирингового центра путем сопоставления введенных Клирингового идентификатора и пароля соответствующим Клиринговому идентификатору и паролю Участника клиринга / Клирингового центра, информация о которых содержится в базе данных Клиринговой системы.

В случае успешного прохождения процедуры аутентификации Участник клиринга / Клиринговый центр получает возможность осуществления операций в Клиринговой системе.

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

- 5.7. По письменному запросу Участника клиринга Клиринговый центр предоставляет Участнику клиринга копию направленного Участником (Участнику) клиринга электронного сообщения, изготовленного (распечатанного) на бумажном носителе.

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

- 5.8. 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 проводится техническая экспертиза в соответствии с приложением № 3 к Правилам клиринга.

- 5.10. В случае, если по результатам технической экспертизы, проведенной в соответствии с приложением № 3 к Правилам клиринга, конфликтная ситуация остается неурегулированной, то такая конфликтная ситуация подлежит рассмотрению в порядке, предусмотренном статьей 42 Правил клиринга.

Статья 6. Торговые счета

- 6.1. При осуществлении клиринга в соответствии с Правилами клиринга Клиринговый центр использует следующие виды торговых банковских счетов, открытых в Расчетной организации:

- торговый банковский счет в российских рублях;

- торговый банковский счет в иностранной валюте.
- 6.2. **Торговый счет** – торговый банковский счет в российских рублях Участника клиринга, в том числе специальный брокерский счет или счет доверительного управляющего, Клирингового центра или клиента Участника клиринга, предназначенный для учета индивидуального клирингового обеспечения в российских рублях.
- 6.2.1. Торговый счет Банка предназначен для учета денежных средств, используемых для обеспечения исполнения и исполнения обязательств Банка по сделкам, заключенным им с расчетами в российских рублях за свой счет и за счет его клиентов, для исполнения обязательств Банка по уплате Комиссионного вознаграждения и Возмещения, либо для обеспечения исполнения и исполнения обязательств другого Участника клиринга (в случае открытия Банком для Участника клиринга дополнительной позиции по денежным средствам, определяемой в отношении этого торгового счета) по сделкам, заключенным с расчетами в российских рублях, а также для исполнения обязательств такого Участника клиринга по уплате Комиссионного вознаграждения в соответствии с Правилами клиринга.
- 6.2.2. Торговый счет Участника клиринга, не являющегося кредитной организацией в соответствии с законодательством Российской Федерации, предназначен для учета денежных средств, используемых для обеспечения исполнения и исполнения обязательств по сделкам, заключенным Участником клиринга с расчетами в российских рублях за свой счет или за счет его клиентов, а также для исполнения обязательств Участника клиринга по уплате Комиссионного вознаграждения и Возмещения в соответствии с Правилами клиринга.
- 6.2.3. Торговый счет клиента Участника клиринга предназначен для учета денежных средств, используемых для обеспечения исполнения и исполнения обязательств по сделкам, заключенным Участником клиринга с расчетами в российских рублях за счет этого клиента, а также для исполнения обязательств Участника клиринга по уплате Комиссионного вознаграждения по указанным сделкам.
- 6.3. **Валютный торговый счет** – торговый банковский счет в иностранной валюте Участника клиринга, в том числе специальный брокерский счет или счет доверительного управляющего, Клирингового центра или клиента Участника клиринга, предназначенный для учета индивидуального клирингового обеспечения в иностранной валюте.
- 6.3.1. Валютный торговый счет Банка предназначен для учета денежных средств, используемых для обеспечения исполнения и исполнения обязательств по сделкам, заключенным с расчетами в иностранной валюте за свой счет и за счет клиентов, либо для обеспечения исполнения и исполнения обязательств другого Участника клиринга (в случае открытия Банком для Участника клиринга дополнительной валютной позиции по денежным средствам, определяемой в отношении этого торгового счета) по сделкам, заключенным с расчетами в иностранной валюте.
- 6.3.2. Валютный торговый счет Участника клиринга, не являющегося кредитной организацией в соответствии с законодательством Российской Федерации, предназначен для учета денежных средств, используемых для обеспечения исполнения и исполнения обязательств по сделкам, заключенным с расчетами в иностранной валюте за свой счет или за счет его клиентов.

- 6.3.3. Валютный торговый счет клиента Участника клиринга предназначен для учета денежных средств, используемых для обеспечения исполнения и исполнения обязательств по сделкам, заключенным Участником клиринга с расчетами в иностранной валюте за счет этого клиента
- 6.4. При осуществлении клиринга в соответствии с Правилами клиринга Клиринговый центр использует следующие типы торговых счетов депо, а также счета, открытые в Расчетном депозитории:
- Торговый. НКЦ. Ценные бумаги в собственности депонента;
 - Торговый. НКЦ. Н.Д.;
 - Торговый. НКЦ. Иностраннй Н.Д.;
 - Торговый. НКЦ. Д.У.;
 - Эмиссионный счет;
 - Казначейский счет депо.
- 6.5. **Торговый счет депо владельца** — торговый счет депо типа «Торговый. НКЦ. Ценные бумаги в собственности Депонента» Участника клиринга или Клирингового центра, предназначенный для учета ценных бумаг, принадлежащих Участнику клиринга или Клиринговому центру на праве собственности или ином вещном праве.
- 6.6. **Торговый счет депо номинального держателя Участника клиринга** – торговый счет депо типа «Торговый. НКЦ. Н.Д.» Участника клиринга, имеющего лицензию профессионального участника рынка ценных бумаг на осуществление депозитарной деятельности, предназначенный для учета ценных бумаг клиентов Участника клиринга.
- 6.7. **Торговый счет депо номинального держателя Держателя** - торговый счет депо типа «Торговый. НКЦ. Н.Д.» или «Торговый. НКЦ. Иностраннй Н.Д.» Держателя, предназначенный для учета ценных бумаг Участников клиринга и/или их клиентов, депозитарное обслуживание которых осуществляется Держателем.
- 6.8. **Торговый счет депо доверительного управления** - торговый счет депо типа «Торговый. НКЦ. Д.У.» Участника клиринга, предназначенный для учета ценных бумаг, находящихся в доверительном управлении Участника клиринга.
- 6.9. **Торговый счет депо клиента Участника клиринга** - торговый счет депо типа «Торговый. НКЦ. Ценные бумаги в собств. Депонента» клиента Участника клиринга.
- 6.10. **Эмиссионный счет** - счет, открытый Расчетным депозитарием эмитенту в соответствии с договором эмиссионного счета.
- 6.11. **Казначейский счет депо** – торговый счет депо типа «Казначейский счет депо», открытый Расчетным депозитарием эмитенту для учет прав эмитента на выпущенные им ценные бумаги.
- 6.12. При осуществлении клиринга в соответствии с Правилами клиринга Клиринговый центр использует следующие типы торговых разделов торговых счетов депо, а также счетов депо, открытых в Расчетном депозитории:

- Блокировано для клиринга в НКЦ. Сделки в валюте РФ (код типа раздела – 31);
 - Блокировано для клиринга в НКЦ. Сделки в иностранной валюте (код типа раздела – 3F);
 - Блокировано для клиринга в НКЦ. Обеспечение (код типа раздела – 36).
- 6.13. **Торговый раздел** – торговый раздел типа «Блокировано для клиринга в НКЦ. Сделки в валюте РФ» Торгового счета депо владельца Участника клиринга или Клирингового центра и/или Торгового счета депо номинального держателя Участника клиринга и/или Торгового счета депо доверительного управления и/или эмиссионного счета и/или Торгового счета депо клиента и/или Торгового счета депо эмитента.
- 6.14. **Валютный торговый раздел** – торговый раздел типа «Блокировано для клиринга в НКЦ. Сделки в иностранной валюте» Торгового счета депо владельца Участника клиринга или Клирингового центра и/или Торгового счета депо номинального держателя Участника клиринга и/или Торгового счета депо доверительного управления и/или Эмиссионного счета депо и/или Торгового счета депо клиента и/или Торгового счета депо эмитента.
- 6.15. **Дополнительный торговый раздел** – торговый раздел типа «Блокировано для клиринга в НКЦ. Сделки в валюте РФ» или «Блокировано для клиринга в НКЦ. Сделки в иностранной валюте» Торгового счета депо номинального держателя Держателя.

Существуют следующие типы дополнительных торговых разделов типа «Блокировано для клиринга в НКЦ. Сделки в валюте РФ»:

- **Тип «А»** - для учета ценных бумаг, принадлежащих на праве собственности или ином вещном праве Участнику клиринга, депозитарное обслуживание которого осуществляется Держателем;
- **Тип «В»** - для учета ценных бумаг клиентов Участника клиринга, депозитарное обслуживание которых осуществляется Держателем;
- **Тип «С»** - для учета ценных бумаг, находящихся в доверительном управлении Участника клиринга, депозитарное обслуживание которого осуществляется Держателем.

Существуют следующие типы дополнительных торговых разделов типа «Блокировано для клиринга в НКЦ. Сделки в иностранной валюте»:

- **Тип «D_XXX»¹** - для учета ценных бумаг, принадлежащих на праве собственности или ином вещном праве Участнику клиринга, депозитарное обслуживание которого осуществляется Держателем;
- **Тип «E_XXX»** - для учета ценных бумаг клиентов Участника клиринга, депозитарное обслуживание которых осуществляется Держателем;

¹ XXX - здесь и далее – код валюты, определенный в Регламенте клиринга

- **Тип «F_XXX»** - для учета ценных бумаг, находящихся в доверительном управлении Участника клиринга, депозитарное обслуживание которого осуществляется Держателем.
- 6.16. **Торговый раздел обеспечения** - торговый раздел типа «Блокировано для клиринга в НКЦ. Обеспечение» Торгового счета депо владельца Участника клиринга и/или Торгового счета депо номинального держателя Участника клиринга и/или Торгового счета депо доверительного управления и/или Торгового счета депо клиента.
- 6.17. **Дополнительный торговый раздел обеспечения** - торговый раздел типа «Блокировано для клиринга в НКЦ. Обеспечение» Торгового счета депо номинального держателя Держателя.
- 6.18. Торговые разделы всех типов, перечисленные в пунктах 6.12-6.17 Правил клиринга далее совместно именуются Разделы.
- Торговые разделы, перечисленные в пунктах 6.12-6.15 Правил клиринга далее совместно именуются Разделы T0.
- Торговые разделы обеспечения и Дополнительные торговые разделы обеспечения далее совместно именуются Разделы T+.

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. **Счет обеспечения T+** – клиринговый регистр, соответствующий лицевому счету, открытому Участнику клиринга в Клиринговом центре на балансовом счете № 30420 (30421) «Средства для исполнения обязательств, допущенных к клирингу, и индивидуального клирингового обеспечения» для учета Обеспечения в денежных средствах.
- Счет обеспечения T+ открывается к Торговому счету Участника клиринга или его клиента при получении от Расчетного депозитария информации о новом Разделе обеспечения, соответствующем Разделу, входящему в состав одного Торгово-клирингового счета совместно с указанным Торговым счетом.
- 7.3. **Счет обеспечения T0** – клиринговый регистр, соответствующий лицевому счету, открытому Участнику клиринга в Клиринговом центре на балансовом счете № 30420 (30421) «Средства для исполнения обязательств, допущенных к клирингу, и индивидуального клирингового обеспечения» для учета денежных средств, предназначенных для обеспечения исполнения и исполнения обязательств по сделкам, за исключением денежных средств, являющихся Обеспечением.
- Счет обеспечения T0 открывается к Торговому счету Участника клиринга или его клиента при получении от Расчетной организации информации о новом Торговом счете.
- 7.4. На клиринговых регистрах Клиринговый центр учитывает:
- позиции по денежным средствам в разрезе Торговых счетов;

- позиции по ценным бумагам в разрезе Разделов, кодов ценных бумаг;
- Единый лимит каждого Участника клиринга в разрезе Расчетных кодов;
- обязанности и требования Участника клиринга по каждому допущенному к клирингу обязательству по Сделке с частичным обеспечением;
- обязательства Участников клиринга и Клирингового центра по возврату Гарантийных переводов;
- Нетто-обязательство / Нетто-требование Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам по сделкам клирингового пула в разрезе позиций по денежным средствам / ценным бумагам;
- Нетто-обязательство / Нетто-требование Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам по Сделкам с частичным обеспечением в разрезе Счетов обеспечения T+ / Разделов T+, Дат исполнения, валют / кодов ценных бумаг;
- Итоговое нетто-обязательство / Итоговое нетто-требование Участника клиринга в разрезе Счетов обеспечения T+ / Разделов T+, валют / кодов ценных бумаг;
- Обеспечение Участника клиринга в разрезе Счетов обеспечения T+ / Разделов T+, валют / кодов ценных бумаг;
- Маржинальное требование Участника клиринга (в случае наличия);
- взнос Участника клиринга в Гарантийный фонд.

7.5. **Позиция по денежным средствам** – клиринговый регистр, предназначенный для учета данных о денежных средствах при проведении Клиринговым центром Процедуры контроля обеспечения.

Существуют следующие разделы клирингового регистра «Позиция по денежным средствам»:

Денежная позиция Участника клиринга / Клирингового центра – позиция по денежным средствам, определяемая в отношении Счета обеспечения T0, открытого к Торговому счету Участника клиринга или Клирингового центра.

Клиентская денежная позиция – позиция по денежным средствам, определяемая в отношении Счета обеспечения T0, открытого к Торговому счету Участника клиринга, являющемуся специальным брокерским счетом, и/или к Торговому счету клиента Участника клиринга.

Денежная позиция ДУ – позиция по денежным средствам, определяемая в отношении Счета обеспечения T0, открытого к Торговому счету Участника клиринга, предназначенному для учета денежных средств, находящихся в доверительном управлении этого Участника клиринга.

Валютная денежная позиция – позиция по денежным средствам, определяемая в отношении Счета обеспечения T0, открытого к валютному торговому счету Участника клиринга.

Валютная клиентская денежная позиция – позиция по денежным средствам, определяемая в отношении Счета обеспечения T0, открытого к валютного торговому счету Участника клиринга, являющемуся специальным брокерским счетом, и/или к валютному торговому банковскому счету клиента Участника клиринга.

Валютная денежная позиция ДУ – позиция по денежным средствам, определяемая в отношении Счета обеспечения Т0, открытого к валютному торговому счету Участника клиринга, предназначенному для учета денежных средств, находящихся в доверительном управлении этого Участника клиринга.

Денежные позиции, клиентские денежные позиции, денежные позиции ДУ, валютные денежные позиции, валютные клиентские денежные позиции, валютные денежные позиции ДУ далее совместно именуются основными позициями по денежным средствам.

Дополнительная собственная денежная позиция – позиция по денежным средствам, определяемая в отношении Счета обеспечения Т0, открытого к торговому счету Банка, осуществляющего расчетное обслуживание Участника клиринга и/или его клиентов.

Дополнительная клиентская денежная позиция – позиция по денежным средствам, определяемая в отношении Счета обеспечения Т0, открытого к торговому счету Банка, осуществляющего расчетное обслуживание клиентов Участника клиринга, не являющегося кредитной организацией.

Дополнительная денежная позиция ДУ – позиция по денежным средствам, определяемая в отношении Счета обеспечения Т0, открытого к торговому счету Банка, осуществляющего расчетное обслуживание Участника клиринга при выполнении им функций доверительного управляющего, и предназначенному для учета денежных средств, находящихся в доверительном управлении Участника клиринга.

Дополнительные собственные денежные позиции, дополнительные клиентские денежные позиции и дополнительные денежные позиции ДУ далее совместно именуются дополнительными рублевыми денежными позициями.

Дополнительная собственная валютная денежная позиция – позиция по денежным средствам, определяемая в отношении Счета обеспечения Т0, открытого к валютному торговому счету Банка, осуществляющего расчетное обслуживание Участника клиринга и/или его клиентов.

Дополнительная клиентская валютная денежная позиция – позиция по денежным средствам, определяемая в отношении Счета обеспечения Т0, открытого к валютному торговому счету Банка, осуществляющего расчетное обслуживание клиентов Участника клиринга.

Дополнительная валютная денежная позиция ДУ Участника клиринга – позиция по денежным средствам, определяемая в отношении Счета обеспечения Т0, открытого к валютному торговому счету Банка, осуществляющего расчетное обслуживание Участника клиринга при выполнении им функций доверительного управляющего, и предназначенного для учета денежных средств, находящихся в доверительном управлении Участника клиринга.

Дополнительные валютные денежные позиции - Дополнительные собственные валютные денежные позиции, Дополнительные клиентские валютные денежные позиции и Дополнительные валютные денежные позиции ДУ далее совместно именуются дополнительными валютными денежными позициями.

Дополнительные позиции по денежным средствам – Дополнительная собственная денежная позиция, дополнительная клиентская денежная позиция, дополнительная денежная позиция ДУ, дополнительная собственная валютная

денежная позиция, дополнительная клиентская валютная денежная позиция и дополнительная валютная денежная позиция ДУ далее совместно именуются дополнительными позициями по денежным средствам.

- 7.6. **Позиция по ценным бумагам / Позиция депо** – клиринговый регистр, предназначенный для учета данных о количестве ценных бумаг при проведении Клиринговым центром Процедуры контроля обеспечения.

Существуют следующие разделы клирингового регистра «Позиция по ценным бумагам»:

Позиция «Депо-1» Участника клиринга / Клирингового центра — позиция депо, определяемая в отношении Торгового раздела Торгового счета депо владельца Участника клиринга или Клирингового центра в Расчетном депозитарии и/или Дополнительного торгового раздела - тип А, открытого для Участника клиринга на Торговых счетах депо номинального держателя Держателей в Расчетном депозитарии.

Позиция «Депо-2» Участника клиринга — позиция депо, определяемая в отношении Торгового раздела Торгового счета депо номинального держателя Участника клиринга в Расчетном депозитарии и/или Торгового раздела Торгового счета депо клиента Участника клиринга в Депозитарии и/или Дополнительного торгового раздела - тип В, открытого для Участника клиринга на Торговых счетах депо номинального держателя Держателей в Расчетном депозитарии.

Позиция «Депо-3» Участника клиринга – позиция депо, определяемая в отношении открытого для Участника клиринга Торгового раздела Эмиссионного счета, открытого для Участника клиринга.

Позиция «Депо-4» Участника клиринга — позиция депо, определяемая в отношении Торгового раздела Торгового счета депо доверительного управления Участника клиринга в Расчетном депозитарии и/или Дополнительного торгового раздела - тип С, открытого для Участника клиринга на Торговых счетах депо номинального держателя Держателей в Расчетном депозитарии.

Позиция «Депо-5» Участника клиринга — позиция депо, определяемая в отношении Валютного торгового раздела Торгового счета депо владельца Участника клиринга в Расчетном депозитарии и/или Дополнительного торгового раздела - тип D_XXX, открытого для Участника клиринга на Торговых счетах депо номинального держателя Держателей в Расчетном депозитарии.

Позиция «Депо-6» Участника клиринга — позиция депо, определяемая в отношении Валютного торгового раздела Торгового счета депо номинального держателя Участника клиринга в Расчетном депозитарии, и/или Валютного торгового раздела Торгового счета депо клиента Участника клиринга в Расчетном депозитарии, и/или Дополнительного торгового раздела - тип E_XXX, открытого для Участника клиринга на Торговых счетах депо номинального держателя Держателей в Расчетном депозитарии.

Позиция «Депо-7» Участника клиринга — позиция депо, определяемая в отношении Валютного торгового раздела Торгового счета депо доверительного управления Участника клиринга в Расчетном депозитарии и/или Дополнительного торгового раздела - тип F_XXX, открытого для Участника клиринга на торговых счетах депо номинального держателя Держателей в Расчетном депозитарии.

Позиция «Депозит-8» Участника клиринга – позиция депо, определяемая в отношении открытого для Участника клиринга Валютного торгового раздела Эмиссионного счета.

Учетная позиция «1» Участника клиринга — клиринговый регистр, предназначенный для учета требований Участника клиринга по ценным бумагам, возникающих в результате заключения биржевых сделок с акциями в ходе проведения торгов по их размещению. Учетная позиция «1» Участника клиринга определяется по каждой ценной бумаге в отношении каждого лицевого счета, а также Торгового раздела и/или Дополнительного торгового раздела в Расчетном депозитарии.

Учетная позиция «2» Участника клиринга — клиринговый регистр, предназначенный для учета обязательств Участника клиринга по ценным бумагам, возникающих в результате заключения биржевых сделок с акциями в ходе проведения торгов по их размещению. Учетная позиция «2» Участника клиринга определяется по каждой ценной бумаге.

- 7.7. В Клиринговой системе устанавливаются начальные и плановые значения позиций по денежным средствам и позиций депо Участников клиринга.

Порядок и случаи изменения значений позиций по денежным средствам и позиций депо приведен в приложении № 7 к Правилам клиринга.

- 7.8. Порядок ведения клиринговых регистров определен в соответствующих статьях разделов IV и V Правил клиринга.

РАЗДЕЛ II. ТРЕБОВАНИЯ К УЧАСТНИКАМ КЛИРИНГА

Статья 8. Требования к Участникам клиринга

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

- Договор об оказании клиринговых услуг по форме, предусмотренной приложением № 1 к Правилам клиринга, в 2 (двух) экземплярах, подписанный уполномоченным лицом юридического лица и скрепленный печатью юридического лица;
- комплект документов в соответствии с перечнем, приведенным в разделе I приложения № 4 к Правилам клиринга.

В случае если какой-либо из документов, указанных в приложении № 4 к Правилам клиринга, ранее уже предоставлялся Клиринговому центру и имеется в наличии у Клирингового центра, то юридическое лицо по предварительному согласованию с Клиринговым центром может быть освобождено от обязанности повторного предоставления этого документа.

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

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

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

В случае изменения сведений, содержащихся в Анкете Участника клиринга (клиента) (Регистрационной карточке) или в иных представленных Клиринговому центру документах, Участник клиринга обязан в течение 5 (пяти) рабочих дней после таких изменений предоставить Клиринговому центру Анкету Участника клиринга (клиента) (Регистрационную карточку) с обновленной информацией в форме электронного документа и соответствующие документы, подтверждающие такие изменения.

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

8.5. Для подтверждения своего финансового состояния Участники клиринга категории «Б» обязаны в течение всего срока действия Договора об оказании клиринговых услуг предоставлять Клиринговому центру отчетность в соответствии с приложением № 5 к Правилам клиринга.

В целях оценки финансового состояния Участника клиринга Клиринговый центр вправе затребовать от Участника клиринга дополнительную информацию и отчетность, не указанную в приложении № 5 к Правилам клиринга.

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

9.1. Допуск к клиринговому обслуживанию в соответствии с Правилами клиринга предоставляется Участнику клиринга, который соответствует следующим требованиям:

- имеет действующий Договор об оказании клиринговых услуг, заключенный с Клиринговым центром;
- имеет действующую лицензию на осуществление банковских операций, выданную Банком России (для кредитных организаций);
- является участником Подсистемы ЭДО НКЦ;
- выполняет требования Клирингового центра по предоставлению информации и отчетности, предусмотренные пунктами 8.4-8.5 Правил клиринга;
- выполняет требования Клирингового центра к финансовой устойчивости Участника клиринга, предусмотренные пунктом 9.2 или 9.3 Правил клиринга;
- имеет хотя бы один зарегистрированный в Клиринговом центре Торгово-клиринговый счет;
- предоставил Клиринговому центру Заявление о ТКС для внебиржевых сделок (данное требование относится только к клиринговому обслуживанию Участников клиринга при осуществлении клиринга по внебиржевым сделкам прямого РЕПО с Банком России);
- в деятельности Участника клиринга отсутствуют факты ухудшения его финансового состояния и/или отсутствует информация, дающая основания считать возможными ухудшение финансового состояния Участника клиринга и/или неспособность Участника клиринга своевременно и в полном объеме исполнять свои обязательства по Сделкам с частичным обеспечением, Маржинальные требования и/или иные обязательства Участника клиринга, возникающие из Правил клиринга.

9.2. Участник клиринга - кредитные организации должны соответствовать следующим требованиям к финансовой устойчивости:

- соблюдать обязательные нормативы Банка России, установленные для кредитных организаций;
- иметь по балансу на последнюю отчетную дату положительный финансовый результат текущего года, определяемый 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;
- 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.

- 9.3. Участники клиринга - некредитные организации должны соответствовать следующим требованиям к финансовой устойчивости:
- иметь по балансу на последнюю отчетную дату положительный финансовый результат, определяемый как остаток по строке "Нераспределенная прибыль (непокрытый убыток)" бухгалтерского баланса (формы 0710001);
 - в деятельности Участников клиринга должны отсутствовать основания для осуществления мер по предупреждению банкротства в соответствии с законодательством Российской Федерации о несостоятельности (банкротстве).
- 9.4. Участники клиринга должны соответствовать требованиям к финансовой устойчивости, приведенным в пунктах 9.2-9.3 Правил клиринга, в течение всего времени допуска к клиринговому обслуживанию в соответствии с Правилами клиринга.
- Участники клиринга обязаны незамедлительно уведомлять Клиринговый центр о своем несоответствии указанным требованиям.
- 9.5. 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, направляя соответствующие уведомления в форме электронного документа.
- 9.6. Для получения возможности заключения Сделок с частичным обеспечением Участник клиринга обязан внести взнос в Гарантийный фонд в размере, установленном пунктом 15.2 Правил клиринга.
- Клиринговый центр уведомляет Биржу о выполнении Участником клиринга требования о внесении взноса в Гарантийный фонд.
- 9.7. Для регистрации Торгово-клирингового счета Участника клиринга, устанавливающего однозначное соответствие между определенной позицией по ценным бумагам и определенной позицией по денежным средствам, а также в случае необходимости изменения такого соответствия Участник клиринга обязан предоставить Клиринговому центру Заявление на регистрацию ТКС в бумажной форме или в форме электронного документа.
- Одна позиция по ценным бумагам может входить в состав только одного Торгово-клирингового счета.
- Одна позиция по денежным средствам может входить в состав нескольких Торгово-клиринговых счетов.
- 9.8. Для заключения Сделок с частичным обеспечением Участник клиринга должен предварительно открыть в Расчетном депозитарии Торговый раздел обеспечения либо использовать для учета Обеспечения в ценных бумагах Дополнительный торговый раздел обеспечения, открытый Держателем для Участника клиринга. При открытии Расчетным депозитарием Раздела Т+ между ним и Разделом Т0, открытым в рамках того же торгового счета депо, устанавливается взаимнооднозначное соответствие.
- 9.9. Удержание Клиринговым центром с Участника клиринга:

- Комиссионного вознаграждения по сделкам с ценными бумагами, заключенным Участником клиринга в иностранной валюте;
- абонентской платы;
- постоянной части Комиссионного вознаграждения по сделкам РЕПО;
- постоянной части Комиссионного вознаграждения по сделкам купли-продажи акций;
- Комиссионного вознаграждения за предоставление по запросам Участников клиринга дубликатов отчетов по итогам клиринга, предусмотренных Правилами клиринга;
- Комиссионного вознаграждения по тарифному плану «Размещения-фиксированный»;
- дополнительного вознаграждения в случае, предусмотренном пунктом 37.16 Правил клиринга;
- Возмещения;

а также установление Ограничительного лимита по уплате возмещения и зачисление Возмещения осуществляется со Счета / в отношении Счета / на Счет обеспечения T0, соответствующего / соответствующий Торговому счету / Дополнительной позиции по денежным средствам, указанному / указанной Участником клиринга в представленном Клиринговому центру Заявлении о торговом счете для возмещения и комиссии.

В случае непредоставления Участником клиринга Заявления о торговом счете для возмещения и комиссии операции, указанные в настоящем пункте Правил клиринга, осуществляются в отношении Счета обеспечения T0, открытого к Торговому счету или Дополнительной позиции по денежным средствам, если такой Торговый счет или Дополнительная позиция по денежным средствам, - единственная, по которому (которой) возможно проведение операций в соответствии с Правилами клиринга.

В иных случаях операции, указанные в настоящем пункте Правил клиринга, осуществляются в отношении Счета обеспечения T0, открытого к Торговому счету или Дополнительной позиции по денежным средствам с наиболее ранней датой открытия.

Торговый счет / Дополнительная позиция по денежным средствам, определенная в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга, далее именуется Счетом для возмещения и комиссии.

- 9.10. В случае получения от Расчетной организации информации о закрытии и/или невозможности проведения операций по Счету для возмещения и комиссии, Клиринговый центр вправе установить Ограничительный лимит по уплате возмещения в отношении Счета обеспечения T0, открытого к любому другому Торговому счету (Дополнительной позиции по денежным средствам) до начала или в ходе Процедуры контроля обеспечения.

Статья 10. Порядок регистрации Участников клиринга и их Клиентов

- 10.1. Клиринговый центр осуществляет регистрацию Участников клиринга и их Клиентов и присваивает каждому Участнику клиринга / Клиенту 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.

- 10.2. Регистрация Клиентов Участников клиринга осуществляется на основании информации, полученной от Участника клиринга, или на основании информации, предоставленной Клиринговому центру Биржами.
- 10.3. Регистрация Участников клиринга и Клиентов осуществляется Клиринговым центром в соответствии с требованиями нормативных правовых актов федерального органа исполнительной власти в области финансовых рынков. Участнику клиринга может быть присвоен в Клиринговой системе только один код Участника клиринга.
- 10.4. Сведения, необходимые для регистрации Участника клиринга / Клиента предоставляются Участником клиринга в Клиринговый центр в форме электронного документа.
- 10.5. Процедура регистрации Участника клиринга предусматривает присвоение Участнику клиринга следующих кодов и идентификаторов:
 - код Участника клиринга (присваивается в соответствии с нормативными правовыми актами федерального органа исполнительной власти в области финансовых рынков);
 - идентификатор (присваивается Клиринговым центром);
 - специальный код (присваивается Участником клиринга самостоятельно).
- 10.6. После присвоения Участнику клиринга кода и заключения Участником клиринга с Техническим центром договора о предоставлении интегрированного технологического сервиса Клиринговый центр присваивает Участнику клиринга идентификатор Участника клиринга. Участнику клиринга может быть присвоено в Клиринговой системе более одного идентификатора Участника клиринга. При этом для каждого Участника клиринга устанавливается однозначное соответствие всех идентификаторов присвоенному коду Участника клиринга.
- 10.7. Участник клиринга - управляющий также указывает Клиринговому центру специальный код Участника клиринга. Специальный код должен соответствовать формату (набору символов), используемому в Клиринговой системе, и является уникальным для данного Участника клиринга. При этом для каждого Участника клиринга Клиринговый центр устанавливает однозначное соответствие специального кода коду Участника клиринга.
- 10.8. Процедура регистрации Клиентов Участников клиринга предусматривает присвоение Клиринговым центром таким Клиентам следующих уникальных кодов:
 - код Клиента (присваивается в соответствии с нормативными правовыми актами федерального органа исполнительной власти в области финансовых рынков);
 - краткий код Клиента (указывается Участником клиринга самостоятельно).
- 10.9. Краткий код Клиента присваивается Клиенту при условии, что:
 - Участнику клиринга присвоен идентификатор;

- Клиенту Участника клиринга присвоен код Клиента в соответствии с Правилами клиринга;
 - краткий код Клиента, предложенный Участником клиринга, соответствует формату (набор символов), используемому в Клиринговой системе, и является уникальным для данного Участника клиринга.
- 10.10. Клиенту Участника клиринга может быть присвоено в Клиринговой системе более одного краткого кода Клиента. Для каждого Клиента устанавливается однозначное соответствие всех кратких кодов Клиента коду Клиента.
- 10.11. В целях регистрации кодов Клиентов Участник клиринга может дополнительно к сведениям, установленным нормативными правовыми актами федерального органа исполнительной власти в области финансовых рынков, предоставлять иные сведения, в том числе, сведения о номере лицензии на осуществление банковских операций, выданной Клиенту, сведения о том, является ли Клиент квалифицированным инвестором.
- 10.11.1. При получении от Участника клиринга сведений о номере лицензии на осуществление банковских операций, выданной Клиенту, Клиринговый центр регистрирует Клиента с отметкой «кредитная организация», если соответствующая лицензия является действительной.
- 10.11.2. В случае если Участник клиринга не укажет при регистрации Клиента номер лицензии на осуществление банковских операций, либо указанная лицензия отозвана (аннулирована), такой Клиент регистрируется с отметкой «некредитная организация».
- 10.11.3. Если после регистрации Клиринговым центром Клиента – кредитной организации, Банк России отзовет (аннулирует) лицензию на осуществление банковских операций, номер которой был указан Участником клиринга при регистрации данного Клиента, Участник клиринга обязан представить в Клиринговый центр соответствующую информацию в порядке и по форме, установленным Клиринговым центром. Клиринговый центр после получения соответствующей информации проставляет такому Клиенту отметку «некредитная организация».
- 10.12. Клиринговый центр информирует Участников клиринга о присвоении им, а также Клиентам кодов (в том числе, кратких или специальных), а также о присвоении идентификатора путем направления соответствующего уведомления.
- 10.13. Для регистрации Биржей Участника клиринга / Клиента в качестве Участника торгов / клиента Участника торгов Клиринговый центр вправе передавать имеющуюся у него информацию об Участниках клиринга и Клиентах, а также о присвоенных им кодах Бирже.
- 10.14. Клиринговый центр вправе самостоятельно аннулировать регистрацию Клиентов в случае несоблюдения требований, установленных Правилами клиринга.
- 10.15. Участник клиринга самостоятельно отслеживает полноту и актуальность информации, предоставляемой в целях регистрации кодов Участника клиринга и кодов Клиента. Клиринговый центр не несет ответственности за актуальность и достоверность информации, предоставленной Участником клиринга, а также за нарушение Участником клиринга порядка предоставления таких сведений.

Статья 11. Порядок приостановления и прекращения допуска к клиринговому обслуживанию

11.1. Клиринговый центр вправе приостановить допуск к клиринговому обслуживанию Участника клиринга по любому из следующих оснований:

- на основании соответствующего уведомления Биржи;
- при отсутствии хотя бы одного зарегистрированного Торгово-клирингового счета;
- при невозможности осуществления операций с использованием Торгово-клирингового счета, указанного в Заявлении о ТКС для внебиржевых сделок (в части осуществления клирингового обслуживания по внебиржевым сделкам прямого РЕПО с Банком России);
- при нарушении Участником клиринга установленных Правилами клиринга требований;
- при применении Банком России к Участнику клиринга – кредитной организации санкций за нарушение банковского законодательства, в том числе: введение запрета на осуществление Участником клиринга отдельных банковских операций, если это приведет к невозможности заключения и/или исполнения Участником клиринга сделок и назначение временной администрации по управлению кредитной организацией – Участником клиринга в рамках мер по предупреждению банкротства кредитной организации;
- при применении к Участнику клиринга санкций уполномоченных органов за нарушение законодательства Российской Федерации, в том числе: применение административных взысканий, ограничений и введение запрета на проведение Участником клиринга отдельных операции;
- по результатам рассмотрения Клиринговым центром предоставленных Участником клиринга в соответствии с пунктами 8.4-8.5 Правил клиринга информации и документов, а также в случае их непредставления в надлежащий срок;
- при наличии фактов ухудшения финансового состояния Участника клиринга и/или информации, дающей основания считать возможными ухудшение финансового состояния Участника клиринга и/или неспособность Участника клиринга своевременно и в полном объеме исполнять свои обязательства по Сделкам, Маржинальные требования и/или иные обязательства Участника клиринга, возникающие из Правил клиринга;
- при наличии фактов неисполнения или ненадлежащего исполнения Участником клиринга обязательств перед Клиринговым центром, возникших из Договора об оказании клиринговых услуг при оказании Клиринговым центром услуг в соответствии с иными правилами клиринга, утвержденными Клиринговым центром и регламентирующими различные направления клиринговой деятельности.

11.2. Клиринговый центр приостанавливает допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию при получении Клиринговым центром от Участника клиринга письма о приостановлении допуска к клиринговому обслуживанию.

- 11.3. 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.
- 11.4. После прекращения 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.
- 11.5. Клиринговый центр прекращает допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию (независимо от его категории) по любому из следующих оснований:
- в случае прекращения действия Договора об оказании клиринговых услуг;
 - в случае отзыва (аннулирования) Банком России лицензии на осуществление банковских операций у Участника клиринга – кредитной организации;
 - в случае назначения временной администрации или принятия арбитражным судом решения о введении в отношении Участника клиринга одной из процедур банкротства;
 - ликвидации Участника клиринга, а также в случае реорганизации Участника клиринга при условии, что деятельность Участника клиринга в результате реорганизации прекращается;
 - неоднократного (два и более раза) в течение одного года неисполнения Участником клиринга своих обязательств, допущенных к клирингу, и/или иных денежных обязательств Участника клиринга, возникающих на основании Правил клиринга;
 - неоднократного (два и более раза) в течение одного года нарушения Участником клиринга установленных Правилами клиринга требований.
- 11.6. Клиринговый центр вправе прекратить допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию при поступлении в Клиринговый центр уведомления от Биржи о прекращении допуска Участника клиринга к участию в торгах на Бирже.
- 11.7. 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, направляя соответствующие уведомления в форме электронного документа.
- 11.8. В случае прекращения допуска к клиринговому обслуживанию, Клиринговый центр возвращает Участнику клиринга денежные средства, составляющие взнос Участника клиринга в Гарантийный фонд, учитываемый на дату прекращения допуска к клиринговому обслуживанию, в течение 3 (трех) банковских дней после получения Клиринговым центром письма от Участника клиринга о возврате вклада в Гарантийный фонд, содержащего платежные реквизиты, за исключением случаев, указанных в статье 39 Правил клиринга.

Статья 12. Требования к клиентам Участника клиринга

- 12.1. Для передачи Клиринговому центру полномочий со стороны эмитента, являющегося клиентом Участника клиринга, на получение информации о количестве ценных бумаг, учитываемых на Разделах Т0, открытых на эмиссионном счете в Расчетном депозитарии, а также на передачу Расчетному депозитарию информации, на основании которой Расчетный депозитарий осуществляет списание и/или зачисление ценных бумаг с Разделов Т0 и/или на Разделы Т0 по итогам клиринга сделок с ценными бумагами, осуществляемого Клиринговым центром, эмитент обязан предоставить в Депозитарий условное поручение депо, предусмотренное условиями осуществления депозитарной деятельности Депозитария.
- 12.2. При открытии Расчетной организацией Торгового счета клиента Участника клиринга Участник клиринга обязан предоставить Клиринговому центру Уведомление об использовании торгового счета клиента от соответствующего клиента.

Статья 13. Требования к Держателям. Порядок получения (лишения) статуса Держателя

- 13.1. Для получения статуса Держателя юридические лица, являющиеся Участниками клиринга, предоставляют Клиринговому центру:
- Заявление о предоставлении статуса Держателя;
 - нотариально удостоверенную копию лицензии профессионального участника рынка ценных бумаг на осуществление депозитарной деятельности, выданной федеральным органом исполнительной власти в области финансовых рынков (для организаций, являющихся резидентами РФ).
- 13.2. Для получения статуса Держателя юридические лица, не являющиеся Участниками клиринга, помимо документов, указанных в пункте 13.1 Правил клиринга, предоставляют Клиринговому центру:
- юридические лица, являющиеся резидентами РФ, - документы, указанные в разделе I приложения № 4 к Правилам клиринга (за исключением отчетности, предусмотренной приложением № 5 к Правилам клиринга);
 - юридические лица, являющиеся нерезидентами РФ, - документы, указанные в разделе II приложения № 4 к Правилам клиринга.
- Юридические лица, являющиеся резидентами РФ и не являющиеся Участниками клиринга, для получения / поддержания статуса Держателя обязаны выполнить условия для получения в соответствии с Порядком ЭДО отчетных документов по итогам клиринга в форме электронных документов.
- 13.3. Решение о предоставлении (лишении) организации статуса Держателя принимается Клиринговым центром.
- 13.4. Юридическое лицо / Участник клиринга может быть лишен статуса Держателя по любому из следующих оснований:

- в случае аннулирования или приостановления действия лицензии профессионального участника рынка ценных бумаг на осуществление депозитарной деятельности,
- в случае отзыва (аннулирования) Банком России лицензии на осуществление банковских операций;
- при невыполнении условий для получения в соответствии с Порядком ЭДО отчетных документов по итогам клиринга в форме электронных документов,
- нарушения Держателем требований по представлению документов, указанных в подпункте 13.5 Правил клиринга,
- письма Держателя о лишении его статуса Держателя;
- при применении к Держателю санкций уполномоченных органов за нарушение законодательства Российской Федерации;
- в случае назначения временной администрации или принятия арбитражным судом решения о введении в отношении Держателя одной из процедур банкротства;
- ликвидации Держателя, а также в случае реорганизации Держателя при условии, что деятельность Держателя в результате реорганизации прекращается;
- неоднократного (два и более) нарушения Держателем установленных Правилами клиринга требований;
- по иным основаниям.

13.5. Держатель 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, Держатель 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.

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

13.7. Клиринговый центр извещает юридическое лицо / Участника клиринга о получении им статуса Держателя, а также о лишении его статуса Держателя путем размещения соответствующей информации на Сайте Клирингового центра в течение 3 (трех) рабочих дней со дня принятия соответствующего решения.

Статья 14. Требования к Банкам

14.1. Для открытия в Клиринговой системе дополнительной денежной позиции Участника клиринга Банк обязан предоставить Клиринговому центру Уведомление об использовании дополнительной позиции по денежным средствам.

Направление Банком Клиринговому центру Уведомления, предусмотренного настоящим подпунктом, означает согласие Банка на проведение расчетов через соответствующий торговый счет Банка по обязательствам и требованиям Участника клиринга по денежным средствам, а также, для дополнительной рублевой денежной позиции, - по обязательствам Участника клиринга по уплате Комиссионного вознаграждения по сделкам, заключенным с указанием Торгово-клирингового счета, в состав которого входит его соответствующая дополнительная рублевая денежная позиция.

- 14.2. Банки, инициировавшие открытие в Клиринговой системе дополнительных позиций по денежным средствам для Участников клиринга, далее по тексту Правил клиринга именуются также Клиринговыми банками.

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

Статья 15. Перечень мер, направленных на управление рисками при осуществлении клиринга

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

- предъявляет требования к финансовой устойчивости Участников клиринга;
- предъявляет к Участникам клиринга требование о внесении Обеспечения;
- осуществляет предварительный контроль достаточности денежных средств и ценных бумаг по каждому Участнику клиринга в процессе заключения им сделок, за исключением Сделок с частичным обеспечением, путем ведения в Клиринговой системе позиций депо и позиций по денежным средствам в порядке, предусмотренном Правилами клиринга;
- осуществляет предварительный контроль достаточности Обеспечения Участника клиринга при подаче заявок на заключение Сделок с частичным обеспечением;
- не реже, чем каждый Расчетный день, осуществляет переоценку стоимости Обеспечения, а также Нетто-обязательств / Нетто-требований Участника клиринга по Сделкам с частичным обеспечением и иных обязательств и требований Участников клиринга, возникающих в соответствии с Правилами клиринга, и контроль достаточности Обеспечения, в случае недостаточности – предъявляет Участнику клиринга требование о внесении Обеспечения (Маржинальное требование);
- осуществляет контроль Единого лимита при исполнении / прекращении обязательств по Сделкам с частичным обеспечением, возврате Обеспечения;
- формирует Гарантийный фонд для обеспечения исполнения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением.

15.2. Гарантийный фонд формируется Клиринговым центром в российских рублях за счет взносов в Гарантийный фонд всех Участников клиринга, допущенных к заключению Сделок с частичным обеспечением.

Размер взноса в Гарантийный фонд каждого Участника клиринга составляет 2 000 000 (два миллиона) рублей.

15.3. Клиринговый центр вправе размещать денежные средства, составляющие Гарантийный фонд, во вклады в кредитных организациях.

Доходы по таким вкладам не включаются в состав Гарантийного фонда.

Статья 16. Единый лимит и риск-параметры

16.1. Единый лимит рассчитывается Клиринговым центром при изменении размера Обеспечения Участника клиринга, при подаче Участником клиринга заявок, заключении им Сделок с частичным обеспечением, исполнении / прекращении обязательств по Сделкам с частичным обеспечением, изменении риск-параметров.

- 16.2. Единый лимит Участника клиринга используется для проверки возможности подачи Участником клиринга заявок, исполнения / прекращения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением, возврата Участнику клиринга Обеспечения, а также выполнения иных операций, предусмотренных Правилами клиринга. Указанная проверка осуществляется, исходя из анализа изменения значения Единого лимита Участника клиринга до и после проведения операции.
- 16.3. Единый лимит Участника клиринга по Расчетному коду рассчитывается с учетом:
- Обеспечения Участника клиринга в российских рублях, учитываемого по Счету обеспечения T+, относящемуся к Расчетному коду;
 - Обеспечения Участника клиринга в ценных бумагах, учитываемого по всем Разделам T+, относящимся к Расчетному коду;
 - Нетто-обязательств / Нетто-требований Участника клиринга по Сделкам с частичным обеспечением в российских рублях и ценных бумагах, учитываемых по Счету обеспечения T+ / всем Разделам T+, относящимся к Расчетному коду, по всем Датам исполнения;
 - Задолженности Участника клиринга перед Клиринговым центром в российских рублях, учитываемой по Счету обеспечения T+, относящемуся к Расчетному коду;
 - Задолженности по гарантийным переводам Участника клиринга перед Клиринговым центром в российских рублях, учитываемой по Счету обеспечения T+, относящемуся к Расчетному коду;
 - корректировки Единого лимита с учетом Индикативных ставок РЕПО.
- 16.4. Единый лимит Участника клиринга в ходе торгов рассчитывается Клиринговым центром с учетом зарегистрированных в Системе торгов заявок на заключение Сделок с частичным обеспечением, поданных Участником клиринга.
- 16.5. Базовыми риск-параметрами, используемыми Клиринговым центром для контроля и управления рисками, являются:
- Расчетная цена;
 - Верхняя и Нижняя границы ценового коридора;
 - Верхняя и Нижняя границы диапазона оценки рыночных рисков;
 - дисконт;
 - Расчетная ставка РЕПО;
 - Верхняя и Нижняя границы коридора ставок РЕПО;
 - Верхняя и Нижняя граница диапазона оценки процентных рисков.
- Помимо базовых риск-параметров Клиринговым центром используются дополнительные риск-параметры, приведенные в Методике определения риск-параметров рынка ценных бумаг.
- 16.6. Расчет и изменение риск-параметров осуществляется Клиринговым центром по состоянию на 19:00 по московскому времени.
- Клиринговый центр может принять решение об изменении риск-параметров до начала и в ходе торгов.

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

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

16.7. Единый лимит Участника клиринга рассчитывается Клиринговым центром исходя из оценки в российских рублях максимально возможного уменьшения в течение срока, необходимого для прекращения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением по основаниям, установленным подпунктом 29.1.2 Правил клиринга, общей стоимости:

- Обеспечения Участника клиринга в российских рублях и ценных бумагах;
- Задолженности Участника клиринга перед Клиринговым центром в российских рублях;
- Задолженности по гарантийным переводам Участника клиринга перед Клиринговым центром в российских рублях;
- Нетто-обязательств / Нетто-требований Участника клиринга по Сделкам с частичным обеспечением в российских рублях и ценных бумагах по всем Датам исполнения;
- обязательств и требований по Сделкам с частичным обеспечением, которые могут быть заключены на основании зарегистрированных в Системе торгов заявок, направленных на заключение Сделок с частичным обеспечением,

в связи с изменением Расчетных цен ценных бумаг, являющихся предметом Сделок с частичным обеспечением, и/или изменением процентных ставок по сделкам РЕПО.

При расчете Единого лимита Участника клиринга обязательства по Сделкам с частичным обеспечением, которые могут быть заключены на основании зарегистрированных в Системе торгов заявок, Нетто-обязательства Участника клиринга по Сделкам с частичным обеспечением в российских рублях и ценных бумагах и задолженности учитываются со знаком «минус», требования по Сделкам с частичным обеспечением, которые могут быть заключены на основании зарегистрированных в Системе торгов заявок, Нетто-требования Участника клиринга по Сделкам с частичным обеспечением в российских рублях и ценных бумагах и Обеспечение Участника клиринга в российских рублях и ценных бумагах – со знаком «плюс».

Для целей расчета Единого лимита Участника клиринга Нетто-обязательства и Нетто-требования Участника клиринга по Сделкам с частичным обеспечением в российских рублях или по ценной бумаге с одним кодом с разными Датами исполнения складываются с учетом знака.

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

Рассчитанный в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга Единый лимит корректируется (складывается с учетом знака) с итоговой корректировкой Единого лимита с учетом Расчетных ставок РЕПО, рассчитанной как сумма с учетом знака корректировок Единого лимита с учетом Расчетных ставок РЕПО по каждой Дате исполнения, кроме текущей.

- 16.8. Верхняя и Нижняя границы диапазона оценки рыночных и процентных рисков, используемые при расчете Единого лимита Участника клиринга, зависят от объема обязательств Участника клиринга по Сделкам с частичным обеспечением.

РАЗДЕЛ IV. ПОРЯДОК И УСЛОВИЯ ДОПУСКА ОБЯЗАТЕЛЬСТВ К КЛИРИНГУ

Статья 17. Порядок взаимодействия с Биржей при подаче заявок и заключении сделок, допуске к клирингу обязательств по биржевым сделкам и обязательств по внесению компенсационных взносов

- 17.1. При подаче Участником клиринга заявки Биржа с использованием Системы торгов направляет Клиринговому центру информацию о поданной заявке.
- 17.2. Немедленно после получения информации о поданной заявке Клиринговый центр проверяет возможность регистрации заявки в Системе торгов.
- Регистрация заявки в Системе торгов является возможной при выполнении одновременно следующих условий:
- 1) активного состояния² в Клиринговой системе Торгово-клирингового счета, указанного в заявке;
 - 2) для заявок на заключение сделок с кодом расчетов Y_n , если значение цены, указанной в заявке, больше либо равно Нижней границе ценового коридора и меньше либо равно Верхней границе ценового коридора, установленных Клиринговым центром для ценной бумаги, по которой подана заявка;
 - 3) для заявок на заключение сделок РЕПО с кодом расчетов $T0/Y_n$, $Y0/Y_n$, если значение ставки РЕПО, указанной в заявке, больше либо равно Нижней границе коридора ставок РЕПО и меньше либо равно Верхней границе коридора ставок РЕПО, установленных Клиринговым центром для ценной бумаги, по которой подана заявка;
 - 4) прохождения заявкой Процедуры контроля обеспечения в соответствии со статьей 18 Правил клиринга, за исключением заявок на заключение сделок с кодом расчетов $K0$.
- 17.3. При выполнении условий, указанных в пункте 17.2 настоящей статьи, Клиринговый центр с использованием Системы торгов направляет Бирже Отчет о возможности регистрации заявки, при невыполнении хотя бы одного из условий, указанных в пункте 17.2 настоящей статьи, - Отчет о невозможности регистрации заявки.
- 17.4. При снятии в Системе торгов заявки с любым кодом расчетов, за исключением кода расчетов $K0$, Биржа с использованием Системы торгов направляет Клиринговому центру Уведомление о снятии заявки.
- 17.4.1. После получения Уведомления о снятии заявки на заключение сделки с кодом расчетов Y_n , $T0/Y_n$, $Y0/Y_n$, поданной Участником клиринга, Клиринговый центр рассчитывает Единый лимит Участника клиринга по Расчетному коду, соответствующему Торговому счету, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в отозванной заявке, без учета отозванной заявки.

² Активное состояние торгово-клирингового счета в Системе клиринга определяется в соответствии с Регламентом клиринга («А» - торгово-клиринговый счет, по которому проводятся операции).

17.5. В случае регистрации в Системе торгов заявки, являющейся в соответствии с Правилами торговли допустимой встречной по отношению к ранее зарегистрированной в Системе торгов заявке на заключение сделок с Клиринговым центром, Клиринговый центр с использованием Системы торгов направляет Участникам клиринга, подавшим допустимые встречные заявки (за исключением заявок на заключение сделок с кодом расчетов К0), Подтверждения Клирингового центра.

Цена и количество ценных бумаг в заключаемых сделках определяется в соответствии с Правилами торговли.

17.6. В целях создания условий для исполнения обязательств по сделкам Клиринговый центр вправе подавать в Систему торгов заявки от своего имени и за свой счет.

17.7. Заключение сделок с кодом расчетов К0 осуществляется Клиринговым центром только по заявкам, прошедшим Процедуру контроля обеспечения, путем направления Участникам клиринга, подавшим заявки на заключение сделок с кодом расчетов К0, являющиеся допустимыми встречными заявками и прошедшими Процедуру контроля обеспечения, Подтверждений Клирингового центра.

Процедура контроля обеспечения по заявкам на заключение сделок с кодом расчетов К0 осуществляется на основании Запроса о возможности заключения сделок, полученного от Биржи, немедленно после его получения.

17.8. После регистрации сделки в Системе торгов информация о заключенной сделке становится доступной Клиринговому центру посредством Системы торгов.

17.8.1. После получения посредством Системы торгов информации о заключении сделки Клиринговый центр допускает к клирингу обязательства по заключенной сделке.

17.8.2. После получения посредством Системы торгов информации о заключении сделки с кодом расчетов Т0, К0 Клиринговый центр включает в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов по сделкам с центральным контрагентом обязательства/требования Участников клиринга по оплате и передаче ценных бумаг по заключенной сделке.

17.8.3. После получения посредством Системы торгов информации о заключении сделки с кодом расчетов Y_n , $T0/Y_n$, $Y0/Y_n$, Клиринговый центр также:

- рассчитывает соответствующий Единый лимит Участника клиринга без учета заявки (части заявки), на основании которой была заключена указанная сделка, и с учетом указанной заключенной сделки;
- изменяет с учетом заключенной сделки Нетто-обязательство и/или Нетто-требование Участника клиринга по Сделкам с частичным обеспечением в российских рублях и ценных бумагах с Датами исполнения, соответствующими Дате (Датам) исполнения обязательств по заключенной сделке, по Счету обеспечения $T+$, открытому к Торговому счету, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в заявке, на основании которой заключена сделка (для денежных средств), и/или по Разделу $T+$, соответствующему Разделу $T0$, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в заявке, на основании которой заключена сделка (для ценных бумаг).

- 17.9. После получения посредством Системы торгов информации о заключении сделки с кодом расчетов Z0 Клиринговый центр также:
- включает в Клиринговый пул для расчетов в ходе торгов обязательства/требования Участников клиринга по оплате и передаче ценных бумаг по заключенной сделке (первой части сделки РЕПО) с кодом расчетов Z0;
 - осуществляет взаимодействия с Расчетным депозитарием с целью проведения расчетов в ходе торгов по заключенной сделке (первой части сделки РЕПО) с кодом расчетов Z0.
- 17.10. После окончания торгов на Бирже в дату, предшествующую дате внесения компенсационных взносов информация об обязательствах по внесению / требованиях по получению Участниками клиринга компенсационных взносов становится доступной Клиринговому центру посредством Системы торгов.
- 17.10.1. После получения посредством Системы торгов информации об обязательствах по внесению / требованиях по получению Участниками клиринга компенсационных взносов Клиринговый центр допускает указанные обязательства / требования к клирингу.
- 17.10.2. В дату внесения компенсационных взносов Клиринговый центр посредством Системы торгов передает Бирже информацию об исполнении обязательств по внесению / требований по получению Участниками клиринга компенсационных взносов.

Статья 18. Процедура контроля обеспечения по биржевым сделкам с ценными бумагами, осуществляемая при подаче заявок или заключении сделок

- 18.1. Процедура контроля обеспечения, осуществляемая при подаче заявок на заключение биржевых сделок с ценными бумагами, считается пройденной для сделки, которая будет заключена на основании такой заявки, в следующих случаях:
- 18.1.1. Для заявки на покупку ценных бумаг с кодом расчетов T0, Z0, Rb, T0/Уп в случае, если сумма денежных средств, необходимая для исполнения в полном объеме обязательства по оплате ценных бумаг по сделке, которая может быть заключена на основании поданной заявки (за исключением заявок, дата активации которых не наступила), включая уплату НКД и Комиссионного вознаграждения по сделке, не превышает планового значения соответствующей позиции по денежным средствам за вычетом соответствующих Ограничительных лимитов.
- Для заявок на заключение сделок РЕПО, проверка, указанная в настоящем подпункте Правил клиринга, осуществляется для первой части сделки РЕПО.
- Для заявок на покупку ценных бумаг, поданных Участником клиринга категории «А», проверка, указанная в настоящем подпункте Правил клиринга, не осуществляется.
- 18.1.2. Для заявки на продажу ценных бумаг с кодом расчетов T0, Rb, T0/Уп в случае, если количество ценных бумаг, необходимое для исполнения в полном объеме обязательства по передаче ценных бумаг по сделке, которая может быть заключена на основании поданной заявки (за исключением заявок, дата активации которых не наступила), не превышает планового значения соответствующей позиции депо, а также (в отношении заявок на заключение сделок в иностранной валюте) в случае

если сумма денежных средств, необходимая для исполнения в полном объеме обязательства по уплате Комиссионного вознаграждения по сделке, не превышает планового значения соответствующей позиции по денежным средствам за вычетом соответствующих Ограничительных лимитов.

Для заявок на заключение сделок РЕПО, проверка, указанная в настоящем подпункте Правил клиринга, осуществляется для первой части сделки РЕПО.

Для заявок на продажу ценных бумаг, поданных Участником клиринга категории «А», проверка, указанная в настоящем подпункте Правил клиринга, осуществляется только в случае принятия Участником клиринга категории «А» на себя обязательств по внесению индивидуального клирингового обеспечения в ценных бумагах в соответствии с пунктом 2.16 Правил клиринга.

18.1.3. Для заявки на продажу ценных бумаг с кодом расчетов Z0 в случае, если количество ценных бумаг, необходимое для исполнения в полном объеме обязательства по передаче ценных бумаг по сделке, которая может быть заключена на основании поданной заявки, не превышает начального и планового значения соответствующей позиции депо, а также (в отношении заявок на заключение сделок в иностранной валюте) в случае если сумма денежных средств, необходимая для исполнения в полном объеме обязательства по уплате Комиссионного вознаграждения по сделке, не превышает планового значения соответствующей позиции по денежным средствам за вычетом соответствующих Ограничительных лимитов.

18.1.4. Для заявки на покупку или на продажу с кодом расчетов B0-B30 или S0-S2 в случае, если сумма денежных средств, необходимая для исполнения в полном объеме обязательства по уплате Комиссионного вознаграждения по сделке, которая может быть заключена на основании поданной заявки, не превышает планового значения соответствующей позиции по денежным средствам за вычетом соответствующих Ограничительных лимитов.

Для заявок, поданных Участником клиринга категории «А», проверка, указанная в настоящем подпункте Правил клиринга, не осуществляется.

18.1.5. Для заявки на покупку или на продажу с кодом расчетов Yn, T0/Yn, Y0/Yn в случае, если значение Единого лимита Участника клиринга по Расчетному коду, соответствующему Торговому счету, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в заявке, с учетом поданной заявки не стало отрицательным, или, если Единый лимит Участника клиринга по такому Расчетному коду был отрицательным до момента подачи заявки, - проверку того, что Единый лимит Участника клиринга по такому Расчетному коду, рассчитанный с учетом поданной заявки, не стал меньше, чем Единый лимит Участника клиринга по этому Расчетному коду, рассчитанный до момента подачи заявки.

Для заявок на заключение сделок РЕПО с кодом расчетов T0/Yn, проверка, указанная в настоящем подпункте Правил клиринга, осуществляется для второй части сделки РЕПО.

Для заявок, поданных Участником клиринга категории «А», проверка, указанная в настоящем подпункте Правил клиринга, не осуществляется.

Если указанное значение Единого лимита с учетом поданной заявки – отрицательное, Клиринговый центр формирует в Клиринговой системе распоряжение на внесение денежных средств в Обеспечение на сумму абсолютного значения указанного Единого лимита, которое исполняется за счет денежных

средств, учитываемых на Счетах обеспечения Т0, в порядке, аналогичном порядку, определенному пунктом 26.5 Правил клиринга.

В случае предоставления Участником клиринга Клиринговому центру Заявления о порядке использования денежных средств и ценных бумаг, в соответствии с которым Участник клиринга дает указание Клиринговому центру не перечислять денежные средства, учитываемые на Счетах обеспечения Т0, на Счета обеспечения Т+ при отрицательном Едином лимите, указанное в настоящем подпункте Правил клиринга распоряжение на внесение денежных средств в Обеспечение Клиринговым центром не формируется.

Заявление о порядке использования денежных средств и ценных бумаг предоставляется Участником клиринга Клиринговому центру в бумажной форме или в форме электронного документа.

Заявление о порядке использования денежных средств и ценных бумаг исполняется Клиринговым центром, начиная с Расчетного дня, следующего за датой предоставления указанного заявления.

В случае непредоставления Заявления о порядке использования денежных средств и ценных бумаг, перечисление денежных средств и ценных бумаг между Счетами обеспечения Т0 и Счетами обеспечения Т+, а также Разделами Т0 и Разделами Т+ осуществляется во всех случаях, установленных Правилами клиринга.

Для изменения порядка использования денежных средств и ценных бумаг Участнику клиринга необходимо предоставить новое Заявление о порядке использования денежных средств и ценных бумаг.

- 18.2. В случае прохождения заявки на покупку или на продажу с кодом расчетов Yn, T0/Yn, Y0/Yn Процедуры контроля обеспечения, Клиринговый центр начинает учитывать значение Единого лимита Участника клиринга по Расчетному коду, соответствующему Торговому счету, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в заявке, рассчитанное в соответствии с подпунктом 18.1.5 Правил клиринга, в качестве нового значения Единого лимита Участника клиринга, в случае непрохождения - Клиринговый центр не изменяет учитываемое по такому Расчетному коду значение Единого лимита Участника клиринга.
- 18.3. Для заявок с отложенной датой активации Процедура контроля обеспечения в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга осуществляется в дату активации во время, установленное Временным регламентом.
- 18.4. Процедура контроля обеспечения, осуществляемая при заключении биржевых сделок с ценными бумагами, считается пройденной в следующих случаях:
- 18.4.1. Для заявки на покупку с кодом расчетов K0 в случае если сумма денежных средств, необходимая для исполнения в полном объеме обязательства по оплате ценных бумаг по сделке, включая суммы, необходимые для уплаты НКД и Комиссионного вознаграждения по сделке, не превышает планового значения соответствующей позиции по денежным средствам за вычетом соответствующих Ограничительных лимитов.
- 18.4.2. Для заявки на продажу ценных бумаг с кодом расчетов K0 в случае если количество ценных бумаг, необходимое для исполнения в полном объеме обязательства по передаче ценных бумаг по сделке, не превышает планового значения соответствующей позиции депо.

Статья 19. Порядок допуска к клирингу обязательств по внебиржевым сделкам с ценными бумагами

19.1. Для исполнения обязательств по внебиржевым сделкам Участники клиринга, являющиеся сторонами данных сделок, до Даты исполнения внебиржевых сделок в ходе периода регистрации поручений обязаны направить Клиринговому центру Поручение на клиринг внебиржевой сделки.

Поручение на клиринг внебиржевой сделки направляется с использованием Клиринговой системы в форме электронного сообщения, подписанного АСП, или в форме документа на бумажном носителе.

В Поручении на клиринг внебиржевой сделки могут содержаться данные по одной и более внебиржевым сделкам. При получении от Участника клиринга Поручения на клиринг внебиржевой сделки Клиринговый центр регистрирует его в Клиринговой системе за исключением случая, приведенного в абзаце четвертом настоящего пункта.

Клиринговый центр не регистрирует в Клиринговой системе Поручения на клиринг внебиржевой сделки до получения от Участника клиринга Заявления о ТКС для внебиржевых сделок (данное требование относится только к клирингу по внебиржевым сделкам прямого РЕПО с Банком России).

Поручение на клиринг внебиржевой сделки в форме документа на бумажном носителе оформляется как единый документ, подписанный уполномоченными лицами обоих Участников клиринга – сторон внебиржевой сделки.

19.2. В Клиринговой системе после регистрации Поручений на клиринг внебиржевой сделки, полученных от Участников клиринга – сторон внебиржевой сделки в форме электронного сообщения, проводится сверка данных, содержащихся в Поручении на клиринг внебиржевой сделки, полученном от каждого из них.

19.3. Клиринговый центр регистрирует данные по внебиржевой сделке в Клиринговой системе и учитывает обязательства и требования по ней на соответствующих клиринговых регистрах, если реквизиты внебиржевой сделки, содержащиеся в Поручениях на клиринг внебиржевой сделки Участников клиринга - контрагентов, совпадают.

19.4. Клиринговый центр не регистрирует данные по внебиржевой сделке в Клиринговой системе и не учитывает обязательства и требования по ней на соответствующих клиринговых регистрах:

- если реквизиты внебиржевой сделки, содержащиеся в Поручении на клиринг внебиржевой сделки одного Участника клиринга, не совпадают с реквизитами внебиржевой сделки, содержащимися в Поручении на клиринг внебиржевой сделки Участника клиринга – его контрагента;
- если до окончания периода регистрации поручений Клиринговый центр получил Поручение на клиринг внебиржевой сделки только от одного Участника клиринга;
- если вид и объект обязательств по внебиржевой сделке не входят в Список видов и объектов обязательств по внебиржевым сделкам, утвержденный Клиринговым центром и раскрытый на сайте Клирингового центра.

- 19.5. После регистрации данных по внебиржевой сделке в Клиринговой системе Клиринговый центр допускает обязательства по внебиржевой сделке к клирингу, а Участники клиринга обязаны совершить действия, необходимые для исполнения обязательств по ней, в порядке, предусмотренном статьей 20 Правил клиринга.

Статья 20. Порядок действий Участников клиринга для исполнения обязательств по сделкам и обязательств по внесению компенсационных взносов

- 20.1. Для обеспечения исполнения обязательств, возникающих в результате заключения сделок с ценными бумагами, Участник клиринга категории «Б» обязан обеспечивать наличие денежных средств на Торговых счетах в Расчетной организации, Счетах обеспечения Т+ и/или ценных бумаг на Разделах в Расчетном депозитории, которые могут быть использованы при прохождении сделками с ценными бумагами Процедуры контроля обеспечения в порядке, определенном Правилами клиринга.

- 20.2. Участник клиринга категории «А» может заключать биржевые сделки без предварительного внесения индивидуального клирингового обеспечения в денежных средствах.

Для исполнения обязательств по заключенным Сделкам с частичным обеспечением Участник клиринга категории «А» обязан внести денежные средства на клиринговый банковский счет Клирингового центра, открытый в Расчетной организации и предназначенный для учета индивидуального клирингового обеспечения, и/или ценные бумаги на Разделы Т+ до установленного Временным регламентом времени исполнения Участниками клиринга Итоговых нетто-обязательств перед Клиринговым центром (для Сделок с частичным обеспечением).

Денежные средства, перечисленные Участником клиринга категории «А» на клиринговый банковский счет Клирингового центра, учитываются на Счетах обеспечения Т0, открытых Клиринговым центром Участнику клиринга категории «А» на основании его Заявления о присвоении Расчетных кодов, предоставленного Клиринговому центру.

Для исполнения обязательств по сделке с кодом расчетов Z0 Участник клиринга категории «А» обязан внести денежные средства и/или ценные бумаги на Счета обеспечения Т0 (Разделы Т0) до подачи заявки на заключение указанной сделки.

Для исполнения обязательств по сделкам, за исключением Сделок с частичным обеспечением и сделок с кодом расчетов Z0, Участник клиринга категории «А» обязан внести денежные средства и/или ценные бумаги на Счета обеспечения Т0 (Разделы Т0) до установленного Временным регламентом момента окончания Процедуры контроля обеспечения по сделкам с расчетами в соответствующей валюте.

- 20.3. Участник клиринга, имеющий обязательство по сделке с ценными бумагами (первой или второй части сделки РЕПО), не прошедшей Процедуру контроля обеспечения до момента окончания периода получения Клиринговым центром от Участников клиринга Специальных и/или Срочных отчетов на исполнение Даты ее исполнения, обязан до момента окончания периода регистрации поручений в Дату исполнения данной сделки (первой или второй части сделки РЕПО) зарегистрировать по ней в Клиринговой системе Отчет на исполнение.

Порядок подачи и регистрации в Клиринговой системе Отчетов на исполнение определен в статье 21 Правил клиринга.

- 20.4. Участник клиринга, имеющий обязательство по внесению компенсационного взноса, обязан до момента окончания периода регистрации поручений в Дату внесения компенсационного взноса зарегистрировать в Клиринговой системе Поручение на внесение данного компенсационного взноса, за исключением случая отказа контрагента от получения компенсационного взноса.

Порядок подачи и регистрации в Клиринговой системе поручений на внесение компенсационных взносов и поручений на отказ от компенсационных взносов определен в статье 22 Правил клиринга.

- 20.5. Для прохождения сделкой с ценными бумагами с кодом расчетов B0-B30, S0-S2, вторым частям сделок РЕПО с кодом расчетов Z0 или Rb и компенсационным взносам Процедуры контроля обеспечения Участник клиринга вправе вместо Отчета на исполнение использовать Срочный отчет на исполнение или Специальный отчет на исполнение.

Порядок подачи и регистрации в Клиринговой системе Специального отчета на исполнение приведен в статье 23 Правил клиринга, Срочного отчета на исполнение – в статье 24 Правил клиринга.

- 20.6. Участник клиринга, имеющий обязательства по внесению компенсационных взносов и/или по сделкам с ценными бумагами (первым или вторым частям сделок РЕПО), по которым при подаче заявки не проводилась Процедура контроля обеспечения и которые включены им в Специальный или Срочный отчет на исполнение, но не прошли Процедуру контроля обеспечения до момента окончания периода регистрации поручений, обязан исполнить обязательства по сделкам (первым или вторым частям сделок РЕПО), Дата исполнения которых наступила, или обязательства по внесению компенсационных взносов, Дата внесения которых наступила, в соответствии с пунктами 20.3, 20.4 Правил клиринга соответственно.

- 20.7. По сделкам, не прошедшим Процедуру контроля обеспечения, Участник клиринга до момента окончания периода регистрации поручений по указанным сделкам вправе заменить Торгово-клиринговый счет, с использованием которого должны быть исполнены обязательства по сделкам.

Для осуществления указанной замены Участник клиринга предоставляет Клиринговому центру Заявление о замене Торгово-клирингового счета. Заявление о замене Торгово-клирингового счета предоставляет в бумажной форме или в форме электронного документа.

Информация о замене Торгово-клирингового счета, выполненной по инициативе Участника клиринга, доводится до сведения Участника клиринга путем предоставления Уведомления о замене Торгово-клирингового счета.

- 20.8. После замены Торгово-клирингового счета в сделке обязательства по уплате компенсационных взносов по такой сделке также исполняются с использованием нового Торгово-клирингового счета.

- 20.9. Порядок исполнения (прекращения) обязательств по Сделкам с частичным обеспечением определен статьей 28 Правил клиринга.

Статья 21. Порядок подачи и регистрации Отчетов на исполнение

- 21.1. Для прохождения сделкой с ценными бумагами с кодом расчетов В0-В30, первой части сделки РЕПО с кодом расчетов S0-S2, второй части сделки РЕПО с кодом расчетов S0-S2, Z0 и Rb Процедуры контроля обеспечения Участники клиринга, являющиеся сторонами по данной сделке, формируют и подают в Клиринговую систему Отчеты на исполнение.
- 21.2. Отчет на исполнение сделки с ценными бумагами с кодом расчетов В0, может быть подан Участником клиринга в Клиринговую систему в ходе периода регистрации поручений, начиная для биржевой сделки с кодом расчетов В0 с даты ее заключения, для внебиржевой сделки с кодом расчетов В0 - с даты регистрации данных о сделке в Клиринговой системе, до Даты прекращения ее исполнения.
- 21.3. Отчет на исполнение сделки с ценными бумагами с кодом расчетов В01-В30 может быть подан Участником клиринга в Клиринговую систему в ходе периода регистрации поручений, начиная (для биржевой сделки с кодом расчетов В01-В30 с Расчетного дня, следующего за датой ее заключения, для внебиржевой сделки с кодом расчетов В01-В30 с Расчетного дня, следующего за датой регистрации данных о сделке в Клиринговой системе) до Даты прекращения ее исполнения.
- 21.4. Отчет на исполнение первой части сделки РЕПО с кодом расчетов S0-S2 может быть подан Участником клиринга в Клиринговую систему в ходе периода регистрации поручений (по первой части внебиржевой сделки РЕПО с кодом расчетов S0-S2 при условии регистрации данных о ней в Клиринговой системе), начиная с Даты исполнения первой части сделки РЕПО до Даты прекращения ее исполнения.
- 21.5. Отчет на исполнение второй части сделки РЕПО с кодом расчетов S0-S2, Z0 и Rb (при условии того, что первая часть сделки РЕПО уже прошла Процедуру контроля обеспечения), может быть подан Участников клиринга в Клиринговую систему в ходе периода регистрации поручений, начиная с Даты исполнения первой части сделки РЕПО до Даты прекращения исполнения второй части сделки РЕПО.
- 21.6. Отсутствие в Клиринговой системе информации об успешном проведении Процедуры контроля обеспечения по первой части сделки РЕПО ведет к невозможности регистрации Участниками клиринга, являющимися сторонами данной сделки, Отчетов на исполнение (Срочных отчетов на исполнение, Специальных отчетов на исполнение) второй части данной сделки РЕПО.
- 21.7. Отчет на исполнение сделки с ценными бумагами (первой или второй части сделки РЕПО), поданный Участником клиринга - покупателем, регистрируется в Клиринговой системе только при условии превышения (равенства) планового значения соответствующей позиции по денежным средствам данного Участника клиринга в момент подачи Отчета на исполнение, за вычетом соответствующих Ограничительных лимитов, величины(е) обязательства данного Участника клиринга по денежным средствам, возникшего по данной сделке (первой или второй части сделки РЕПО) (с учетом НКД).
- 21.8. Отчет на исполнение сделки с ценными бумагами (первой или второй части сделки РЕПО), поданный Участником клиринга - продавцом, регистрируется в

Клиринговой системе только при условии превышения (равенства) планового значения соответствующей позиции депо данного Участника клиринга в момент подачи Отчета на исполнение величины(е) обязательства данного Участника клиринга по ценным бумагам, возникшего по данной сделке (первой или второй части сделки РЕПО).

- 21.9. Отсутствие в Клиринговой системе зарегистрированного Отчета на исполнение по сделке с ценными бумагами с кодом расчетов В0-В30, первой части сделки РЕПО с ценными бумагами с кодом расчетов S0-S2, второй части сделки РЕПО с кодом расчетов S0-S2, Z0 и Rb в Дату ее исполнения по состоянию на момент окончания периода регистрации поручений в соответствии с пунктом 20.3 Правил клиринга признается нарушением со стороны Участника клиринга требований Правил клиринга, повлекшим неисполнение обязательств по данной сделке с ценными бумагами (первой или второй части сделки РЕПО) в Дату исполнения.
- 21.10. Участнику клиринга в Клиринговой системе раскрывается информация о регистрации Отчета на исполнение по сделке с ценными бумагами (первой или второй части сделки РЕПО), поданного в Клиринговую систему его контрагентом.
- 21.11. Участники клиринга вправе до окончания периода регистрации поручений отзывать зарегистрированные Отчеты на исполнение по сделкам с ценными бумагами (первой или второй части сделки РЕПО) и подавать новые Отчеты на исполнение по этим сделкам при условии, что указанные сделки (первые или вторые части сделки РЕПО) еще не прошли Процедуру контроля обеспечения в соответствии с пунктом 21.12 настоящей статьи.
- 21.12. При условии регистрации в Клиринговой системе Отчетов на исполнение по сделке с ценными бумагами (первой или второй части сделки РЕПО) обоих Участников клиринга, являющихся сторонами данной сделки, данная сделка (первая или вторая часть сделки РЕПО) считается обеспеченной (прошедшей Процедуру контроля обеспечения), и обязательства по данной сделке (первой или второй части сделки РЕПО) включаются в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов.
- 21.13. В случае прохождения второй частью биржевой сделки РЕПО Процедуры контроля обеспечения до Даты исполнения Клиринговый центр формирует и передает Бирже Отчет о досрочном исполнении сделок РЕПО.

Статья 22. Порядок подачи и регистрации поручений на внесение компенсационных взносов и поручений на отказ от компенсационных взносов

- 22.1. Для прохождения компенсационным взносом Процедуры контроля обеспечения Участник клиринга, имеющий обязательство по внесению компенсационного взноса, в Дату внесения компенсационного взноса формирует и подает в Клиринговую систему Поручение на внесение компенсационного взноса.
- 22.2. Поручение на внесение компенсационных взносов может быть подано в Клиринговую систему в ходе периода регистрации поручений в Дату внесения компенсационных взносов.
- 22.2.1. Поручение на внесение компенсационного взноса в виде денежных средств, поданное Участником клиринга, регистрируется в Клиринговой системе только при

условии превышения (равенства) планового значения соответствующей позиции по денежным средствам данного Участника клиринга в момент подачи Поручения, за вычетом соответствующих Ограничительных лимитов, величины(е) обязательства данного Участника клиринга по внесению компенсационного взноса.

Поручение на внесение компенсационного взноса в виде ценных бумаг, поданное Участником клиринга, регистрируется в Клиринговой системе только при условии превышения (равенства) планового значения соответствующей позиции депо данного Участника клиринга в момент подачи Поручения величины(е) обязательства данного Участника клиринга по внесению компенсационного взноса.

22.3. При условии регистрации в Клиринговой системе Поручения на внесение компенсационного взноса, поданного Участником клиринга, компенсационный взнос считается обеспеченным (прошедшим Процедуру контроля обеспечения), и обязательства по внесению данного компенсационного взноса включаются в Клиринговый пул для проведения расчетов по итогам торгов.

22.4. Участнику клиринга в Клиринговой системе раскрывается информация о регистрации Поручения на внесение компенсационного взноса, поданного в Клиринговую систему его контрагентом по соответствующей сделке.

22.5. Участник клиринга вправе отказаться от получения компенсационного взноса. Для этого Участники клиринга, являющиеся контрагентами по биржевой сделке РЕПО, до окончания периода регистрации поручений в Дату внесения компенсационного взноса формируют и подают в Клиринговую систему Поручения на отказ от компенсационного взноса.

Поручения на отказ от компенсационного взноса может быть подано при условии, что компенсационный взнос еще не прошел Процедуру контроля обеспечения в соответствии с пунктом 22.3 Правил клиринга.

При регистрации в Клиринговой системе Поручений на отказ от компенсационного взноса со стороны каждого из Участников клиринга – контрагентов по биржевой сделке РЕПО, внесение компенсационного взноса по данной сделке не осуществляется и факт неисполнения обязательств по внесению компенсационного взноса со стороны Участника клиринга, имеющего обязательство по внесению компенсационного взноса, не регистрируется.

22.6. Участнику клиринга в Клиринговой системе раскрывается информация о регистрации Поручения на отказ от компенсационного взноса, поданного в Клиринговую систему его контрагентом.

22.7. Отзыв Участником клиринга ранее зарегистрированного в Клиринговой системе Поручения на отказ от компенсационного взноса возможен только до момента регистрации его контрагентом в Клиринговой системе Поручения на отказ от компенсационного взноса.

Статья 23. Порядок подачи и регистрации Специальных отчетов на исполнение

23.1. Два Участника клиринга, являющиеся сторонами по сделкам, заключенным с кодами расчетов В0-В30, первой части сделки РЕПО с кодом расчетов S0-S2, второй части сделки РЕПО с кодом расчетов S0-S2, Z0 и Rb, обязательства по

которым могут быть исполнены в данный Расчетный день, могут использовать одновременную Процедуру контроля обеспечения по данным сделкам и компенсационным взносам, начисленным в соответствии с условиями данных сделок РЕПО (биржевых и внебиржевых).

Для этого Участники клиринга формируют и подают в Клиринговую систему Специальные отчеты на исполнение.

Специальный отчет на исполнение может быть подан в Клиринговую систему в ходе периода регистрации поручений.

- 23.2. По всем сделкам и компенсационным взносам, включенным в Специальный отчет на исполнение, Клиринговый центр для каждой позиции, входящей в состав Торгово-клиринговых счетов, указанных в сделках и компенсационных взносах, включенных в Специальный отчет на исполнение, рассчитывает условное двустороннее нетто-обязательство (нетто-требование) Участника клиринга по денежным средствам или ценным бумагам.

В целях Правил клиринга условное двустороннее нетто-обязательство (нетто-требование) Участника клиринга по денежным средствам определяется как отрицательная (положительная) разница между суммой требований и суммой обязательств Участника клиринга по денежным средствам по сделкам с кодами расчетов В0-В30, вторым частям сделок РЕПО с кодами расчетов Z0 и Rb, по первым и вторым частям сделок РЕПО с кодами расчетов S0-S2, а также по компенсационным взносам в виде денежных средств по биржевым и внебиржевым сделкам РЕПО, заключенным с одним контрагентом, отвечающих требованиям, указанным в пункте 23.1 Правил клиринга, включенным в Специальный отчет на исполнение.

В целях Правил клиринга условное двустороннее нетто-обязательство (нетто-требование) Участника клиринга по ценным бумагам определяется как отрицательная (положительная) разница между суммой требований и суммой обязательств Участника клиринга по ценным бумагам по сделкам с кодами расчетов В0-В30, вторым частям сделок РЕПО с кодами расчетов Z0 и Rb, по первым и вторым частям сделок РЕПО с кодами расчетов S0-S2, а также по компенсационным взносам в виде ценных бумаг по биржевым и внебиржевым сделкам РЕПО, заключенным с одним контрагентом, отвечающих требованиям, указанным в пункте 23.1 Правил клиринга, включенным в Специальный отчет на исполнение.

- 23.3. Специальный отчет на исполнение Участника клиринга, имеющего условное двустороннее нетто-обязательство по денежным средствам, регистрируется в Клиринговой системе только при условии превышения (равенства) планового значения соответствующей позиции по денежным средствам данного Участника клиринга в момент подачи Специального отчета на исполнение, за вычетом соответствующих Ограничительных лимитов, величины(е) условного двустороннего нетто-обязательства данного Участника клиринга по денежным средствам.

Специальный отчет на исполнение Участника клиринга, имеющего условное двустороннее нетто-обязательство по ценным бумагам, регистрируется в Клиринговой системе только при условии превышения (равенства) планового значения соответствующей позиции депо данного Участника клиринга в момент

подачи Специального отчета на исполнение величины(е) условного двустороннего нетто-обязательства данного Участника клиринга по ценным бумагам.

- 23.4. Участнику клиринга в Клиринговой системе раскрывается информация о регистрации Специального отчета на исполнение, поданного в Клиринговую систему его контрагентом.
- 23.5. Участники клиринга вправе до окончания периода регистрации поручений отзывать зарегистрированные Специальные отчеты на исполнение и подавать новые Специальные отчеты на исполнение при условии, что сделки и/или компенсационные взносы, включенные в Специальный отчет на исполнение, еще не прошли Процедуру контроля обеспечения в соответствии с подпунктом 23.6 Правил клиринга. Специальные отчеты, не прошедшие Процедуру контроля обеспечения до окончания периода регистрации поручений, после его окончания исключаются из Клиринговой системы.
- 23.6. При совпадении номеров сделок в зарегистрированных в Клиринговой системе Специальных отчетах на исполнение обоих Участников клиринга, являющихся сторонами сделок с кодами расчетов В0-В30, вторых частей сделок РЕПО с кодами расчетов Z0 и Rb, первых и вторых частей сделок РЕПО с кодами расчетов S0-S2, а также компенсационных взносов, включенных в Специальные отчеты на исполнение, указанные сделки (компенсационные взносы) считаются обеспеченными (прошедшими Процедуру контроля обеспечения), и обязательства по указанным сделкам и/или обязательства по внесению указанных компенсационных взносов включаются в Клиринговый пул для проведения расчетов по итогам торгов.

Статья 24. Порядок подачи и регистрации Срочных отчетов на исполнение

- 24.1. Два Участника клиринга, являющиеся сторонами по сделкам, заключенным с кодами расчетов В0-В30, первой части сделки РЕПО с кодом расчетов S0-S2, второй части сделки РЕПО с кодом расчетов S0-S2, Z0 и Rb, обязательства по которым могут быть исполнены в данный Расчетный день, могут использовать одновременную Процедуру контроля обеспечения по данным сделкам и компенсационным взносам, начисленным в соответствии с условиями данных сделок РЕПО (биржевых и внебиржевых), после прохождения которой эти сделки и/или компенсационные взносы считаются обеспеченными, и обязательства по данным сделкам и/или обязательства по внесению данных компенсационных взносов включаются в Клиринговый пул для расчетов в ходе торгов, порядок проведения которых определен в статье 28 Правил клиринга.

Для этого Участники клиринга формируют и подают в Клиринговую систему Срочные отчеты на исполнение.

Срочный отчет на исполнение может быть подан в Клиринговую систему в ходе периода регистрации поручений.

- 24.2. Клиринговый центр для каждой позиции, входящей в состав Торгово-клиринговых счетов, указанных в сделках и компенсационных взносах, включенных в Срочный отчет на исполнение, рассчитывает нетто-обязательство (нетто-требование) Участника клиринга по денежным средствам или ценным бумагам.

24.3. Нетто-обязательство (нетто-требование) Участника клиринга по денежным средствам рассчитывается по формуле:

НОД = **СТ** - **СО**, где:

НОД - нетто-обязательство (нетто-требование) Участника клиринга по денежным средствам;

СТ - сумма требований, а **СО** – сумма обязательств Участника клиринга по денежным средствам по:

- сделкам с кодом расчетов В0-В30, включенным в Срочный отчет на исполнение;
- первым частям сделок РЕПО с кодом расчетов S0-S2, включенным в Срочный отчет на исполнение;
- вторым частям обеспеченных сделок РЕПО с кодом расчетов Z0, S0-S2 или Rb, включенным в Срочный отчет на исполнение;
- компенсационным взносам в денежных средствах, включенным в Срочный отчет на исполнение.

Отрицательное значение НОД означает нетто-обязательство Участника клиринга по денежным средствам, положительное значение НОД — нетто-требование Участника клиринга по денежным средствам.

24.4. Нетто-обязательство (нетто-требование) Участника клиринга по ценным бумагам, рассчитывается по формуле:

НОЦ = **СТЦ** - **СОЦ**, где:

НОЦ - нетто-обязательство (нетто-требование) Участника клиринга по ценной бумаге;

СТЦ - сумма требований, а **СОЦ** – сумма обязательств Участника клиринга по соответствующей ценной бумаге по:

- обеспеченным сделкам с кодом расчетов В0-В30, включенным в Срочный отчет на исполнение;
- первым частям обеспеченных сделок РЕПО с кодом расчетов S0-S2, включенным в Срочный отчет на исполнение;
- вторым частям обеспеченных сделок РЕПО с кодом расчетов Z0, S0-S2 или Rb, включенным в Срочный отчет на исполнение;
- компенсационным взносам в ценных бумагах, включенным в Срочный отчет на исполнение.

Отрицательное значение НОЦ означает нетто-обязательство Участника клиринга по ценной бумаге, положительное значение НОЦ — нетто-требование Участника клиринга по ценной бумаге.

24.5. Срочный отчет на исполнение Участника клиринга, имеющего нетто-обязательство по денежным средствам, регистрируется в Клиринговой системе только при условии превышения (равенства) в момент подачи Срочного отчета на исполнение планового значения соответствующей позиции по денежным средствам данного Участника клиринга, за вычетом соответствующих Ограничительных лимитов, величины(е) данного нетто-обязательства по денежным средствам.

- 24.6. Срочный отчет на исполнение Участника клиринга, имеющего нетто-обязательство по ценным бумагам, регистрируется в Клиринговой системе только при условии неперевышения в момент подачи Срочного отчета на исполнение данного нетто-обязательства по ценным бумагам меньшей из двух величин: планового или начального значения соответствующей позиции по ценным бумагам данного Участника клиринга.
- 24.7. Участнику клиринга в Клиринговой системе раскрывается информация о регистрации Срочного отчета на исполнение, поданного в Клиринговую систему его контрагентом.
- 24.8. Участники клиринга вправе до окончания периода регистрации поручений отзывать зарегистрированные Срочные отчеты на исполнение и подавать новые Срочные отчеты на исполнение при условии, что сделки и/или компенсационные взносы, включенные в Срочный отчет на исполнение, еще не прошли Процедуру контроля обеспечения в соответствии с пунктом 24.9 Правил клиринга. Срочные отчеты, не прошедшие Процедуру контроля обеспечения до окончания периода регистрации поручений, после его окончания исключаются из Клиринговой системы.
- 24.9. При совпадении номеров сделок в зарегистрированных в Клиринговой системе Срочных отчетах на исполнение обоих Участников клиринга, являющихся сторонами сделок с кодами расчетов B0-B30, вторых частей сделок РЕПО с кодами расчетов Z0 и Rb, первых и вторых частей сделок РЕПО с кодами расчетов S0-S2, а также компенсационных взносов, включенных в Срочные отчеты на исполнение, указанные сделки (компенсационные взносы) считаются обеспеченными (прошедшими Процедуру контроля обеспечения), и нетто-обязательства (нетто-требования) Участников клиринга по денежным средствам или ценным бумагам, рассчитанные по указанным сделкам и/или компенсационным взносам, включаются в Клиринговый пул для проведения расчетов в ходе торгов.

РАЗДЕЛ V. ПОРЯДОК ПРОВЕДЕНИЯ КЛИРИНГА

Статья 25. Порядок проведения клиринговых сессий

25.1. До начала торгов в установленное Временным регламентом время Клиринговый центр проводит клиринговую сессию, в ходе которой Клиринговый центр:

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

25.2. Клиринговый центр с использованием Системы торгов передает Бирже информацию об установленных риск-параметрах.

25.3. Размер обязательства Участника клиринга и Клирингового центра по уплате Гарантийного перевода по Счету обеспечения T+ рассчитывается по обязательствам по Сделкам с частичным обеспечением, Дата исполнения которых отстоит от текущей даты на три Расчетных дня, по формуле:

$$\text{COM_RUB} = \sum_i (\sum_j \text{OBL}_{ij} \times (\text{Rc}_j + \text{RepoRate}_{ij}) + \text{OBL_RUB}_i) + \text{RET_RUB}, \text{ где}$$

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

OBL_{ij} – Нетто-обязательства / Нетто-требования Участника клиринга (с учетом знака) по j-м ценным бумагам по Сделкам с частичным обеспечением с i-ой Датой исполнения, учитываемые по Разделам обеспечения, относящимся к тому же Расчетному коду, что и Счет обеспечения T+, по которому рассчитано обязательство по уплате Гарантийного перевода;

OBL_RUB_i - Нетто-обязательство / Нетто-требование Участника клиринга (с учетом знака) в российских рублях по Сделкам с частичным обеспечением с i-ой Датой исполнения, учитываемое по Счету обеспечения T+;

Rc_j – Расчетная цена j-ой ценной бумаги, рассчитанная в предыдущий

Расчетный день (в российских рублях);

$RepoRate_{ij}$ - Расчетная ставка РЕПО, установленная в предыдущий Расчетный день для i -ой Даты исполнения и j -ой ценной бумаги (в российских рублях);

RET_RUB – размер непрекращенного обязательства по возврату Гарантийных переводов (с учетом знака), рассчитанный в предыдущий Расчетный день по Расчетному коду;

\sum_i – сумма по Датам исполнения;

\sum_j - сумма по ценным бумагам.

Если значение COM_RUB отрицательное, это означает наличие обязанности Участника клиринга по уплате Гарантийного перевода по Расчетному коду Клиринговому центру в размере, равном абсолютному значению COM_RUB , если положительное – наличие требования Участника клиринга к Клиринговому центру по получению Гарантийного перевода по Счету обеспечения $T+$ в размере, равном значению COM_RUB .

Информация о размере обязательства Участника клиринга по уплате Гарантийного перевода по Счету обеспечения $T+$ указывается в Отчете об обязательствах по Сделкам с частичным обеспечением.

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

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

RET_RUB_{new} – размер обязательства по возврату Гарантийных переводов по Счету обеспечения $T+$ (с учетом знака);

RET_RUB – размер непрекращенного обязательства по возврату Гарантийных переводов по Счету обеспечения $T+$ (с учетом знака), рассчитанный в предыдущий Расчетный день;

COM_RUB – размер обязательства (с учетом знака) по уплате Гарантийного перевода по Счету обеспечения $T+$, рассчитанный в ходе текущей клиринговой сессии.

Если значение RET_RUB_{new} отрицательное, это означает наличие обязанности Участника клиринга по возврату Клиринговому центру Гарантийных переводов по Счету обеспечения $T+$ в размере, равном абсолютному значению RET_RUB_{new} , если положительное – наличие обязанности Клирингового центра по возврату Участнику клиринга Гарантийных переводов по Счету обеспечения $T+$ в размере, равном значению RET_RUB_{new} .

- 25.5. Обязательство Участника клиринга по уплате Гарантийного перевода по Счету обеспечения $T+$ исполняется за счет Обеспечения Участника клиринга в российских рублях, учитываемого по тому же Счету обеспечения $T+$.

В результате исполнения требования Участника клиринга по получению Гарантийного перевода по Счету обеспечения $T+$ увеличивается Обеспечение Участника клиринга в российских рублях, учитываемого по тому же Счету обеспечения $T+$.

- 25.6. Если Обеспечения Участника клиринга в российских рублях, учитываемого по Счету обеспечения $T+$, недостаточно для исполнения обязательства Участника клиринга по уплате Гарантийного перевода по Счету обеспечения $T+$ в полном объеме, неисполненное обязательство (неисполненная часть обязательства)

Участника клиринга по уплате Гарантийного перевода по Счету обеспечения Т+ учитывается Клиринговым центром по Расчетному коду как Задолженность по гарантийным переводам по Счету обеспечения Т+ Участника клиринга перед Клиринговым центром.

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

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

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

25.7. Порядок действий Клирингового центра при неисполнении Участником клиринга Задолженности по гарантийным переводам в срок, установленный в пункте 25.6 Правил клиринга, определен в статье 29 Правил клиринга.

25.8. Проценты на сумму уплаченных и/или полученных Гарантийных переводов не начисляются и не уплачиваются.

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

25.10. Маржинальное требование должно быть исполнено Участником клиринга путем внесения денежных средств и/или ценных бумаг в Обеспечение в порядке, установленном статьей 25 Правил клиринга.

Маржинальное требование может быть также прекращено полностью или в части в случаях:

- исполнения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением с наступившей Датой исполнения;
- заключения Сделок с частичным обеспечением, приводящих к увеличению Единого лимита Участника клиринга;

25.11. Маржинальное требование по Расчетному коду, возникшее у Участника клиринга, считается прекращенным в момент времени, когда Единый лимит Участника клиринга по такому Расчетному коду станет неотрицательным.

25.12. В случае неисполнения Участником клиринга Маржинального требования по Расчетному коду в срок, установленный Временным регламентом, между Клиринговым центром и Участником клиринга, не исполнившим Маржинальное требование, без подачи заявок заключаются сделки купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов Yn и/или сделки РЕПО с кодом расчетов Y0/Yn, приводящие к увеличению Единого лимита данного Участника клиринга по Расчетному коду.

Указанные сделки заключаются до момента исполнения Маржинального требования Участника клиринга по Расчетному коду.

Указанные сделки не заключаются в случае, если у Участника клиринга, не исполнившего Маржинальное требование, отозвана (аннулирована) лицензия Банка

России на осуществление банковских операций или в случае, если в отношении такого Участника клиринга действуют иные обстоятельства, предусмотренные пунктом 11.1 Правил клиринга.

Сделки с частичным обеспечением, заключенные в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга, учитываются при расчете Нетто-обязательств / Нетто-требований Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам по Сделкам с ценными бумагами с соответствующими Датами исполнения.

Клиринговый центр с использованием Системы торгов уведомляет Биржу о необходимости заключения сделок купли-продажи ценных бумаг и/или сделок РЕПО в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга и об условиях указанных сделок.

Статья 26. Порядок внесения и возврата Обеспечения

26.1. Внесение Обеспечения в российских рублях Участником клиринга возможно двумя способами:

- 1) путем перевода денежных средств на клиринговый банковский счет Клирингового центра, открытый в Расчетной организации и предназначенный для учета индивидуального клирингового обеспечения;
- 2) путем перевода денежных средств со Счетов обеспечения T0 на Счета обеспечения T+ на основании распоряжения на внесение денежных средств в Обеспечение, поданного Участником клиринга с использованием Клиринговой системы.

26.2. Внесение Обеспечения в ценных бумагах возможно двумя способами:

- 1) путем перечисления ценных бумаг на Раздел T+ на основании поручения, поданного владельцем торгового счета депо в Расчетный депозитарий
- 2) путем перечисления ценных бумаг с Раздела T0 на Раздел T+ на основании распоряжения на внесение ценных бумаг в Обеспечение, поданного Участником клиринга с использованием Клиринговой системы.

26.3. В качестве Обеспечения могут быть внесены ценные бумаги, включенные в Клиринговый лист для Сделок с частичным обеспечением, и иные ценные бумаги.

Перечень иных ценных бумаг, внесение которых в Обеспечение возможно, устанавливается решением Клирингового центра.

26.4. Перевод денежных средств на клиринговый банковский счет Клирингового центра, открытый в Расчетной организации и предназначенный для учета индивидуального клирингового обеспечения, с целью их учета в качестве Обеспечения должен осуществляться с обязательным указанием в назначении платежа соответствующего Расчетного кода Участника клиринга.

26.4.1. Клиринговый центр учитывает в Клиринговой системе денежные средства, переведенные Участником клиринга на клиринговый банковский счет Клирингового центра, открытый в Расчетной организации и предназначенный для учета индивидуального клирингового обеспечения, в качестве Обеспечения Участника клиринга по Счету обеспечения T+, соответствующему Расчетному коду, указанному в назначении платежа, и увеличивает Единый лимит Участника

клиринга по Расчетному коду, указанному в назначении платежа, с учетом перечисленной суммы денежных средств.

- 26.5. Распоряжение на внесение денежных средств / ценных бумаг в Обеспечение, подаваемое Участником клиринга с использованием Клиринговой системы, содержит указание на Торгово-клиринговый счет, по которому должна быть исполнена данная операция, и сумму денежных средств / количество ценных бумаг, которые необходимо внести в Обеспечение.
- 26.5.1. Распоряжение на внесение денежных средств в Обеспечение, поданное Участником клиринга, исполняется за счет денежных средств, учитываемых по Счету обеспечения T0, в случае достаточности планового значения позиции по денежным средствам по Счету обеспечения T0, открытому к Торговому счету, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в распоряжении.
- 26.5.2. Распоряжение на внесение ценных бумаг в Обеспечение, поданное Участником клиринга, исполняется за счет ценных бумаг, учитываемых на Разделе T0, в случае достаточности планового значения позиции по ценным бумагам по Разделу T0, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в распоряжении.
- 26.5.3. Частичное исполнение распоряжения на внесение денежных средств / ценных бумаг в Обеспечение невозможно.
- 26.5.4. В случае положительного результата проверки возможности исполнения распоряжения на внесение денежных средств / ценных бумаг в Обеспечение, в Клиринговой системе незамедлительно уменьшается соответствующее значение позиции по денежным средствам / ценным бумагам по Счету обеспечения T0 / Разделу T0 и увеличивается сумма денежных средств / количество ценных бумаг, учитываемых в качестве Обеспечения по Счету обеспечения T+ / Разделу T+ Участника клиринга.
- 26.5.5. Обязательства по перечислению денежных средств со Счетов обеспечения T0 на Счета обеспечения T+ и/или по перечислению ценных бумаг с Разделов T0 на Разделы T+ по распоряжениям на внесение денежных средств / ценных бумаг в Обеспечение, прошедшим проверку возможности их исполнения в соответствии с подпунктами 26.5.1, 26.5.2 Правил клиринга, включаются в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов по сделкам с центральным контрагентом и учитываются при определении нетто-обязательств / нетто-требований Участников клиринга по денежным средствам / ценным бумагам в соответствии со статьей 31 Правил клиринга.
- 26.6. Участник клиринга может перевести денежные средства, учитываемые в качестве Обеспечения, между своими Счетами обеспечения T+, подав в Клиринговый центр Заявление о переводе денежных средств в электронном виде с использованием Клиринговой системы или в форме электронного документа.
- Данное заявление не принимается Клиринговым центром к исполнению, если сумма денежных средств в российских рублях, указанная Участником клиринга в заявлении, превышает сумму денежных средств, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга по Счету обеспечения T+, с которого денежные средства должны быть списаны, или если Единый лимит Участника клиринга по Счету обеспечения T+, с которого денежные средства, учитываемые в качестве Обеспечения Участника клиринга, должны быть списаны, в результате такого списания станет отрицательным, или отрицательный Единый лимит Участника

клиринга по Расчетному коду, соответствующему Счету обеспечения Т+, в результате такого списания уменьшится.

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

- 26.7. Обеспечение в российских рублях используется в следующей очередности:
- 1) для погашения Задолженности Участника клиринга перед Клиринговым центром;
 - 2) для погашения Задолженности по гарантийным переводам Участника клиринга перед Клиринговым центром;
 - 3) для обеспечения исполнения обязательств Участника клиринга по Сделкам с частичным обеспечением;
 - 4) для исполнения обязательств Участника клиринга в российских рублях по Сделкам с частичным обеспечением с наступившей Датой исполнения;
 - 5) для исполнения обязательства Участника клиринга по возврату Гарантийных переводов.
- 26.8. Обеспечение в ценных бумагах используется в следующей очередности:
- 1) для обеспечения исполнения обязательств Участника клиринга по Сделкам с частичным обеспечением;
 - 2) для исполнения обязательств Участника клиринга по передаче ценных бумаг по Сделкам с частичным обеспечением с наступившей Датой исполнения.
- 26.9. После перечисления Участником клиринга денежных средств на счет Клирингового центра, открытый в Расчетной организации, и учета их в качестве Обеспечения по Счету обеспечения Т+, у Клирингового центра возникает обязательство вернуть денежные средства Участнику клиринга в размере, определяемом в соответствии с пунктами 26.11, 26.12 Правил клиринга.
- 26.10. Возврат Клиринговым центром Участнику клиринга денежных средств, учитываемых в качестве Обеспечения, осуществляется после прекращения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением в соответствии со статьей 28 Правил клиринга, или на основании Запроса о возврате денежных средств из Обеспечения.
- Возврат Клиринговым центром Участнику клиринга ценных бумаг, учитываемых в качестве Обеспечения, осуществляется на основании Запроса о возврате ценных бумаг из Обеспечения или на основании поручения на списание ценных бумаг с Раздела Т+, поданного в Расчетный депозитарий. Исполнение указанного поручения будет осуществляться в порядке, установленном статьей 34 Правил клиринга.
- 26.10.1. Денежные средства, учитываемые в качестве Обеспечения по Счету обеспечения Т+ Участника клиринга, возвращаются на Торговый счет, к которому открыт Счет обеспечения Т+, или на счет, предварительно зарегистрированный в Клиринговом центре (далее – Счет для возврата денежных средств).

Регистрация Счета для возврата денежных средств осуществляется на основании Заявления на регистрацию Счета для возврата денежных средств, предоставляемого Участником клиринга в Клиринговый центр в форме электронного документа.

В случае если владельцем Счета для возврата денежных средств является Клиент Участника клиринга, Участник клиринга обязан предоставить Клиринговому центру Письмо об идентификации клиента.

26.10.2. Ценные бумаги, учитываемые в качестве Обеспечения по Разделу Т+, возвращаются на Раздел Т0, соответствующий Разделу Т+.

26.10.3. Запрос о возврате денежных средств из Обеспечения содержит указание на Расчетный код Участника клиринга, валюту и сумму денежных средств, которые необходимо вернуть.

Запрос о возврате ценных бумаг из Обеспечения содержит указание на Раздел Т+ и количество ценных бумаг, которые необходимо вернуть.

Запрос о возврате денежных средств из Обеспечения направляется Участником клиринга в электронном виде с использованием Клиринговой системы или в форме электронного документа. В случае если между Участником клиринга и Клиринговым центром предусмотрен обмен сообщениями по системе S.W.I.F.T., Участник клиринга вправе направить Запрос о возврате денежных средств из Обеспечения в форме сообщения по системе S.W.I.F.T.

Запрос о возврате ценных бумаг из Обеспечения направляется Участником клиринга в электронном виде с использованием Клиринговой системы.

Сроки предоставления Запросов о возврате денежных средств / ценных бумаг из Обеспечения установлены Временным регламентом.

При предоставлении Запроса о возврате денежных средств / ценных бумаг из Обеспечения позднее времени, указанного во Временном регламенте, Запрос о возврате денежных средств / ценных бумаг из Обеспечения не исполняется.

Запрос о возврате денежных средств / ценных бумаг из Обеспечения действует в день его предоставления.

Запрос о возврате денежных средств / ценных бумаг из Обеспечения, полученный в сроки, установленные Временным регламентом, исполняется после его получения при соблюдении условия, указанного в пункте 26.11 Правил клиринга.

26.11. Возврат Клиринговым центром Участнику клиринга денежных средств / ценных бумаг в соответствии с Запросом о возврате денежных средств / ценных бумаг из Обеспечения исполняется в случае, если Единый лимит по Счету обеспечения Т+, соответствующему Расчетному коду Участника клиринга, указанному в запросе, или Единый лимит по Расчетному коду, к которому относится Раздел Т+, указанный в запросе, рассчитанный без учета возвращаемой суммы денежных средств / количества ценных бумаг соответственно, не станет отрицательным.

26.12. Возврат Клиринговым центром Участнику клиринга денежных средств после прекращения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением в соответствии со статьей 28 Правил клиринга исполняется в сумме, без учета которого Единый лимит по Расчетному коду Участника клиринга не станет отрицательным.

- 26.13. Обеспечение Участника клиринга по Счету обеспечения T+ / Разделу T+ уменьшается, а плановые значения позиций по денежным средствам / ценным бумагам по Счету обеспечения T0 / Разделу T0 увеличиваются на возвращаемую сумму денежных средств / количество ценных бумаг сразу после проверки возможности исполнения Запроса о возврате денежных средств / ценных бумаг из Обеспечения в соответствии с пунктом 26.11 Правил клиринга.
- 26.13.1. Обязательства по перечислению денежных средств со Счета обеспечения T+ на Счет обеспечения T0 и/или по перечислению ценных бумаг с Разделов T+ на Разделы T0, соответствующие Запросам о возврате денежных средств / ценных бумаг из Обеспечения, прошедшим проверку возможности их исполнения в соответствии с подпунктами 26.11 Правил клиринга, включаются в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов по сделкам с центральным контрагентом и учитываются при определении нетто-обязательств / нетто-требований Участников клиринга по денежным средствам / ценным бумагам в соответствии со статьей 31 Правил клиринга.
- 26.14. Клиринговый центр вправе осуществить в любое время зачет денежных требований Участника клиринга по возврату ему денежных средств, учитываемых в качестве Обеспечения, с денежными требованиями Клирингового центра к этому Участнику клиринга.
- 26.15. Информация о размере Обеспечения и об изменении размера Обеспечения передается Участнику клиринга в составе Отчета об обеспечении.
Отчет об обеспечении направляется Участнику клиринга в форме электронного документа в срок, установленный Временным регламентом.
- 26.16. Клиринговый центр осуществляет ежегодную сверку остатков Обеспечения на Счетах обеспечения T+ Участника клиринга в российских рублях путем направления соответствующего уведомления Участнику клиринга не позднее десятого рабочего дня года, следующего за отчетным годом.
Если в течение десяти рабочих дней после направления Участнику клиринга указанного уведомления, Участник клиринга не уведомит Клиринговый центр о наличии расхождений, остатки Обеспечения на Счетах обеспечения T+ Участника клиринга в российских рублях считаются подтвержденными.

Статья 27. Порядок внесения и возврата взноса в Гарантийный фонд

- 27.1. Для учета денежных средств в качестве взноса в Гарантийный фонд Участник клиринга обязан перечислить денежные средства в российских рублях в сумме, не меньшей установленного Клиринговым центром размера взноса в Гарантийный фонд, на клиринговый банковский счет Клирингового центра, открытый в Расчетной организации и предназначенный для учета коллективного клирингового обеспечения рынка ценных бумаг, с обязательным указанием в назначении платежа слова «фонд» и после него без пробелов Расчетного кода Участника клиринга, присвоенного для учета взноса в Гарантийный фонд.
Присвоение Участнику клиринга Расчетного кода для учета взноса в Гарантийный фонд осуществляется Клиринговым центром на основании Заявления о присвоении Расчетного кода для учета взноса в Гарантийный фонд, предоставленного Клиринговому центру в бумажной форме или в форме электронного документа.

В случае внесения в Гарантийный фонд денежных средств в сумме, превышающей установленный Клиринговым центром размер взноса в Гарантийный фонд, в качестве взноса в Гарантийный фонд данного Участника клиринга учитываются денежные средства в сумме, равной установленному Клиринговым центром размеру взноса в Гарантийный фонд.

Денежные средства Участника клиринга, перечисленные на клиринговый банковский счет Клирингового центра, предназначенный для учета средств коллективного клирингового обеспечения рынка ценных бумаг, в сумме, превышающей установленный Клиринговым центром размер взноса в Гарантийный фонд, возвращаются Клиринговым центром Участнику клиринга по письменному требованию Участника клиринга.

27.2. После перечисления Участником клиринга денежных средств на клиринговый банковский счет Клирингового центра, открытый в Расчетной организации и предназначенный для учета коллективного клирингового обеспечения рынка ценных бумаг, 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.

27.3. Возврат Участнику клиринга его взноса в Гарантийный фонд осуществляется при прекращении Договора об оказании клиринговых услуг в соответствии с пунктом 3.12 Правил клиринга.

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

При получении от Участника клиринга Заявления о возврате взноса в Гарантийный фонд Клиринговый центр незамедлительно информирует об этом Биржу с целью прекращения допуска Участника клиринга к заключению Сделок с частичным обеспечением.

Заявление Участника клиринга о возврате взноса в Гарантийный фонд исполняется Клиринговым центром в случае отсутствия у Участника клиринга Задолженности и/или неисполненных обязательств по Сделкам с частичным обеспечением не позднее Расчетного дня, следующего за датой получения указанного заявления.

Статья 28. Порядок исполнения / прекращения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением и обязательств по возврату Гарантийных переводов

28.1. В срок, установленный Временным регламентом, Клиринговый центр:

28.1.1. рассчитывает обязательство каждого Участника клиринга и Клирингового центра по возврату Гарантийных переводов с наступившей Датой исполнения по каждому Счету обеспечения T+ по формуле:

$$RET_RUB = -(\sum_j OBL_j \times Rc_j + OBL_RUB), \text{ где}$$

RET_RUB – размер обязательства Участника клиринга или Клирингового центра по возврату Гарантийных переводов по Счету обеспечения T+ (в российских рублях);

OBL_j – Нетто-обязательства / Нетто-требования Участника клиринга (с учетом знака) по j -м ценным бумагам по Сделкам с частичным обеспечением с наступившей Датой исполнения, учитываемые по Разделам Т+, относящимся к тому же Расчетному коду, что и Счет обеспечения Т+, по которому рассчитывается обязательство по возврату Гарантийных переводов, рассчитанные без учета Сделок с частичным обеспечением, обязательства по уплате Гарантийных переводов по которым в соответствии с Правилами клиринга не возникают;

OBL_RUB - Нетто-обязательство / Нетто-требование Участника клиринга (с учетом знака) в российских рублях по Сделкам с частичным обеспечением с наступившей Датой исполнения, учитываемое по Счету обеспечения Т+, рассчитанное без учета Сделок с частичным обеспечением, обязательства по уплате Гарантийных переводов по которым в соответствии с Правилами клиринга не возникают;

Rc_j – Расчетная цена j -ой ценной бумаги, рассчитанная в день Т-4, где Т – текущий Расчетный день (в российских рублях);

\sum_j - сумма по ценным бумагам.

Если значение RET_RUB отрицательное, это означает наличие обязанности Участника клиринга по возврату Клиринговому центру Гарантийных переводов по Расчетному коду в размере, равном абсолютному значению RET_RUB , если положительное – наличие обязанности Клирингового центра по возврату Участнику клиринга Гарантийных переводов по Счету обеспечения Т+ в размере, равном значению RET_RUB .

28.1.2. включает в Клиринговый пул по Сделкам с частичным обеспечением:

- обязательства и требования Участника клиринга и Клирингового центра по денежным средствам и ценным бумагам по Сделкам с частичным обеспечением с наступившей Датой исполнения;
- обязательства / требования Участника клиринга по возврату Гарантийных переводов, определенные в соответствии с пунктом 28.1.1 Правил клиринга;
- обязательства / требования Участника клиринга и Клирингового центра по Сделкам РЕПО Клирингового центра и/или Договорам займа Клирингового центра, заключенным в соответствии с пунктом 29.5 Правил клиринга;
- обязательства по передаче / требования по получению Дохода, определенные в соответствии со статьей 36 Правил клиринга;

28.1.3. зачитывает встречные однородные обязательства и требования Участника клиринга и Клирингового центра по денежным средствам и ценным бумагам по Сделкам с частичным обеспечением с наступившей Датой исполнения, обязательства по которым учитываются по определенному Счету обеспечения Т+ / Разделу Т+, обязательства / требования Участника клиринга по возврату Гарантийных переводов, учитываемые по тому же Счету обеспечения Т+ и определенные в соответствии с пунктом 28.1.1 Правил клиринга, обязательства по передаче / требования по получению Дохода, определенные в соответствии со статьей 36 Правил клиринга, а в части, в которой обязательства и требования не были зачтены – определяет Итоговые нетто-обязательства и/или Итоговые нетто-требования по денежным средствам / ценным бумагам каждого Участника клиринга по каждому Счету обеспечения Т+ / Разделу Т+;

- 28.1.4. формирует и передает Участникам клиринга отчеты, содержащие информацию об Итоговых нетто-обязательствах / Итоговых нетто-требованиях по денежным средствам / ценным бумагам.
- 28.2. Участник клиринга обязан исполнить свои Итоговые нетто-обязательства по денежным средствам или ценным бумагам до времени, установленного Временным регламентом.
- 28.3. Клиринговый центр исполняет Итоговые нетто-требования Участника клиринга, учитываемые по Счету обеспечения T+ / Разделу T+, относящемуся к Расчетному коду, при условии исполнения Участником клиринга своих Итоговых нетто-обязательств, учитываемых по тому же Счету обеспечения T+ / по всем Разделам T+, относящимся к тому же Расчетному коду.
- 28.4. Для исполнения Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам, учитываемого по Счету обеспечения T+ / Разделу T+, используется Обеспечение Участника клиринга в соответствующих денежных средствах / ценных бумагах, внесенное Участником клиринга в порядке, определенном статьей 25 Правил клиринга, учитываемое по тому же Счету обеспечения T+ / Разделу T+. Обеспечение, учитываемое по другим Счетам обеспечения T+ / Разделам T+ этого же Участника клиринга, не используется.
- 28.4.1. Если Обеспечения в денежных средствах / ценных бумагах, учитываемого по Счету обеспечения T+ / Разделу T+, недостаточно для исполнения Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам, учитываемого по Счету обеспечения T+ / Разделу T+, Клиринговый центр на недостающую сумму денежных средств / недостающее количество соответствующих ценных бумаг формирует в Клиринговой системе распоряжение на внесение денежных средств / ценных бумаг в Обеспечение, которое исполняется в порядке, аналогичном порядку, определенному пунктом 26.5 Правил клиринга.
- Указанное в настоящем пункте Правил клиринга распоряжение Клирингового центра не формируется в случае, если Участником клиринга в соответствии с пунктом 18.1.5 Правил клиринга предоставлено Заявление о порядке использования денежных средств и ценных бумаг, в соответствии с которым Участник клиринга дает указание Клиринговому центру не перечислять денежные средства / ценные бумаги со Счетов обеспечения T0 на Счета обеспечения T+ / с Разделов T0 на Разделы T+ при исполнении обязательств по Сделкам с частичным обеспечением.
- 28.4.2. Если в результате действий, определенных в пункте 28.4.1 Правил клиринга, недостаточность Обеспечения Участника клиринга для исполнения соответствующего Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам и/или ценным бумагам сохраняется, данный Участник клиринга признается Недобросовестным участником клиринга, и Клиринговый центр выполняет действия, направленные на урегулирование указанных неисполненных обязательств, в порядке, определенном статьей 29 Правил клиринга.
- 28.5. В случае достаточности Обеспечения в денежных средствах / ценных бумагах для исполнения Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам и/или по итогам урегулирования неисполненных

обязательств по Сделкам с частичным обеспечением в соответствии со статьей 29 Правил клиринга, Клиринговый центр зачитывает Итоговое нетто-обязательство Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам, учитываемое по Счету обеспечения T+ / Разделу T+, с требованием Участника клиринга по возврату денежных средств в российских рублях / соответствующих ценных бумаг, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга по тому же Счету обеспечения T+ / Разделу T+.

- 28.5.1. Итоговое нетто-обязательство Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам, учитываемое по Счету обеспечения T+ / Разделу T+, считается исполненным, если размер Обеспечения Участника клиринга в соответствующих денежных средствах / ценных бумагах по тому же Счету обеспечения T+ / Разделу T+ не меньше, чем Итоговое нетто-обязательство Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам, учитываемое по Счету обеспечения T+ / Разделу T+.

При этом размер Обеспечения Участника клиринга в соответствующих денежных средствах / ценных бумагах по Счету обеспечения T+ / Разделу T+ уменьшается на сумму такого исполненного Итогового нетто-обязательства.

- 28.5.2. Если размер Обеспечения Участника клиринга в российских рублях по Счету обеспечения T+ меньше, чем Итоговое нетто-обязательство Участника клиринга по денежным средствам в российских рублях, учитываемое по тому же Счету обеспечения T+, разность между Итоговым нетто-обязательством Участника клиринга по денежным средствам в российских рублях по Счету обеспечения T+ и размером Обеспечения Участника клиринга в российских рублях по Счету обеспечения T+ учитывается как Задолженность Участника клиринга перед Клиринговым центром по Счету обеспечения T+, а размер Обеспечения Участника клиринга в российских рублях по Счету обеспечения T+ устанавливается равным нулю.

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

Информация о наличии у Участника клиринга Задолженности и ее размере передается Участнику клиринга в составе отчета «Требование о погашении задолженности», направляемом Участнику клиринга в соответствии с пунктом 25.6 Правил клиринга.

- 28.5.3. Если Задолженность Участника клиринга не погашена в установленные Временным регламентом сроки, Клиринговый центр использует средства Гарантийного фонда в порядке, определенном статьей 30 Правил клиринга.

- 28.6. Итоговое нетто-требование Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам, учитываемое по Счету обеспечения T+ / Разделу T+, прекращается возникновением обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга соответствующих денежных средств / ценных бумаг, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга по тому же Счету обеспечения T+ / Разделу T+, в размере Итогового нетто-требования по денежным средствам / ценным бумагам, учитываемого по Счету обеспечения T+ / Разделу T+.

При этом размер Обеспечения Участника клиринга в соответствующих денежных средствах / ценных бумагах по Счету обеспечения T+ / Разделу T+ увеличивается на сумму такого прекращенного Итогового нетто-требования.

28.6.1. После прекращения Итогового нетто-требования Участника клиринга по денежным средствам обязательство Клирингового центра по возврату Участнику клиринга денежных средств в российских рублях, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга по Счету обеспечения T+, зачитывается с обязательством Участника клиринга по погашению его Задолженности по гарантийным переводам и Задолженности по сделкам перед Клиринговым центром в российских рублях, учитываемым по Счету обеспечения T+ (в случае наличия у Участника клиринга таких обязательств).

При этом размер Обеспечения Участника клиринга в российских рублях по Счету обеспечения T+ уменьшается на сумму Задолженности по гарантийным переводам Участника клиринга, а затем - Задолженности по сделкам Участника клиринга, учитываемым по тому же Счету обеспечения T+.

28.6.2. После выполнения действий, указанных в подпункте 28.6.1 Правил клиринга, Клиринговый центр:

- 1) увеличивает плановое значение позиции по денежным средствам по Счету обеспечения T0, соответствующему Счету обеспечения T+, на сумму прекращенного Итогового нетто-требования Участника клиринга по денежным средствам, учитываемого по Счету обеспечения T+, но не превышающую сумму Обеспечения Участника клиринга в денежных средствах по тому же Счету обеспечения T+, и при условии, что изъятие этой суммы из Обеспечения не приведет к возникновению у Участника клиринга отрицательного Единого лимита по Расчетному коду, соответствующему Счету обеспечения T+, либо на максимально возможную сумму, не превышающую сумму Обеспечения Участника клиринга в денежных средствах по Счету обеспечения T+, изъятие которой из Обеспечения не приведет к возникновению у Участника клиринга отрицательного Единого лимита по Расчетному коду, соответствующему Счету обеспечения T+;
- 2) увеличивает плановое значение позиции по ценным бумагам по Разделу T0, соответствующему Разделу T+, на объем прекращенного Итогового нетто-требования Участника клиринга по ценным бумагам, учитываемого по Разделу T+, но не превышающую сумму Обеспечения Участника клиринга в ценных бумагах по тому же Разделу T+, и при условии, что изъятие этого количества ценных бумаг из Обеспечения не приведет к возникновению у Участника клиринга отрицательного Единого лимита по Расчетному коду, соответствующему Разделу T+, либо на максимально возможный объем, не превышающий количества соответствующих ценных бумаг в Обеспечении Участника клиринга по Разделу T+, изъятие которых из Обеспечения не приведет к возникновению у Участника клиринга отрицательного Единого лимита по Расчетному коду, соответствующему Разделу T+.

При этом размер Обеспечения Участника клиринга в денежных средствах / ценных бумагах по Счету обеспечения T+ / Разделу T+ уменьшается на сумму денежных средств / количество ценных бумаг, на которые увеличены соответствующие позиции Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам, а обязательства по возврату денежных средств / ценных бумаг из Обеспечения в соответствующем объеме включаются в Клиринговый пул для проведения расчетов по итогам торгов по сделкам с центральным контрагентом.

Действия, указанные в настоящем подпункте Правил клиринга не выполняются в случае, если Участником клиринга в соответствии с пунктом 18.1.5 Правил

клиринга предоставлено Заявление о порядке использования денежных средств и ценных бумаг, в соответствии с которым Участник клиринга дает указание Клиринговому центру не перечислять денежные средства / ценные бумаги со Счетов обеспечения Т+ на Счета обеспечения Т0 / с Разделов Т+ на Разделы Т0 после прекращения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением.

Статья 29. Порядок урегулирования случаев неисполнения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением

29.1. В случаях:

29.1.1. частичного неисполнения или неисполнения в полном объеме Участником клиринга своих Итоговых нетто-обязательств по денежным средствам и/или ценным бумагам;

29.1.2. непогашения Участником клиринга до времени, установленного Временным регламентом, Задолженности по гарантийным переводам и/или Задолженности и наличия Обеспечения Участника клиринга в ценных бумагах;

в ходе прекращения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением, проводимого в соответствии со статьей 28 Правил клиринга, между Клиринговым центром и Недобросовестным участником клиринга, без подачи заявок заключается сделка РЕПО с кодом расчетов Y0/Y1 (две сделки купли-продажи ценных бумаг с кодами расчетов Y0, Y1).

29.2. Сделки РЕПО (сделки купли-продажи ценных бумаг), указанные в пункте 29.1 Правил клиринга, заключаются при соблюдении следующих условий:

- а) у Участника клиринга не отозвана (не аннулирована) лицензия Банка России на осуществление банковских операций и/или лицензия профессионального участника рынка ценных бумаг на осуществление брокерской деятельности, дилерской деятельности и/или деятельности по управлению ценными бумагами;
- б) у Клирингового центра отсутствует информация об обстоятельствах в отношении Участника клиринга, перечисленных в пункте 11.1 Правил клиринга, при наступлении которых клиринговое обслуживание Участника клиринга может быть приостановлено;
- в) количество Расчетных дней, в течение которых Участник клиринга не исполняет Итоговое нетто-обязательство по денежным средствам по одному Счету обеспечения Т+ или Итоговое нетто-обязательство по соответствующим ценным бумагам по Разделам Т+, относящимся к одному Расчетному коду, не превышает 6 (шести) Расчетных дней подряд;
- г) отсутствует решение об исключении ценной бумаги, по которой учитывается неисполненное Итоговое нетто-обязательство, из Клирингового листа для Сделок с частичным обеспечением со следующего Расчетного дня.

29.2.1. Сделки купли-продажи, указанные в пункте 29.1 Правил клиринга, заключаются в случае предоставления Участником клиринга Клиринговому центру Заявления о заключении сделок купли-продажи.

Заявление о заключении сделок купли-продажи предоставляется Участником клиринга на бумажном носителе.

29.3. Условия сделок РЕПО (двух сделок купли-продажи), заключаемых между Клиринговым центром и Недобросовестным участником клиринга в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга, соответствуют условиям Сделок с частичным обеспечением, определенным Правилами торговли, с учетом следующих особенностей:

- в случае наличия у Участника клиринга неисполненного Итогового нетто-обязательства по ценным бумагам, по первой части сделки РЕПО (по первой сделке купли-продажи) у Участника клиринга возникают требования по соответствующим ценным бумагам, противоположные указанному неисполненному Итоговому нетто-обязательству Участника клиринга по ценным бумагам в объеме, равном неисполненному Итоговому нетто-обязательству Участника клиринга по ценным бумагам;
- в случае наличия у Участника клиринга неисполненного Итогового нетто-обязательства по денежным средствам (в российских рублях), по первой части сделки РЕПО (по первой сделке купли-продажи) у Участника клиринга возникают требования в российских рублях, противоположные указанному неисполненному Итоговому нетто-обязательству Участника клиринга по денежным средствам, и обязательства по ценным бумагам в объеме, равном количеству ценных бумаг, не превышающему суммы объема Итогового нетто-требования по ценным бумагам, соответствующего неисполненному Участником клиринга Итоговому нетто-обязательству по денежным средствам, и размера Обеспечения Участника клиринга в соответствующих ценных бумагах;
- в случае наличия у Участника клиринга Задолженности и/или Задолженности по гарантийным переводам, по первой части сделки РЕПО (по первой сделке купли-продажи) у Участника клиринга возникают требования в российских рублях, противоположные Задолженности и/или Задолженности по гарантийным переводам, и обязательства по ценным бумагам в объеме, не превышающем размера Обеспечения Участника клиринга в ценных бумагах, соответствующем сумме Задолженности и/или Задолженности по гарантийным переводам.
- первая часть сделки РЕПО (первая сделка купли-продажи) исполняется в день ее заключения;
- вторая часть сделки РЕПО (вторая сделка купли-продажи) исполняется в Расчетный день, следующий за днем ее заключения;
- сумма первой части сделки РЕПО (сумма первой сделки купли-продажи) определяется как произведение количества ценных бумаг в сделке и последней определенной Клиринговым центром Расчетной цены ценных бумаг, уменьшенной на последний определенный Клиринговым центром дисконт по ценным бумагам;
- цена второй части сделки РЕПО (цена второй сделки купли-продажи) определяется по формуле:

$$\text{Price} = K \times R_c \times (1-d) \times S \times n / 365, \text{ где}$$

Price – цена второй части сделки РЕПО (цена второй сделки купли-продажи), в российских рублях,

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

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

Rc – Расчетная цена ценных бумаг, в российских рублях,

d - дисконт по ценным бумагам, в долях единицы,

S – ставка, установленная Клиринговым центром в соответствии с Методикой определения риск-параметров рынка ценных бумаг,

n – количество календарных дней между датой исполнения первой и второй части сделки РЕПО (между датами исполнения первой и второй сделки купли-продажи);

- при наличии у Участника клиринга неисполненного Итогового нетто-обязательства по денежным средствам, учитываемого по Счету обеспечения T+, сделка РЕПО (сделки купли-продажи) в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга заключаются в отношении ценных бумаг, по которым по у Участника учитывается Итоговое нетто-требование по ценным бумагам, учитываемое по Разделу T+, относящемуся к тому же Расчетному коду, что и Счет обеспечения T+;
- при наличии у Участника клиринга Задолженности и/или Задолженности по гарантийным переводам, учитываемых по Счету обеспечения T+, сделка РЕПО (сделки купли-продажи) в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга заключаются в отношении ценных бумаг, учитываемых в качестве Обеспечения Участника по Разделу T+, относящемуся к тому же Расчетному коду, что и Счет обеспечения T+.

29.3.1. В случае невозможности исполнения Участником клиринга своих Итоговых нетто-обязательств по денежным средствам / ценным бумагам вследствие непреодолимой силы или сбоя в платежной системе Банка России, между Клиринговым центром и Участником клиринга в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга заключается сделка РЕПО (две сделки купли-продажи) со ставкой РЕПО (штрафной ставкой), равной нулю.

Под обстоятельствами непреодолимой силы понимаются:

- военные действия, акты террора, диверсии и саботажа, массовые беспорядки, забастовки, смена политического режима и другие политические осложнения;
- изменения законодательных или иных актов государственных органов Российской Федерации, решений законодательных и исполнительных органов власти;
- пожары или иные несчастные случаи, разрушения или значительные повреждения занимаемых Участником клиринга помещений;
- любые иные обстоятельства, которые создают или могут создать угрозу жизни или здоровью работников Участника клиринга.

О возникновении обстоятельств непреодолимой силы, вследствие которых исполнение Участником клиринга своих Итоговых нетто-обязательств по денежным средствам / ценным бумагам невозможно, Участник клиринга обязан уведомить Клиринговый центр любыми доступными средствами связи до установленного Временным регламентом времени исполнения Итоговых нетто-обязательств по денежным средствам / ценным бумагам.

Участник клиринга обязан предоставить Клиринговому центру документы, подтверждающие обстоятельства непреодолимой силы в течение 7 (семи) дней. В случае непредоставления Участником клиринга Клиринговому центру таких документов в указанный срок с Участника клиринга по решению Клирингового центра взыскивается неустойка по ставке РЕПО (штрафной ставке), рассчитанной в соответствии с подпунктом 29.3 Правил клиринга в расчете на количество календарных дней между датой исполнения первой части сделки РЕПО и датой расчета неустойки (между датами исполнения первой и второй сделки купли-продажи).

- 29.4. При наличии случаев неисполнения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением, определенных в пункте 29.1 Правил клиринга и несоблюдении хотя бы одного из условий, указанных в подпункте 29.2 Правил клиринга, в ходе прекращения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением, проводимого в соответствии со статьей 28 Правил клиринга, между Клиринговым центром и Недобросовестным участником клиринга, без подачи заявок заключается сделка купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов Y0, условия которой соответствуют условиям первой сделки купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов Y0, определенным в подпункте 29.3 Правил клиринга, за исключением цены сделки купли-продажи ценных бумаг, которая рассчитывается по формуле для цены второй части сделки РЕПО (второй сделки купли-продажи).
- 29.5. Заключение сделок в соответствии с пунктами 29.1-29.4 Правил клиринга осуществляется в отношении всех Участников клиринга, имеющих неисполненные Итоговые нетто-обязательства по денежным средствам / ценным бумагам.
- 29.6. При наличии Недобросовестных участников клиринга, не исполнивших полностью или частично свои Итоговые нетто-обязательства по денежным средствам / ценным бумагам, для исполнения Итоговых нетто-требований по денежным средствам / ценным бумагам Добросовестных участников клиринга Клиринговый центр выполняет действия в следующей последовательности:
- использует свободные собственные денежные средства и/или собственные ценные бумаги;
 - в случае недостаточности свободных собственных ценных бумаг заключает Сделки РЕПО Клирингового центра или Договоры займа Клирингового центра, условия которых определены статьей 35 Правил клиринга;
 - в случае недостаточности свободных собственных денежных средств и/или невозможности заключения Сделок РЕПО Клирингового центра или Договоров займа Клирингового центра в соответствии со статьей 35 Правил клиринга на необходимое недостающее количество ценных бумаг без подачи заявок заключает сделки РЕПО с кодом расчетов Y0/Y1 (две сделки купли-продажи ценных бумаг с кодами расчетов Y0, Y1), с Добросовестными участниками клиринга.
- 29.6.1. Сделки купли-продажи в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга заключаются в случае предоставления Участником клиринга Клиринговому центру Заявления о заключении сделок купли-продажи, предусмотренного пунктом 29.2.1 Правил клиринга.
- 29.6.2. Условия сделок РЕПО (двух сделок купли-продажи), заключаемых между Клиринговым центром и Добросовестным участником клиринга в соответствии с

настоящим пунктом Правил клиринга, соответствуют условиям Сделок с частичным обеспечением, определенным Правилами торговли, с учетом следующих особенностей:

- в случае недостаточности у Клирингового центра ценных бумаг для исполнения Итоговых нетто-требований Добросовестного участника клиринга по первой части сделки РЕПО (по первой сделке купли-продажи) у Участника клиринга возникают обязательства по соответствующим ценным бумагам, противоположные указанному неисполненному Итоговому нетто-требованию Добросовестного участника клиринга по ценным бумагам в объеме, равном неисполненному Итоговому нетто-требованию Добросовестного участника клиринга по ценным бумагам;
- в случае недостаточности у Клирингового центра денежных средств для исполнения Итоговых нетто-требований Добросовестного участника клиринга, по первой части сделки РЕПО (по первой сделке купли-продажи) у Участника клиринга возникают обязательства в российских рублях, противоположные указанному неисполненному Итоговому нетто-требованию Добросовестного участника клиринга по денежным средствам, и требования по ценным бумагам в объеме, равном Итоговому нетто-обязательству Добросовестного участника клиринга по ценным бумагам, соответствующему неисполненному Итоговому нетто-требованию Добросовестного участника клиринга по денежным средствам;
- иные условия заключаемых сделок соответствуют условиям сделок, определенных в пункте 29.3, при этом цена второй части сделки РЕПО (второй сделки купли-продажи) определяется таким образом, чтобы разница между суммой первой и второй частью сделки РЕПО (между суммой первой и второй сделки купли-продажи) была уплачена в пользу Добросовестного участника клиринга.

29.7. Сделки РЕПО (две сделки купли-продажи), указанные в пункте 29.6 Правил клиринга, могут заключаться Клиринговым центром с одним Добросовестным участником клиринга не более, чем 20 (двадцать) Расчетных дней подряд, при наличии у Добросовестного участника клиринга Итогового нетто-требования по ценным бумагам.

29.7.1. В случае невозможности Клирингового центра исполнить Итоговые нетто-требования по ценной бумаге одного или нескольких Добросовестных участников клиринга в течение 20 (двадцать) Расчетных дней подряд, Клиринговый центр:

- исключает указанную ценную бумагу из Клирингового листа для Сделок с частичным обеспечением;
- заключает с Добросовестным участником клиринга без подачи заявок сделку купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов Y0, условия которой соответствуют условиям первой сделки купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов Y0, определенным в подпункте 29.6 Правил клиринга, за исключением цены сделки купли-продажи ценных бумаг, которая рассчитывается по формуле для цены второй части сделки РЕПО (второй сделки купли-продажи).

29.8. После заключения сделок в соответствии с пунктами 29.1-29.7 Правил клиринга Клиринговый центр включает обязательства по указанным сделкам с наступившей Датой исполнения в Клиринговый пул по Сделкам с частичным обеспечением и

зачитывает встречные однородные Итоговые нетто-обязательства / Итоговые нетто-требования по денежным средствам и ценным бумагам и/или Задолженности / Задолженности по гарантийным переводам Участника клиринга с обязательствами и требованиями по указанным заключенным сделкам с наступившей Датой исполнения.

В результате такого зачета Итоговые нетто-обязательства / нетто-требования Участников клиринга по ценным бумагам прекращаются (становятся равными нулю), у Участника клиринга может учитываться новое Итоговое нетто-обязательство / нетто-требование по денежным средствам, значение которого отлично от нуля.

Порядок прекращения указанного Итогового нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга по денежным средствам определен статьей 28 Правил клиринга.

- 29.8.1. Обязательства и требования по вторым частям сделок РЕПО (вторым сделкам купли-продажи), вторым частям Сделок репо Клирингового центра и Договорам займа Клирингового центра, заключенным в соответствии с пунктами 29.1-29.5 Правил клиринга, учитываются в составе Нетто-обязательств / Нетто-требований Участника клиринга по Сделкам с частичным обеспечением с Датой исполнения, соответствующей дате исполнения указанных обязательств и требований.
- 29.9. В случае заключения Клиринговым центром сделок в соответствии с пунктом 25.12 Правил клиринга с Участником клиринга, не исполнившим Маржинальное требование, и/или сделок в соответствии с пунктом 29.4 Правил клиринга с Недобросовестным участником клиринга, Клиринговый центр на основании пункта 17.6 Правил клиринга подает заявки и/или заключает сделки с целью приведения к нулю суммы обязательств Клирингового центра по передаче ценных бумаг с одной и/или разными Датой исполнения.
- 29.10. Клиринговый центр с использованием Системы торгов уведомляет Биржу о необходимости заключения сделок РЕПО (сделок купли-продажи) в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга и об условиях указанных сделок.

Статья 30. Порядок использования и возмещения Гарантийного фонда

- 30.1. Клиринговый центр использует средства Гарантийного фонда для исполнения обязательств любого из Участников клиринга по Сделкам с частичным обеспечением с наступившей Датой исполнения в случае, если Задолженность такого Участника клиринга перед Клиринговым центром не погашена в срок, установленный пунктом 28.5.2 Правилам клиринга.
- 30.2. В первую очередь используется взнос в Гарантийный фонд Недобросовестного участника клиринга, во вторую – взносы в Гарантийный фонд Добросовестных участников клиринга.
Взносы в Гарантийный фонд Добросовестных участников клиринга используются в случае, если сумма Задолженностей Недобросовестных участников клиринга перед Клиринговым центром превышает 1 (один) миллиард российских рублей.
- 30.3. Взнос в Гарантийный фонд Недобросовестного участника клиринга используется для удовлетворения требований Клирингового центра по задолженности Недобросовестного участника клиринга путем передачи денежных средств,

составляющих взнос в Гарантийный фонд Недобросовестного участника клиринга Клиринговому центру в счет погашения Задолженности Недобросовестного участника клиринга.

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

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

30.4. Взносы в Гарантийный фонд Добросовестных участников клиринга используются в размере превышения суммы Задолженностей Недобросовестных участников клиринга величины, установленной в соответствии с пунктом 30.2 Правил клиринга.

30.4.1. Использование взносов в Гарантийный фонд Добросовестных участников клиринга осуществляется пропорционально размеру вноса в Гарантийный фонд каждого Участника клиринга.

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

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

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

30.5. Клиринговый центр уведомляет Биржу об использовании вноса в Гарантийный фонд Недобросовестного участника клиринга и/или взносов в Гарантийный фонд Добросовестных участников клиринга для удовлетворения требований по Задолженности Недобросовестного участника клиринга.

30.6. В случае использования взносов в Гарантийный фонд Добросовестных Участников клиринга, Недобросовестный участник клиринга обязан в течение 2 (двух) Расчетных дней возместить использованные средства Гарантийного фонда.

Уведомление о необходимости возмещения средств Гарантийного фонда, содержащее информацию о сумме использованных средств Гарантийного фонда, подлежащей возмещению Участником клиринга, о реквизитах счета для возмещения средств Гарантийного фонда, о сроке, в течение которого средства Гарантийного фонда должны быть возмещены, направляется Участнику клиринга в форме электронного документа не позднее рабочего дня, следующего за датой использования Гарантийного фонда.

В случае невозмещения Недобросовестным участником клиринга средств Гарантийного фонда Клиринговый центр вправе требовать от такого Участника клиринга этого возмещения в судебном порядке.

- 30.7. После возмещения Недобросовестным участником клиринга использованных средств Гарантийного фонда, Клиринговый центр возмещает использованные взносы в Гарантийный фонд Добросовестных участников клиринга.
- Если полученных от Недобросовестного участника клиринга денежных средств недостаточно для полного возмещения взносов в Гарантийный фонд Добросовестных участников клиринга, осуществляется частичное возмещение таких взносов в размере, пропорциональном сумме использованных средств Гарантийного фонда из взноса каждого Участника клиринга.
- При этом размер взноса в Гарантийный фонд Добросовестного участника клиринга и размер обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга взноса в Гарантийный фонд увеличиваются на сумму возмещенных денежных средств.
- 30.8. После возмещения Недобросовестным участником клиринга использованных средств Гарантийного фонда такой Участник клиринга обязан возместить (внести) свой взнос в Гарантийный фонд в установленном Клиринговым центром размере.
- 30.9. Клиринговый центр уведомляет Биржу о возмещении Недобросовестным участником клиринга средств Гарантийного фонда и его взноса в Гарантийный фонд.
- 30.10. В случае использования взносов в Гарантийный фонд Добросовестных участников клиринга и невозмещения Недобросовестным участником клиринга использованных средств Гарантийного фонда в течение 2 (двух) Расчетных дней после их использования, Добросовестные участники клиринга обязаны в течение 2 (двух) Расчетных дней после направления Клиринговым центром соответствующих уведомлений 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.

Статья 31. Порядок исполнения обязательств и требований Участников клиринга и Клирингового центра, включенных в клиринговый пул

- 31.1. Клиринговый центр осуществляет определение и учет обязательств и требований по денежным средствам (по сделкам с ценными бумагами) по каждой позиции по денежным средствам Участника клиринга (Клирингового центра) в соответствии с условиями заключенных им сделок, обязательства по которым включены в соответствующий клиринговый пул.
- Клиринговый центр осуществляет определение и учет обязательств и требований по ценным бумагам (по сделкам с ценными бумагами) по каждой позиции депо и по каждой учетной позиции Участника клиринга (Клирингового центра) в отношении каждой ценной бумаги в отдельности в соответствии с условиями заключенных им сделок, обязательства по которым включены в соответствующий клиринговый пул.
- 31.2. По обязательства по сделкам с ценными бумагами с кодами расчетов T0 и K0, включенным в клиринговый пул для расчетов по итогам торгов по сделкам с центральным контрагентом, проводится неттинг, по итогам которого определяются

нетто-обязательства / нетто-требования Участников клиринга и Клирингового центра по денежным средствам и по ценным бумагам.

- 31.3. Обязательства по первым частям обеспеченных сделок РЕПО с кодами расчетов Rb, обязательства по обеспеченным сделкам с ценными бумагами с кодами расчетов B0-B30, первым частям обеспеченных сделок РЕПО с кодами расчетов S0-S2 и вторым частям обеспеченных сделок РЕПО с любыми кодами расчетов, исполнение которых осуществлялось Участниками клиринга путем ввода Отчетов на исполнение или Специальных отчетов на исполнение, а также обязательства по внесению компенсационных взносов, прошедших в течение Расчетного дня Процедуру контроля обеспечения, и нетто-обязательства / нетто-требования Участников клиринга и Клирингового центра по денежным средствам и по ценным бумагам, определенные по итогам неттинга обязательств по сделкам, включенным в клиринговый пул для расчетов по итогам торгов по сделкам с центральным контрагентом, включаются в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов.

По обязательствам, включенным в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов, проводится неттинг, по итогам которого определяются нетто-обязательства / нетто-требования Участников клиринга и Клирингового центра по денежным средствам и по ценным бумагам.

- 31.3.1. Нетто-обязательство (нетто-требование) Участника клиринга (Клирингового центра) по денежным средствам по сделкам клирингового пула по каждой его позиции по денежным средствам, определенной в отношении Счета обеспечения T0, рассчитывается по формуле:

$НОД = СТ - СО$, где:

НОД - Нетто-обязательство (Нетто-требование) Участника клиринга (Клирингового центра) по денежным средствам по сделкам клирингового пула;

СТ - сумма требований, а **СО** – сумма обязательств Участника клиринга (Клирингового центра) по денежным средствам по:

- нетто-обязательствам / нетто-требованиям, определенным по итогам неттинга обязательств по сделкам, включенным в клиринговый пул для расчетов по итогам торгов по сделкам с центральным контрагентом в соответствии с пунктом 31.2 Правил клиринга;
- первым частям обеспеченных сделок РЕПО с кодом расчетов Rb;
- обеспеченным сделкам с кодом расчетов B0-B30, исполнение обязательств по которым осуществлялось Участниками клиринга путем ввода Отчетов на исполнение или Специальных отчетов на исполнение;
- первым частям обеспеченных сделок РЕПО с кодом расчетов S0-S2, исполнение обязательств по которым осуществлялось Участниками клиринга путем ввода Отчетов на исполнение или Специальных отчетов на исполнение;
- вторым частям обеспеченных сделок РЕПО с любым кодом расчетов, исполнение обязательств по которым осуществлялось Участниками клиринга путем ввода Отчетов на исполнение или Специальных отчетов на исполнение;
- внесению / получению компенсационных взносов;

прошедшим в течение Расчетного дня Процедуру контроля обеспечения (по соответствующей позиции по денежным средствам);

- требованиям по зачислению денежных средств на Счет обеспечения Т0 по исполненным в Клиринговой системе возвратам денежных средств из Обеспечения по Запросам Участника клиринга о возврате денежных средств из Обеспечения или по прекращенным обязательствам по Сделкам с частичным обеспечением;
- обязательствам по списанию денежных средств со Счета обеспечения Т0 по исполненным в Клиринговой системе распоряжениям на внесение денежных средств в Обеспечение, поданным / сформированным Участником клиринга / Клиринговым центром;
- обязательствам по уплате Комиссионных вознаграждений, определенным в соответствии со статьей 37 Правил клиринга;
- обязательствам по уплате / требованиям по получению Возмещения, определенных в соответствии со статьей 32 Правил клиринга.

Отрицательное значение НОД означает наличие Нетто-обязательства Участника клиринга (Клирингового центра) по денежным средствам по сделкам клирингового пула, положительное значение НОД — Нетто-требования Участника клиринга (Клирингового центра) по денежным средствам по сделкам клирингового пула.

- 31.3.2. Нетто-обязательство (Нетто-требование) Участника клиринга (Клирингового центра) по ценным бумагам по сделкам клирингового пула по каждой его позиции депо, определенной в отношении Раздела Т0 и в отношении каждой ценной бумаги рассчитывается по формуле:

НОЦ = СТЦ - СОЦ, где:

НОЦ - Нетто-обязательство (Нетто-требование) Участника клиринга (Клирингового центра) по ценной бумаге по сделкам клирингового пула;

СТЦ - сумма требований, а **СОЦ** – сумма обязательств Участника клиринга (Клирингового центра) по соответствующей ценной бумаге по:

- нетто-обязательствам / нетто-требованиям, определенным по итогам неттинга обязательств по сделкам, включенным в клиринговый пул для расчетов по итогам торгов по сделкам с центральным контрагентом в соответствии с пунктом 31.2 Правил клиринга;
- первым частям обеспеченных сделок РЕПО с кодом расчетов Rb;
- обеспеченным сделкам с кодом расчетов В0-В30, исполнение обязательств по которым осуществлялось Участниками клиринга путем ввода Отчетов на исполнение или Специальных отчетов на исполнение;
- первым частям обеспеченных сделок РЕПО с кодом расчетов S0-S2, исполнение обязательств по которым осуществлялось Участниками клиринга путем ввода Отчетов на исполнение или Специальных отчетов на исполнение;
- вторым частям обеспеченных сделок РЕПО с любым кодом расчетов, исполнение обязательств по которым осуществлялось Участниками клиринга путем ввода Отчетов на исполнение или Специальных отчетов на исполнение;
- внесению / получению компенсационных взносов;

прошедшим в течение Расчетного дня Процедуру контроля обеспечения (по соответствующей позиции депо);

- требованиям по зачислению ценных бумаг на Раздел Т0 по исполненным в Клиринговой системе возвратам ценных бумаг из Обеспечения по Запросам

Участника клиринга о возврате ценных бумаг из Обеспечения или по прекращенным обязательствам по Сделкам с частичным обеспечением;

- обязательствам по списанию ценных бумаг с Раздела T0 по исполненным в Клиринговой системе распоряжениям на внесение ценных бумаг в Обеспечение, поданным / сформированным Участником клиринга / Клиринговым центром.

Отрицательное значение НОЦ означает наличие Нетто-обязательства Участника клиринга (Клирингового центра) по ценной бумаге по сделкам клирингового пула, положительное значение НОЦ — Нетто-требования Участника клиринга (Клирингового центра) по ценной бумаге по сделкам клирингового пула.

- 31.3.3. Нетто-обязательство (нетто-требование) Участника клиринга по ценным бумагам по сделкам клирингового пула по каждому его Разделу T+ и по каждой ценной бумаге рассчитывается по формуле:

НОЦ = СТЦ - СОЦ, где:

НОЦ - Нетто-обязательство (Нетто-требование) Участника клиринга по ценной бумаге по сделкам клирингового пула;

СТЦ - сумма требований, а **СОЦ** – сумма обязательств Участника клиринга по соответствующей ценной бумаге по:

- требованиям по зачислению ценных бумаг на Раздел T+ по исполненным в Клиринговой системе распоряжениям на внесение ценных бумаг в Обеспечение, поданным / сформированным Участником клиринга / Клиринговым центром;
- обязательствам по списанию ценных бумаг с Раздела T+ по исполненным в Клиринговой системе возвратам ценных бумаг из Обеспечения по Запросам Участника клиринга о возврате ценных бумаг из Обеспечения или по прекращенным обязательствам по Сделкам с частичным обеспечением.

Отрицательное значение НОЦ означает наличие Нетто-обязательства Участника клиринга (Клирингового центра) по ценной бумаге по сделкам клирингового пула, положительное значение НОЦ — Нетто-требования Участника клиринга (Клирингового центра) по ценной бумаге по сделкам клирингового пула.

- 31.4. Обязательства по сделкам с кодом расчетов Z0 и первым частям сделок РЕПО с кодом расчетов Z0, прошедшим в этот Расчетный день Процедуру контроля обеспечения, включаются в клиринговый пул для расчетов в ходе торгов. Обязательства и требования Участников клиринга по таким сделкам определяются в отношении каждой сделки в отдельности.

- 31.5. Нетто-обязательства (нетто-требования) Участников клиринга по денежным средствам и по ценным бумагам по сделкам клирингового пула, рассчитанные в соответствии с пунктами 24.2-24.4 Правил клиринга по сделкам с ценными бумагами с кодом расчетов B0-B30, первым частям сделок РЕПО с кодом расчетов S0-S2, вторым частям сделок РЕПО с кодами расчетов Rb, Z0, S0-S2, а также по компенсационным взносам, исполнение которых осуществлялось Участниками клиринга путем ввода Срочных отчетов на исполнение, прошедшим в этот Расчетный день Процедуру контроля обеспечения, включаются в клиринговый пул для расчетов в ходе торгов.

- 31.6. Нетто-обязательства (нетто-требования) Участников клиринга по ценным бумагам по сделкам клирингового пула, рассчитанные в соответствии с пунктом 24.4 или в соответствии с подпунктами 31.3.2 и 31.3.3 Правил клиринга, включаются в Распоряжение на проведение операций по торговым разделам, направляемое Клиринговым центром Расчетному депозитарию в соответствии с пунктом 34.10 или пунктом 34.11 Правил клиринга.
- 31.7. Нетто-обязательства Участников клиринга по денежным средствам по сделкам клирингового пула, определенные в соответствии с пунктом 24.3 или подпунктом 31.3.1 Правил клиринга в отношении Счета обеспечения T0, исполняются за счет денежных средств, учитываемых по тому же Счету обеспечения T0.
- 31.7.1. Нетто-обязательство Участника клиринга по денежным средствам по сделкам клирингового пула, определенное в отношении Счета обеспечения T0, считается исполненным, если значение плановой позиции по денежным средствам по тому же Счету обеспечения T0 не меньше, чем Нетто-обязательство Участника клиринга по денежным средствам по сделкам клирингового пула.
- 31.7.2. Если значение плановой позиции по денежным средствам по Счету обеспечения T0 меньше, чем Нетто-обязательство Участника клиринга по денежным средствам по сделкам клирингового пула, определенное в отношении Счета обеспечения T0, указанное Нетто-обязательство прекращается в части, соответствующей размеру указанной плановой позиции, а неисполненная часть указанного Нетто-обязательства учитывается как Ограничительный лимит по уплате Комиссионного вознаграждения и/или Ограничительный лимит по уплате Возмещения.
- 31.7.3. Клиринговый центр зачитывает Нетто-обязательство (или его часть) Участника клиринга по денежным средствам по сделкам клирингового пула, определенное в отношении Счета обеспечения T0, с требованием Участника клиринга по возврату денежных средств, учитываемых по тому же Счету обеспечения T0, а значение плановой позиции по денежным средствам по тому же Счету обеспечения T0 уменьшается на сумму такого исполненного Нетто-обязательства (или его части).
- 31.8. Нетто-требование Участника клиринга по денежным средствам по сделкам клирингового пула, определенное в соответствии с пунктом 24.3 или подпунктом 31.3.1 Правил клиринга в отношении Счета обеспечения T0, прекращается возникновением обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга денежных средств, учитываемых по тому же Счету обеспечения T0, в размере указанного Нетто-требования Участника клиринга.
При этом значение плановой позиции по денежным средствам по Счету обеспечения T0 увеличивается на сумму такого прекращенного Нетто-требования.
- 31.9. После исполнения (прекращения) Нетто-обязательств (нетто-требований) Участников клиринга по денежным средствам по сделкам клирингового пула в соответствии с пунктами 31.7, 31.8 Правил клиринга и получения от Расчетного депозитария отчета о проведении операций по Разделам в соответствии с пунктом 34.13 Правил клиринга:
- обязательства Участников клиринга и Клирингового центра по оплате и передаче ценных бумаг (по сделкам с ценными бумагами), включенные в клиринговый пул для расчетов в ходе торгов или в клиринговый пул для

- расчетов по итогам торгов, считаются прекращенными в соответствующем клиринговом пуле;
- расчеты по ценным бумагам по итогам клиринга считаются завершенными.
- 31.10. Обязательства и требования Участников клиринга по сделкам, не прошедшим Процедуру контроля обеспечения, за исключением Сделок с частичным обеспечением, учитываются в Клиринговой системе и являются допущенными к клирингу вплоть до Даты прекращения исполнения таких сделок.
- При этом, Участники клиринга, являющиеся сторонами по Необеспеченным сделкам, имеют возможность исполнить свои обязательства по таким сделкам путем регистрации в Клиринговой системе Отчетов на исполнение, и/или Специальных отчетов на исполнение, и/или Срочных отчетов на исполнение вплоть до Даты прекращения исполнения. С Даты прекращения исполнения обязательства Участников клиринга по Необеспеченным сделкам не подлежат исполнению в Клиринговой системе, Необеспеченные сделки исключаются из Клиринговой системы.
- 31.11. Исключение сделок из Клиринговой системы не влечет прекращение обязательств сторон по указанным сделкам. Требования о надлежащем исполнении таких сделок могут быть предъявлены любой из сторон в соответствии с гражданским законодательством при условии соблюдения порядка разрешения споров, предусмотренного Правилами клиринга и Правилами торговли.
- 31.12. Обязательства и требования Участников клиринга по внесению компенсационных взносов учитываются в Клиринговой системе и являются допущенными к клирингу в Дату внесения компенсационных взносов. С даты, следующей за Датой внесения компенсационных взносов, обязательства Участников клиринга по необеспеченным компенсационным взносам не подлежат исполнению в Клиринговой системе.

Статья 32. Порядок определения подлежащих исполнению обязательств Участников клиринга по уплате Возмещения

- 32.1. Определение и учет обязательств и требований Участников клиринга по уплате Возмещения осуществляется в Клиринговой системе в российских рублях в отдельности по каждой биржевой сделке с ценными бумагами.
- 32.2. Обязательства и требования Участников клиринга по уплате Возмещения определяются в Клиринговой системе только по биржевым сделкам (сделкам РЕПО), неисполненным до Даты прекращения исполнения, по которым только одним из Участников клиринга нарушены требования Правил клиринга, повлекшим неисполнение обязательств по биржевой сделке с ценными бумагами в Дату исполнения.
- Обязательства и требования Участников клиринга по уплате Возмещения определяются в Клиринговой системе в Дату прекращения исполнения этих сделок на основании информации, полученной от Биржи посредством Системы торгов, и допускаются к клирингу.
- 32.3. Обязательство Участника клиринга по уплате Возмещения подлежит исполнению начиная с Даты прекращения исполнения соответствующей биржевой сделки. При

этом в Дату прекращения исполнения биржевой сделки с ценными бумагами величина обязательства по уплате Возмещения по этой сделке включается в Клиринговой системе в Ограничительный лимит по уплате возмещения для данного Участника клиринга.

Ограничительные лимиты по уплате возмещения устанавливаются в Клиринговой системе каждый Расчетный день (до начала формирования начальных значений позиций по денежным средствам) только в отношении денежных (дополнительных собственных денежных) позиций Участников клиринга.

Значение Ограничительного лимита по уплате возмещения ежедневно определяется в размере совокупных неисполненных обязательств соответствующего Участника клиринга по уплате Возмещения.

- 32.4. Учет обязательства Участника клиринга по уплате Возмещения может быть прекращен в Клиринговой системе (до удержания с этого Участника клиринга денежных средств в размере его обязательства по уплате Возмещения) на основании полученной от Биржи информации об отказе от получения Переменного возмещения или Фиксированного возмещения, подлежащего уплате в соответствии с условиями заключенной биржевой сделки.
- 32.5. Обязательства Участника клиринга по уплате Возмещения исполняются после исполнения всех обязательств Участника клиринга по уплате Комиссионного вознаграждения, определенных в соответствии со статьей 37 Правил клиринга.
- 32.5.1. Возмещение по биржевым сделкам с ценными бумагами удерживается с Участников клиринга в порядке возрастания номеров сделок.
- 32.5.2. Возмещение по биржевой сделке с ценными бумагами может быть удержано только в полном объеме, частичное удержание Возмещения по биржевой сделке не допускается.
- 32.6. В случае недостаточности денежных средств, учитываемых на соответствующей позиции по денежным средствам по Счету обеспечения Т0, для исполнения обязательств Участника клиринга по уплате Возмещения, величина этих обязательств на следующий Расчетный день включается в Клиринговой системе в Ограничительный лимит по уплате возмещения, устанавливаемый для данного Участника клиринга.

Статья 33. Порядок взаимодействия с Расчетной организацией

- 33.1. Перечень документов, которыми обмениваются Клиринговый центр и Расчетная организация в процессе взаимодействия при осуществлении клиринга и расчетов по денежным средствам по итогам клиринга, а также форматы указанных документов и сроки их предоставления определяются договором, заключенным между Клиринговым центром и Расчетной организацией.
- 33.2. Списание денежных средств с Торговых счетов осуществляется на основании распоряжений Клирингового центра или на основании распоряжений лица, которому открыт такой Торговый счет с согласия Клирингового центра.

- 33.3. Клиринговый центр соглашается с проведением любых операций зачисления на Торговый счет на основании распоряжений лица, которому открыт такой Торговый счет.
- 33.4. Каждый Расчетный день до начала Торгов, Клиринговый центр направляет Расчетной организации Запрос выписки по Торговым счетам, в ответ на который Расчетная организация передает Клиринговому центру выписку по Торговым счетам.
- 33.5. После получения от Расчетной организации выписки по Торговым счетам Клиринговый центр передает Расчетной организации распоряжение на перевод на клиринговый банковский счет Клирингового центра, открытый в Расчетной организации и предназначенный для учета индивидуального клирингового обеспечения, денежных средств с Торговых счетов в суммах, указанных в полученной от Расчетной организации выписки по торговым банковским счетам.
- После получения от Расчетной организации отчета об исполнении указанного распоряжения учитывает переведенные денежные средства на Счетах обеспечения T0, открытых к соответствующим Торговым счетам, и устанавливает в Клиринговой системе начальные значения основных и дополнительных позиций по денежным средствам Участников клиринга равными суммам денежных средств, учитываемых на соответствующих Счетах обеспечения T0.
- 33.6. При увеличении в ходе торгов суммы денежных средств, учитываемых на Торговом счете, Расчетная организация передает Клиринговому центру информацию о таком увеличении, а Клиринговый центр учитывает это увеличение в начальных значениях основных и дополнительных позиций по денежным средствам Участников клиринга и передает Расчетной организации распоряжение на перевод на клиринговый банковский счет Клирингового центра денежных средств с Торгового счета в сумме указанного увеличения.
- 33.7. В случае необходимости в ходе Торгов списания денежных средств с Торгового счета, Расчетная организация направляет Клиринговому центру запрос согласия Клирингового центра на списание денежных средств с Торговых счетов.
- Клиринговый центр дает согласие на списание денежных средств с Торговых счетов при условии, что сумма списания не превышает планового значения соответствующей позиции по денежным средствам Участника клиринга за вычетом соответствующих Ограничительных лимитов, и направляет Расчетной организации распоряжение на перевод денежных средств с клирингового банковского счета на Торговые счета на сумму списания.
- 33.8. После окончания торгов Клиринговый центр направляет Расчетной организации распоряжение на проведение операций по Торговым счетам, содержащее распоряжения на перевод денежных средств с клирингового банковского счета на Торговые счета в суммах плановых значений позиций по денежным средствам по Счетам обеспечения T0, учитываемых в Клиринговой системе после прекращения обязательств, включенных в клиринговый пул для расчетов по итогам торгов, в соответствии с пунктами 31.7, 31.8 Правил клиринга.

33.9. После завершения расчетов по денежным средствам по итогам торгов Клиринговый центр направляет Расчетной организации распоряжение на разблокировку денежных средств на Торговых счетах.

Направление Расчетной организации указанного распоряжения означает согласие Клирингового центра на проведение любых операции по торговым банковским счетам до момента получения Расчетной организацией от Клирингового центра запроса выписки по Торговым счетам

Статья 34. Порядок взаимодействия с Расчетным депозитарием и иными депозитариями

34.1. 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.

34.2. Списание ценных бумаг с Разделов торговых счетов депо осуществляется на основании распоряжений Клирингового центра или на основании распоряжений лица, которому открыт такой торговый счет депо с согласия Клирингового центра.

34.3. Клиринговый центр соглашается с проведением любых операций зачисления на Разделы торгового счета депо на основании распоряжений лица, которому открыт такой торговый счет депо.

34.4. 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.

34.5. Каждый Расчетный день до начала Торгов, Клиринговый центр направляет Расчетному депозитарию запрос выписки по Разделам, в ответ на который Расчетный депозитарий передает Клиринговому центру список Разделов и выписку по Разделам.

34.6. После получения от Расчетного депозитария выписки по Разделам Клиринговый центр устанавливает в Клиринговой системе начальные значения позиций депо по Разделам Т0 Участников клиринга в соответствии с информацией о количестве ценных бумаг, учитываемых на Разделах Т0, полученной от Расчетного депозитария в Выписке по Разделам.

34.7. Установление начальных значений учетных позиций Участников клиринга осуществляется только в дату размещения акций, определяемую в соответствии с зарегистрированными в установленном порядке Решением о выпуске и/или

Перспектом ценных бумаг. При этом начальные значения учетных позиций Участников клиринга устанавливаются равными нулю.

Одновременно с установлением начального значения учетной позиции «2» Участника клиринга Клиринговый центр формирует по этой позиции в Клиринговой системе лимит ее возможного максимального значения в размере, определенном либо в договоре, заключенном между Клиринговым центром и Эмитентом акций, либо в зарегистрированных в установленном порядке Решении о выпуске и/или Перспекте ценных бумаг. При этом указанный лимит не может превышать остатка по эмиссионному счету эмитента в соответствии с выпиской реестродержателя на дату, предшествующую дате размещения акций.

34.8. При увеличении в ходе торгов количества ценных бумаг, учитываемых на Разделе, Расчетный депозитарий передает Клиринговому центру информацию о таком увеличении, а Клиринговый центр учитывает это увеличение в начальных значениях позиций депо Участников клиринга по Разделам T0 или увеличивает количество ценных бумаг в Обеспечении, учитываемых по Разделам T+.

34.9. В случае необходимости в ходе Торгов списания ценных бумаг с Раздела, Расчетный депозитарий направляет Клиринговому центру запрос согласия Клирингового центра на списание ценных бумаг с Разделов.

Клиринговый центр дает согласие на списание ценных бумаг с Разделов T0 при условии, что количество ценных бумаг, подлежащих списанию, не превышает планового и начального значения соответствующей позиции депо Участника клиринга.

Клиринговый центр дает согласие на списание ценных бумаг с Раздела T+ при условии, что в результате такого списания Единый лимит Участника клиринга по Расчетному коду, к которому относится указанный Раздел T+, не станет отрицательным.

При этом количество ценных бумаг в Обеспечении, учитываемых по Разделу T+, уменьшается на количество ценных бумаг, указанное в запросе.

34.10. Проведение расчетов по ценным бумагам в ходе торгов осуществляется Расчетным депозитарием на основании полученного от Клирингового центра распоряжения на проведение операций по Разделам, содержащего обязательства и требования Участника клиринга по передаче ценных бумаг, включенные в клиринговый пул для расчетов в ходе торгов.

34.11. Проведение расчетов по ценным бумагам по итогам торгов осуществляется Расчетным депозитарием на основании полученного от Клирингового центра распоряжения на проведение операций по Разделам, содержащего Нетто-обязательства и Нетто-требования Участника клиринга и Клирингового центра по ценным бумагам по сделкам клирингового пула, определенные на основании обязательств, включенных в клиринговый пул для расчетов по итогам торгов.

34.12. Исполнение распоряжения на проведение операций по Разделам, 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.

- 34.13. После исполнения распоряжения на проведение операций по Разделам, полученного от Клирингового центра, Расчетный депозитарий направляет Клиринговому центру отчет о проведении операций по Разделам.
- 34.14. После завершения расчетов по ценным бумагам по итогам торгов в соответствии с пунктом 31.9 Правил клиринга, Клиринговый центр направляет Расчетному депозитарию Распоряжение на разблокировку Разделов и ценных бумаг, учитываемых на Разделах.

Направление Расчетному депозитарию указанного распоряжения означает согласие Клирингового центра на проведение любых операции по Разделам Т0 до момента получения Расчетным депозитарием от Клирингового центра запроса выписки по Разделам.

Статья 35. Условия Сделок РЕПО Клирингового центра и Договоров займа Клирингового центра, порядок их заключения и исполнения

- 35.1. Сделки РЕПО Клирингового центра и/или Договоры займа Клирингового центра заключаются между Клиринговым центром и Участником клиринга в случае, установленном пунктом 29.5 Правил клиринга.

В случае предоставления Участником клиринга Клиринговому центру Заявления о заключении Договоров займа, вместо Сделки РЕПО Клирингового центра в соответствии с пунктом 35.1 Правил клиринга между Участником клиринга и Клиринговым центром заключается Договор займа Клирингового центра.

- 35.2. Предметом Сделок РЕПО Клирингового центра и Договоров займа Клирингового центра могут являться ценные бумаги, включенные в Клиринговый лист для Сделок с частичным обеспечением (далее в настоящей статье – Ценные бумаги).

- 35.3. Займодавец по Договору займа Клирингового центра (продавцом по первой части Сделки РЕПО Клирингового центра) является Участник клиринга, заемщиком (покупателем по первой части Сделки РЕПО Клирингового центра) - Клиринговый центр.

- 35.4. Клиринговый центр вправе заключить Сделку РЕПО Клирингового центра или Договор займа Клирингового центра с любым Участником клиринга, внесшим взнос в Гарантийный фонд, с использованием любого Раздела Т+, открытого на Торговом счете депо владельца Участника клиринга в Расчетном депозитарии.

- 35.5. Для предоставления Клиринговому центру возможности заключения Сделок РЕПО Клирингового центра или Договоров займа Клирингового центра с использованием иных Разделов Т+ Участников клиринга, указанных в пункте 35.4 Правил клиринга, или с иными Участниками клиринга, Участник клиринга предоставляет Клиринговому центру Заявление о Торгово-клиринговых счетах для заключения сделок с Клиринговым центром на бумажном носителе.

Участник клиринга, предоставляя указанное заявление Клиринговому центру, гарантирует Клиринговому центру, что он обладает всеми необходимыми поручениями и полномочиями на заключение сделок в отношении ценных бумаг, учитываемых на Разделе Т+, указанном в заявлении.

- 35.6. Выбор Участника клиринга, с которым, в случае необходимости, заключается Сделка РЕПО Клирингового центра или Договор займа Клирингового центра, и выбор Раздела Т+ Участника клиринга, с использованием которого будет заключена Сделка РЕПО Клирингового центра или Договор займа Клирингового центра, а также определение количества ценных бумаг, в отношении которых заключается Сделка РЕПО Клирингового центра или Договор займа Клирингового центра, осуществляется Клиринговым центром.
- 35.7. Условия Сделки РЕПО Клирингового центра:
- 1) в дату заключения Сделки РЕПО Клирингового центра Участник клиринга (продавец по первой части Сделки РЕПО Клирингового центра) обязан передать Клиринговому центру (покупателю по первой части Сделки РЕПО Клирингового центра) Ценные бумаги в количестве, определенном Клиринговым центром, а Клиринговый центр обязан уплатить Участнику клиринга сумму РЕПО;
 - 2) в Расчетный день, следующий за датой заключения Сделки РЕПО Клирингового центра, Клиринговый центр обязан вернуть Участнику клиринга Ценные бумаги, полученные по первой части Сделки РЕПО Клирингового центра, а Участник клиринга обязан уплатить Клиринговому центру сумму РЕПО, уменьшенную исходя из Ставки по Сделкам РЕПО Клирингового центра;
 - 3) срок Сделки РЕПО Клирингового центра составляет один Расчетный день;
 - 4) сумма РЕПО рассчитывается как произведение количества Ценных бумаг, переданных по первой части Сделки РЕПО Клирингового центра, и последней Расчетной цены Ценных бумаг, определенной в соответствии с Методикой определения риск-параметров рынка ценных бумаг;
 - 5) Ставка по Сделкам РЕПО Клирингового центра устанавливается в процентах годовых, с базой равной 365 дням. Информация о Ставке по Сделкам РЕПО Клирингового центра публикуется на Сайте Клирингового центра. Ставка по заключенным по Сделкам РЕПО Клирингового центра не может быть изменена;
 - 6) в случае если на дату заключения Сделки РЕПО Клирингового центра приходится дата составления списка лиц, имеющих право на получение Дохода, Клиринговый центр обязан передать Доход Участнику клиринга. Порядок и сроки передачи Дохода в форме денежных средств, а также сумма Дохода, подлежащая передаче, определяются статьей 36 Правил клиринга. Иной Доход Клиринговый центр передает Участнику клиринга в течение десяти Расчетных дней, следующих за днем получения Клиринговым центром такого Дохода.
- 35.8. Условия Договора займа Клирингового центра:
- 1) в дату заключения Договора займа Участник клиринга (займодавец) обязан передать Клиринговому центру (заемщику) Ценные бумаги в количестве, определенном Клиринговым центром;
 - 2) в Расчетный день, следующий за датой заключения Договора займа Клирингового центра, Клиринговый центр обязан вернуть Участнику клиринга Ценные бумаги, полученные по Договору займа Клирингового центра, и уплатить проценты по Договору займа Клирингового центра, рассчитанные как произведение Ставки по Договорам займа Клирингового

- центра, установленной Клиринговым центром на дату заключения Договора займа Клирингового центра, количества Ценных бумаг, переданных по Договору займа Клирингового центра, количества календарных дней с даты заключения Договора займа Клирингового центра до следующего Расчетного дня, и последней Расчетной цены Ценных бумаг, определенной в соответствии с Методикой определения риск-параметров рынка ценных бумаг;
- 3) Ставка по Договорам займа Клирингового центра устанавливается в процентах годовых, с базой равной 365 дням. Информация о Ставке по Договорам займа Клирингового центра публикуется на Сайте Клирингового центра. Ставка по заключенным Договорам займа Клирингового центра не может быть изменена;
 - 4) в случае если на дату заключения Договора займа Клирингового центра приходится дата составления списка лиц, имеющих право на получение Дохода, Клиринговый центр обязан передать Доход Участнику клиринга. Порядок и сроки передачи Дохода в форме денежных средств, а также сумма Дохода, подлежащая передаче, определяются статьей 36 Правил клиринга. Иной Доход Клиринговый центр передает Участнику клиринга в течение десяти Расчетных дней, следующих за днем получения Клиринговым центром такого Дохода.
- 35.9. Клиринговый центр заключает Сделки РЕПО Клирингового центра или Договоры займа Клирингового центра в случае недостаточности у него ценных бумаг для исполнения Итоговых нетто-требований Добросовестных участников клиринга с Участниками клиринга и с использованием Разделов Т+, указанных в пункте 35.4 Правил клиринга, или с Участниками клиринга, предоставившими заявление, указанное в пункте 35.5 Правил клиринга, с использованием Разделов Т+, указанных в данном заявлении, при условии, что на таком Разделе Т+ учитываются недостающие у Клирингового центра ценные бумаги.
- 35.10. Сделки РЕПО Клирингового центра и Договоры займа Клирингового центра заключаются без подачи заявок.
- 35.11. Обязательства по передаче и возврату Ценных бумаг во исполнение Сделки РЕПО Клирингового центра / Договора займа Клирингового центра, а также обязательства по оплате ценных бумаг по соответствующим частям Сделок РЕПО Клирингового центра / обязательство Клирингового центра по уплате Участнику клиринга процентов по Договору займа Клирингового центра включаются в клиринговый пул по Сделкам с частичным обеспечением в Дату их исполнения и исполняются в порядке, установленном статьей 28 Правил клиринга.
- 35.12. В дату заключения Сделки РЕПО Клирингового центра или Договора займа Клирингового центра информация о заключенной Сделке РЕПО Клирингового центра / Договоре займа Клирингового центра включается в Выписку из реестра сделок, принятых в клиринг, предоставляемую Участнику клиринга в соответствии со статьей 38 Правил клиринга. Указанный отчет является документом, удостоверяющим передачу Участником клиринга Клиринговому центру Ценных бумаг.

Статья 36. Порядок передачи Доходов по сделкам РЕПО, заключенным с Клиринговым центром

36.1. Клиринговый центр определяет размер обязательств по ценным бумагам, определяемый с целью передачи Дохода, как разницу между определяемой в отношении Раздела Т+ Участника клиринга суммой требований и суммой обязательств Участника клиринга по ценным бумагам, по которым принято решение о выплате Дохода, по неисполненным на дату составления списка лиц, имеющих право на получение Дохода, сделкам РЕПО, заключенным с Клиринговым центром, в том числе Сделкам РЕПО Клирингового центра, и Договорам займа Клирингового центра. Для сделок РЕПО под неисполненными сделками понимаются неисполненные вторые части сделок РЕПО.

36.2. Если размер обязательства по ценным бумагам, определяемый с целью передачи Дохода, определенный в соответствии с пунктом 36.1 Правил клиринга в отношении Раздела Т+ Участника клиринга, отрицательный, такой Участник клиринга обязан передать Доход Клиринговому центру в течение 10 (десяти) рабочих дней после даты раскрытия эмитентом ценных бумаг информации о факте исполнения (полностью или частично) своих обязательств по выплате Дохода.

Если Размер обязательства по ценным бумагам, определяемый с целью передачи Дохода, определенный в соответствии с пунктом 36.1 Правил клиринга в отношении Раздела Т+ Участника клиринга, положительный, Клиринговый центр обязан передать такому Участнику клиринга Доход в течение 15 (пятнадцати) рабочих дней после раскрытия эмитентом ценных бумаг информации о факте исполнения (полностью или частично) своих обязательств по выплате Дохода.

36.3. Для сделок с акциями размер обязательства по передаче Дохода в форме денежных средств рассчитывается по формуле:

| | |
|--------------------------------------|---|
| $Inc = N \times d \times 0.91$, где | |
| Inc | размер обязательства по передаче Дохода (в рублях Российской Федерации); |
| N | абсолютное значение размера обязательства по ценным бумагам, определяемого с целью передачи Дохода, определенное в отношении Раздела Т+ Участника клиринга; |
| d | сумма начисления на одну акцию, установленная эмитентом ценных бумаг (в рублях Российской Федерации). |

В случае выплаты Дохода ценными бумагами, размер обязательства по передаче Дохода в форме ценных бумаг рассчитывается по формуле:

| | |
|--------------------------|---|
| $Inc = N \times d$, где | |
| Inc | размер обязательства по передаче Дохода (в штуках); |
| N | абсолютное значение размера обязательства по ценным бумагам, определяемого с целью передачи Дохода, определенное в отношении Раздела Т+ Участника клиринга; |
| d | количество ценных бумаг передаваемых эмитентом на одну акцию, установленное эмитентом ценных бумаг (в штуках). |

36.4. Для сделок с облигациями размер обязательства по передаче Дохода в форме денежных средств рассчитывается по формуле:

| | |
|--------------------------------|--|
| $Inc = N \times (d + m)$, где | |
|--------------------------------|--|

| | |
|-----|---|
| Inc | размер обязательства по передаче Дохода (в рублях Российской Федерации); |
| N | абсолютное значение размера обязательства по ценным бумагам, определяемого с целью передачи Дохода, определенное в отношении Раздела T+ Участника клиринга; |
| d | размер начисленного купона на одну облигацию, установленный эмитентом ценных бумаг (в рублях Российской Федерации); |
| m | сумма погашения части основного долга. |

- 36.5. В течение одного рабочего дня после раскрытия эмитентом ценных бумаг информации о факте исполнения (полностью или частично) своих обязательств по выплате Дохода, на основании информации о сделках РЕПО, заключенных с Клиринговым центром, и Договорах займа Клирингового центра, не исполненных на дату составления списка лиц, имеющих право на получение Дохода, в Клиринговой системе рассчитываются и учитываются обязательства по передаче и/или требования по получению Дохода каждого Участника клиринга и Клирингового центра.
- 36.5.1. Клиринговый центр передает Доход Участнику клиринга, имеющему требование по получению Дохода в отношении одного или нескольких своих Разделов T+, в случае, если данный Участник клиринга не имеет не исполненных в установленный срок (просроченных) обязательств по передаче Дохода перед Клиринговым центром в отношении другого (других) своих Разделов T+.
- 36.5.2. Обязательства по передаче Дохода включаются в клиринговый пул по Сделкам с частичным обеспечением и исполняются в порядке, установленном статьей 28 Правил клиринга.
- 36.6. Информация об исполнении обязательств по передаче Дохода включается в Отчет об Итоговых нетто-обязательствах / нетто-требованиях.

РАЗДЕЛ VI. ПОРЯДОК ОПЛАТЫ УСЛУГ. ОТЧЕТЫ ПО ИТОГАМ КЛИРИНГА

Статья 37. Порядок оплаты услуг Клирингового центра, Биржи и Технического центра

- 37.1. Клиринговый центр взимает с Участников клиринга:
- клиринговую комиссию в пользу Клирингового центра;
 - комиссионное вознаграждение в пользу Биржи за организацию торгов;
 - вознаграждение в пользу Технического центра за предоставление интегрированного технологического сервиса (ИТС), включая дополнительное вознаграждение за предоставление ИТС, установленное документами Технического центра (далее – Дополнительное вознаграждение).
- 37.2. Размер клиринговой комиссии, подлежащей уплате Участником клиринга, рассчитывается Клиринговым центром в соответствии с Тарифами Клирингового центра на рынке ценных бумаг (приложение № 2 к Правилам клиринга).
- 37.3. В случае нарушения Участниками клиринга порядка и сроков уплаты клиринговой комиссии Участник клиринга обязан уплатить Клиринговому центру неустойку в размере 2% (двух процентов), НДС не облагается, от суммы неуплаченной клиринговой комиссии за каждый день просрочки.
- 37.4. Комиссионное вознаграждение Биржи за организацию торгов, включая неустойку за нарушение порядка и сроков его уплаты, взимается Клиринговым центром в соответствии с действующими размерами комиссионного вознаграждения за организацию торгов, утвержденными Биржей (далее – Тарифы Биржи), на основании договора, заключенного с Биржей.
- 37.5. Вознаграждение Технического центра, включая неустойку за нарушение порядка и сроков его уплаты, взимается Клиринговым центром в соответствии с действующими размерами вознаграждения за предоставление ИТС, утвержденными Техническим центром (далее – Тарифы Технического центра), на основании договора, заключенного с Техническим центром.
- 37.6. Участник клиринга исполняет обязательства по уплате комиссионных вознаграждений Клирингового центра, Биржи и Технического центра в российских рублях.
- 37.7. Размер обязательства Участников клиринга по уплате Комиссионного вознаграждения по биржевым сделкам РЕПО и по биржевым сделкам купли-продажи акций рассчитывается с учетом выбранного Участником клиринга тарифного плана.
- 37.7.1. Выбор тарифного плана по биржевым сделкам РЕПО осуществляется Участником клиринга путем предоставления Клиринговому центру Заявления о выборе (смене) тарифного плана по сделкам РЕПО.
- Выбор тарифного плана по биржевым сделкам купли-продажи акций осуществляется Участником клиринга путем предоставления Клиринговому центру Заявления о выборе (смене) тарифного плана по сделкам купли-продажи акций

В случае непредоставления заявлений, указанных в настоящем подпункте Правил клиринга для Участника клиринга действует Тарифный план 1 «Базовый» по биржевым сделкам РЕПО и/или Тарифный план 1 по биржевым сделкам купли-продажи акций.

- 37.7.2. Заявления о выборе (смене) тарифного плана предоставляются Участником клиринга на бумажном носителе.

Заявление о выборе (смене) тарифного плана предоставляется в Клиринговый центр не позднее, чем за 5 (пять) рабочих дней до первого числа месяца, начиная с которого будет действовать выбранный тарифный план.

В случае предоставления Участником клиринга Заявления о выборе (смене) тарифного плана, выбранный на основании такого заявления тарифный план действует до момента предоставления Участником клиринга нового Заявления о выборе (смене) тарифного плана.

- 37.8. В случае выбора Участником клиринга тарифного плана по сделкам РЕПО или по сделкам купли-продажи акций, содержащего постоянную часть Комиссионного вознаграждения, такая постоянная часть Комиссионного вознаграждения подлежит уплате Участником клиринга в первый Расчетный день календарного месяца, за который взимается постоянная часть Комиссионного вознаграждения, и, по окончании Торгов в данный Расчетный день, включается в состав Нетто-обязательства по сделкам клирингового пула по денежным средствам по Счету обеспечения Т0, порядок выбора которого установлен пунктом 9.9 Правил клиринга.

- 37.9. Обратная часть Комиссионного вознаграждения по биржевым сделкам РЕПО и по сделкам купли-продажи акций, а также Комиссионное вознаграждение по биржевым сделкам купли-продажи облигаций рассчитывается при подаче заявки на заключение сделки, на ее сумму уменьшается плановое значение позиции по денежным средствам, определяемая в отношении Счета обеспечения Т0, соответствующего Торговому счету, входящему в состав Торгово-клирингового счета, с указанием которой подана заявка на заключение сделки (за исключением сделок, заключаемых с расчетами в иностранной валюте, и Сделок с частичным обеспечением), по окончании Торгов в дату заключения сделки обязательства по уплате указанного Комиссионного вознаграждения включается в состав Нетто-обязательства по сделкам клирингового пула по денежным средствам по указанному Счету обеспечения Т0.

Для указанных сделок с расчетами в иностранной валюте на сумму рассчитанного при подаче заявки Комиссионного вознаграждения, пересчитанного в российские рубли по курсу, установленному Банком России на дату заключения сделки, уменьшается плановое значение позиции по денежным средствам, определяемой в отношении Счета обеспечения Т0, порядок выбора которого установлен пунктом 9.9 Правил клиринга.

- 37.10. Возвратная премия предоставляется по итогам календарного месяца Участникам клиринга, выполнившим условия, необходимые для получения возвратной премии, предусмотренные Тарифами Клирингового центра и Тарифами Биржи.

Информация о суммах возвратной премии, подлежащих перечислению Участнику клиринга, предоставляется Участнику клиринга в Отчете о возвратной премии.

Возвратная премия перечисляется Участнику клиринга Биржей и Клиринговым центром на Торговый счет, порядок выбора которого установлен пунктом 9.9 Правил клиринга, не позднее третьего Расчетного дня месяца, следующего за месяцем оказания клиринговых услуг.

- 37.11. Комиссионное вознаграждение по Сделкам с частичным обеспечением рассчитывается по окончании Торгов в каждый Расчетный день и включается в состав Нетто-обязательства по сделкам клирингового пула по денежным средствам по Счету обеспечения T0, порядок выбора которого установлен пунктом 9.9 Правил клиринга.
- 37.12. Комиссионное вознаграждение по внебиржевым сделкам рассчитывается по окончании Торгов в дату регистрации Поручения на клиринг внебиржевой сделки, и включается в состав Нетто-обязательства по сделкам клирингового пула по денежным средствам по Счету обеспечения T0, соответствующего Торговому счету, указанному в Поручении на клиринг внебиржевой сделки (за исключением внебиржевых сделок, заключаемых в иностранной валюте).
- 37.13. Абонентская плата, 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 абонентская плата, и, по окончании Торгов в данный Расчетный день, включается в состав Нетто-обязательства по сделкам клирингового пула по денежным средствам по Счету обеспечения T0, порядок выбора которого установлен пунктом 9.9 Правил клиринга.

В случае прекращения допуска Участника клиринга к участию в Торгах Биржи в течение квартала, абонентская плата взимается на следующий Расчетный день после прекращения допуска к участию в Торгах.

- 37.14. Комиссионное вознаграждение за предоставление по запросам Участников клиринга дубликатов отчетов по итогам клиринга, предусмотренных Правилами клиринга, подлежат уплате Участником клиринга в день предоставления указанных дубликатов и, по окончании Торгов в данный Расчетный день, включается в состав Нетто-обязательства по сделкам клирингового пула по денежным средствам по Счету обеспечения T0, порядок выбора которого установлен пунктом 9.9 Правил клиринга.
- 37.15. Участник клиринга вправе выбрать тарифный план «Размещения-фиксированный». Выбор тарифного плана «Размещения-фиксированный» осуществляется на основании Заявления о выборе тарифного плана «Размещения-фиксированный» предоставленного Участником клиринга в бумажной форме.
- Заявление предоставляется Участником клиринга Клиринговому центру не позднее, чем за 10 (десять) рабочих дней до начала периода, состоящего из 3 (трех) последовательных календарных месяцев, с которого будет применяться тарифный план «Размещения-фиксированный».
- Период действия тарифного плана «Размещения-фиксированный» составляет 12 (двенадцать) календарных месяцев, начиная с первого числа месяца, указанного в заявлении.

В случае выбора Участником клиринга тарифного плана «Размещения-фиксированный» Участник клиринга уплачивает Комиссионное вознаграждение Биржи, Клирингового центра и вознаграждение Технического центра по биржевым сделкам купли-продажи облигаций и/или еврооблигаций 2 (двух) эмитентов, указанных в Заявлении Участника клиринга о выборе тарифного плана «Размещения-фиксированный», в которых Участник клиринга будет являться продавцом при осуществлении размещения или доразмещения (отчуждения первичным владельцем) в режимах торгов Режим основных торгов, Размещение: адресные заявки и Размещение: аукцион, а также в которых Участник клиринга будет являться покупателем в режимах торгов Выкуп: адресные заявки, Выкуп: Аукцион, в пользу Биржи, Клирингового центра и Технического центра соответственно.

Иные виды комиссионного вознаграждения по указанным биржевым сделкам с Участника клиринга, выбравшего тарифный план «Размещения-фиксированный», не взимаются.

Комиссионное вознаграждение по тарифному плану «Размещения-фиксированный» подлежит уплате Участником клиринга в первый Расчетный день первого месяца из 3 (трех) последовательных календарных месяцев, за которые взимается указанное Комиссионное вознаграждение, и, по окончании Торгов в данный Расчетный день, включается в состав Нетто-обязательства по сделкам клирингового пула по денежным средствам по Счету обеспечения Т0, порядок выбора которого установлен пунктом 9.9 Правил клиринга.

- 37.16. Определенное в соответствии с Тарифами Технического центра, отличное от нуля Дополнительное вознаграждение, рассчитанное в отношении Участника клиринга / Клиента Участника клиринга, подлежит уплате Участником клиринга в Расчетный день, по итогам которого указанное дополнительное вознаграждение рассчитано, и по окончании Торгов в данный Расчетный день, включается в состав Нетто-обязательства по сделкам клирингового пула по денежным средствам по Счету обеспечения Т0, соответствующего Торговому счету, входящему в состав Торгово-клирингового счета, с указанием которого Участником клиринга в течение данного Расчетного дня были заключены сделки за свой счет или за счет указанного Клиента, если такой Торгово-клиринговый счет – единственный, либо по Счету обеспечения Т0, порядок выбора которого установлен пунктом 9.9 Правил клиринга, если Участником клиринга в течение данного Расчетного дня сделки за свой счет или за счет указанного Клиента были заключены с указанием нескольких Торгово-клиринговых счетов.
- 37.17. Сумма неустойки, предусмотренной за неисполнение обязательств Участников клиринга по уплате Комиссионного вознаграждения, включается в общий размер соответствующего обязательства Участника клиринга по уплате Комиссионного вознаграждения.
- 37.18. Обязательства Участника клиринга по уплате Комиссионного вознаграждения исполняются после исполнения иных обязательств Участника клиринга по денежным средствам, определенных в соответствии со статьей 31 Правил клиринга, за исключением обязательств по уплате Возмещения.
- 37.19. В случае недостаточности денежных средств на соответствующем Счете обеспечения Т0 для исполнения обязательств Участника клиринга по уплате

Комиссионного вознаграждения, указанные обязательства исполняются в следующей очередности:

- в первую очередь исполняются обязательства по уплате неустойки, начисленной в связи с неисполнением обязательств по уплате Комиссионного вознаграждения;
- во вторую очередь – обязательства по уплате Комиссионного вознаграждения, начисленного в предыдущие Расчетные дни;
- в третью очередь – обязательства по уплате Комиссионного вознаграждения, начисленного в текущий Расчетный день.

В случае недостаточности денежных средств на соответствующем Счете обеспечения Т0 для исполнения обязательств Участника клиринга по уплате Комиссионного вознаграждения соответствующей очереди, обязательства, входящие в соответствующую очередь, исполняются с учетом следующих приоритетов по видам Комиссионного вознаграждения:

- 1) оборотная часть Комиссионного вознаграждения;
- 2) постоянная часть Комиссионного вознаграждения по сделкам РЕПО;
- 3) постоянная часть Комиссионного вознаграждения по сделкам купли-продажи акций;
- 4) Комиссионное вознаграждение по тарифному плану «Размещения-фиксированный»;
- 5) абонентская плата;
- 6) дополнительное вознаграждение;
- 7) Комиссионное вознаграждение за предоставление дубликатов отчетов по итогам клиринга.

В случае недостаточности денежных средств на соответствующем Счете обеспечения Т0 для исполнения обязательств Участника клиринга по уплате Комиссионного вознаграждения соответствующей очереди и соответствующего вида, обязательства по уплате соответствующего вида Комиссионного вознаграждения, входящие в соответствующую очередь, исполняются с учетом следующих приоритетов по получателям Комиссионного вознаграждения:

- 1) Клиринговый центр;
- 2) Биржа;
- 3) Технический центр.

37.20. В случае недостаточности денежных средств на соответствующем Счете обеспечения Т0 для исполнения обязательств Участника клиринга по уплате Комиссионного вознаграждения, сумма неисполненных обязательств по уплате Комиссионного вознаграждения, в том числе обязательств по уплате неустойки, на следующий Расчетный день включается в Клиринговой системе в соответствующий Ограничительный лимит по уплате комиссионного вознаграждения, устанавливаемый для данного Участника клиринга, по Счету обеспечения Т0, по которому было определено неисполненное обязательство по уплате Комиссионного вознаграждения.

Значение Ограничительного лимита по уплате комиссионного вознаграждения ежедневно определяется в размере соответствующих неисполненных обязательств Участника клиринга по уплате Комиссионного вознаграждения.

Статья 38. Порядок представления отчетов по итогам клиринга

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

- Выписка из реестра сделок, принятых в клиринг, содержащая информацию об обязательствах по сделкам, допущенных к клирингу;
- Отчет по обязательствам и требованиям Участника клиринга по денежным средствам и ценным бумагам, содержащий информацию об обязательствах, определенных по результатам клиринга;
- Выписка из реестра неисполненных сделок;
- Выписка из протокола исполнения сделок и обязательств по внесению компенсационных взносов, содержащая информацию о допущенных к клирингу обязательствах по внесению компенсационных взносов;
- Отчет по обязательствам Участника клиринга по комиссионному вознаграждению;
- Отчет о торгово-клиринговых счетах и иных реквизитах Участника клиринга;
- Выписка из протокола внесения компенсационных взносов;
- Уведомление о замене Торгово-клирингового счета;
- Отчет об обязательствах по Сделкам с частичным обеспечением, содержащий информацию о допущенных к клирингу обязательствах по Сделкам с частичным обеспечением;
- Отчет об Итоговых нетто-обязательствах / нетто-требованиях, содержащий информацию об обязательствах по Сделкам с частичным обеспечением, определенных по результатам клиринга;
- Отчет об Обеспечении, содержащий информацию о размере Обеспечения Участника клиринга в денежных средствах и ценных бумагах и об изменении размера такого Обеспечения;
- Требование о погашении Задолженности;
- Отчет о Маржинальном требовании;
- Отчет о возвратной премии.

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

38.2. Для клиентов Участников клиринга Клиринговый центр формирует Выписку из реестра сделок, принятых в клиринг (по сделкам клиентов), содержащую информацию о допущенных к клирингу обязательствах по сделкам, заключенным Участником клиринга за счет клиента, для которого формируется отчет.

Указанный отчет направляется Участникам клиринга (для передачи их клиенту) и/или уполномоченным ими организациям.

Для Держателей Клиринговый центр формирует Отчет о дополнительных торговых разделах, открытых для проведения операций Участниками клиринга, и иных реквизитах.

Указанный отчет направляется Держателям и/или уполномоченным ими организациям.

38.3. В случае предоставления Участником клиринга Клиринговому центру Заявления о предоставлении отчетов Держателю, для Держателя, указанного в заявлении, Клиринговый центр формирует Выписку из реестра сделок, принятых в клиринг (для Держателей), содержащую информацию о допущенных к клирингу обязательствах по сделкам, заключенным Участником клиринга с указанием Торгово-клиринговых счетов, в состав которых входят позиции по ценным бумагам, определяемые в отношении торговых разделов Держателя.

Указанный отчет направляется Держателю и/или уполномоченной им организации.

38.4. В случае предоставления Участником клиринга Клиринговому центру Заявления о предоставлении отчетов Клиринговому банку, для Клирингового банка, указанного в заявлении, Клиринговый центр формирует Выписку из реестра сделок, принятых в клиринг (для Клиринговых банков), содержащая информацию о допущенных к клирингу обязательствах по сделкам, заключенным Участником клиринга с указанием Торгово-клиринговых счетов, в состав которых входят позиции по денежным средствам, определяемые в отношении торговых банковских счетов Клирингового банка.

Указанный отчет направляется Клиринговому банку.

38.5. Отчеты, указанные в пунктах 38.1 и 38.2 Правил клиринга, направляются Участнику клиринга (Держателю, Клиринговому банку) в форме электронных документов в соответствии с Порядком ЭДО.

38.6. Отчеты, направляемые в форме электронных документов, имеют категорию «В»³ и составляются в текстовом формате (ASCII) в соответствии с Порядком ЭДО.

38.7. Отчеты в форме электронных документов направляются Участнику клиринга / Держателю / Клиринговому банку ежедневно при условии совершения им (по его поручению / с использованием его торговых разделов (торговых банковских счетов)) операций в Клиринговой системе.

Отчет о торгово-клиринговых счетах и иных реквизитах Участника клиринга и Отчет о дополнительных торговых разделах, открытых для проведения операций Участниками клиринга направляются, соответственно, Участнику клиринга и Держателю дополнительно каждый первый Расчетный день месяца.

Отчеты о возвратной премии направляются Участникам клиринга, выполнившим условия, необходимые для получения возвратной премии по итогам календарного месяца, в первый Расчетный день месяца, следующего за отчетным.

38.8. Участнику клиринга на основании его письменного запроса могут быть выданы повторно отчеты в бумажной форме или в форме электронных документов, а также отчеты, не предусмотренные пунктами 38.1 и 38.2 Правил клиринга (далее - нестандартные отчеты), в бумажной форме.

³ Понятие категории электронного документа определяется в Правилах ЭДО

- 38.9. Для получения в бумажной форме отчетов, указанных в пункте 38.8 Правил клиринга, Участник клиринга обязан предоставить Клиринговому центру Доверенность на получение и предоставление документов.
- 38.10. Отчеты в бумажной форме или в форме электронных документов, указанные в пункте 38.8 Правил клиринга, а также нестандартные отчеты в бумажной форме предоставляются/направляются Участникам клиринга в течение 5-ти рабочих дней, начиная с Расчетного дня, следующего за днем оплаты Участником клиринга выставленного Клиринговым центром счета в соответствии с Тарифами Клирингового центра на рынке ценных бумаг, предусмотренными приложением № 2 к Правилам клиринга.
- 38.11. 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.
- 38.12. Форматы и формы отчетов, предоставляемых Клиринговым центром в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга, установлены документом «Форматы и формы отчетов, предоставляемых Участникам клиринга, клиентам Участников клиринга, Держателям и Клиринговым банкам в соответствии с Правилами клиринга ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр» на рынке ценных бумаг», раскрываемом на Сайте Клирингового центра.

РАЗДЕЛ VII. ПРОЧИЕ УСЛОВИЯ

Статья 39. Порядок урегулирования обязательств в случае прекращения допуска к клиринговому обслуживанию

39.1. В случае отзыва (аннулирования) Банком России у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций, клиринговое обслуживание Участника клиринга - кредитной организации прекращается с даты отзыва (аннулирования) Банком России у такого Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций.

39.1.1. Подтверждением факта отзыва (аннулирования) лицензии на осуществление банковских операций у Участника клиринга - кредитной организации является письменное уведомление Банка России, направленное Клиринговому центру (в том числе, посредством факсимильной связи) и/или размещенная Пресс-центром Банка России на сайте Банка России в сети Интернет информация о решении Банка России об отзыве (аннулировании) выданной Участнику клиринга - кредитной организации лицензии на осуществление банковских операций и/или направленное Пресс-центром Банка России по электронному адресу Клирингового центра электронное сообщение, содержащее информацию об отзыве (аннулировании) у Участника клиринга - кредитной организации лицензии на осуществление банковских операций.

39.1.2. В случае отзыва лицензии на осуществление банковских операций у Участника клиринга – кредитной организации, обязательства по сделкам, заключенным до даты отзыва такой лицензии, прекращаются полностью на дату, предшествующую дате отзыва лицензии на осуществление банковских операций у Участника клиринга – кредитной организации.

Указанные обязательства по Сделкам с частичным обеспечением прекращаются возникновением нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга – кредитной организации, рассчитанного в соответствии с пунктом 39.3 Правил клиринга, если Участник клиринга решением суда признан несостоятельным (банкротом), или рассчитанного в соответствии с пунктом 39.4 Правил клиринга, если в отношении Участника клиринга принято решение суда о его ликвидации. Такое нетто-обязательство / нетто-требование Участника клиринга – кредитной организации подлежит исполнению не ранее дня вступления в силу решения арбитражного суда о признании Участника клиринга несостоятельным (банкротом) или о ликвидации Участника клиринга.

Указанные обязательства по сделкам купли-продажи с кодом расчетов В0-В30, сделкам РЕПО с кодом расчетов Rb, S0-S2, Z0 прекращаются возникновением нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга – кредитной организации в отношении других Участников клиринга – его контрагентов по указанным сделкам. Размер указанных нетто-обязательств / нетто-требований рассчитывается в соответствии с пунктом 39.5 Правил клиринга. Такие нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга – кредитной организации подлежат исполнению не ранее дня вступления в силу решения арбитражного суда о признании Участника клиринга несостоятельным (банкротом) или о ликвидации Участника клиринга.

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

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

39.1.4. Клиринговый центр направляет Участнику клиринга - кредитной организации, у которого отозвана (аннулирована) лицензия на осуществление банковских операций, в форме электронного документа уведомление о прекращении обязательств по сделкам не позднее рабочего дня, следующего за датой прекращения обязательств по этим сделкам. Указанное уведомление также содержит информацию о рассчитанных в соответствии с пунктом 39.5 Правил клиринга нетто-обязательствах / нетто-требованиях Участника клиринга – кредитной организации в отношении его контрагентов по сделкам купли-продажи с кодом расчетов В0-В30, сделкам РЕПО с кодом расчетов Rb, S0-S2, Z0.

Уведомления о прекращении обязательств по сделкам купли-продажи с кодом расчетов В0-В30, сделкам РЕПО с кодом расчетов Rb, S0-S2, Z0, содержащие информацию о рассчитанных в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга нетто-обязательствах / нетто-требованиях Участников клиринга - контрагентов Участника клиринга – кредитной организации, у которого отозвана (аннулирована) лицензия на осуществление банковских операций, по указанным сделкам, направляются указанным Участникам клиринга – контрагентам в том же порядке и в те же сроки.

39.1.5. Клиринговый центр в порядке, предусмотренном пунктом 39.3 или 39.4 Правил клиринга, рассчитывает сумму нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга – кредитной организации и направляет такому Участнику клиринга в форме электронного документа уведомление о рассчитанной в соответствии с пунктом 39.3 или 39.4 Правил клиринга сумме нетто-обязательства или нетто-требования Участника клиринга.

39.1.6. Возврат денежных средств Участнику клиринга – кредитной организации осуществляется Клиринговым центром в течение 3 (трех) банковских дней после получения Клиринговым центром письма о возврате денежных средств от уполномоченного органа кредитной организации, содержащего платежные реквизиты, а также документов, подтверждающих полномочия указанного органа (если они ранее не были переданы Клиринговому центру), но не ранее дня вступления в силу решения арбитражного суда о признании Участника клиринга несостоятельным (банкротом) или о ликвидации Участника клиринга.

Возврат денежных средств Участнику клиринга – кредитной организации осуществляется Клиринговым центром в сумме нетто-требования Участника клиринга, рассчитанного соответственно в порядке, предусмотренном пунктом 39.3 или 39.4 Правил клиринга.

39.1.7. Клиринговый центр вправе предъявить к Участнику клиринга – кредитной организации требование о взыскании нетто-обязательства Участника клиринга, рассчитанного соответственно в порядке, предусмотренном пунктом 39.3 или 39.4

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

39.1.8. После принятия арбитражным судом решения о признании Участника клиринга – кредитной организации несостоятельным (банкротом) или о ликвидации Участника клиринга – кредитной организации и направления ему уведомления о рассчитанных нетто-обязательствах / нетто-требованиях Клиринговый центр направляет такому Участнику клиринга в форме электронного документа уведомление о прекращении действия Договора об оказании клиринговых услуг.

39.2. В случае назначения временной администрации или принятия арбитражным судом решения о введении в отношении Участника клиринга одной из процедур банкротства, клиринговое обслуживание Участника клиринга, не являющегося кредитной организацией, 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.

39.2.1. В случае назначения временной администрации или принятия арбитражным судом решения о введении в отношении Участника клиринга, не являющегося кредитной организацией, одной из процедур банкротства, обязательства по сделкам прекращаются полностью в дату прекращения клирингового обслуживания.

Указанные обязательства по Сделкам с частичным обеспечением прекращаются возникновением нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга, не являющегося кредитной организацией, рассчитанных в соответствии с пунктом 39.4 Правил клиринга.

Указанные обязательства по сделкам купли-продажи с кодом расчетов В0-В30, сделкам РЕПО с кодом расчетов Rb, S0-S2, Z0 прекращаются возникновением нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга, не являющегося кредитной организацией, в отношении других Участников клиринга – его контрагентов по указанным сделкам. Размер указанных нетто-обязательств / нетто-требований рассчитывается в соответствии с пунктом 39.5 Правил клиринга. Такие нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга – кредитной организации подлежат исполнению не ранее дня вступления в силу решения арбитражного суда о признании Участника клиринга несостоятельным (банкротом) или о ликвидации Участника клиринга.

39.2.2. Клиринговый центр направляет такому Участнику клиринга, не являющемуся кредитной организацией, в форме электронного документа уведомление о прекращении обязательств по сделкам не позднее Рабочего дня, следующего за датой прекращения обязательств по указанным сделкам. Указанное уведомление также содержит информацию о рассчитанных в соответствии с пунктом 39.5 Правил клиринга нетто-обязательствах / нетто-требованиях Участника клиринга, не являющегося кредитной организацией, в отношении его контрагентов по сделкам купли-продажи с кодом расчетов В0-В30, сделкам РЕПО с кодом расчетов Rb, S0-S2, Z0.

Уведомления о прекращении обязательств по сделкам купли-продажи с кодом расчетов В0-В30, сделкам РЕПО с кодом расчетов Rb, S0-S2, Z0, содержащие информацию о рассчитанных в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга нетто-обязательствах / нетто-требованиях Участников клиринга - контрагентов Участника клиринга, не являющегося кредитной организацией, в отношении

которого назначена временная администрация или введена одна из процедур банкротства, по указанным сделкам, направляются указанным Участникам клиринга – контрагентам в том же порядке и в те же сроки.

39.2.3. Клиринговый центр в порядке, предусмотренном пунктом 39.4 Правил клиринга, рассчитывает сумму нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга, не являющегося кредитной организацией, и направляет такому Участнику клиринга в форме электронного документа уведомление о рассчитанной в соответствии с пунктом 39.4 Правил клиринга сумме нетто-обязательства или нетто-требования Участника клиринга.

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

Возврат денежных средств Участнику клиринга, не являющемуся кредитной организацией, осуществляется Клиринговым центром в сумме нетто-требования Участника клиринга, рассчитанного в порядке, предусмотренном пунктом 39.4 Правил клиринга.

39.2.5. Клиринговый центр вправе предъявить к Участнику клиринга, не являющемуся кредитной организацией, требование о взыскании нетто-обязательства Участника клиринга, рассчитанного в порядке, предусмотренном пунктом 39.4 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).

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

39.3. В случае принятия арбитражным судом решения о признании Участника клиринга – кредитной организации несостоятельным (банкротом) Клиринговый центр рассчитывает размер нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в российских рублях следующим образом:

- 1) по каждой ценной бумаге, включенной в Клиринговый лист для Сделок с частичным обеспечением, рассчитывает нетто-позицию Участника клиринга по ценной бумаге как сумму (с учетом знака) Нетто-обязательств / Нетто-требований Участника клиринга по Сделкам с частичным обеспечением по всем Разделам для учета ценных бумаг в Обеспечении и Датам исполнения по ценной бумаге, учитываемых на конец дня, предшествующего дате отзыва (аннулирования) у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций;
- 2) если нетто-позиция Участника клиринга по ценной бумаге является позицией на продажу, Клиринговый центр рассчитывает произведение абсолютной величины нетто-позиции Участника клиринга по ценной бумаге и разности

- последней определенной Расчетной цены ценной бумаги, и цены сделки, заключенной Клиринговым центром в соответствии с пунктом 29.9 Правил клиринга в объеме, равном нетто-позиции Участника клиринга по ценной бумаге, с направленностью, противоположной направленности нетто-позиции Участника клиринга по ценной бумаге (на покупку);
- 3) если нетто-позиция Участника клиринга по ценной бумаге является позицией на покупку, Клиринговый центр рассчитывает произведение нетто-позиции Участника клиринга по ценной бумаге и разности цены сделки, заключенной Клиринговым центром в соответствии с пунктом 29.9 Правил клиринга в объеме, равном нетто-позиции Участника клиринга по ценной бумаге, с направленностью, противоположной направленности нетто-позиции Участника клиринга по ценной бумаге (на продажу) и последней определенной Расчетной цены ценной бумаги;
 - 4) для каждого Участника клиринга рассчитывает сумму с учетом знака:
 - по всем ценным бумагам, включенным в Клиринговый лист для Сделок с частичным обеспечением, произведений, рассчитанных в соответствии с подпунктами 2, 3 настоящего пункта Правил клиринга;
 - Обеспечения Участника клиринга в российских рублях (учитывается со знаком «плюс»);
 - Обеспечения Участника клиринга в иностранной валюте, пересчитанного в российские рубли по курсу, установленному Банком России на день отзыва у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций (учитывается со знаком «плюс»);
 - взноса Участника клиринга в Гарантийный фонд (учитывается со знаком «плюс»);
 - значения (с учетом знака) обязательства / требования Участника клиринга в российских рублях по возврату Гарантийных переводов, рассчитанного на дату, предшествующую дате отзыва (аннулирования) у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций, и
 - Задолженности и/или Задолженности по гарантийным переводам (со знаком «минус») Участника клиринга в российских рублях, возникшей до даты отзыва (аннулирования) у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций.

Если указанная сумма 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.

- 39.4. В случае принятия арбитражным судом решения о ликвидации Участника клиринга – кредитной организации или в случае назначения временной администрации или принятия арбитражным судом решения о введении в отношении Участника клиринга, не являющегося кредитной организацией, одной из процедур банкротства (за исключением конкурсного управления), Клиринговый центр рассчитывает размер нетто-обязательства Участника клиринга в российских рублях в порядке, предусмотренном пунктом 39.3 Правил клиринга, но с учетом параметров Сделок с частичным обеспечением, заключенных Участником клиринга до момента отзыва (аннулирования) у него лицензии на осуществление

банковских операций в день отзыва (аннулирования) указанной лицензии, а также неустоек (штрафов, пеней) и комиссионных вознаграждений, подлежащих уплате Участником клиринга в соответствии с Правилами клиринга.

39.5. Клиринговый центр рассчитывает размер нетто-обязательств / нетто-требований в российских рублях Участника клиринга (далее – Ликвидант) в отношении других Участников клиринга – его контрагентов по сделкам купли-продажи с кодом расчетов В0-В30, сделкам РЕПО с кодом расчетов Rb, S0-S2, Z0 следующим образом.

39.5.1. Нетто-обязательство (нетто-требование) Ликвиданта по денежным средствам в каждой валюте в отношении каждого Участника клиринга – контрагента по сделкам, рассчитывается по сделкам в соответствующей валюте, заключенным с данным Участником клиринга, по формуле:

НОД = СТ - СО, где:

НОД - нетто-обязательство (нетто-требование) Ликвиданта по денежным средствам в соответствующей валюте;

СТ - сумма требований, а **СО** – сумма обязательств Ликвиданта по денежным средствам по:

- сделкам с кодом расчетов В0-В30;
- первым частям сделок РЕПО с кодом расчетов S0-S2;
- вторым частям сделок РЕПО с кодом расчетов Rb, S0-S2, Z0.

Отрицательное значение НОД означает нетто-обязательство Ликвиданта по денежным средствам в соответствующей валюте, положительное значение НОД - нетто-требование Ликвиданта по денежным средствам.

39.5.2. Нетто-обязательство (нетто-требование) Ликвиданта по ценным бумагам в отношении каждого Участника клиринга – контрагента по сделкам, рассчитывается по сделкам, заключенным с данным Участником клиринга, по формуле:

НОЦ = СТЦ - СОЦ, где:

НОЦ - нетто-обязательство (нетто-требование) Ликвиданта по ценной бумаге;

СТЦ - сумма требований, а **СОЦ** – сумма обязательств Ликвиданта по соответствующей ценной бумаге по:

- сделкам с кодом расчетов В0-В30;
- первым частям сделок РЕПО с кодом расчетов S0-S2;
- вторым частям сделок РЕПО с кодом расчетов Rb, S0-S2, Z0.

Отрицательное значение НОЦ означает нетто-обязательство Ликвиданта по ценной бумаге, положительное значение НОЦ - нетто-требование Ликвиданта по ценной бумаге.

39.5.3. Определенное в соответствии с подпунктом 39.5.1 Правил клиринга нетто-обязательство (нетто-требование) Ликвиданта по денежным средствам в российских рублях в отношении каждого Участника клиринга – контрагента по сделкам складывается с учетом знака с определенным в соответствии с подпунктом 39.5.1 Правил клиринга нетто-обязательство (нетто-требование) Ликвиданта по денежным средствам в иностранной валюте в отношении того же Участника клиринга – контрагента по сделкам, пересчитанным в российские рубли

по курсу, установленному Банком России на дату прекращения клирингового обслуживания Участника клиринга, а также - с определенным в соответствии с подпунктом 39.5.2 Правил клиринга нетто-обязательством (нетто-требованием) Ликвиданта по ценным бумагам в отношении того же Участника клиринга – контрагента по сделкам, пересчитанным в российские рубли по рыночной цене ценной бумаги, определенной на дату прекращения обязательств по сделкам.

Если значение, определенное в соответствии с настоящим подпунктом Правил клиринга, отрицательное, это означает наличие нетто-обязательства в российских рублях Ликвиданта по отношению к Участнику клиринга – контрагенту, если положительное – наличие нетто-требования в российских рублях Ликвиданта по отношению к Участнику клиринга – контрагенту.

- 39.6. В случае отзыва (аннулирования) лицензии на осуществление банковских операций у Клирингового центра, обязательства по Сделкам с частичным обеспечением, 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 39.7 Правил клиринга, если Клиринговый центр решением суда признан несостоятельным (банкротом), или рассчитанного в соответствии с пунктом 39.8 Правил клиринга, если в отношении Клирингового центра принято решение суда о его ликвидации. Такое нетто-обязательство Клирингового центра подлежит исполнению после вступления в силу соответствующего решения арбитражного суда.

- 39.6.1. В случае отзыва (аннулирования) лицензии на осуществление банковских операций у Клирингового центра, обязательства по Сделкам с частичным обеспечением, 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).

- 39.7. В случае принятия арбитражным судом решения о признании Клирингового центра несостоятельным (банкротом) размер нетто-обязательства / нетто-требования Клирингового центра в российских рублях в отношении каждого Участника клиринга рассчитывается как сумма с учетом знака:

- по каждой ценной бумаге, включенной в Клиринговый лист для Сделок с частичным обеспечением, произведения нетто-позиция Участника клиринга по ценной бумаге, рассчитанной как сумма (с учетом знака) Нетто-обязательств / Нетто-требований Участника клиринга по Сделкам с частичным обеспечением по всем Разделам для учета ценных бумаг в Обеспечении и Датах исполнения по ценной бумаге, учитываемых на конец дня, предшествующего дате отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций, и последней определенной Расчетной цены ценной бумаги;
- Обеспечения Участника клиринга в российских рублях (учитывается со

знаком «плюс»);

- Обеспечения Участника клиринга в иностранной валюте, пересчитанного в российские рубли по курсу, установленному Банком России на день отзыва у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций (учитывается со знаком «плюс»);
- неисполненных Маржинальных требований, возникших до даты отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций (учитываются со знаком «минус»);
- взноса Участника клиринга в Гарантийный фонд (учитывается со знаком «плюс»);
- значения (с учетом знака) обязательства / требования Участника клиринга в российских рублях по возврату Гарантийных переводов, рассчитанного на дату, предшествующую дате отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций, и
- Задолженности и/или Задолженности по гарантийным переводам (учитывается со знаком «минус») Участника клиринга в российских рублях, возникшей до даты отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций.

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

39.8. В случае принятия арбитражным судом решения о ликвидации Клирингового центра размер нетто-обязательства / нетто-требования Клирингового центра в российских рублях в отношении Участника клиринга рассчитывается в порядке, предусмотренном пунктом 39.7 Правил клиринга, но с учетом неустоек (штрафов, пеней), комиссионных вознаграждений, подлежащих уплате в соответствии с Правилами клиринга.

39.9. Информация о размере нетто-обязательства / нетто-требования Клирингового центра в российских рублях в отношении Участника клиринга, определенных в соответствии с пунктами 39.7, 39.8 Правил клиринга направляется Клиринговым центром Участнику клиринга в форме электронного документа.

Статья 40. Взаимодействие с Биржей при возникновении обстоятельств, которые могут повлиять на возможность проведения Торгов

40.1. 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 сбой, неисправности и отказы оборудования; сбои и ошибки программного обеспечения; сбои, неисправности и отказы систем связи, энергоснабжения, кондиционирования и других систем жизнеобеспечения, а также иные обстоятельства, такие как случаи нарушения правил разграничения доступа и/или попыток несанкционированного доступа к Клиринговой системе, Клиринговый центр незамедлительно уведомляет об этом Биржу и/или Расчетную организацию

и/или Депозитарий любым из доступных средств связи и предпринимает все возможные меры, направленные на устранение указанных обстоятельств.

Статья 41. Чрезвычайные ситуации

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

- обстоятельства, вызывающие и/или создающие предпосылки к возникновению сбоев (отказов) при эксплуатации Клиринговой системы и/или непосредственно препятствующие ее нормальному (штатному) функционированию, в том числе, обстоятельства непреодолимой силы, а также сбои, неисправности и отказы оборудования; сбои и ошибки программного обеспечения; сбои, неисправности и отказы систем связи, энергоснабжения, кондиционирования и других систем жизнеобеспечения, а также иные обстоятельства, такие как случаи нарушения правил разграничения доступа и/или попыток несанкционированного доступа к Клиринговой системе, последствия которых не устранены в течение 3 (трех) часов со времени окончания торгов;
- военные действия, акты террора, диверсии и саботажа, массовые беспорядки, забастовки, смена политического режима и другие политические осложнения;
- изменения законодательных или иных актов государственных органов Российской Федерации, решений законодательных и исполнительных органов власти;
- пожары или иные несчастные случаи, разрушения или значительные повреждения занимаемых Клиринговым центром помещений;
- любые иные обстоятельства, которые создают или могут создать угрозу жизни или здоровью работников Клирингового центра;
- получение сообщения Биржи о возникновении чрезвычайной ситуации, которая может привести к нарушению клирингового обслуживания Участников клиринга;
- иные обстоятельства, препятствующие клиринговому обслуживанию Участников клиринга, которые, находятся вне контроля Клирингового центра.

41.2. Признание ситуации чрезвычайной осуществляется по решению Клирингового центра.

41.3. В случае признания ситуации чрезвычайной Клиринговый центр извещает Участников клиринга, Биржу, Расчетную организацию/ Депозитарий имеющимися доступными средствами связи о возникновении чрезвычайной ситуации и предпринимаемых в связи с этим действиях.

41.4. В качестве мер по урегулированию чрезвычайной ситуации (при необходимости по согласованию с Биржей) Правлением Клирингового центра 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, Депозитарием и Биржей;

- об отмене результатов Процедуры контроля обеспечения по некоторым или всем сделкам, обязательства по которым были включены в клиринговый пул для расчетов в ходе торгов или клиринговый пул для расчетов по итогам торгов, прошедшим Процедуру контроля обеспечения в текущий Расчетный день, но расчеты по которым не проведены;
- об исключении из клирингового пула для расчетов в ходе торгов или из клирингового пула для расчетов по итогам торгов обязательств по некоторым или всем сделкам;
- о переносе на следующий Расчетный день Даты исполнения обязательств Участников клиринга по сделкам, обязательства по которым не были исключены из клирингового пула для расчетов в ходе торгов или из клирингового пула для расчетов по итогам торгов, но по которым в текущий Расчетный день отменены результаты Процедуры контроля обеспечения, либо не проведена Процедура контроля обеспечения;
- о переносе на следующий Расчетный день Даты исполнения обязательств Участников клиринга по уплате Комиссионного вознаграждения и/или обязательств Участников клиринга по уплате Возмещения по некоторым или всем сделкам, обязательства по которым включены в клиринговый пул;
- 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.

- 41.5. 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.
- 41.6. 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.
- 41.7. 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 41.1 Правил клиринга.

Статья 42. Порядок разрешения споров

- 42.1. Все гражданско-правовые споры и разногласия, возникшие между Участниками клиринга, Участником клиринга и Клиринговым центром в связи с проведением клиринга (оказанием клиринговых и иных связанных с клирингом услуг) и/или с исполнением обязательств по итогам клиринга в соответствии с Правилами клиринга, 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.

- 42.2. Решения Арбитражной комиссии при ОАО Московская Биржа являются окончательными и обязательными для сторон. Неисполненное добровольно решение Арбитражной комиссии при ОАО Московская Биржа подлежит принудительному исполнению в соответствии с законодательством Российской Федерации или законодательством иной страны места принудительного исполнения и/или международными соглашениями.

Приложение № 1
к Правилам клиринга ЗАО АКБ «Национальный
Клиринговый Центр» на рынке ценных бумаг

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 рынке ценных бумаг

Тарифы Клирингового центра на рынке ценных бумаг

| № п/п | Наименование услуги/операции | Тариф |
|---------|--|---|
| 1. | Клиринговое обслуживание Участников клиринга по биржевым сделкам с акциями, депозитарными расписками на акции и инвестиционными паями (кроме сделок РЕПО, сделок с кодом расчетов К0) | |
| 1.1. | Постоянная часть комиссионного вознаграждения, НДС не облагается | в российских рублях, по каждому Участнику клиринга за каждый календарный месяц, взимается в первый Расчетный день месяца оказания клиринговых услуг с Участника клиринга, имеющего допуск к клиринговому обслуживанию в течение одного и более дней в календарном месяце, вне зависимости от факта подачи заявок, заключения и/или исполнения Участником клиринга сделок на биржевых торгах |
| 1.1.1. | Тарифный план 1 | - |
| 1.1.2. | Тарифный план 1а | 15 000 |
| 1.1.3. | Тарифный план 2 | 10 625 |
| 1.1.4. | Тарифный план 2а | 25 625 |
| 1.1.5. | Тарифный план 3 | 191 250 |
| 1.1.6. | Тарифный план 3а | 206 250 |
| 1.1.7. | Тарифный план 4 | 850 000 |
| 1.1.8. | Тарифный план 4а | 865 000 |
| 1.1.9. | Тарифный план 5 | 2 125 000 |
| 1.1.10. | Тарифный план 5а | 2 140 000 |
| 1.2. | Оборотная часть комиссионного вознаграждения, НДС не облагается | в процентах от объема каждой сделки, взимается в дату заключения сделки с каждой стороны сделки, не менее 0,01 рубля |
| 1.2.1. | Тарифный план 1 | 0,00425% |
| 1.2.2. | Тарифный план 1а | 0,00425% ¹ |
| 1.2.3. | Тарифный план 2 | 0,0039525% |
| 1.2.4. | Тарифный план 2а | 0,0039525% ¹ |
| 1.2.5. | Тарифный план 3 | 0,0036125% |
| 1.2.6. | Тарифный план 3а | 0,0036125% ¹ |
| 1.2.7. | Тарифный план 4 | 0,0031875% |
| 1.2.8. | Тарифный план 4а | 0,0031875% ¹ |
| 1.2.9. | Тарифный план 5 | 0,0027625% |
| 1.2.10. | Тарифный план 5а | 0,0027625% ¹ |
| 2. | Комиссионное вознаграждение по биржевым сделкам с акциями с кодом расчетов К0, НДС | в процентах от объема каждой сделки, взимается в дату |

| | | |
|-----------|---|---|
| | не облагается | заклучения сделки с каждой стороны сделки, не менее 0,01 рубля |
| | | 0,004%, но не более 600 рублей |
| 3. | Комиссионное вознаграждение по биржевым сделкам с облигациями, еврооблигациями, депозитарными расписками на облигации (кроме сделок РЕПО, а также Участников клиринга и сделок, предусмотренных разделом 9), НДС не облагается | взимается в дату заключения сделки с каждой стороны сделки, не менее 0,01 рубля |
| 3.1. | по сделкам, заключенным в Режиме основных торгов | произведение 0,0000425% от объема сделки на срок до погашения ² , но не более 0,00425% от объема сделки |
| 3.2. | по сделкам, заключенным в Режиме переговорных сделок и Режиме торгов «Квал.Инвесторы – РПС» | произведение 0,0000425% от объема сделки на срок до погашения ² , но не более 0,00425% от объема сделки и не более 765 рублей |
| 3.3. | по сделкам, заключенным в Режиме торгов «Исполнения обязательств по срочным контрактам» | 0,0007% от объема сделки |
| 3.4. | по сделкам, заключенным в режимах торгов, отличных от Режиме основных торгов, Режиме переговорных сделок, Режиме торгов «Квал.Инвесторы – РПС» и Режиме торгов «Исполнения обязательств по срочным контрактам» | произведение 0,0000425% от объема сделки на срок до погашения ² , но не более 0,0053125% от объема сделки |
| 4. | Клиринговое обслуживание Участников клиринга по биржевым сделкам РЕПО | |
| 4.1. | Постоянная часть комиссионного вознаграждения по биржевым сделкам РЕПО, за исключением Сделок с частичным обеспечением, НДС не облагается | в российских рублях, по каждому Участнику клиринга за каждый календарный месяц, взимается в первый Расчетный день месяца оказания клиринговых услуг с Участника клиринга, имеющего допуск к клиринговому обслуживанию в течение одного и более дней в календарном месяце, вне зависимости от факта подачи заявок, заключения и/или исполнения Участником клиринга сделок на биржевых торгах |
| 4.1.1. | Тарифный план 1 «Базовый» | 0 |
| 4.1.2. | Тарифный план 2 «Экономный» | 63 750 |
| 4.1.3. | Тарифный план 3 «Лидер» | 212 500 |
| 4.2. | Оборотная часть комиссионного вознаграждения по биржевым сделкам РЕПО, за исключением Сделок с частичным обеспечением, НДС не облагается | взимается в дату заключения сделки РЕПО с каждой стороны сделки, не менее 5 рублей ¹ |
| 4.2.1. | Тарифный план 1 «Базовый» | произведение 0,000102% от суммы РЕПО на срок сделки РЕПО ³ |
| 4.2.2. | Тарифный план 2 «Экономный» | произведение 0,00007225% от суммы РЕПО на срок сделки РЕПО ³ |
| 4.2.3. | Тарифный план 3 «Лидер» | произведение 0,00005525% от |

| | | |
|--------|---|---|
| | | суммы РЕПО на срок сделки РЕПО ³ |
| 4.3. | Комиссионное вознаграждение по биржевым сделкам РЕПО, являющимся Сделками с частичным обеспечением и заключенным на основании безадресных заявок, НДС не облагается | взимается в дату заключения сделки РЕПО с каждой стороны сделки, не менее 5 рублей |
| 4.3.1. | для Участника клиринга, заявка РЕПО которого была сохранена в котировках и на ее основании заключена сделка РЕПО | произведение 0,000035% от суммы РЕПО на срок сделки РЕПО ³ |
| 4.3.2. | для Участника клиринга, заявка РЕПО которого удовлетворила сохраненную в котировках заявку РЕПО | произведение 0,000105% от суммы РЕПО на срок сделки РЕПО ³ |
| 4.4. | Комиссионное вознаграждение по биржевым сделкам РЕПО, являющимся Сделками с частичным обеспечением и заключенным на основании адресных заявок, НДС не облагается | взимается в дату заключения сделки РЕПО с каждой стороны сделки, не менее 5 рублей |
| 4.4.1. | для всех Участников клиринга | произведение 0,000105% от суммы РЕПО на срок сделки РЕПО ³ |
| 4.5. | В период до 28 февраля 2013 г. включительно вместо тарифов, предусмотренных пунктами 4.3-4.4 для биржевых сделок РЕПО, являющихся Сделками с частичным обеспечением | 5 рублей за каждую биржевую сделку РЕПО, взимается в дату заключения сделки РЕПО с каждой стороны сделки |
| 5. | Клиринговое обслуживание Участников клиринга по внебиржевым сделкам (кроме сделок РЕПО), НДС не облагается | в процентах от объема каждой сделки, взимается в дату регистрации Поручения на клиринг внебиржевой сделки с каждой стороны сделки, не менее 0,01 рубля |
| 5.1. | Комиссионное вознаграждение по внебиржевым сделкам с акциями, депозитарными расписками на акции, еврооблигациями и инвестиционными паями | 0,004% |
| 5.2. | Комиссионное вознаграждение по внебиржевым сделкам с облигациями, депозитарными расписками на облигации (за исключением еврооблигаций) | 0,0065% |
| 6. | Клиринговое обслуживание Участников клиринга, отнесенных к категории «Б», по внебиржевым сделкам РЕПО, НДС не облагается | произведение 0,00015% от суммы РЕПО на срок сделки РЕПО ³ , но не менее 5 рублей, взимается в дату регистрации Поручения на клиринг внебиржевой сделки |
| 7. | Клиринговое обслуживание Участников клиринга, отнесенных к категории «А», по внебиржевым сделкам РЕПО, НДС не облагается | 5 рублей за каждую внебиржевую сделку РЕПО, взимается в дату регистрации Поручения на клиринг внебиржевой сделки |
| 8. | Комиссионное вознаграждение за предоставление по запросам Участников клиринга дубликатов отчетов по итогам клиринга, предусмотренных Правилами клиринга, включая НДС | в российских рублях, за каждый дубликат одного отчета за один Расчетный день |
| | а) в форме электронного документа | 20 |
| | б) в бумажной форме | 200 |
| | в) за нестандартный отчетный документ в бумажной форме | 250 |

| | | |
|------|--|---|
| 9. | Комиссионное вознаграждение по биржевым сделкам с облигациями и/или еврооблигациями для Участников клиринга, выбравших тарифный план «Размещения-фиксированный», НДС не облагается | в российских рублях, по каждому Участнику клиринга за 3 (три) последовательных календарных месяца, взимается единовременно в первый Расчетный день оплачиваемого периода, вне зависимости от факта подачи заявок, заключения и/или исполнения Участником клиринга сделок на биржевых торгах |
| 9.1. | По биржевым сделкам с облигациями и/или еврооблигациями 2 (двух) эмитентов, указанных в заявлении Участника клиринга по форме приложения 1.1 к Правилам клиринга, в которых Участник клиринга будет являться продавцом при осуществлении размещения или доразмещения (отчуждения первичным владельцем) в режимах торгов Режим основных торгов, Размещение: адресные заявки и Размещение: аукцион, а также в которых Участник клиринга будет являться покупателем в режимах торгов Выкуп: адресные заявки, Выкуп: Аукцион | 3 706 500 |

¹ – по биржевым сделкам с акциями Участникам клиринга, выбравшим тарифные планы 1а, 2а, 3а, 4а, 5а, а также по биржевым сделкам РЕПО, за исключением Сделок с частичным обеспечением, Участникам клиринга предоставляется возвратная премия в следующем порядке:

- возвратная премия предоставляется по сделкам, заключенным без участия Центрального контрагента, в которых обеими сторонами сделки является один Участник клиринга, и по сделкам, заключенным с Центральным контрагентом на основании двух встречных заявок, поданных одним Участником клиринга;
- размер возвратной премии составляет 50% от суммы оборотной части комиссионного вознаграждения по сделке, уплаченной Участником клиринга;
- размер возвратной премии по сделке РЕПО не превышает разности между суммой оборотной части комиссионного вознаграждения по сделке РЕПО и 5 (пятью) рублями;
- возвратная премия предоставляется по итогам календарного месяца и перечисляется Участнику клиринга не позднее третьего Расчетного дня месяца, следующего за месяцем оказания клиринговых услуг.

² – срок до погашения - количество календарных дней от даты заключения сделки, не включая эту дату, до даты погашения облигации, включая эту дату.

³ – под суммой РЕПО и сроком сделки РЕПО принимаются параметры, определенные при заключении соответствующей сделки РЕПО. Для внутрисуточных сделок РЕПО для целей расчета комиссионного вознаграждения срок сделки РЕПО принимается равным 1 дню.

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

Порядок проведения технической экспертизы

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

- проверку соответствия АСП в копии электронного сообщения на бумажном носителе присвоенному Участнику клиринга / Клиринговому центру Клиринговому идентификатору;
- фиксирование результатов проверки в протоколе работы технической комиссии.

б) В случае, если:

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

считается установленным, что:

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

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

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

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

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

I. Список документов, предоставляемых юридическим лицом – резидентом

- 1) Анкета Участника клиринга (клиента) (Регистрационная карточка) на бумажном носителе и в электронном виде.
- 2) Нотариально удостоверенная копия Свидетельства о внесении записи в ЕГРЮЛ, выданная уполномоченным органом исполнительной власти, осуществляющим государственную регистрацию юридических лиц, и подтверждающую факт внесения в ЕГРЮЛ записи о государственной регистрации юридического лица (либо о юридическом лице, зарегистрированном до 1 июля 2002 года).
- 3) Копии учредительных документов юридического лица с изменениями и дополнениями с отметкой о регистрации федеральным органом исполнительной власти, уполномоченным на осуществление государственной регистрации юридических лиц. Указанные копии должны быть заверены федеральным органом исполнительной власти, уполномоченным на осуществление государственной регистрации юридических лиц, или нотариально (указанные документы не предоставляются государственными корпорациями).
- 4) Выписка из Единого государственного реестра юридических лиц (ЕГРЮЛ), действующая на дату предоставления документов и выданная регистрирующим органом не ранее 30-ти дней до дня предоставления выписки из Единого государственного реестра юридических лиц в Клиринговый центр, или нотариально удостоверенную копию такой выписки.
- 5) Нотариально удостоверенная копия свидетельства о постановке на учет в налоговом органе.
- 6) Нотариально удостоверенная копия информационного письма о присвоении кодов статистики или копия, заверенная подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица.
- 7) Нотариально удостоверенные копии лицензий на право осуществления деятельности, подлежащей лицензированию (если имеются).
- 8) В отношении единоличного исполнительного органа (далее по тексту - руководитель):
 - нотариально удостоверенная копия письма территориального учреждения Банка России с подтверждением согласования кандидатуры руководителя (только для кредитных организаций);
 - подлинник или нотариально удостоверенная копия решения уполномоченного органа юридического лица (также могут быть предоставлены нотариально удостоверенная выписка из решения или подлинник выписки, заверенный подписью лица, уполномоченного на подписание решения) об избрании единоличного исполнительного органа;
 - копия документа, удостоверяющего личность, заверенная подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица, или письмо юридического лица, содержащее сведения о реквизитах документа, удостоверяющего личность, а также о дате и месте рождения, адресе места

- жительства (регистрации) или места пребывания;
- копия свидетельства о постановке на учет в налоговом органе (ИНН), заверенная подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица, либо письмо в произвольной форме с указанием ИНН (при наличии).
- 9) В случае подписания Договора об оказании клиринговых услуг и (или) других документов в соответствии с настоящими Правилами клиринга от имени юридического лица не единоличным исполнительным органом, юридическое лицо предоставляет на такое уполномоченное лицо оригинал доверенности или нотариально удостоверенную копию, или копию доверенности, заверенную лицом, выдавшим указанную доверенность. В случае если доверенность представляет полномочия на совершение операций с денежными средствами или иным имуществом, дополнительно предоставляются:
- копия документа, удостоверяющего личность, заверенная подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица, или письмо юридического лица, содержащее сведения о реквизитах документа, удостоверяющего личность, а также о дате и месте рождения, адресе места жительства (регистрации) или места пребывания;
 - копия свидетельства о постановке на учет в налоговом органе (ИНН), заверенная подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица, либо письмо в произвольной форме с указанием ИНН (при наличии);
- 10) Нотариально удостоверенная копия карточки с образцами подписей и оттиска печати юридического лица.
- 11) Подлинник или нотариально удостоверенная копия решения уполномоченного органа юридического лица (также могут быть предоставлены нотариально удостоверенная выписка из решения или подлинник выписки, заверенный подписью лица, уполномоченного на подписание решения) об одобрении сделок, заключаемых в соответствии с Правилами клиринга с Клиринговым центром, а также Договора об оказании клиринговых услуг в случае, если сделки/договор между юридическим лицом и Клиринговым центром в соответствии с требованиями действующего законодательства признаются сделками с заинтересованностью, в противном случае юридическое лицо предоставляет письмо об отсутствии признаков заинтересованности в указанных сделках (договорах).
- 12) 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) Иные документы, которые могут быть запрошены Клиринговым центром в необходимых случаях в целях, не противоречащих действующему законодательству Российской Федерации.
- 14) Если физическое лицо, на которое требуется предоставить копию документа, удостоверяющего личность, заверенную подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица, является иностранным гражданином (лицом без гражданства), то дополнительно необходимо представить:
- заверенную печатью юридического лица и подписью уполномоченного лица

юридического лица копию документа, подтверждающего право иностранного гражданина (лица без гражданства) на пребывание (проживание) в Российской Федерации (вид на жительство, разрешение на временное проживание, виза, иной документ, подтверждающий в соответствии с законодательством Российской Федерации право иностранного гражданина или лица без гражданства на пребывание (проживание) в Российской Федерации);

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

- 15) Отчетность, указанную в пункте 1) приложения № 5 к Правилам клиринга: для кредитных организаций - за три последних отчетных месяца (за исключением отчета о прибылях и убытках), а отчет о прибылях и убытках - на последнюю отчетную квартальную дату, для некредитных организаций - за два последних отчетных квартала (за исключением расчета размера собственных средств (капитала)), а расчет размера собственных средств (капитала) – на три последние отчетные даты.

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

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, подготовленное с использованием надстройки MS EXCEL "Опись документов", размещенной на Сайте Клирингового центра.

II. Список документов, предоставляемых юридическим лицом – нерезидентом

- 1) Анкета Участника клиринга (клиента) (Регистрационная карточка) на бумажном носителе и в электронном виде.
- 2) Опросная Анкета банка-нерезидента (для банков-нерезидентов).
- 3) Действующие редакции учредительных документов и все изменения к ним.
- 4) Документ, подтверждающий государственную регистрацию юридического лица.
- 5) Документ, подтверждающий полномочия руководителей юридического лица, или доверенности на уполномоченных лиц.
- 6) В отношении лиц, уполномоченных действовать от имени юридического лица:
 - копии паспортов или других документов, которые в соответствии с законодательством Российской Федерации являются документами, удостоверяющими личность и содержащие образцы подписей лиц, уполномоченных действовать от имени юридического лица, заверенные печатью юридического лица и подписью уполномоченного лица;

- копии свидетельств о постановке на учет в налоговом органе (ИНН), заверенные подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица, либо письмо в произвольной форме с указанием ИНН (при наличии).
- 7) Документ, подтверждающий постановку юридического лица на налоговый учет в Российской Федерации (копия, верность которой засвидетельствована нотариусом или самим юридическим лицом) (при наличии).
 - 8) 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).
 - 9) Надлежащим образом оформленное специальное разрешение (лицензия или иное основание), выданное уполномоченным органом государства юридического лица-нерезидента на право осуществления деятельности, осуществление которой в соответствии с национальным законодательством государства юридического лица-нерезидента возможно при наличии соответствующего специального разрешения уполномоченного органа.
 - 10) Если физическое лицо, на которое требуется предоставить копию документа, удостоверяющего личность, заверенную подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица, является иностранным гражданином (лицом без гражданства), то дополнительно необходимо представить:
 - заверенную печатью юридического лица и подписью уполномоченного лица юридического лица копию документа, подтверждающего право иностранного гражданина (лица без гражданства) на пребывание (проживание) в Российской Федерации (вид на жительство, разрешение на временное проживание, виза, иной документ, подтверждающий в соответствии с законодательством Российской Федерации право иностранного гражданина или лица без гражданства на пребывание (проживание) в Российской Федерации);
 - заверенную печатью юридического лица и подписью уполномоченного лица юридического лица копию миграционной карты;
 - письмо со сведениями об адресе места жительства (регистрации) или места пребывания (в случае пребывания (проживания) иностранного гражданина в Российской Федерации, и если такая информация не содержится в иных документах, представленных в соответствии с настоящим списком).

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

Документы (за исключением копий паспортов и документов, содержащих образцы подписей), составленные на иностранном языке, должны быть переведены на русский язык. Верность перевода или подлинность подписи переводчика должна быть засвидетельствована нотариусом.

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

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

**Отчетность, предоставляемая Участниками клиринга
Клиринговому центру**

- 1) Кредитные организации предоставляют Клиринговому центру:
 - оборотную ведомость по счетам бухгалтерского учета кредитной организации (форма 0409101) – ежемесячно;
 - информацию об обязательных нормативах и о других показателях деятельности кредитной организации (форма 0409135) – ежемесячно;
 - расчет собственных средств (капитала) (форма 0409134) – ежемесячно;
 - отчет о прибылях и убытках кредитной организации (форма 0409102) – ежеквартально;
 - справку о численном значении норматива максимального размера риска на одного заемщика или группу связанных заемщиков (Н6) (по данным формы 0409118) – ежемесячно;
 - квартальный отчет профессионального участника рынка ценных бумаг (форма №1100) – ежеквартально.

- 2) Некредитные организации предоставляют Клиринговому центру:
 - бухгалтерский баланс (форма 0710001) – ежеквартально;
 - отчет о прибылях и убытках (форма 0710002) – ежеквартально;
 - расчет размера собственных средств (капитала) для профессиональных участников рынка ценных бумаг – ежемесячно;
 - квартальный отчет профессионального участника рынка ценных бумаг (форма №1100) – ежеквартально.

- 3) Участники клиринга обязаны предоставлять отчетность, указанную в пунктах 1) -2) настоящего приложения к Правилам клиринга, в следующие сроки:
 - 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 прибылях и убытках (форма 0409102) - не позднее 15 рабочего дня месяца, следующего за отчетным кварталом;
 - бухгалтерский баланс некредитной организации (форма 0710001), отчет о прибылях и убытках некредитной организации (форма 0710002) - не позднее 45 (сорока пяти) календарных дней, следующих за отчетным кварталом, за исключением отчетности по состоянию на 1 января, которая предоставляется не позднее 15 апреля года, следующего за отчетным;
 - информацию об обязательных нормативах и о других показателях деятельности кредитной организации (форма 0409135), справку о численном

значении норматива максимального размера риска на одного заемщика или группу связанных заемщиков (Н6) кредитной организации (по данным формы 0409118) - не позднее 15 рабочего дня месяца, следующего за отчетным месяцем;

- квартальный отчет профессионального участника рынка ценных бумаг (форма №1100) - не позднее 45 (сорока пяти) календарных дней, следующих за отчетным кварталом, за исключением отчетности по состоянию на 01 января, которая предоставляется не позднее 15 апреля года, следующего за отчетным.
- 4) Форматы предоставления отчетности, указанной в пунктах 1)-2) настоящего приложения к Правилам клиринга, определены Порядком предоставления информации и отчетности.

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

Временной регламент

1. Время (сроки) осуществления документооборота (совершения операций) в процессе взаимодействия Клирингового центра с Участниками клиринга при проведении клиринга и расчетов по сделкам с ценными бумагами, указаны в таблице 1.
2. Время (сроки) осуществления документооборота (совершения операций) в процессе взаимодействия Клирингового центра с Участниками клиринга при внесении / возврате Обеспечения и проведения клиринга по Сделкам с частичным обеспечением, указаны в таблице 2.
3. Все иные документы, которые не указаны в таблицах 1 и 2, передаются Клиринговому центру и/или предоставляются Клиринговым центром в процессе взаимодействия Клирингового центра с Участниками клиринга с 9:00 до 19:00 по московскому времени.

Таблица 1

| NN | НАИМЕНОВАНИЕ ОПЕРАЦИИ | ВРЕМЯ |
|------|--|---|
| 1. | Установление в Клиринговой системе начальных значений позиций по ценным бумагам и денежным средствам Участников клиринга. | до 9:30 |
| 2. | Операции по сделкам с ценными бумагами, заключенным с расчетами в российских рублях | |
| 2.1. | Процедура контроля обеспечения. | 9:30– 19:00 |
| 2.2. | Период регистрации поручений. Получение Клиринговым центром от Участников клиринга Специальных и Срочных отчетов на исполнение. | 9:30 – 18:30 |
| 2.3. | Период регистрации поручений. Получение Клиринговым центром от Участников клиринга Отчетов на исполнение, Поручений на внесении компенсационных взносов и Поручений на отказ от компенсационных взносов по сделкам. | 9:30 – 19:00 |
| 2.4. | Период регистрации поручений. Получение Клиринговым центром от Участников клиринга Поручений на клиринг внебиржевых сделок. | 9:30 – 19:00 |
| 2.5. | Процедура контроля обеспечения по сделкам с отложенной датой активации. | В дату активации во время, установленное по согласованию с Биржей |
| 3. | Операции по сделкам с ценными бумагами, заключенным с расчетами в иностранной валюте (в долларах США) | |
| 3.1. | Процедура контроля обеспечения. | 9:30 – 17:30 |
| 3.2. | Период регистрации поручений. Получение Клиринговым центром от Участников клиринга Специальных и Срочных отчетов на исполнение. | 9:30 – 17:00 |
| 3.3. | Период регистрации поручений. Получение Клиринговым центром от Участников клиринга Отчетов на исполнение, Поручений на внесении компенсационных взносов и Поручений на отказ от компенсационных взносов по сделкам, за исключением сделок с облигациями, эмитентом или генеральным агентом по обслуживанию которых является Банк России. | 9:30 – 17:30 |
| 3.4. | Период регистрации поручений. Получение Клиринговым центром от Участников клиринга Поручений на клиринг внебиржевых сделок. | 9:30 – 17:30 |
| 3.5. | Период регистрации поручений. Получение Клиринговым центром от Участников | 9:30 – 17:15 |

| | | |
|------|---|---|
| | клиринга Отчетов на исполнение, Поручений на внесении компенсационных взносов и Поручений на отказ от компенсационных взносов по сделкам с облигациями, эмитентом или генеральным агентом по обслуживанию которых является Банк России. | |
| 3.5. | Процедура контроля обеспечения по сделкам с отложенной датой активации. | В дату активации во время, установленное по согласованию с Биржей |
| 4. | Направление Участникам клиринга отчетных документов по итогам клиринга (в соответствии со статьей 44 Правил клиринга) в форме электронных документов. | Не позднее времени, указанного в нормативных правовых актах федерального органа исполнительной власти в области финансовых рынков |

Таблица 2

| № | НАИМЕНОВАНИЕ ОПЕРАЦИИ | ВРЕМЯ |
|----------|---|---|
| 1. | Проведение клиринговой сессии. | с 9:45 до 10:00 |
| 2. | Передача Клиринговым центром Участникам клиринга Отчетов о Маржинальном требовании, Требованиях о погашении задолженности, Отчетов об Обеспечении, Отчетов об обязательствах по Сделкам с частичным обеспечением. | до 10:15 |
| 3. | Исполнение Маржинальных требований. | до 17:30 дня возникновения Маржинального требования |
| 4. | Погашение Задолженности по гарантийным переводам. | до 17:30 дня возникновения Задолженности по гарантийным переводам |
| 5. | Погашение Задолженности. | до 17:30 Рабочего дня, следующего за днем возникновения Задолженности |
| 6. | Определение Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований. | 16:00 |
| 7. | Передача Клиринговым центром Отчетов об Итоговых нетто-обязательствах / Итоговых нетто-требованиях. | с 16:00 до 16:15 |
| 8. | Исполнение Участниками клиринга Итоговых нетто-обязательств перед Клиринговым центром. | до 17:00 |
| 9. | Исполнение Клиринговым центром Итоговых нетто-требований перед Участниками клиринга. | до 17:30 |
| 10. | Урегулирование случаев неисполнения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением. | с 17:00 до 17:30 |
| 11. | Передача Участником клиринга в Клиринговый центр распоряжений на внесение денежных средств / ценных бумаг в Обеспечение. | с 10:00 до 18:50 |
| 12. | Передача Участником клиринга в Клиринговый центр Запросов о возврате денежных средств / ценных бумаг из Обеспечения. | с 10:00 до 18:50 |
| 13. | Исполнение Участниками клиринга обязательств по уплате комиссионных вознаграждений по Сделкам с частичным обеспечением. | до 19:00 |
| 14. | Передача Клиринговым центром Участникам клиринга Отчетов об обязательствах по Сделкам с частичным обеспечением. | до 20:00 |

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

Порядок изменения позиций

Обозначения, используемые в таблицах:

S – сумма операции, указанная в заявке, запросе или реестре (в рублях, если не указано иное).

V – объем операции, указанный в заявке, запросе, сделке или реестре (в шт. ценных бумаг).

K – сумма комиссионного вознаграждения, рассчитанная по заявке (в рублях).

Сделки - сумма операции в соответствии с условиями сделки (в рублях, если не указано иное), где Сделки $\leq S$ для заявок на покупку, Сделки $\geq S$ для заявок на продажу.

Ксделки – сумма комиссионного вознаграждения (в рублях), рассчитанная по сделке, где Ксделки $\leq K$ для заявок на покупку, Ксделки $\geq K$ для заявок на продажу.

↑ - увеличение.

↓ - уменьшение.

1. Порядок установления и изменения начальных и плановых позиций по денежным средствам

| № | Операция | Значение позиции по денежным средствам (в соответствующей валюте) | |
|------|--|---|----------|
| | | Начальное | Плановое |
| 1. | Исполнение Расчетной организацией распоряжения на перевод денежных средств на клиринговый банковский счет после получения от Расчетной организации выписки по Торговым счетам (S – сумма денежных средств, учитываемых на Торговом счете) | = S | = S |
| 2. | Зачисление / списание денежных средств | | |
| 2.1. | Увеличение суммы денежных средств, учитываемых на Торговом счете, на сумму S, в том числе при возврате денежных средств из Обеспечения | ↑ на S | ↑ на S |
| 2.2. | Уменьшение суммы денежных средств, учитываемых на Счете обеспечения T0, на основании запроса согласия Клирингового центра на списание денежных средств с Торговых счетов, полученного от Расчетной организации: | | |
| | 1 шаг. Направление Расчетной организации распоряжения на перевод денежных средств с клирингового банковского счета на Торговый счет на сумму S 2 шаг. Направление Расчетной организации согласия на списание денежных средств с Торгового счета | ↓ на S | ↓ на S |
| 2.3. | Уменьшение суммы денежных средств, учитываемых на Счете обеспечения T0, на основании распоряжения Участника клиринга на внесение денежных средств в Обеспечение | ↓ на S | ↓ на S |
| 3. | Регистрация и снятие заявок | | |
| 3.1. | Регистрация заявки на покупку на заключение сделки с кодом расчетов T0, Rb; $X=S+K$ (здесь и далее – в российских рублях, если не указано иное) | | ↓ на X |
| 3.2. | Регистрация заявки на покупку на заключение сделки РЕПО с кодом расчетов T0/Un в российских рублях | | ↓ на S |

| | | | |
|-------|--|--------|------------------|
| 3.3. | Регистрация заявки на покупку на заключение сделки купли-продажи или сделки РЕПО с кодом расчетов Z0; $X=S+K$ | ↓ на S | ↓ на X |
| 3.4. | Регистрация заявки на продажу на заключение сделки купли-продажи или сделки РЕПО с кодом расчетов Z0 | | ↓ на K |
| 3.5. | Регистрация заявки на покупку / продажу на заключение сделки с кодом расчетов B0 – B30, S0 – S2 | | ↓ на K |
| 3.6. | Регистрация заявки на покупку на заключение сделки с кодом расчетов T0, Rb в иностранной валюте; S – в иностранной валюте, K – в российских рублях; позиции в иностранной валюте и в российских рублях проверяются и изменяются отдельно | | ↓ на S ↓ на K |
| 3.7. | Регистрация заявки на покупку на заключение сделки купли-продажи или сделки РЕПО с кодом расчетов Z0 в иностранной валюте; S – в иностранной валюте, K – в российских рублях; позиции в иностранной валюте и в российских рублях проверяются и изменяются отдельно | ↓ на S | ↓ на S ↓ на K |
| 3.8. | Регистрация заявки на покупку на заключение сделки с кодом расчетов B0 – B30, S0 – S2 в иностранной валюте; S – в иностранной валюте, K – в российских рублях | | ↓ на K |
| 3.9. | Регистрация заявки на продажу на заключение сделки с любым кодом расчетов в иностранной валюте; S – в иностранной валюте, K – в российских рублях | | ↓ на K |
| 3.10. | Снятие заявки на покупку на заключение сделки с кодом расчетов T0, Rb в российских рублях; $X=S+K$ | | ↑ на X |
| 3.11. | Снятие заявки на покупку на заключение сделки РЕПО с кодом T0/Уп в российских рублях | | ↑ на S |
| 3.12. | Снятие заявки на покупку на заключение сделки купли-продажи или сделки РЕПО с кодом расчетов Z0; $X=S+K$ | ↑ на S | ↑ на X |
| 3.13. | Снятие заявки на продажу на заключение сделки купли-продажи или сделки РЕПО с кодом расчетов Z0 | | ↑ на K |
| 3.14. | Снятие заявки на покупку на заключение сделки купли-продажи или сделки РЕПО с кодом расчетов Z0 в иностранной валюте; S – в иностранной валюте, K – в российских рублях | ↑ на S | ↑ на S ↑ на K |
| 3.15. | Снятие заявки на покупку / продажу на заключение сделки с кодом расчетов B0 – B30, S0 – S2, в российских рублях и иностранной валюте | | ↑ на K |
| 3.16. | Снятие заявки на покупку на заключение сделки с кодом расчетов T0, Rb в иностранной валюте; S – в иностранной валюте, K – в российских рублях | | ↑ на S ↑ на K |
| 3.17. | Снятие заявки на продажу на заключение сделки с любым кодом расчетов в иностранной валюте; S – в иностранной валюте, K – в российских рублях | | ↑ на K |
| 4. | Заключение сделок | | |
| 4.1. | Заключение сделки по заявке на продажу с кодом расчетов T0, Rb, K0, в российских рублях; $X=Сделки - Kсделки$ | | ↑ на X |
| 4.2. | Заключение сделки по заявке на покупку с кодом расчетов T0, Rb, в российских рублях; | | ↑ на X |

| | | | |
|---------|--|-----------|-----------------------------|
| | $X = S - \text{Сделки} + (K - \text{Ксделки})$ | | |
| 4.3. | Заключение сделки по заявке на покупку с кодом расчетов K0, в российских рублях; $X = \text{Сделки} + \text{Ксделки}$ | | ↓ на X |
| 4.4. | Заключение сделки по заявке на продажу с кодом расчетов T0, K0, Rb в иностранной валюте; S – в иностранной валюте | | ↑ на S |
| 4.5. | Заключение сделки по заявке на покупку с кодом расчетов T0, Rb в иностранной валюте; $X = S - \text{Сделки}$ (в иностранной валюте) $Y = (K - \text{Ксделки})$ (в российских рублях) | | ↑ на X ↑ на Y |
| 4.6. | Заключение сделки по заявке на покупку с кодом расчетов K0 в иностранной валюте; Сделки – в иностранной валюте, Ксделки – в российских рублях | | ↓ на Сделки ↓ на Ксделки |
| 4.7. | Заключение сделки по заявке на продажу с кодом расчетов T0/Yn, в российских рублях | | ↑ на Сделки |
| 4.8. | Заключение сделки по заявке на покупку с кодом расчетов T0/Yn, в российских рублях $X = S - \text{Сделки}$ | | ↑ на X |
| 5. | Регистрация и отзыв Отчетов на исполнение | | |
| 5.1. | Регистрация в Клиринговой системе Отчета на исполнение, содержащего обязательство по оплате ценных бумаг | | ↓ на Сделки |
| 5.2. | Отзыв из Клиринговой системы Отчета на исполнение, содержащего обязательство по оплате ценных бумаг | | ↑ на Сделки |
| 5.3. | Прохождение Отчетом на исполнение, содержащим требование по оплате ценных бумаг, Процедуры контроля обеспечения | | ↑ на Сделки |
| 5.4. | Регистрация в Клиринговой системе Специального отчета на исполнение, содержащего условное двустороннее нетто-обязательство по денежным средствам (X, X<0) | | ↓ на (-X) |
| 5.5. | Отзыв из Клиринговой системы Специального отчета на исполнение, содержащего условное двустороннее нетто-обязательство по денежным средствам (X, X<0) | | ↑ на (-X) |
| 5.6. | Прохождение Специальным отчетом на исполнение, содержащим условное двустороннее нетто-требование по денежным средствам (X), Процедуры контроля обеспечения | | ↑ на X |
| 5.7. | Регистрация в Клиринговой системе Срочного отчета на исполнение, содержащего нетто-обязательство по денежным средствам (X, X<0) | ↓ на (-X) | ↓ на (-X) |
| 5.8. | Отзыв из Клиринговой системы Срочного отчета на исполнение, содержащего нетто-обязательство по денежным средствам (X, X<0) | ↑ на (-X) | ↑ на (-X) |
| 5.9. | Регистрация в Клиринговой системе Поручения на внесение компенсационного взноса в виде денежных средств | | ↓ на S |
| 5.10. | Регистрация в Клиринговой системе Поручения на внесение компенсационного взноса в виде денежных средств Участником клиринга – контрагентом по сделке | | ↑ на S |
| 5.11. | Регистрация в Клиринговой системе Поручения на проведение расчетов по поставке (по поставочным контрактам срочного рынка): | | |
| 5.11.1. | по обязательствам участника клиринга по оплате поставки | | ↓ на S |

| | | | |
|---------|---|--------|--------|
| | базового актива | | |
| 5.11.2. | по требованиям участника клиринга по оплате поставки базового актива | | ↑ на S |
| 6. | Расчеты по итогам клиринга | | |
| 6.1. | Исполнение требования по оплате ценных бумаг или нетто-требования по денежным средствам в ходе торгов в размере X | | ↑ на X |
| 6.2. | Исполнение Нетто-обязательства по денежным средствам по сделкам клирингового пула по итогам торгов в размере X | ↓ на X | |
| 6.3. | Исполнение Нетто-требования по денежным средствам по сделкам клирингового пула по итогам торгов в размере X | ↑ на X | |

2. Порядок установления и изменения начальных и плановых позиций по ценным бумагам

| № | Операция | Значение позиций депо (по каждому коду ценных бумаг) | |
|------|---|--|----------|
| | | Начальное | Плановое |
| 1. | Получение от Расчетного депозитария выписки по Разделам (V – количество ценных бумаг, учитываемых на Разделе T0) | = V | = V |
| 2. | Зачисление / списание ценных бумаг | | |
| 2.1. | Увеличение количества ценных бумаг, учитываемых на Разделе T0, на количество V, в том числе при возврате ценных бумаг из Обеспечения | ↑ на V | ↑ на V |
| 2.2. | Уменьшение количества ценных бумаг, учитываемых на Разделе T0, на V на основании запроса согласия Клирингового центра на списание ценных бумаг с Разделов, полученного от Расчетного депозитария, или на основании распоряжения Участника клиринга на внесение ценных бумаг в Обеспечение | ↓ на V | ↓ на V |
| 3. | Регистрация и снятие заявок | | |
| 3.1. | Регистрация заявки на продажу на заключение сделки с кодом расчетов T0, Rb, T0/Yn в российских рублях и/или иностранной валюте | | ↓ на V |
| 3.2. | Регистрация заявки на продажу на заключение сделки купли-продажи или сделки РЕПО с кодом расчетов Z0 в российских рублях и иностранной валюте | | ↓ на V |
| 3.3. | Снятие заявки на продажу на заключение сделки с кодом расчетов T0, Rb, T0/Yn в российских рублях и/или иностранной валюте | | ↑ на V |
| 3.4. | Снятие заявки на продажу на заключение сделки купли-продажи или сделки РЕПО с кодом расчетов Z0 в российских рублях и иностранной валюте | | ↑ на V |
| 4. | Заключение сделок | | |
| 4.1. | Заключение сделки по заявке на покупку с кодом расчетов T0, K0, Rb, T0/Yn | | ↑ на V |
| 4.2. | Заключение сделки по заявке на продажу с кодом расчетов K0 в российских рублях и иностранной валюте | | ↓ на V |
| 5. | Регистрация и отзыв Отчетов на исполнение | | |
| 5.1. | Регистрация в Клиринговой системе Отчета на исполнение, содержащего обязательство по передаче ценных бумаг | | ↓ на V |
| 5.2. | Отзыв из Клиринговой системы Отчета на исполнение, содержащего обязательство по передаче ценных бумаг | | ↑ на V |

| | | | |
|---------|--|--------|-----------|
| 5.3. | Прохождение Отчетом на исполнение, содержащим требование по передаче ценных бумаг, Процедуры контроля обеспечения | | ↑ на V |
| 5.4. | Регистрация в Клиринговой системе Специального отчета на исполнение, содержащего условное двустороннее нетто-обязательство по ценным бумагам (X, X<0) | | ↓ на (-X) |
| 5.5. | Отзыв из Клиринговой системы Специального отчета на исполнение, содержащего условное двустороннее нетто-обязательство по ценным бумагам (X, X<0) | | ↑ на (-X) |
| 5.6. | Прохождение Специальным отчетом на исполнение, содержащим условное двустороннее нетто-требование по ценным бумагам (X), Процедуры контроля обеспечения | | ↑ на X |
| 5.7. | Регистрация в Клиринговой системе Срочного отчета на исполнение, содержащего нетто-обязательство по ценным бумагам (X, X<0) | | ↓ на (-X) |
| 5.8. | Отзыв из Клиринговой системы Срочного отчета на исполнение, содержащего нетто-обязательство по ценным бумагам (X, X<0) | | ↑ на (-X) |
| 5.9. | Регистрация в Клиринговой системе Поручения на внесение компенсационного взноса в виде ценных бумаг | | ↓ на V |
| 5.10. | Регистрация в Клиринговой системе Поручения на внесение компенсационного взноса в виде ценных бумаг Участником клиринга – контрагентом по сделке | | ↑ на V |
| 5.11. | Регистрация в Клиринговой системе Поручения на проведение расчетов по поставке (по поставочным контрактам срочного рынка) | | |
| 5.11.1. | по обязательствам участника клиринга по поставке базового актива | | ↓ на V |
| 5.11.2. | по требованиям участника клиринга по поставке базового актива | | ↑ на V |
| 6. | Расчеты по итогам клиринга | | |
| 6.1. | Исполнение обязательства по передаче ценных бумаг или нетто-обязательства по ценным бумагам в ходе торгов в размере X | ↓ на X | |
| 6.2. | Исполнение требования по передаче ценных бумаг или нетто-требования по ценным бумагам в ходе торгов в размере X | ↑ на X | ↑ на X |
| 6.3. | Исполнение Нетто-обязательства по ценным бумагам по сделкам клирингового пула по итогам торгов в размере X | ↓ на X | |
| 6.4. | Исполнение Нетто-требования по ценным бумагам по сделкам клирингового пула по итогам торгов в размере X | ↑ на X | |