



УТВЕРЖДЕНЫ

решением Наблюдательного совета
ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр»

от «04» апреля 2014 года (Протокол № 16)

Председатель Наблюдательного совета
ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр»

Лыков С.П.



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

Москва, 2014г.

СОДЕРЖАНИЕ

РАЗДЕЛ I. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ	5
Статья 1. Термины и определения	5
Статья 2. Общие положения	12
Статья 3. Права и обязанности Участников клиринга и Клирингового центра	16
Статья 4. Конфиденциальность	17
Статья 5. Порядок использования Аналога собственноручной подписи	18
Статья 6. Торговые счета	19
Статья 7. Клиринговые регистры	22
РАЗДЕЛ II. ТРЕБОВАНИЯ К УЧАСТНИКАМ КЛИРИНГА	27
Статья 8. Требования к Участникам клиринга	27
Статья 9. Условия клирингового обслуживания. Порядок предоставления допуска к клиринговому обслуживанию	28
Статья 10. Порядок регистрации Участников клиринга, Торгово-клиринговых счетов Участников клиринга и присвоения Участникам клиринга Клиринговых идентификаторов	30
Статья 11. Порядок приостановления и прекращения допуска к клиринговому обслуживанию	34
Статья 12. Требования к клиентам Участника клиринга	37
Статья 13. Требования к Держателям. Порядок получения (лишения) статуса Держателя	37
Статья 14. Требования к Банкам	39
РАЗДЕЛ III. МЕРЫ, НАПРАВЛЕННЫЕ НА УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ ПРИ ОСУЩЕСТВЛЕНИИ КЛИРИНГА	40
Статья 15. Перечень мер, направленных на управление рисками при осуществлении клиринга	40
Статья 16. Единый лимит и риск-параметры	41
РАЗДЕЛ IV. ПОРЯДОК И УСЛОВИЯ ДОПУСКА ОБЯЗАТЕЛЬСТВ К КЛИРИНГУ	44
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	44
Статья 18. Процедура контроля обеспечения по биржевым сделкам с ценными бумагами	47
Статья 19. Порядок допуска к клирингу обязательств по внебиржевым сделкам с ценными бумагами	50
РАЗДЕЛ V. ПОРЯДОК ПРОВЕДЕНИЯ КЛИРИНГА	52
ПОДРАЗДЕЛ V-I. ПОРЯДОК ВНЕСЕНИЯ И ВОЗВРАТА ОБЕСПЕЧЕНИЯ И ВЗНОСОВ В ГАРАНТИЙНЫЕ ФОНДЫ	52
Статья 20. Порядок внесения Обеспечения	52
Статья 21. Порядок возврата Обеспечения	55
Статья 22. Порядок внесения взносов в Гарантийные фонды	59
Статья 23. Порядок возврата взносов в Гарантийные фонды	61
ПОДРАЗДЕЛ V-II. КЛИРИНГОВЫЕ СЕССИИ	64
Статья 24. Порядок проведения клиринговых сессий	64

ПОДРАЗДЕЛ V-III. ПОРЯДОК ВКЛЮЧЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ В КЛИРИНГОВЫЙ ПУЛ	68
Статья 25. Общие требования к порядку исполнения обязательств по сделкам и обязательств по внесению компенсационных взносов	68
Статья 26. Порядок подачи и регистрации Отчетов на исполнение.....	70
Статья 27. Порядок подачи и регистрации поручений на внесение компенсационных взносов и поручений на отказ от компенсационных взносов	73
Статья 28. Порядок подачи и исполнения Поручений на отказ от исполнения сделки РЕПО	74
Статья 29. Порядок подачи и регистрации Специальных и Срочных отчетов на исполнение	75
Статья 30. Порядок включения в клиринговый пул обязательств Участников клиринга по уплате Возмещения.....	78
Статья 31. Порядок включения в клиринговый пул обязательств по Сделкам Т+ и обязательств по возврату Гарантийных переводов	80
ПОДРАЗДЕЛ V-IV. ПОРЯДОК ДЕЙСТВИЙ В СЛУЧАЯХ НЕИСПОЛНЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ	84
Статья 32. Порядок действий в случаях неисполнения обязательств по Сделкам Т+	84
Статья 33. Порядок использования и возмещения Гарантийных фондов	90
ПОДРАЗДЕЛ V-V. ПОРЯДОК ИСПОЛНЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ, ВКЛЮЧЕННЫХ В КЛИРИНГОВЫЙ ПУЛ	95
Статья 34. Порядок исполнения обязательств и требований Участников клиринга и Клирингового центра, включенных в клиринговый пул	95
ПОДРАЗДЕЛ V-VI. ПОРЯДОК ВЗАИМОДЕЙСТВИЯ С РАСЧЕТНОЙ ОРГАНИЗАЦИЕЙ И РАСЧЕТНЫМ ДЕПОЗИТАРИЕМ.....	101
Статья 35. Порядок взаимодействия с Расчетной организацией	101
Статья 36. Порядок взаимодействия с Расчетным депозитарием и иными депозитариями.....	102
ПОДРАЗДЕЛ V-VII. СДЕЛКИ РЕПО КЛИРИНГОВОГО ЦЕНТРА И ДОГОВОРЫ ЗАЙМА КЛИРИНГОВОГО ЦЕНТРА	106
Статья 37. Условия Сделок РЕПО Клирингового центра и Договоров займа Клирингового центра, порядок их заключения и исполнения	106
ПОДРАЗДЕЛ V-VIII. ПОРЯДОК ПЕРЕДАЧИ ДОХОДА	109
Статья 38. Порядок передачи Доходов по сделкам РЕПО, Договорам займа и сделкам купли-продажи ценных бумаг, заключенным с Клиринговым центром.....	109
РАЗДЕЛ VI. ПОРЯДОК ОПЛАТЫ УСЛУГ. ОТЧЕТЫ ПО ИТОГАМ КЛИРИНГА	111
Статья 39. Порядок оплаты услуг Клирингового центра, Биржи и Технического центра	111
Статья 40. Порядок представления отчетов по итогам клиринга	116
РАЗДЕЛ VII. ПРОЧИЕ УСЛОВИЯ	119
Статья 41. Перевод обязательств и перевод Обеспечения клиента Участника клиринга от одного Участника клиринга другому Участнику клиринга.....	119
Статья 42. Порядок действий в случае включения Участника клиринга в перечень организаций, в отношении которых имеются сведения об их причастности к экстремистской деятельности или терроризму.....	122

Статья 43. Порядок урегулирования обязательств в случае прекращения допуска к клиринговому обслуживанию	123
Статья 44. Взаимодействие с Биржей при возникновении обстоятельств, которые могут повлиять на возможность проведения Торгов	135
Статья 45. Чрезвычайные ситуации	136
Статья 46. Порядок разрешения споров	137
Приложение № 1	138
Приложение № 2	139
Приложение № 3	144
Приложение № 4	146
Приложение № 5	151
Приложение № 6	154
Приложение № 7	156
Приложение № 8	164

РАЗДЕЛ I. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ

Настоящие Правила клиринга ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр» на рынке ценных бумаг регулируют отношения, связанные с 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.

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

Статья 1. Термины и определения

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

Банк ЕвразЭс – Банк-нерезидент, зарегистрированный на территории государства - члена Евразийского экономического сообщества, подписавшего Соглашение о сотрудничестве в области организации интегрированного валютного рынка государств - членов Евразийского экономического сообщества.

Банк-нерезидент - юридическое лицо, являющееся Нерезидентом, которое на основании специального разрешения (лицензии или иного основания) компетентного органа государства учреждения имеет право осуществлять банковские операции, предусмотренные личным законом Банка-нерезидента.

Биржа – 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 торгов. Термины «Дата внесения компенсационного

вноса», «Дата прекращения исполнения» для внебиржевых сделок используются в значениях, определенных Правилами торгов, с учетом особенностей внебиржевых сделок.

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

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

Гарантийные фонды – Фонд финансовой стабильности и/или гарантийные фонды, формируемые Клиринговым центром в соответствии с иными правилами клиринга Клирингового центра.

Дата исполнения - дата, в которую Участники клиринга и/или Клиринговый центр обязаны исполнить свои обязательства в соответствии с условиями заключенной сделки с ценными бумагами или иные обязательства 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, не имеющий Итоговых нетто-обязательств по денежным средствам и/или ценным бумагам, не обеспеченных средствами под исполнение, и Задолженности перед Клиринговым центром.

Договор займа Клирингового центра - договор займа ценных бумаг, заключаемый Клиринговым центром с Участником клиринга в соответствии с Правилами клиринга с целью исполнения обязательств Клирингового центра по Сделкам Т+.

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 Т+, заключаемым Клиринговым центром с Участником клиринга, для которого рассчитан Единый лимит.

Задолженность – неисполненные обязательства Участника клиринга, в том числе обязательства по сделкам, обязательства по уплате комиссионного вознаграждения, обязательства по уплате Гарантийных переводов и/или иные обязательства, указанные в Правилах клиринга.

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

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

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

итогах зачета в ходе клиринга в соответствии с Правилами клиринга обязательств с наступившей Датой исполнения по Сделкам T+ 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 T+.

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 T+ и обязательств / требований Участника клиринга по возврату Гарантийных переводов.

Итоговое нетто-требование по ценным бумагам – требование в ценных бумагах 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 T+.

Клиент – юридическое или физическое лицо, зарегистрированное Биржей в качестве клиента Участника торгов.

Клиринг без предварительного обеспечения – клиринг по сделке, при заключении которой не проверяется наличие Обеспечения Участника клиринга в размере, необходимом для исполнения обязательств по такой сделке.

Клиринг с полным обеспечением – клиринг по сделке, условием заключения которой является наличие Обеспечения Участника клиринга и/или требования Участника клиринга по получению ценных бумаг / денежных средств с Датой исполнения не позднее, чем Дата исполнения обязательств по заключаемой сделке, в размере, необходимом для исполнения обязательств по денежным средствам и/или ценным бумагам по такой сделке в полном объеме.

Клиринг с частичным обеспечением - клиринг по сделке, условием заключения которой является достаточность Единого лимита Участника клиринга.

Клиринговый брокер - Участник клиринга, исполняющий функции клирингового брокера в соответствии с Законом о клиринге и Правилами клиринга.

Клиринговая комиссия / комиссия за клиринг – плата, взимаемая Клиринговым центром с Участников клиринга в соответствии с Тарифами Клирингового центра (приложение № 2 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 подлежащих исполнению в дату формирования клирингового пула обязательств по сделке с ценными бумагами с кодом расчетов Z0, X0 или из обязательств по сделкам, включенным в Срочный отчет на исполнение.

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

Клиринговый пул для расчетов в ходе торгов по сделкам с центральным контрагентом - клиринговый пул, состоящий из подлежащих исполнению в дату формирования клирингового пула обязательств по сделкам, заключенным с центральным контрагентом и включенным в Срочный отчет на исполнение.

Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов по сделкам с центральным контрагентом - клиринговый пул, состоящий из подлежащих исполнению в определенный Правилами клиринга момент времени в дату формирования клирингового пула обязательств по сделкам с ценными бумагами, заключенным с центральным контрагентом.

Клиринговый пул по Сделкам T+ - клиринговый пул, состоящий из обязательств по Сделкам T+, подлежащих исполнению в определенный Правилами клиринга момент времени в дату формирования клирингового пула.

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

Клиринговый лист – перечень ценных бумаг, с которыми возможно заключение и клиринг Сделок T+ 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, установленные внутренними документами Технического центра, в отношении которых на Клиринговый центр возложены функции по определению соответствующих обязательств Участников торгов / Участников клиринга и контролю за порядком их исполнения. Комиссионное вознаграждение взимается в российских рублях. Возложение на Клиринговый центр функций по определению обязательств Участников торгов / Участников клиринга по уплате комиссионного вознаграждения (за исключением клиринговой комиссии) и контролю за порядком их исполнения осуществляется на основании соответствующих договоров.

Конечный контрагент – Участник клиринга, который будет являться стороной по **парной** сделке, заключенной на основании заявки Участника торгов, которому адресована заявка на заключение сделки (сделок) с центральным контрагентом.

Кредитная организация - кредитная организация, являющаяся Резидентом.

Маржинальное требование - требование Клирингового центра к Участнику клиринга об обеспечении обязательств по Сделкам T+, 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 рынка ценных бумаг ЗАО «ФБ ММВБ».

Недобросовестный участник клиринга - Участник клиринга, имеющий Итоговое нетто-обязательство по денежным средствам и/или ценным бумагам, не обеспеченное средствами под исполнение, и/или Задолженность перед Клиринговым центром.

Некредитная организация - юридическое лицо, являющееся Резидентом и не являющееся кредитной организацией.

Некредитная организация – нерезидент - юридическое лицо, являющееся Нерезидентом и не имеющее права осуществлять банковские операции.

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

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 T+ - сумма денежных средств в российских рублях или количество ценных бумаг, представляющие собой превышение обязательств Участника клиринга по Сделкам T+ над его требованиями к Клиринговому центру по Сделкам T+ 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 T+ - сумма денежных средств в российских рублях или количество ценных бумаг, представляющие собой превышение требований Участника клиринга по Сделкам T+ над его обязательствами перед Клиринговым центром по Сделкам T+ 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. Обеспечение может использоваться для исполнения обязательств Участника клиринга по сделкам.

Ограничительный лимит - клиринговый регистр, предназначенный для учета неисполненных обязательств Участника клиринга в случаях, установленных Правилами клиринга.

Отчет на исполнение – поручение Участника клиринга, направляемое Клиринговому центру с использованием Клиринговой системы в форме электронного сообщения, подписанного АСП Участника клиринга, и инициирующее включение обязательств по сделке с ценными бумагами (первой/второй части сделки РЕПО) в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов / в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов по сделкам с центральным контрагентом.

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 включение обязательств по нескольким сделкам с ценными бумагами (первым/вторым частям сделок РЕПО) и/или обязательств по внесению компенсационных взносов в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов / в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов по сделкам с центральным контрагентом.

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 включение обязательств по одной или нескольким сделкам с ценными бумагами (первым/вторым частям сделок РЕПО) и/или обязательств по внесению компенсационных взносов в Клиринговый пул для расчетов в ходе торгов / в Клиринговый пул для расчетов в ходе торгов по сделкам с центральным контрагентом.

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

Период регистрации поручений - период расчетного дня, установленный в соответствии с приложением № 6 к Правилам клиринга, в течение которого Клиринговый центр регистрирует поручения от Участников клиринга и/или Клиринговых организаций.

Подсистема ЭДО НКЦ - Подсистема Системы Электронного Документооборота ОАО ММВБ-РТС (далее – СЭД ОАО ММВБ-РТС), организатором которой является Клиринговый центр и которая используется Клиринговым центром для взаимодействия с участниками Подсистемы ЭДО НКЦ и Организатором СЭД. Подсистема ЭДО НКЦ представляет собой совокупность программного, информационного и аппаратного обеспечения Клирингового центра, Организатора СЭД и участников Подсистемы ЭДО НКЦ.

Поручение на внесение компенсационного взноса - поручение Участника клиринга, направляемое Клиринговому центру с использованием Клиринговой системы в форме электронного сообщения, подписанного АСП Участника клиринга, и инициирующее включение 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 торгов – 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.

Правила клиринга на валютном рынке – действующие Правила клиринга ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр» на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.

Процедура контроля обеспечения по сделке с ценными бумагами / Процедура контроля обеспечения — механизм контроля достаточности индивидуального клирингового обеспечения Участника клиринга для обеспечения исполнения обязательств по денежным средствам и/или ценным бумагам, осуществляемого при подаче заявки на заключение сделки с ценными бумагами или при заключении сделки.

Раздел – торговый раздел торгового счета депо, открытого в Расчетном депозитарии с указанием Клирингового центра в качестве клиринговой организации, которая вправе давать распоряжения по этому торговому счету, а также торговые разделы указанных в Правилах клиринга счетов депо, открытых в Расчетном депозитарии.

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.

Режим закрытия позиций – установленное Клиринговым центром в отношении Участника клиринга ограничение по Расчетному коду (Расчетным кодам), при котором могут заключаться сделки, стороной которых является Участник клиринга, приводящие только к увеличению Единого лимита такого Участника клиринга.

Резидент - лицо, являющееся резидентом в соответствии с законодательством Российской Федерации о валютном регулировании и валютном контроле.

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

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

Сделка T+ – сделка РЕПО с кодом расчетов T0/Yn, Y0/Yn, Y1/Yn или сделка купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов Yn, заключенная с Центральным контрагентом в соответствии с Правилами торгов 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 соответствии с Правилами клиринга с целью исполнения обязательств Клирингового центра по Сделкам T+.

Счет для возврата денежных средств - зарегистрированный в Клиринговом центре счет в соответствующей валюте, открытый в банке на территории Российской Федерации или в банке за пределами территории Российской Федерации (с учетом ограничений, установленных действующим законодательством Российской Федерации), и предназначенный для перечисления на него денежных средств с целью исполнения обязательств Клирингового центра по возврату индивидуального клирингового обеспечения в денежных средствах Участнику клиринга.

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 Разделом и Расчетным кодом.

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

Фонд финансовой стабильности - коллективное клиринговое обеспечение (гарантийный фонд), сформированное Клиринговым центром за счет взносов всех Участников клиринга, допущенных к клирингу с частичным обеспечением, за исключением Участников клиринга, на которые в соответствии с Законом о клиринге не распространяется требование о передаче имущества в коллективное клиринговое обеспечение.

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 Правила клиринга на валютном рынке, Методику определения риск-параметров рынка ценных бумаг, Правилами торгов, законами, нормативными актами Банка России 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, Y1/Yn.
- 2.2. Клиринговый центр осуществляет клиринг без выполнения функций центрального контрагента по:
 - сделкам купли-продажи с кодом расчетов B0-B30, Z0;
 - сделкам РЕПО с кодом расчетов Rb, S0-S2, Z0;
 - сделкам размещения и выкупа с кодом расчетов T0;
 - сделкам размещения акций с кодом расчетов X0.
- 2.3. Клиринговый центр осуществляет клиринг с частичным обеспечением, клиринг с полным обеспечением и клиринг без предварительного обеспечения.
- 2.4. Клиринговый центр осуществляет клиринг с частичным обеспечением по:
 - сделкам купли-продажи с кодом расчетов Yn;
 - сделкам РЕПО с кодом расчетов Y0/Yn, Y1/Yn;
 - вторым частям сделок РЕПО с кодом расчетов T0/Yn.
- 2.5. Клиринговый центр осуществляет клиринг с полным обеспечением по:
 - сделкам купли-продажи с кодом расчетов T0, Z0, X0, K0;
 - первым частям сделок РЕПО с кодом расчетов T0/Yn, Rb, Z0.

- 2.6. Клиринговый центр осуществляет клиринг без предварительного обеспечения по:
- сделкам купли-продажи с кодом расчетов B0-B30;
 - сделкам РЕПО с кодом расчетов S0-S2;
 - вторым частям сделок РЕПО с кодом расчетов Rb, Z0.
- 2.7. Клиринговый центр осуществляет клиринг по сделкам, заключенным с расчетами в российских рублях или в иностранной валюте.
- 2.8. Клиринговый центр не осуществляет клиринг по сделкам с ценными бумагами с кодами расчетов, отличными от кодов расчетов, предусмотренных Правилами торгов.
- 2.9. Расчеты по результатам клиринга осуществляются в ходе торгов и по итогам торгов.
- 2.10. Клиринг с частичным обеспечением может осуществляться только по сделкам с ценными бумагами, включенными в Клиринговый лист.
- 2.10.1. Включение и исключение ценной бумаги в Клиринговый лист / из Клирингового листа осуществляется по решению Клирингового центра.
- 2.10.2. По ценным бумагам, включенным в Клиринговый лист, Клиринговый центр вправе установить признак «запрет коротких продаж».
- Установление признака «запрет коротких продаж» по ценной бумаге, означает, что по Сделкам T+ с такой ценной бумагой осуществляется клиринг с полным обеспечением по ценным бумагам.
- 2.10.3. Заключение Сделок T+ с ценными бумагами, не включенными в Клиринговый лист, осуществляется с признаком «запрет коротких продаж» и с Нижней границей диапазона оценки рисков, равной нулю.
- 2.11. 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 (Гарантийные фонды).
- 2.12. Индивидуальное клиринговое обеспечение в ценных бумагах учитывается на торговых счетах депо, открытых в Расчетном депозитарии с указанием Клирингового центра в качестве клиринговой организации, которая вправе давать распоряжения по этим счетам.
- 2.13. Индивидуальное клиринговое обеспечение в российских рублях и иностранной валюте учитывается на соответствующем клиринговом банковском счете Клирингового центра, открытом в Расчетной организации и предназначенном для учета индивидуального клирингового обеспечения рынка ценных бумаг.
- 2.14. Индивидуальное клиринговое обеспечение в денежных средствах также может учитываться на торговых банковских счетах, открытых в Расчетной организации с указанием Клирингового центра в качестве клиринговой организации, которая вправе давать распоряжения по этим счетам.
- 2.15. Перечень видов используемых торговых счетов приведен в статье 6 Правил клиринга.

2.16. Коллективное клиринговое обеспечение (Гарантийные фонды) в российских рублях или иностранной валюте учитывается на клиринговом банковском счете Клирингового центра в соответствующей валюте, открытом в Расчетной организации и предназначенном для учета коллективного клирингового обеспечения.

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

2.18. Информация о реквизитах клиринговых счетов Клирингового центра, предназначенных для учета индивидуального или коллективного клирингового обеспечения, размещается на Сайте Клирингового центра.

Об изменениях реквизитов указанных счетов Клиринговый центр извещает Участников клиринга путем направления им новых реквизитов в форме электронного документа и путем размещения соответствующей информации на Сайте Клирингового центра не позднее, чем за 3 (три) рабочих дня до введения этих изменений в действие, если решением Клирингового центра не установлен иной срок изменения реквизитов указанных счетов.

2.19. Клиринговый центр вправе использовать в своих интересах денежные средства, составляющие индивидуальное и коллективное клиринговое обеспечение, зачисленное на клиринговые банковские счета Клирингового центра, с учетом ограничений, установленных внутренним документом Клирингового центра, определяющим критерии размещения временно свободных денежных средств Клирингового центра.

Доходы от такого использования указанных денежных средств не включаются в состав индивидуального и коллективного клирингового обеспечения.

2.20. Существуют следующие категории Участников клиринга: Участники клиринга категории «А», Участники клиринга категории «Б1», Участники клиринга категории «Б2» и Участники клиринга категории «В».

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

2.20.2. Участниками клиринга категории «Б1» и Участниками клиринга категории «Б2» являются Участники клиринга, допущенные к клирингу с частичным обеспечением и не являющиеся Участником клиринга категории «А».

Участники клиринга категории «Б1» имеют право заключать сделки купли-продажи ценных бумаг и сделки РЕПО, являющиеся Сделками Т+, как на основании адресных, так и безадресных заявок.

Участники клиринга категории «Б2» имеют право заключать сделки купли-продажи ценных бумаг, являющиеся Сделками Т+, как на основании адресных, так и безадресных заявок, а также сделки РЕПО, являющиеся Сделками Т+, на основании адресных заявок.

По Сделкам Т+, стороной по которым является Участник клиринга категории «Б1» или «Б2», осуществляется клиринг с частичным обеспечением.

2.20.3. Участниками клиринга категории «В» являются Участники клиринга, не допущенные к клирингу с частичным обеспечением и не являющиеся Участником клиринга категории «А».

По Сделкам Т+, стороной по которым является Участник клиринга категории «В», осуществляется клиринг с полным обеспечением.

2.20.4. К клирингу без предварительного обеспечения допускаются Участники клиринга всех категорий.

2.21. 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.

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

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

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

В случае несоответствия информации, содержащейся в электронном документе, направленном посредством Системы ЭДО, и электронном документе, направленном посредством системы S.W.I.F.T., Участники клиринга и Клиринговый центр в первую очередь руководствуются информацией, содержащейся в электронном документе, направленном посредством Системы ЭДО, во вторую - посредством системы S.W.I.F.T.

2.23. 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.

2.24. 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.

2.25. 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.

2.26. 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 39 Правил клиринга.

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

- 3.7. Участник клиринга вправе отказаться от исполнения Договора об оказании клиринговых услуг только при отсутствии у него имущественных обязательств по указанному договору, а также неисполненных им обязательств, допущенных к клирингу, письменно уведомив об этом Клиринговый центр не позднее, чем за 5 (пять) дней до даты прекращения действия Договора об оказании клиринговых услуг.
- 3.8. Клиринговый центр вправе отказаться от исполнения Договора об оказании клиринговых услуг с Участником клиринга в случае нарушения Участником клиринга требований, предъявляемых к нему Правилами клиринга.
- 3.9. Клиринговый центр вправе отказаться от исполнения Договора об оказании клиринговых услуг с Участником клиринга в случае, если в течение 6 (шести) месяцев с момента заключения указанного Договора Участник клиринг 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:
- 1) прекращения допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию в соответствии со всеми правилами клиринга, на основании которых Участник клиринга был допущен к клиринговому обслуживанию;
 - 2) ликвидации Участника клиринга, а также в случае реорганизации Участника клиринга при условии, что деятельность Участника клиринга в результате реорганизации прекращается;
 - 3) отзыва (аннулирования) лицензии на осуществление банковских операций у Участника клиринга (для кредитных организаций);
 - 4) аннулирование специального разрешения (лицензии или иного основания), выданного компетентным органом государства учреждения Банка-нерезидента, на основании которого Банк-нерезидент имеет право осуществлять банковские операции, предусмотренные личным законом Банка-нерезидента (для Банков-нерезидентов).
- 3.11. Прекращение действия Договора об оказании клиринговых услуг не освобождает Участника клиринга и Клиринговый центр от исполнения обязательств, возникших до прекращения действия Договора об оказании клиринговых услуг.
- 3.12. Клиринговый центр вправе на своем Сайте раскрывать информацию о нарушениях Участниками клиринга требований Правил клиринга, в том числе, о фактах неисполнения ими обязательств в порядке, предусмотренном Правилами клиринга.

Статья 4. Конфиденциальность

- 4.1. Участник клиринга и Клиринговый центр обязуются рассматривать содержание Договора об оказании клиринговых услуг и условия заключенных 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, 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.

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.

Порядок присвоения Клирингового идентификатора Участнику клиринга определен пунктом 10.9 Правил клиринга.

Уведомление о присвоении Клирингового идентификатора Участнику клиринга передается Участнику клиринга в составе Отчета о торгово-клиринговых счетах Участника клиринга, направляемого в соответствии со статьей 40 Правил клиринга.

Сведения о присвоенных Клиринговых идентификаторах относятся к конфиденциальным. Участник клиринга и Клиринговый центр обеспечивают соблюдение требований о конфиденциальности и несут риск последствий, связанных с нарушением таких требований.

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

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

- 5.6. При подаче (направлении) электронных сообщений, подписанных АСП, Технический центр с использованием Клиринговой системы осуществляет идентификацию лица, подписавшего электронное сообщение, путем сопоставления АСП, содержащегося в электронном сообщении, Клиринговому идентификатору, присвоенному Участнику клиринга / Клиринговому центру, информация о котором содержится в базе данных Клиринговой системы.
- 5.7. Участник клиринга и Клиринговый центр соглашаются с тем, что Клиринговым центром могут быть изготовлены (распечатаны) копии 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.
- 5.8. По письменному запросу Участника клиринга Клиринговый центр предоставляет Участнику клиринга копию направленного Участником (Участнику) клиринга электронного сообщения, изготовленного (распечатанного) на бумажном носителе. Запрос Участника клиринга должен содержать дату, на которую, либо период времени, за который предоставляются электронные сообщения.
- 5.9. Участник клиринга и Клиринговый центр соглашаются с тем, что все возникшие конфликтные ситуации, связанные с использованием АСП, будут стремиться решить в досудебном порядке.
- 5.10. В случае возникновения конфликтных ситуаций в связи с использованием АСП проводится техническая экспертиза в соответствии с приложением № 3 к Правилам клиринга.
- 5.11. В случае, если по результатам технической экспертизы, проведенной в соответствии с приложением № 3 к Правилам клиринга, конфликтная ситуация остается неурегулированной, то такая конфликтная ситуация подлежит рассмотрению в порядке, предусмотренном статьей 46 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 с указанием Клирингового центра в качестве клиринговой организации, которая вправе давать распоряжения по этим счетам:
- торговый банковский счет в российских рублях;
 - торговый банковский счет в иностранной валюте.
- 6.2. **Торговый счет** – торговый банковский счет в российских рублях или 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 российских рублях или иностранной валюте соответственно.

- 6.2.1. Торговый счет Банка используется для учета денежных средств, предназначенных для обеспечения исполнения и исполнения обязательств Банка по сделкам, заключенным за его счет, или для учета денежных средств, предназначенных для обеспечения исполнения и исполнения обязательств Банка по сделкам, заключенным за счет его клиентов, либо для обеспечения исполнения и исполнения обязательств другого Участника клиринга по сделкам (в случае открытия Банком для Участника клиринга дополнительной позиции по денежным средствам, определяемой в отношении этого Торгового счета).

Торговый счет Банка в российских рублях также используется для исполнения обязательств Банка по уплате Комиссионного вознаграждения и Возмещения, а в случае открытия Банком для Участника клиринга дополнительной позиции по денежным средствам, определяемой в отношении этого Торгового счета, - для исполнения обязательств такого Участника клиринга по уплате Комиссионного вознаграждения.

- 6.2.2. Торговый счет Участника клиринга, не являющегося кредитной организацией в соответствии с законодательством Российской Федерации, используется для учета денежных средств, предназначенных для обеспечения исполнения и исполнения обязательств по сделкам, заключенным за счет Участника клиринга или за счет его клиентов.

Торговый счет Участника клиринга, не являющегося кредитной организацией, в российских рублях также используется для исполнения обязательств Участника клиринга по уплате Комиссионного вознаграждения и Возмещения.

- 6.2.3. Торговый счет клиента Участника клиринга открывается такому клиенту Участника клиринга и используется для учета денежных средств, предназначенных для обеспечения исполнения и исполнения обязательств по сделкам, заключенным за счет этого клиента.

Торговый счет клиента Участника клиринга в российских рублях также используется для исполнения обязательств Участника клиринга по уплате Комиссионного вознаграждения по указанным сделкам.

- 6.3. Торговый счет для учета денежных средств клиентов используется для учета денежных средств, предназначенных для обеспечения исполнения и исполнения обязательств по сделкам, заключенным за счет клиентов Участника клиринга.

Торговым счетом, предназначенным для учета денежных средств клиентов, является специальный брокерский счет, открытый Участником клиринга – некредитной организацией, или отдельный Торговый счет Участника клиринга – кредитной организации.

- 6.4. Торговый счет для учета денежных средств, находящихся в доверительном управлении этого Участника клиринга, используется для учета денежных средств, предназначенных для обеспечения исполнения и исполнения обязательств по сделкам, заключенным за счет денежных средств, находящихся в доверительном управлении Участника клиринга.

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

- торговый счет депо владельца Участника клиринга, Клирингового центра или

клиента Участника клиринга;

- торговый счет депо номинального держателя Участника клиринга или Держателя;
- торговый счет депо иностранного номинального держателя Держателя;
- торговый счет депо доверительного управляющего Участника клиринга;
- торговый счет депо брокера Участника клиринга;
- эмиссионный счет эмитента;
- торговый казначейский счет депо эмитента;
- счет депо владельца Участника клиринга или клиента Участника клиринга;
- счет депо номинального держателя Участника клиринга или Держателя.

6.6. При осуществлении клиринга в соответствии с Правилами клиринга Клиринговый центр использует торговые разделы, заблокированные для клиринга НКЦ, торговых счетов депо, а также торговые разделы, заблокированные для торгов по реализации ценных бумаг, заложенных под ломбардные кредиты и по кредитам овернайт Банка России, счетов депо, открытых в Расчетном депозитарии.

6.7. **Торговый раздел** – торговый раздел (за исключением торгового раздела типа «Блокировано для клиринга в НКЦ. Обеспечение») торгового счета депо владельца Участника клиринга или Клирингового центра и/или торгового счета депо номинального держателя Участника клиринга и/или торгового счета депо доверительного управляющего и/или эмиссионного счета и/или торгового счета депо владельца клиента Участника клиринга и/или торгового казначейского счета депо эмитента и/или эмиссионного счета и/или торгового счета депо брокера и/или счета депо владельца Участника клиринга и/или счета депо владельца клиента Участника клиринга.

6.8. **Дополнительный торговый раздел** – торговый раздел (за исключением торгового раздела типа «Блокировано для клиринга в НКЦ. Обеспечение») торгового счета депо номинального держателя Держателя и/или торгового счета депо иностранного номинального держателя Держателя и/или счета депо номинального держателя Держателя.

Существуют следующие типы дополнительных торговых разделов:

- **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 клиента Участника клиринга, депозитарное обслуживание которых осуществляется Держателем;
- **Тип «С»** - для учета ценных бумаг, находящихся в доверительном управлении Участника клиринга, депозитарное обслуживание которого осуществляется Держателем.

6.9. **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 управляющего и/или торгового счета депо владельца клиента Участника клиринга.

- 6.10. **Дополнительный торговый раздел обеспечения** - торговый раздел типа «Блокировано для клиринга в НКЦ. Обеспечение» торгового счета депо номинального держателя Держателя.
- 6.11. Торговые разделы всех типов, перечисленные в пунктах 6.6-6.10 Правил клиринга далее совместно именуются Разделы.
- Торговые разделы, перечисленные в пунктах 6.7-6.8 Правил клиринга далее совместно именуются Разделы T0.
- Торговые разделы обеспечения и Дополнительные торговые разделы обеспечения далее совместно именуются Разделы T+.
- Разделы T0 и T+, открытые в рамках одного торгового счета депо, являются связанными, если коды таких разделов, за исключением первых двух символов, совпадают.

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.
- 7.2.1. Счета обеспечения T+ открываются на основании Заявления Участника клиринга на присвоение Расчетного кода, предоставленного Клиринговому центру.
- 7.2.2. Для одного Расчетного кода открывается один Счет обеспечения T+ в российских рублях и по одному Счету обеспечения T+ в каждой иностранной валюте, денежные средства в которой принимаются Клиринговым центром в качестве Обеспечения.
- 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.
- 7.3.1. Счет обеспечения T0 открывается к Торговому счету Участника клиринга или его клиента при получении от Расчетной организации информации о новом Торговом счете.
- 7.3.2. Счет обеспечения T0 в соответствующей валюте связывается с Расчетным кодом на основании Заявления Участника клиринга на присвоение Расчетного кода, предоставленного Клиринговому центру.
- 7.3.3. С одним Расчетным кодом может быть связано не более одного Счета обеспечения T0 в каждой валюте.
- 7.3.4. Тип денежных средств (собственных, клиентских или находящихся в доверительном управлении), учитываемых на Торговом счете, должен соответствовать типу денежных средств, учитываемых на Расчетном коде.

7.3.5. Заявление о присвоении Расчетного кода направляется Клиринговому центру в форме электронного документа или в бумажной форме.

Заявление о присвоении Расчетного кода должно содержать признак, указывающий для учета каких денежных средств и обязательств будет использоваться Расчетный код:

- для учета денежных средств Участника клиринга и обязательств Участника клиринга по сделкам, заключенным за счет Участника клиринга;
- для учета денежных средств клиентов Участника клиринга и обязательств Участника клиринга по сделкам, заключенным за счет клиентов Участника клиринга;
- для учета денежных средств, находящихся в доверительном управлении этого Участника клиринга и обязательств Участника клиринга по сделкам, заключенным за счет денежных средств, находящихся в доверительном управлении этого Участника клиринга.

7.3.6. При получении от Расчетного депозитария информации о новом Разделе Т+, связанном с Разделом Т0, входящим в состав зарегистрированного Торгово-клирингового счета, Счета обеспечения Т+ открываются Клиринговым центром без предоставления Заявления на присвоение Расчетного кода.

При этом для такого Расчетного кода признак, указывающий для учета каких денежных средств и обязательств будет использоваться Расчетный код, устанавливается в соответствии с типом позиции депо по Разделу, входящему в состав Торгово-клирингового счета.

7.3.7. Для заключения Участником клиринга сделок за счет клиентов Участника клиринга и/или за счет денежных средств, находящихся в доверительном управлении Участника клиринга, Участник клиринга обязан совершить действия, необходимые для присвоения Клиринговым центром Участнику клиринга отдельного Расчетного кода (отдельных Расчетных кодов) для учета денежных средств клиентов Участника клиринга и обязательств Участника клиринга по сделкам, заключенным за счет клиентов Участника клиринга, и/или отдельного Расчетного кода (отдельных Расчетных кодов) для учета денежных средств, находящихся в доверительном управлении Участника клиринга, и обязательств Участника клиринга по сделкам, заключенным за счет денежных средств, находящихся в доверительном управлении этого Участника клиринга.

7.3.8. Клиринговый центр информирует Участника клиринга о присвоенном ему Расчетном коде не позднее рабочего дня, следующего за днем присвоения Расчетного кода, посредством Подсистемы ЭДО НКЦ.

7.3.9. При открытии Счета обеспечения Т+ начальное и плановое значение позиции по денежным средствам, определяемой в отношении Счета обеспечения Т+, устанавливается равным нулю.

7.4. На клиринговых регистрах Клиринговый центр учитывает:

- позиции по денежным средствам в разрезе Счетов обеспечения Т+ и Счетов обеспечения Т0;
- позиции по ценным бумагам в разрезе Разделов Т0 и Разделов Т+, кодов ценных бумаг;
- Единый лимит каждого Участника клиринга в разрезе Расчетных кодов;
- Лимит, обеспеченный средствами фонда, каждого Участника клиринга для которого указан лимит установлен, в разрезе Расчетных кодов;

- обязанности и требования Участника клиринга по каждому допущенному к клирингу обязательству по Сделке T+;
- 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 Счетов обеспечения и Разделов, валют / кодов ценных бумаг;
- Нетто-обязательство / Нетто-требование Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам по Сделкам T+ 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;
- Маржинальное требование Участника клиринга (в случае наличия);
- взнос Участника клиринга в Фонд финансовой стабильности.

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, или в отношении Счета обеспечения T+, предназначенных для учета денежных средств 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, или к Торговому счету клиента Участника клиринга, или к Торговому счету Участника клиринга, или в отношении Счета обеспечения T+, предназначенных для учета денежных средств клиентов Участника клиринга.

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

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

Дополнительная собственная денежная позиция – позиция по денежным средствам, определяемая в отношении Счета обеспечения T0, открытого к торговому счету Банка, осуществляющего расчетное обслуживание Участника клиринга.

Дополнительная клиентская денежная позиция – позиция по денежным средствам, определяемая в отношении Счета обеспечения T0, открытого к торговому счету Банка, осуществляющего расчетное обслуживание клиентов Участника клиринга.

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 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 или Торгового раздела обеспечения Торгового счета депо владельца Участника клиринга или Клирингового центра в Расчетном депозитарии и/или Дополнительного торгового раздела - тип А / Дополнительного торгового раздела обеспечения, 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 или Торгового раздела обеспечения 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 / Дополнительного торгового раздела обеспечения, 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 или Торгового раздела обеспечения торгового счета депо доверительного управляющего Участника клиринга в Расчетном депозитарии и/или Дополнительного торгового раздела - тип С / Дополнительного торгового раздела обеспечения, открытого для Участника клиринга на торговых счетах депо номинального держателя / торговых счетах депо иностранного номинального держателя Держателей в Расчетном депозитарии.

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 категорий «Б1», «Б2», «В» 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 Правилами клиринга предоставляется Участнику клиринга на основании соответствующего Заявления о предоставлении допуска к клиринговому обслуживанию.
- 9.2. Допуск к клиринговому обслуживанию с категорией «В» в соответствии с Правилами клиринга предоставляется Участнику клиринга, который соответствует следующим требованиям:
 - 9.2.1. имеет действующий Договор об оказании клиринговых услуг, заключенный с Клиринговым центром;
 - 9.2.2. имеет действующий договор / договоры, заключенный(-ые) с Техническим центром и обеспечивающий(-ие) технический доступ к Клиринговой системе, и установил необходимое для клирингового обслуживания программно-техническое обеспечение, соответствующее требованиям, установленным Техническим центром;
 - 9.2.3. имеет действующую лицензию на осуществление банковских операций, выданную Банком России (для кредитных организаций);
 - 9.2.4. имеет действующее специальное разрешение (лицензию или иное основание), выданное компетентным органом государства учреждения Банка-нерезидента, на основании которого Банк-нерезидент имеет право осуществлять банковские операции, предусмотренные личным законом Банка-нерезидента (для Банков-нерезидентов);
 - 9.2.5. является участником Подсистемы ЭДО НКЦ;
 - 9.2.6. выполняет требования Клирингового центра по предоставлению информации и отчетности, предусмотренные пунктами 8.4-8.5 Правил клиринга;
 - 9.2.7. выполняет требования Клирингового центра к финансовой устойчивости Участника клиринга, предусмотренные пунктом 9.5 Правил клиринга;
 - 9.2.8. имеет хотя бы один зарегистрированный в Клиринговом центре Торгово-клиринговый счет;
 - 9.2.9. 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).
- 9.3. Допуск к клиринговому обслуживанию с категорией «Б2» в соответствии с Правилами клиринга предоставляется Участнику клиринга, который помимо требований, установленных пунктом 9.1 Правил клиринга, соответствует следующим требованиям:
 - 9.3.1. внес взнос в Фонд финансовой стабильности в размере, установленном в соответствии с пунктом 15.2 Правил клиринга;
 - 9.3.2. Участники клиринга – Нерезиденты, не являющиеся Банками ЕврАзЭС, должны иметь рейтинг не ниже следующего уровня рейтинга по международной шкале

долгосрочной кредитоспособности по обязательствам в российских рублях или в иностранной валюте:

- Standard & Poor's «BBB»;
- Moody's Investors Service «Baa2»;
- Fitch Ratings «BBB»;

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

9.4. Допуск к клиринговому обслуживанию с категорией «Б1» в соответствии с Правилами клиринга предоставляется Участнику клиринга, который помимо требований, установленных пунктами 9.1 и 9.3 Правил клиринга, соответствует следующим требованиям:

- имеет собственные средства (капитал) не менее 180 000 000 (ста восьмидесяти миллионов) рублей.

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

9.5.1. Участники клиринга - кредитные организации - соблюдать обязательные нормативы Банка России, установленные для кредитных организаций;

9.5.2. в деятельности Участников клиринга – кредитных организаций 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;

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

9.5.4. в деятельности Участников клиринга – Банков-нерезидентов должны отсутствовать основания для отзыва в соответствии с национальным законодательством государства учреждения Банка-нерезидента специального разрешения (лицензии или иного основания), выданного компетентным органом государства учреждения Банка-нерезидента, на основании которого Банк-нерезидент имеет право осуществлять банковские операции.

9.6. Участники клиринга должны соответствовать требованиям к финансовой устойчивости, приведенным в пунктах 9.5 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.

- 9.7. Клиринговый центр вправе не предоставлять допуск к клиринговому обслуживанию Участникам клиринга категорий «Б1», «Б2» и «В», не соответствующим следующим требованиям:
- 9.7.1. кредитные организации – наличие по балансу на последнюю отчетную дату положительного финансового результата текущего года, определяемого как разница между суммой остатков, числящихся на балансовых счетах по учету доходов текущего года, и суммой остатков, числящихся на балансовых счетах по учету расходов текущего года;
- 9.7.2. некредитные организации – наличие по балансу на последнюю отчетную дату положительного финансового результата деятельности, определяемого как прибыль после налогообложения;
- 9.7.3. Нерезиденты - наличие по финансовой отчетности на последнюю отчетную дату положительного финансового результата деятельности, определяемого как прибыль после налогообложения.
- 9.8. Допуск к клиринговому обслуживанию предоставляется Участнику клиринга Клиринговым центром в срок, не превышающий 5 (пяти) рабочих дней после выполнения Участником клиринга требований и условий, предусмотренных настоящей статьей Правил клиринга.

О факте предоставления Участнику клиринга допуска к клиринговому обслуживанию и о категории Участника клиринга 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.

Статья 10. Порядок регистрации Участников клиринга, Торгово-клиринговых счетов Участников клиринга и присвоения Участникам клиринга Клиринговых идентификаторов

- 10.1. Клиринговый центр осуществляет регистрацию Участников клиринга.
- 10.1.1. Процедура регистрации Участника клиринга предусматривает присвоение Участнику клиринга следующих кодов и идентификаторов:
- код Участника клиринга (присваивается в соответствии с нормативными актами Банка России);
 - идентификатор (присваивается Клиринговым центром). Если Участник клиринга является Участником торгов, идентификатор присваивается на основании данных, полученных от Биржи;
 - специальный код Участника клиринга, являющегося управляющим (присваивается Участником клиринга самостоятельно).
- 10.1.2. Информация о коде Участника клиринга учитывается в реестре Участников клиринга и предоставляется по запросу Банка России, иных уполномоченных лиц и органов, а также Участников клиринга и содержит данные, соответствующие требованиям Банка России, предъявляемым к регистрации Участников клиринга (кодов Участников клиринга).
- 10.1.3. Клиринговым центром Участнику клиринга может быть присвоено более одного идентификатора Участника клиринга. При этом для каждого Участника клиринга устанавливается однозначное соответствие всех идентификаторов присвоенному коду Участника клиринга.

- 10.1.4. 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.
- 10.2. Для регистрации Торгово-клирингового счета Участника клиринга, устанавливающего однозначное соответствие между Разделом и Расчетным кодом, 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.
- Один Раздел может входить в состав только одного Торгово-клирингового счета.
- Один Расчетный код может входить в состав нескольких Торгово-клиринговых счетов.
- 10.3. Для заключения Сделок Т+ у Участника клиринга должен быть зарегистрирован Торгово-клиринговый счет, в состав которого входит Раздел Т+ и Расчетный код, к которому привязан Счет обеспечения Т+.
- 10.3.1. Для заключения иных сделок Участник клиринга может использовать Торгово-клиринговый счет, в состав которого входят:
- Раздел Т+, и Расчетный код, к которому привязан Счет обеспечения Т+;
 - Раздел Т0, и Расчетный код, к которому привязан Счет обеспечения Т+;
 - Разделу Т0, и Расчетный код, к которому привязан Счет обеспечения Т0.
- 10.3.2. Разделы Т+, зарегистрированные в составе Торгово-клиринговых счетов совместно с одним Расчетным кодом, далее именуются Разделами Т+, относящимися к такому Расчетному коду.
- 10.3.3. В случае наличия зарегистрированного Торгово-клирингового счета, в состав которого входит Раздел Т0, регистрация Торгово-клирингового счета, в состав которого входит Раздел Т+, связанный с Разделом Т0, осуществляется Клиринговым центром без предоставления Участником клиринга Заявления на регистрацию ТКС.
- 10.4. Заявление на регистрацию ТКС должно содержать:
- 1) код и наименование Участника торгов, который вправе подавать заявки с указанием такого Торгово-клирингового счета;
 - 2) указание на модель заключения сделок с использованием такого Торгово-клирингового счета:
 - 0 – для заключения сделок на основании заявок Участника торгов, являющегося Участником клиринга, предоставившим заявление;
 - 1 – для заключения сделок от имени Участника клиринга на основании заявок Участника торгов, указанного Участником клиринга в заявлении;
 - 2 - для заключения сделок на основании заявок Участника торгов, в которых Участник клиринга указан в качестве Клирингового брокера. Подача данного заявления считается согласием Участника клиринга на указание его в заявках с соответствующим Торгово-клиринговым счетом в качестве Клирингового брокера;

10.5. Участник клиринга категории «Б1» или «Б2» вправе с использованием Клиринговой системы установить для Торгово-клирингового счета, предназначенного для заключения Сделок Т+, признак «запрет коротких продаж» и/или признак «запрет необеспеченных покупок».

По Сделкам Т+, заключенным с указанием Торгово-клирингового счета с признаком «запрет коротких продаж», осуществляется клиринг с полным обеспечением по ценным бумагам.

По Сделкам Т+, заключенным с указанием Торгово-клирингового счета с признаком «запрет необеспеченных покупок», осуществляется клиринг с полным обеспечением по денежным средствам.

10.5.1. Для Торгово-клирингового счета, предназначенного для заключения Сделок Т+, для которого признак «запрет коротких продаж» не установлен, Участник клиринга категории «Б1» или «Б2» вправе с использованием Клиринговой системы установить ограничение на размер Нетто-обязательства по ценной бумаге по Сделкам Т+. Соблюдение указанного ограничения проверяется при подаче заявки на заключение Сделки Т+ с учетом обязательств и требований по Сделкам Т+, которые могут быть заключены на основании такой заявки.

10.6. Для предоставления Участнику торгов или Клиенту возможности воспользоваться в будущем Переводом обязательств и Переводом Обеспечения, определенными в статье 41 Правил клиринга, по основаниям и в порядке, установленных в статье 41 Правил клиринга, Участник клиринга должен открыть для такого Участника торгов или Клиента (далее – Обособленный клиент) отдельный Раздел и отдельный Расчетный код и зарегистрировать их в составе отдельного Торгово-клирингового счета, в Заявлении на регистрацию ТКС указать:

- 1) наименование / фамилию, имя и отчество и код Обособленного клиента, который будет закреплен за данным Торгово-клиринговым счетом;
- 2) ИНН Обособленного клиента – юридического лица, имеющего ИНН, или номер паспорта Обособленного клиента – физического лица, или адрес и регистрационный номер в стране регистрации Обособленного клиента – юридического лица, являющегося Нерезидентом и не имеющего ИНН.

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

10.6.1. Участник клиринга не вправе указывать Расчетный код, открытый для Обособленного клиента и зарегистрированный в составе Торгово-клирингового счета для Обособленного клиента, при регистрации иных Торгово-клиринговых счетов.

10.7. Удержание Клиринговым центром с Участника клиринга:

- Комиссионного вознаграждения по сделкам с расчетами в иностранной валюте;
- абонентской платы;
- постоянной части Комиссионного вознаграждения по сделкам РЕПО;
- постоянной части Комиссионного вознаграждения по сделкам купли-продажи;
- 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 39.17 Правил клиринга;
- Комиссионного вознаграждения Биржи и Технического центра по сделкам, клиринг по которым осуществляет иная клиринговая организация;
- Возмещения,

а также зачисление Возмещения осуществляется в отношении Счета обеспечения T+, указанному Участником клиринга в представленном Клиринговому центру Заявлении о счете для возмещения и комиссии.

В случае непредоставления Участником клиринга Заявления о счете для возмещения и комиссии операции, указанные в настоящем пункте Правил клиринга, осуществляются в отношении Счета обеспечения T+ с наиболее ранней датой открытия.

- 10.7.1. В Заявлении о счете для возмещения и комиссии Участником клиринга может быть указан признак, означающий, что со Счета обеспечения T+, соответствующего Расчетному коду, указанному в таком заявлении, необходимо также удерживать оборотную часть Комиссионного вознаграждения по сделкам с расчетами в российских рублях.

В случае, если такой признак не указан, оборотная часть Комиссионного вознаграждения по сделкам с расчетами в российских рублях, а также неустойки, установленные Правилами торгов, удерживаются со Счета обеспечения T0 или Счета обеспечения T+, по которому должны исполняться обязательства по сделке.

- 10.7.2. Счет обеспечения T+, определенный в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга, далее именуется Счетом для возмещения и комиссии.

- 10.8. В случае получения от Расчетной организации информации о закрытии и/или невозможности проведения операций по Торговому счету, к которому открыт Счет обеспечения T0, являвшийся Счетом для возмещения и комиссии до вступления в силу настоящей редакции Правил клиринга, включая получение от Расчетной организации уведомления о приостановлении или прекращении участия Участника клиринга / клиента Участника клиринга в платежной системе Расчетной организации, Клиринговый центр вправе установить в качестве Счета для возмещения и комиссии любой Счет обеспечения T+.

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

- 10.9.1. Клиринговый идентификатор соответствует одному идентификатору Участника клиринга. Одному идентификатору Участника клиринга может соответствовать более одного Клирингового идентификатора.

Заявление о присвоении Клирингового идентификатора предоставляется Клиринговому центру на бумажном носителе.

- 10.9.2. Присвоение Участнику клиринга Клирингового идентификатора осуществляется Клиринговым центром в течение 5 (пяти) рабочих дней после получения Заявления о присвоении Клирингового идентификатора при условии отсутствия замечаний по представленному заявлению.

- 10.9.3. Клиринговый центр информирует Участника клиринга о присвоенном ему Клиринговом идентификаторе не позднее рабочего дня, следующего за днем присвоения Клирингового идентификатора, путем включения информации о Клиринговом идентификаторе Участника клиринга в состав Отчета о торгово-клиринговых счетах.
- 10.9.4. Аннулирование присвоенного Участнику клиринга Клирингового идентификатора по инициативе Участника клиринга осуществляется на основании Заявления об аннулировании Клирингового идентификатора, предоставленного Участником клиринга Клиринговому центру.
- Заявление об аннулировании Клиринговых идентификаторов предоставляется Клиринговому центру на бумажном носителе.
- Аннулирование всех Клиринговых идентификаторов, соответствующих идентификатору Участника клиринга, осуществляется на основании полученного от Биржи уведомления о прекращении допуска к торгам Участника клиринга, являющегося Участником торгов, по такому идентификатору.

Статья 11. Порядок приостановления и прекращения допуска к клиринговому обслуживанию

- 11.1. Клиринговый центр вправе приостановить допуск к клиринговому обслуживанию Участника клиринга категории «Б1», категории «Б2» или категории «В» по всем сделкам или по отдельным видам сделок, а также по отдельным Режимам торгов, по любому из следующих оснований:
- 11.1.1. на основании соответствующего уведомления Биржи (для Участника клиринга, являющегося Участником торгов);
- 11.1.2. при отсутствии хотя бы одного зарегистрированного Торгово-клирингового счета;
- 11.1.3. 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);
- 11.1.4. при нарушении Участником клиринга установленных Правилами клиринга требований;
- 11.1.5. при применении Банком России к Участнику клиринга – кредитной организации санкций за нарушение банковского законодательства, в том числе: введение запрета на осуществление Участником клиринга отдельных банковских операций, если это приведет к невозможности заключения и/или исполнения Участником клиринга сделок и назначение временной администрации по управлению кредитной организацией – Участником клиринга в рамках мер по предупреждению банкротства кредитной организации;
- 11.1.6. при применении к Участнику клиринга санкций уполномоченных органов за нарушение законодательства Российской Федерации, в том числе при применении административных наказаний;
- 11.1.7. при получении Клиринговым центром письменного сообщения от компетентного органа государства учреждения Банка-нерезидента в отношении Банка-нерезидента, из которого следует невозможность дальнейшего осуществления клирингового обслуживания Банка-нерезидента, и/или размещении соответствующей информации на сайте вышеуказанного компетентного органа в сети Интернет;

- 11.1.8. наличие в деятельности Участника клиринга оснований для осуществления мер по предупреждению банкротства в соответствии с законодательством Российской Федерации о несостоятельности (банкротстве), а также оснований для отзыва (аннулирования) уполномоченным федеральным органом исполнительной власти лицензии на осуществление соответствующего вида деятельности в соответствии с законодательством Российской Федерации;
- 11.1.9. 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;
- 11.1.10. при наличии фактов ухудшения финансового состояния Участника клиринга и/или информации, дающей основания считать возможными ухудшение финансового состояния Участника клиринга и/или неспособность Участника клиринга своевременно и в полном объеме исполнять свои обязательства по Сделкам, Маржинальные требования и/или иные обязательства Участника клиринга, возникающие из Правил клиринга;
- 11.1.11. 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;
- 11.1.12. в случае отсутствия в отчетности Участника клиринга положительного финансового результата, предусмотренного пунктом 9.7 Правил клиринга, по состоянию на две и более последовательные отчетные даты;
- 11.1.13. в случае снижения рейтинга Участника клиринга – Нерезидента, не являющегося Банком ЕврАзЭС, ниже уровня, установленного пунктом 9.3.2 Правил клиринга, или в случае отзыва соответствующего рейтинга.
- 11.2. Клиринговый центр вправе установить Участнику клиринга категории «Б1» категорию «Б2» или категорию «В», а Участнику клиринга категории «Б2» - категорию «В», по основаниям, предусмотренным подпунктами 11.1.9-11.1.13 Правил клиринга, а также:
 - 11.2.1. при несоответствии размера вноса Участника клиринга категории «Б1» или «Б2» в Фонд финансовой стабильности размеру, установленному в соответствии с пунктом 15.2 Правил клиринга.
- 11.3. В случае приостановления допуска к клиринговому обслуживанию, в том числе по отдельным видам сделок или по отдельным Режимам торгов, Клиринговый центр продолжает осуществлять клиринг и иные функции, связанные с осуществлением клиринга по сделкам, стороной по которым является данный Участник клиринга, заключенным до момента приостановления допуска к клиринговому обслуживанию Участника клиринга или, соответственно, до момента приостановления допуска к клиринговому обслуживанию по отдельным видам сделок или по отдельным Режимам торгов.
- 11.4. После получения информации о прекращении действия оснований для приостановления допуска к клиринговому обслуживанию и/или понижения категории Участника клиринга и на основании соответствующего письма Участника клиринга Клиринговый центр вправе принять решение о возобновлении приостановленного клирингового обслуживания / об изменении категории Участника клиринга.

- 11.5. Клиринговый центр прекращает допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию (независимо от его категории) по любому из следующих оснований:
 - 11.5.1. в случае прекращения действия Договора об оказании клиринговых услуг;
 - 11.5.2. в случае отзыва (аннулирования) Банком России лицензии на осуществление банковских операций у Участника клиринга – кредитной организации;
 - 11.5.3. в случае отзыва (аннулирования) специального разрешения (лицензии или иного основания) компетентного органа государства учреждения Банка-нерезидента, в соответствии с которым Банк-нерезидент имеет право осуществлять банковские операции;
 - 11.5.4. в случае назначения временной администрации или принятия арбитражным судом решения о введении в отношении Участника клиринга одной из процедур банкротства;
 - 11.5.5. ликвидации Участника клиринга, а также в случае реорганизации Участника клиринга при условии, что деятельность Участника клиринга в результате реорганизации прекращается;
 - 11.5.6. размещение в сети Интернет на официальном сайте уполномоченного органа информации о включении Участника клиринга в перечень организаций, в отношении которых имеются сведения об их причастности к экстремистской деятельности или терроризму, либо размещение в сети Интернет на официальном сайте уполномоченного органа решения о применении мер по замораживанию (блокированию) денежных средств или иного имущества, принадлежащих Участнику клиринга, в отношении которого имеются достаточные основания подозревать его причастность к террористической деятельности (в том числе к финансированию терроризма) при отсутствии оснований для включения в указанный перечень (далее – включение в перечень).
- 11.6. Клиринговый центр вправе прекратить допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию:
 - 11.6.1. при поступлении в Клиринговый центр уведомления от Биржи о прекращении допуска Участника клиринга к участию в торгах на Бирже (для Участника клиринга, являющегося Участником торгов);
 - 11.6.2. неоднократно (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;
 - 11.6.3. неоднократно (два и более раза) в течение одного года нарушения Участником клиринга установленных Правилами клиринга требований.
- 11.7. С момента получения в отношении Участника клиринга информации о случаях, указанных в пунктах 11.1, 11.2 и 11.6 Правил клиринга, Клиринговый центр вправе установить для такого Участника клиринга Лимит, обеспеченный средствами фонда, равным нулю.
- 11.8. Клиринговый центр извещает Участника клиринга и Биржу о приостановлении / прекращении или возобновлении приостановленного допуска к клиринговому обслуживанию (в том числе, по отдельным видам сделок или по отдельным Режимам торгов) или об изменении категории Участника клиринга не позднее рабочего дня, следующего за днем приостановления / прекращения или возобновления приостановленного допуска к клиринговому обслуживанию / днем

установления Участнику клиринга иной категории, направляя соответствующие уведомления в форме электронного документа.

- 11.9. В случае прекращения допуска к клиринговому обслуживанию или изменения категории Участника клиринга с «Б1» или «Б2» на «В», Клиринговый центр возвращает Участнику клиринга денежные средства, составляющие взнос Участника клиринга в Фонд финансовой стабильности, учитываемый на дату прекращения допуска к клиринговому обслуживанию / дату изменения категории Участника клиринга, в течение 3 (трех) банковских дней после получения Клиринговым центром письма от Участника клиринга о возврате вклада в Фонд финансовой стабильности, содержащего платежные реквизиты, за исключением случаев, указанных в статье 41 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 Участника клиринга 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 уполномоченным органом (для организаций, являющихся Резидентами).
- 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 - Резиденты - документы, указанные в разделе I приложения № 4 к Правилам клиринга (за исключением отчетности, предусмотренной приложением № 5 к Правилам клиринга);
 - юридические лица - Нерезиденты - документы, указанные в разделе II приложения № 4 к Правилам клиринга.

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

- 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 Обеспечения Участника клиринга при подаче заявок на заключение сделок;
- не реже, чем каждый Расчетный день, осуществляет переоценку стоимости Обеспечения, а также Нетто-обязательств / Нетто-требований Участника клиринга по Сделкам T+ 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 T+, возврате Обеспечения;
- формирует Гарантийные фонды для обеспечения исполнения обязательств по Сделкам T+;
- не реже, чем каждый Расчетный день, осуществляет переоценку стоимости иностранной валюты и ценных бумаг, учитываемых в качестве взносов в Гарантийные фонды.

15.2. Фонд финансовой стабильности формируется Клиринговым центром за счет взносов всех Участников клиринга категорий «Б1» и «Б2».

Обязательный минимальный размер взноса в Фонд финансовой стабильности каждого Участника клиринга категорий «Б1» и «Б2» - стороны по Сделкам T+, являющимися сделками РЕПО, заключенными только за счет Участников торгов, а также Сделкам T+, являющимися сделками купли-продажи, заключенными за счет Участников торгов и/или за счет Клиентов, составляет 5 000 000 (пять миллионов) рублей, а каждого Участника клиринга категорий «Б1» и «Б2» - стороны по Сделкам T+, являющимися сделками РЕПО, заключенными как за счет Участников торгов, так и за счет Клиентов, составляет 10 000 000 (десять миллионов) рублей.

Порядок определения размера взноса в Фонд финансовой стабильности, вносимого Участником клиринга сверх установленного настоящим пунктом Правил клиринга обязательного минимального размера взноса в Фонд финансовой стабильности (далее – переменный взнос), установлен Методикой определения размера переменного взноса в Фонд финансовой стабильности, являющейся приложением № 8 к Правилам клиринга.

15.3. В качестве взносов в Гарантийные фонды Участники клиринга могут вносить денежные средства в российских рублях и иностранной валюте, а также ценные бумаги.

15.3.1. Перечень иностранных валют и ценных бумаг, принимаемых Клиринговым центром в качестве взносов в Гарантийные фонды, устанавливается решением Клирингового центра.

15.3.2. Предельная доля иностранной валюты, принимаемой Клиринговым центром в качестве взноса в Гарантийный фонд, составляет 100%.

Предельная доля ценных бумаг, принимаемых Клиринговым центром в качестве взноса в Гарантийный фонд, составляет 100%.

Статья 16. Единый лимит и риск-параметры

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

16.2. Единый лимит Участника клиринга используется для проверки возможности подачи Участником торгов заявок на заключение сделок, стороной по которым будет являться Участник клиринга, исполнения / прекращения обязательств по сделкам, стороной по которым является Участник клиринга, 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 и иностранной валюте, учитываемого по Счетам обеспечения T+, относящимся 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 T+ в российских рублях и ценных бумагах, учитываемых по Счету обеспечения T+ / всем Разделам T+, относящимся к Расчетному коду, по всем Датам исполнения;
- обязательств по уплате Комиссионных вознаграждений по Сделкам T+, учитываемых по Расчетному коду;
- Задолженности Участника клиринга перед Клиринговым центром в российских рублях, учитываемой по Счету обеспечения T+, относящемуся к Расчетному коду;
- обязательств по передаче / требований по получению Дохода, учитываемых по Расчетному коду и/или по Разделам T+, относящимся к Расчетному коду;
- иных обязательств / требований Участника клиринга, если это установлено иными правилами клиринга Клирингового центра.

16.4. Обязательства по передаче / требования по получению Дохода, определенные Клиринговым центром в соответствии со статьей 38 Правил клиринга, учитываются при расчете Единого лимита в Дату исполнения обязательств по передаче Дохода, а обязательства по передаче Дохода в форме денежных средств

по сделкам купли-продажи акций – дополнительно учитываются с даты заключения сделки до даты, предшествующей Дате исполнения обязательств по передаче такого Дохода (включительно), либо до даты, установленной решением Клирингового центра.

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. 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 T+.

16.7. Клиринговый центр вправе установить индивидуальные Верхние и Нижние границы диапазона оценки рыночных рисков и Верхние и Нижние границы диапазона оценки процентных рисков, расширяющие указанные диапазоны, для определенных Участников клиринга.

16.8. Участник клиринга категории «Б1» или «Б2» вправе с использованием Клиринговой системы установить индивидуальные Верхние и Нижние границы диапазона оценки рыночных рисков и Верхние и Нижние границы диапазона оценки процентных рисков, расширяющие указанные диапазоны, для определенных Торгово-клиринговых счетов Участника клиринга.

16.9. 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.

16.10. 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 T+ по основаниям, установленным пунктом 24.12 Правил клиринга, общей стоимости активов и обязательств, указанных в пункте 16.3 Правил клиринга, в связи с изменением Расчетных цен ценных бумаг, являющихся предметом Сделок T+, и/или изменением Ставок по сделкам РЕПО, являющимся Сделками T+.

При расчете Единого лимита Участника клиринга обязательства по Сделкам Т+, которые могут быть заключены на основании зарегистрированных в Системе торгов заявок, Нетто-обязательства Участника клиринга по Сделкам Т+ в российских рублях и ценных бумагах, иные обязательства и Задолженность учитываются со знаком «минус», требования по Сделкам Т+, которые могут быть заключены на основании зарегистрированных в Системе торгов заявок, Нетто-требования Участника клиринга по Сделкам Т+ в российских рублях и ценных бумагах, иные требования и Обеспечение Участника клиринга в российских рублях, иностранной валюте и ценных бумагах – со знаком «плюс».

Для целей расчета Единого лимита Участника клиринга Нетто-обязательства и Нетто-требования Участника клиринга по Сделкам Т+ 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.

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 торгов 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 состояния¹ 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 T_0/Y_n , Y_0/Y_n , Y_1/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 K_0 .
- 17.3. Процедура контроля обеспечения осуществляется в отношении Разделов и/или Счетов обеспечения, по которым должны исполняться обязательства по сделке.
- 17.3.1. Обязательства по сделке с кодом расчетов T_0 , Z_0 , R_b , X_0 , B_0 - B_{30} , S_0 - S_2 , K_0 исполняются по Разделу T_0 или Разделу T^+ и Счету обеспечения T_0 или Счету обеспечения T^+ , входящим в состав Торгово-клирингового счета, указанного в заявке на заключение сделки.
- 17.3.2. Обязательства по сделке с кодом расчетом Y_n , T_0/Y_n , Y_0/Y_n , Y_1/Y_n всегда исполняются по Разделу T^+ и Счету обеспечения T^+ . Этими Разделом и Счетом обеспечения T^+ являются:
- в случае если в заявке на заключение сделки указан Торгово-клиринговый счет, в состав которого входят Раздел T^+ и Счет обеспечения T^+ , то Раздел T^+ и Счет обеспечения T^+ , входящие в состав Торгово-клирингового счета, указанного в заявке;
 - в случае если в заявке на заключение сделки указан Торгово-клиринговый счет, в состав которого входят Раздел T_0 и/или Счет обеспечения T_0 , то

¹ Активное состояние торгово-клирингового счета в Системе клиринга определяется в соответствии с Регламентом клиринга («А» - торгово-клиринговый счет, по которому проводятся операции).

Раздел Т+, связанный с Разделом Т0, входящим в состав Торгово-клирингового счета, указанного в заявке, и Счет обеспечения Т+, входящий в состав Торгово-клирингового счета совместно с таким Разделом Т+.

- 17.4. 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.
- 17.5. При снятии в Системе торгов заявки с любым кодом расчетов, за исключением кода расчетов К0, Биржа с использованием Системы торгов направляет Клиринговому центру Уведомление о снятии заявки.
- 17.5.1. После получения Уведомления о снятии заявки на заключение сделки с кодом расчетов Y_n , $T0/Y_n$, $Y0/Y_n$, $Y1/Y_n$, поданной Участником торгов, стороной которой будет являться Участник клиринга Клиринговый центр рассчитывает Единый лимит Участника клиринга по Расчетному коду, соответствующему Счету обеспечения Т+, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в отозванной заявке, без учета отозванной заявки.
- 17.6. При регистрации в Системе торгов заявки, являющейся в соответствии с Правилами торгов допустимой встречной по отношению к ранее зарегистрированной в Системе торгов заявке на заключение сделок с Клиринговым центром, Клиринговый центр заключает сделку с каждым из Участников клиринга, указанным в заявке в качестве стороны сделки (за исключением заявок на заключение сделок с кодом расчетов К0).
- 17.7. В целях создания условий для исполнения обязательств по сделкам Клиринговый центр вправе заключать Сделки на основании заявок, поданных в Систему торгов Клиринговым центром.
- 17.8. Заключение сделок с кодом расчетов К0 осуществляется Клиринговым центром только по допустимым встречным заявкам, прошедшим Процедуру контроля обеспечения, с каждым из Участников клиринга, указанным в таких заявках в качестве стороны сделки.
- 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.
- 17.9. После того, как информация о регистрации сделки стала доступной Клиринговому центру посредством Системы торгов, Клиринговый центр допускает к клирингу обязательства по заключенной сделке.
- 17.9.1. После того, как информация о регистрации сделки купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов Т0, К0 стала доступной Клиринговому центру посредством Системы торгов, Клиринговый центр также:
- включает в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов по сделкам с центральным контрагентом с ближайшим временем исполнения обязательства/требования Участников клиринга по оплате и передаче ценных бумаг по заключенной сделке;
 - рассчитывает соответствующий Единый лимит Участника клиринга без учета заявки (части заявки), на основании которой была заключена указанная

сделка, и с учетом указанной заключенной сделки (для сделок, заключенных на основании заявок, поданных с указанием Торгово-клирингового счета, в состав которого входят Счета обеспечения T+ и/или Разделы T+).

17.9.2. После того, как информация о регистрации сделки РЕПО с кодом расчетов Rb стала доступной Клиринговому центру посредством Системы торгов, Клиринговый центр также:

- включает в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов с ближайшим временем исполнения обязательства / требования Участников клиринга по оплате и передаче ценных бумаг по первой части заключенной сделки РЕПО.

17.9.3. После того, как информация о регистрации сделки с кодом расчетов Yn, T0/Yn, Y0/Yn, Y1/Yn стала доступной Клиринговому центру посредством Системы торгов, 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 T+ в российских рублях и ценных бумагах с Датами исполнения, соответствующими Дате (Датам) исполнения обязательств по заключенной сделке, по Счету обеспечения T+ (для денежных средств) и/или по Разделу T+ (для ценных бумаг), по которым должны исполняться обязательства по сделке.

17.10. После того, как информация о регистрации сделки с кодом расчетов Z0, X0 стала доступной Клиринговому центру посредством Системы торгов, 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, X0;
- рассчитывает соответствующий Единый лимит Участника клиринга без учета заявки (части заявки), на основании которой была заключена указанная сделка, и с учетом указанной заключенной сделки (для сделок, заключенных на основании заявок, поданных с указанием Торгово-клирингового счета, в состав которого входят Счета обеспечения T+ и/или Разделы T+);
- осуществляет взаимодействия с Расчетным депозитарием с целью проведения расчетов в ходе торгов по заключенной сделке (первой части сделки РЕПО) с кодом расчетов Z0, X0. Взаимодействие с Расчетным депозитарием с целью проведения расчетов по сделке с кодом расчетов X0 осуществляется с учетом требования, установленного подпунктом 36.10.1 Правил клиринга.

17.11. 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.

17.11.1. 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.

17.11.2. 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

18.1. Процедура контроля обеспечения, осуществляемая при подаче заявок на заключение биржевых сделок, за исключением заявок, дата активации которых не наступила, считается пройденной в следующих случаях:

18.1.1. Для заявки на покупку ценных бумаг с кодом расчетов T0, Z0, Rb, X0 в случае, если сумма сделки, которая может быть заключена на основании поданной заявки, включая НКД, не превышает планового значения позиции по денежным средствам по Счету обеспечения T0 или T+, по которому должны исполняться обязательства по сделке.

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

18.1.2. Для заявки на продажу ценных бумаг с кодом расчетов T0, Rb в случае, если количество ценных бумаг, указанное в заявке, не превышает планового значения позиции по ценным бумагам по Разделу T0 или T+, по которому должны исполняться обязательства по сделке.

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

18.1.3. Для заявки на продажу ценных бумаг с кодом расчетов Z0, X0 в случае, если количество ценных бумаг, указанное в заявке, не превышает начального и планового значения позиции по ценным бумагам по Разделу T0 или T+, по которому должны исполняться обязательства по сделке.

18.1.4. Для заявок на покупку или продажу ценных бумаг с кодом расчетов T0, Rb, Z0, X0 на заключение сделки, обязательства по которой должны исполняться по Разделу T+ и/или Счету обеспечения T+, дополнительно к условиям, указанным в подпунктах 18.1.1-18.1.3 Правил клиринга, проверяется достаточность Единого лимита Участника клиринга по Расчетному коду, соответствующему Разделу T+ и/или Счету обеспечения T+, по которым должны исполняться обязательства по сделке, в соответствии с подпунктом 18.1.7 Правил клиринга. При этом сумма операции, в отношении которой осуществляется указанная проверка, определяется в соответствии с подпунктами 18.1.1-18.1.3 Правил клиринга.

18.1.5. Для заявки на покупку или на продажу с кодом расчетов Yn, Y0/Yn, Y1/Yn, в случае достаточности Единого лимита Участника клиринга по Расчетному коду, соответствующему Счету обеспечения T+, по которому должны исполняться обязательства по сделке, в соответствии с подпунктом 18.1.7 Правил клиринга.

18.1.6. Для заявки на покупку или продажу ценных бумаг с кодом расчетов T0/Yn в случае прохождения проверки в соответствии с подпунктом 18.1.1 или 18.1.2 Правил клиринга и проверки в соответствии с подпунктом 18.1.5 Правил клиринга.

18.1.7. Единый лимит Участника клиринга по Расчетному коду является достаточным для подачи заявки при условии, что значение Единого лимита с учетом поданной заявки не станет отрицательным, или, если Единый лимит Участника клиринга по такому Расчетному коду был отрицательным до момента подачи заявки, при условии, что Единый лимит Участника клиринга по такому Расчетному коду,

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

18.1.8. Для заявки на покупку ценных бумаг с кодом расчетов Y_n , Y_0/Y_n , Y_1/Y_n , T_0/Y_n на заключение Сделки T_+ , по которой должен осуществляться клиринг с полным обеспечением по денежным средствам, дополнительным необходимым условием, кроме условий, указанных в подпункте 18.1.5 или подпункте 18.1.6, является следующее:

- сумма сделки, которая может быть заключена на основании поданной заявки, включая НКД, не превышает планового значения позиции по денежным средствам, рассчитанного по каждой Дате исполнения, по Счету обеспечения T_+ , по которому должны исполняться обязательства по сделке.

Для заявок на заключение сделок РЕПО, проверки, указанные в настоящем подпункте Правил клиринга, осуществляются для первой и второй части сделки РЕПО.

18.1.9. Для заявки на продажу ценных бумаг с кодом расчетов Y_n , Y_0/Y_n , Y_1/Y_n , T_0/Y_n на заключение Сделки T_+ , по которой должен осуществляться клиринг с полным обеспечением по ценным бумагам, дополнительным необходимым условием, кроме условий, указанных в подпункте 18.1.5 или подпункте 18.1.6, является следующее:

- количество ценных бумаг, указанное в заявке, не превышает планового значения позиции по ценным бумагам, рассчитанного по каждой Дате исполнения, по Разделу T_+ , по которому должны исполняться обязательства по сделке.

Для заявок на заключение сделок РЕПО, проверки, указанные в настоящем подпункте Правил клиринга, осуществляются для первой и второй части сделки РЕПО.

18.1.10. Для заявки на покупку ценных бумаг с кодом расчетов T_0 , Z_0 , R_b , X_0 , заявки на продажу ценных бумаг с кодом расчетов T_0 , R_b , Z_0 , X_0 на заключение сделок срисчетами в иностранной валюте, для заявки на покупку или на продажу с кодом расчетов Y_n , Y_0/Y_n , Y_1/Y_n , T_0/Y_n дополнительно к условиям, указанным в подпунктах 18.1.1-18.1.6 Правил клиринга, а также для заявки на покупку или на продажу с кодом расчетов B_0 - B_{30} или S_0 - S_2 проверяется наличие Обеспечения, необходимого для исполнения обязательства по уплате Комиссионного вознаграждения по сделке, которая может быть заключена на основании поданной заявки:

- для заявки на заключение сделки, обязательства по которой должны исполняться по Счету обеспечения T_0 - в плановой позиции по денежным средствам по Счету обеспечения T_0 ;
- для заявки на заключение сделки, обязательства по которой должны исполняться по Счету обеспечения T_+ , или обязательства по уплате комиссионных вознаграждений по которой должны исполняться по Счету обеспечения T_+ , - в Едином лимите.

18.1.11. Для заявок с кодом расчетов T_0 , Z_0 , R_b , X_0 , B_0 - B_{30} или S_0 - S_2 на заключение сделок, обязательства по которым должны исполняться по Счету обеспечения T_0 , проверки, указанные в подпунктах 18.1.1-18.1.4, 18.1.10 Правил клиринга осуществляются с учетом Ограничительного лимита, установленного по Счету обеспечения T_0 .

18.1.12. Проверки, указанные в подпунктах 18.1.1-18.1.11 Правил клиринга, осуществляются с учетом поданной заявки, по которой осуществляется проверка, а также с учетом иных поданных заявок такой же направленности, а также зарегистрированных и не обеспеченных средствами под расчеты Отчетов на исполнение (Специальных отчетов на исполнение, Срочных отчетов на исполнение) такой же направленности, приводящих к изменению той же позиции, что и проверяемая заявка.

18.1.13. Для заявок на покупку ценных бумаг, поданных Участником клиринга категории «А», проверки, указанные в подпунктах 18.1.1, 18.1.4-18.1.6, 18.1.10, 18.1.11 Правил клиринга, не осуществляются.

Для заявок на продажу ценных бумаг, поданных Участником клиринга категории «А», проверка, указанная в подпункте 18.1.2 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 2.21 Правил клиринга.

18.2. В случае прохождения заявки на покупку или на продажу Процедуры контроля обеспечения, в ходе которой осуществлялась проверка достаточности Единого лимита, Клиринговый центр начинает учитывать значение Единого лимита Участника клиринга по Расчетному коду, соответствующему Счету обеспечения T+, по которому должны исполняться обязательства по сделке, рассчитанное в соответствии с подпунктом 18.1.7 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 (далее – основная Процедура контроля обеспечения).

18.4. Для заявок с отложенной датой активации с реквизитом «Частичное обеспечение/отступное» осуществляется дополнительная Процедура контроля обеспечения при подаче такой заявки. Указанная процедура считается пройденной в следующем случае:

- если сумма денежных средств, необходимая для исполнения в полном объеме обязательства по передаче отступного за отказ от исполнения обязательств по заключению сделки на основании заявки с отложенной датой активации с реквизитом «Частичное обеспечение/отступное», величина которого определяется в соответствии с Правилами торгов (далее – отступное за отказ от заключения сделки), не превышает планового значения позиции по денежным средствам по Счету обеспечения T+, по которому должны исполняться обязательства по сделке.

18.4.1. В случае непрохождения заявки с отложенной датой активации с реквизитом «Частичное обеспечение/отступное» основной Процедуры контроля обеспечения Клиринговый центр включает в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов с ближайшим временем исполнения обязательство по передаче отступного за отказ от заключения сделки.

- 18.5. Процедура контроля обеспечения, осуществляемая при заключении биржевых сделок с ценными бумагами с кодом расчетов КО, считается пройденной в следующих случаях:
- 18.5.1. Для сделки, заключенной на основании заявки на покупку, в случае если сумма сделки, включая НКД, не превышает планового значения позиции по денежным средствам по Счету обеспечения, по которому должны исполняться обязательства по сделке, а также в случае прохождения проверок, указанных в подпунктах 18.1.10, 18.1.11 Правил клиринга.
- 18.5.2. Для сделки, заключенной на основании заявки на продажу, в случае если количество ценных бумаг в сделке не превышает планового значения позиции депо по Разделу, по которому должны исполняться обязательства по сделке.

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 25 Правил клиринга.

РАЗДЕЛ V. ПОРЯДОК ПРОВЕДЕНИЯ КЛИРИНГА

ПОДРАЗДЕЛ V-I. ПОРЯДОК ВНЕСЕНИЯ И ВОЗВРАТА ОБЕСПЕЧЕНИЯ И ВЗНОСОВ В ГАРАНТИЙНЫЕ ФОНДЫ

Статья 20. Порядок внесения Обеспечения

- 20.1. Внесение Обеспечения в российских рублях и иностранной валюте Участником клиринга возможно двумя способами:
- 1) путем перевода денежных средств на соответствующий 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.
- 20.2. 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.
- 20.3. В качестве Обеспечения могут быть внесены ценные бумаги, включенные в Клиринговый лист, и иные ценные бумаги.
- Перечень иных ценных бумаг и перечень иностранных валют, внесение которых в Обеспечение возможно, устанавливается решением Клирингового центра.
- 20.3.1. Ценные бумаги, эмитентом которых является Участник клиринга или связанное с ним лицо, не учитываются в качестве Обеспечения по Разделу T+, предназначенному для учета собственных ценных бумаг такого Участника клиринга.
- 20.3.2. Предельная доля ценных бумаг, принимаемых в Обеспечение и включенных в Клиринговый лист, составляет 100%.
- Предельная доля иных ценных бумаг, принимаемых в Обеспечение, устанавливается решением Клирингового центра.
- 20.4. Предельная доля иностранной валюты, принимаемой в Обеспечение, составляет 100%.
- 20.5. 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.
- 20.5.1. 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.
- 20.6. Распоряжение на внесение денежных средств / ценных бумаг в Обеспечение, подаваемое Участником клиринга с использованием Клиринговой системы, содержит указание на Торгово-клиринговые счета, по которым должна быть исполнена данная операция, и сумму денежных средств / количество ценных бумаг, которые необходимо внести в Обеспечение.
- 20.6.1. 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, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в распоряжении, за вычетом соответствующего Ограничительного лимита.
- 20.6.2. 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.
- 20.6.3. Частичное исполнение распоряжения на внесение денежных средств / ценных бумаг в Обеспечение невозможно.
- 20.6.4. Внесение денежных средств в Обеспечение осуществляется на Счет обеспечения T+, входящий в состав Торгово-клирингового счета, указанного в распоряжении.
- 20.6.5. Внесение ценных бумаг в Обеспечение осуществляется на Раздел T+, связанный с Разделом T0, входящим в состав Торгово-клирингового счета, указанного в распоряжении.
- 20.6.6. В случае положительного результата проверки возможности исполнения распоряжения на внесение денежных средств / ценных бумаг в Обеспечение, в Клиринговой системе незамедлительно уменьшается плановое значение позиции по денежным средствам / ценным бумагам по Счету обеспечения T0 / Разделу T0 и увеличивается плановое значение позиции по денежным средствам / ценным бумагам по Счету обеспечения T+ / Разделу T+ Участника клиринга.
- 20.6.7. 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 20.6.1, 20.6.2 Правил клиринга, включаются в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов и учитываются при определении Нетто-обязательств / Нетто-требований Участников клиринга по денежным средствам / ценным бумагам по сделкам клирингового пула в соответствии со статьей 34 Правил клиринга.
- 20.7. 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 соответствующей валюте, указанная Участником

клиринга в заявлении, превышает плановое значение позиции по денежным средствам в этой же валюте по Счету обеспечения T+, с которого денежные средства должны быть списаны, за вычетом соответствующего Ограничительного лимита или если Единый лимит Участника клиринга по Расчетному коду, соответствующему 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 T+, в результате такого списания уменьшится.

В случае если в соответствии с поданным Заявлением о переводе денежных средств, списание денежных средств осуществляется со Счета обеспечения T+, входящего в состав Торгово-клирингового счета с признаком «запрет необеспеченных покупок», и/или со Счета обеспечения T+ Участника клиринга категории «B», дополнительным условием исполнения такого заявления является не превышение суммы денежных средств, подлежащей списанию, планового значения позиции по денежным средствам, рассчитанного по всем Датам исполнения, по Счету обеспечения T+ за вычетом соответствующего Ограничительного лимита.

При исполнении Заявления о переводе денежных средств плановое значение позиции по денежным средствам Участника клиринга по Счету обеспечения T+, с которого списываются денежные средства, уменьшается, а по Счету обеспечения T+, на который зачисляются денежные средства, - увеличивается на сумму переводимых денежных средств.

20.8. Обеспечение в российских рублях используется в следующей очередности:

- 1) для погашения Задолженности Участника клиринга перед Клиринговым центром;
- 2) для исполнения обязательств, включенных в клиринговый пул;
- 3) для обеспечения исполнения обязательств Участника клиринга по Сделкам T+;
- 4) для исполнения обязательств по уплате Комиссионного вознаграждения;
- 5) для исполнения обязательств по уплате Возмещений;
- 6) для уплаты пеней за наличие непогашенной Задолженности.

20.9. Обеспечение в иностранной валюте используется в следующей очередности:

- 1) для исполнения обязательств в соответствующей иностранной валюте, включенных в клиринговый пул;
- 2) для обеспечения исполнения обязательств Участника клиринга по Сделкам T+.

20.10. Обеспечение в ценных бумагах используется в следующей очередности:

- 1) для исполнения обязательств в соответствующих ценных бумагах, включенных в клиринговый пул;
- 2) для обеспечения исполнения обязательств Участника клиринга по Сделкам T+.

20.11. После перечисления Участником клиринга денежных средств на счет Клирингового центра, открытый в Расчетной организации, и учета их в качестве Обеспечения по Счету обеспечения T+, у Клирингового центра возникает

обязательство вернуть денежные средства Участнику клиринга в размере, определяемом в соответствии с пунктами 21.4, 21.5 Правил клиринга.

- 20.12. 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.

Статья 21. Порядок возврата Обеспечения

- 21.1. Возврат Клиринговым центром Участнику клиринга денежных средств, учитываемых в качестве Обеспечения, осуществляется на основании Запроса о возврате денежных средств из Обеспечения, Постоянного поручения на возврат денежных средств из Обеспечения или на основании Заявления о порядке использования денежных средств и ценных бумаг.

Возврат Клиринговым центром Участнику клиринга ценных бумаг, учитываемых в качестве Обеспечения, осуществляется на основании Запроса о возврате ценных бумаг из Обеспечения, или на основании Заявления о порядке использования денежных средств и ценных бумаг, или на основании поручения на списание ценных бумаг с Раздела Т+, поданного в Расчетный депозитарий. Исполнение указанного поручения будет осуществляться в порядке, установленном статьей 36 Правил клиринга.

- 21.1.1. Возврат денежных средств на основании Запроса о возврате денежных средств из Обеспечения или Постоянного поручения на возврат денежных средств из Обеспечения осуществляется на Счет для возврата денежных средств, предварительно зарегистрированный в Клиринговом центре.

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 качестве Счета для возврата денежных средств может быть указан, в том числе, Торговый счет.

В случае если владельцем Счета для возврата денежных средств является клиент Участника клиринга, Участник клиринга вместе с таким заявлением предоставляет Клиринговому центру:

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

- 21.1.2. Возврат денежных средств на основании Заявления о порядке использования денежных средств и ценных бумаг осуществляется на Счет обеспечения Т0, соответствующий Счету обеспечения Т+.

- 21.1.3. Возврат ценных бумаг на основании Запроса о возврате ценных бумаг из Обеспечения или на основании Заявления о порядке использования денежных средств и ценных бумаг осуществляется на Раздел Т0, связанный с Разделом Т+.

- 21.1.4. Возврат ценных бумаг на основании поручения на списание ценных бумаг с Раздела Т+, поданного в Расчетный депозитарий, осуществляется на раздел торгового счета депо, указанный в поручении.
- 21.2. Запрос о возврате денежных средств из Обеспечения содержит указание на Счет обеспечения Т+ / Расчетный код Участника клиринга, валюту и сумму денежных средств.
- 21.2.1. Запрос о возврате ценных бумаг из Обеспечения содержит указание на Раздел Т+, код и количество ценных бумаг.
- 21.2.2. 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.
- 21.2.3. Постоянное поручение на возврат денежных средств из Обеспечения направляется Участником клиринга в форме электронного документа.
- Постоянное поручение на возврат денежных средств из Обеспечения исполняется Клиринговым центром каждый Расчетный день, начиная с первого Расчетного дня, следующего за датой предоставления указанного поручения, после прекращения обязательств по Сделкам Т+, включенных в последний в течение Расчетного дня Клиринговый пул по Сделкам Т+ в соответствии со статьей 31 Правил клиринга, в размере плановой позиции по денежным средствам, учитываемой по Счету обеспечения Т+.
- Постоянное поручение на возврат денежных средств из Обеспечения действует до его отмены Участником клиринга.
- Отмена Постоянного поручения на возврат осуществляется путем направления Участником клиринга Клиринговому центру электронного документа.
- 21.2.4. Запрос о возврате ценных бумаг из Обеспечения направляется Участником клиринга в электронном виде с использованием Клиринговой системы.
- 21.2.5. Сроки предоставления Запросов о возврате денежных средств / ценных бумаг из Обеспечения установлены Временным регламентом.
- 21.2.6. 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.
- 21.2.7. Запрос о возврате денежных средств / ценных бумаг из Обеспечения действует в день его предоставления.
- 21.2.8. Запрос о возврате денежных средств / ценных бумаг из Обеспечения, полученный в сроки, установленные Временным регламентом, исполняется в день его получения при соблюдении условия, указанного в пункте 21.4 Правил клиринга.
- 21.3. Заявление о порядке использования денежных средств и ценных бумаг содержит указание Клиринговому центру:
- а) о порядке перечисления денежных средств / ценных бумаг со Счетов обеспечения Т0 на Счета обеспечения Т+ / с Разделов Т0 на Разделы Т+ при исполнении обязательств по Сделкам Т+:
 - не перечислять;

- перечислять в сумме / количестве, недостающем для исполнения Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам;
- перечислять в размере Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам.

В случае непредоставления Заявления о порядке использования денежных средств и ценных бумаг денежные средства / ценные бумаги со Счетов обеспечения T0 на Счета обеспечения T+ / с Разделов T0 на Разделы T+ при исполнении обязательств по Сделкам T+ перечисляются в сумме / количестве, недостающем для исполнения Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам.

- б) о порядке возврата денежных средств / ценных бумаг со Счетов обеспечения T+ / с Разделов T+ после прекращения обязательств по Сделкам T+:
- не возвращать;
 - возвращать в размере Итогового нетто-требования Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам.

В случае непредоставления Заявления о порядке использования денежных средств и ценных бумаг денежные средства / ценные бумаги со Счетов обеспечения T+ / с Разделов T+ после прекращения обязательств по Сделкам T+ не возвращаются.

- 21.3.1. Заявление о порядке использования денежных средств и ценных бумаг предоставляется Участником клиринга Клиринговому центру в бумажной форме или в форме электронного документа.
- 21.3.2. Заявление о порядке использования денежных средств и ценных бумаг исполняется Клиринговым центром, начиная с Расчетного дня, следующего за датой предоставления указанного заявления.
- 21.4. 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 количество ценных бумаг / сумма денежных средств, подлежащая возврату, не превышает планового значения позиции по денежным средствам / ценным бумагам Участника клиринга по Счету обеспечения T+ / Разделу T+ за вычетом соответствующего Ограничительного лимита (для Счета обеспечения T+), и Единый лимит по Расчетному коду Участника клиринга, указанному в запросе, или Единый лимит по Расчетному коду, к которому относится Раздел T+, указанный в запросе, рассчитанный без учета возвращаемой суммы денежных средств / количества ценных бумаг соответственно, не станет отрицательным.

В случае возврата денежных средств / ценных бумаг со Счета обеспечения T+ / Раздела T+, входящего в состав Торгово-клирингового счета с признаком «запрет необеспеченных покупок» / «запрет коротких продаж», и/или Участника клиринга категории «В», и/или ценных бумаг с признаком «запрет коротких продаж», дополнительным условием исполнения такого возврата является не превышение суммы денежных средств / количества ценных бумаг, подлежащего списанию, планового значения позиции по денежным средствам / ценным бумагам, рассчитанного по всем Датам исполнения, по Счету обеспечения T+ / Разделу T+ за вычетом соответствующего Ограничительного лимита (для Счета обеспечения T+).

- 21.5. Возврат Клиринговым центром Участнику клиринга денежных средств / ценных бумаг на основании Заявления о порядке использования денежных средств и ценных бумаг осуществляется после прекращения обязательств по Сделкам T+, включенных в Клиринговый пул по Сделкам T+ в соответствии со статьей 31 Правил клиринга, в размере прекращенного Итогового нетто-требования Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам, учитываемого по Счету обеспечения T+ / Разделу T+, но не превышающем планового значения позиции по денежным средствам / ценным бумагам по тому же Счету обеспечения T+ / Разделу T+ за вычетом соответствующего Ограничительного лимита (для Счета обеспечения T+), и при условии, что возврат этой суммы денежных средств / количества ценных бумаг из Обеспечения не приведет к возникновению у Участника клиринга отрицательного Единого лимита по Расчетному коду, соответствующему Счету обеспечения T+ / Разделу T+, либо на максимально возможную сумму, не превышающую планового значения позиции по денежным средствам / ценным бумагам по Счету обеспечения T+ / Разделу T+ за вычетом соответствующего Ограничительного лимита (для Счета обеспечения T+), возврат которой из Обеспечения не приведет к возникновению у Участника клиринга отрицательного Единого лимита по Расчетному коду, соответствующему Счету обеспечения T+.
- 21.6. Сразу после проверки возможности возврата денежных средств / ценных бумаг из Обеспечения, проведенной в соответствии с пунктом 21.4 или пунктом 21.5 Правил клиринга, плановое значение позиции по денежным средствам / ценным бумагам по Счету обеспечения T+ / Разделу T+ уменьшается, а плановое значение позиции по денежным средствам / ценным бумагам по Счету обеспечения T0 / Разделу T0 увеличивается на возвращаемую сумму денежных средств / количество ценных бумаг (при возврате денежных средств / ценных бумаг на Счета обеспечения T0 / Разделы T0).
- 21.6.1. Обязательства по списанию денежных средств / ценных бумаг со Счетов обеспечения T+ / Разделов T+ и/или обязательства по зачислению денежных средств / ценных бумаг на Счета обеспечения T0 / Разделы T0, возникшие на основании Запросов о возврате денежных средств / ценных бумаг из Обеспечения или Заявлений о порядке использования денежных средств и ценных бумаг, прошедших проверку возможности их исполнения в соответствии с пунктом 21.4 или пунктом 21.5 Правил клиринга соответственно, включаются в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов и учитываются при определении Нетто-обязательств / Нетто-требований Участников клиринга по денежным средствам / ценным бумагам по сделкам клирингового пула в соответствии со статьей 34 Правил клиринга.
- 21.7. 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.
- 21.8. Клиринговый центр осуществляет ежегодную сверку остатков на Счетах обеспечения T+ Участника клиринга в российских рублях и иностранной валюте путем направления соответствующего уведомления Участнику клиринга не позднее десятого рабочего дня года, следующего за отчетным годом.
Если в течение десяти рабочих дней после направления Участнику клиринга указанного уведомления, Участник клиринга не уведомит Клиринговый центр о

наличии расхождений, остатки на Счетах обеспечения Т+ Участника клиринга в российских рублях и/или иностранной валюте считаются подтвержденными.

Статья 22. Порядок внесения взносов в Гарантийные фонды

22.1. Для учета денежных средств в качестве взносов в Гарантийные фонды Участник клиринга обязан перечислить денежные средства в российских рублях и/или иностранной валюте на клиринговый банковский счет Клирингового центра в соответствующей валюте, открытый в Расчетной организации и предназначенный для учета коллективного клирингового обеспечения, по реквизитам, размещенным на Сайте Клирингового центра, с обязательным указанием в назначении платежа Расчетного кода Участника клиринга, присвоенного для учета взносов в Гарантийные фонды.

22.1.1. Присвоение Участнику клиринга Расчетного кода для учета взносов в Гарантийные фонды осуществляется Клиринговым центром на основании Заявления о присвоении Расчетного кода для учета взносов в Гарантийные фонды, предоставленного Клиринговому центру в бумажной форме или в форме электронного документа.

22.2. Для учета ценных бумаг в качестве взносов в Гарантийные фонды Участник клиринга обязан:

а) выполнить действия, необходимые для открытия субсчета депо на клиринговом счете депо Клирингового центра в Расчетном депозитарии, предназначенном для учета коллективного клирингового обеспечения (далее – субсчет депо), предусмотренные Условиями осуществления депозитарной деятельности Расчетного депозитария и Правилами клиринга;

б) зарегистрировать Торгово-клиринговый счет для учета взносов в Гарантийные фонды, в состав которого входят субсчет депо и Расчетный код для учета взносов в Гарантийные фонды. Регистрация Торгово-клирингового счета для учета взносов в Гарантийные фонды осуществляется на основании заявления, предоставляемого Участником клиринга в Клиринговый центр в бумажной форме или в форме электронного документа;

в) перечислить ценные бумаги на указанный субсчет депо.

22.2.1. Перечисление ценных бумаг на субсчет депо осуществляется путем подачи Участником клиринга с использованием Клиринговой системы соответствующего распоряжения, в котором указывается Торгово-клиринговый счет Участника клиринга, с которого ценные бумаги должны быть списаны, и Торгово-клиринговый счет для учета взносов в Гарантийные фонды.

В качестве Торгово-клирингового счета Участника клиринга, с которого ценные бумаги должны быть списаны, может быть указан только Торгово-клиринговый счет, в состав которого входит Раздел, открытый на торговом счете депо владельца Участника клиринга.

22.2.2. Распоряжение на перечисление ценных бумаг в Гарантийные фонды исполняется в случае, если плановое значение позиции по ценным бумагам по Разделу, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в распоряжении в качестве Торгово-клирингового счета, с которого ценные бумаги должны быть списаны, больше либо равно количеству перечисляемых ценных бумаг, указанному в распоряжении.

В случае перечисления ценных бумаг с Раздела Т+ дополнительными условиями, необходимыми для исполнения указанного распоряжения, являются:

- 1) неотрицательное значение Единого лимита по Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета, с которого ценные бумаги должны быть списаны, на момент подачи распоряжения;
- 2) перечисление ценных бумаг не приведет к возникновению у Участника клиринга отрицательного Единого лимита по Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета, с которого ценные бумаги должны быть списаны.

22.2.3. Для исполнения распоряжения Участника клиринга на перечисление ценных бумаг в Гарантийные фонды Клиринговый центр направляет Расчетному депозитарию распоряжение в соответствии с пунктом 36.12 Правил клиринга.

22.3. Для контроля за исполнением обязательств Участника клиринга по внесению взносов в Гарантийные фонды, Клиринговый центр рассчитывает Единый лимит Участника клиринга по Торгово-клиринговому счету для учета взносов в Гарантийные фонды в соответствии с принципами, изложенными в статье 16 Правил клиринга, с учетом:

- суммы денежных средств в российских рублях, перечисленных Участником клиринга на клиринговый банковский счет Клирингового центра в российских рублях, предназначенный для учета коллективного клирингового обеспечения;
- суммы денежных средств в иностранной валюте, перечисленных Участником клиринга на клиринговый банковский счет Клирингового центра в соответствующей валюте, предназначенный для учета коллективного клирингового обеспечения;
- количества ценных бумаг, перечисленных Участником клиринга на свой субсчет депо;
- обязательства Участника клиринга по внесению взноса в Фонд финансовой стабильности в размере, равном установленному Клиринговым центром размеру взноса Участника клиринга в Фонд финансовой стабильности;
- обязательства Участника клиринга по внесению взносов в Гарантийные фонды, формируемые в соответствии с иными правилами клиринга Клирингового центра.

Риск-параметры, используемые для оценки иностранной валюты, перечисленной Участником клиринга для учета в качестве взносов в Гарантийные фонды, устанавливаются Клиринговым центром в соответствии с Методикой определения риск-параметров валютного рынка и рынка драгоценных металлов, ценных бумаг – в соответствии с Методикой определения риск-параметров рынка ценных бумаг.

22.4. Обязательства Участника клиринга по внесению взносов в Гарантийные фонды считаются исполненными, если Единый лимит Участника клиринга по Торгово-клиринговому счету для учета взносов в Гарантийные фонды, рассчитанный в соответствии с пунктом 22.3 Правил клиринга, является неотрицательным.

22.5. В случае если Единый лимит Участника клиринга по Торгово-клиринговому счету для учета взносов в Гарантийные фонды становится отрицательным, Клиринговый центр направляет Участнику клиринга требование о приведении взносов Участника клиринга в Гарантийные фонды в соответствие установленным размерам взносов.

Указанное требование направляется Участнику клиринга по итогам клиринговой сессии, проводимой в соответствии со статьей 24 Правил клиринга, путем направления Отчета о гарантийных фондах, содержащего информацию об отрицательном значении Единого лимита Участника клиринга по Торгово-клиринговому счету для учета взносов в Гарантийные фонды.

Указанное требование должно быть исполнено Участником клиринга в течение 1 (одного) Расчетного дня с даты его направления Участнику клиринга путем перечисления денежных средств в российских рублях и/или иностранной валюте и/или ценных бумаг для учета в качестве взносов в Гарантийные фонды в порядке, установленном настоящей статьей Правил клиринга.

- 22.6. Российские рубли, иностранная валюта и/или ценные бумаги, перечисленные Участником клиринга для учета в качестве взносов в Гарантийные фонды, учитываются в качестве таких взносов в следующей очередности:
- в первую очередь указанные средства учитываются в качестве взноса в Фонд финансовой стабильности;
 - во вторую очередь - в качестве взносов в гарантийный фонды, формируемые в соответствии с иными правилами клиринга Клирингового центра.
- 22.7. В случае невыполнения Участником клиринга требования Клирингового центра о приведении взносов Участника клиринга в Гарантийные фонды в соответствии установленным размерам взносов в срок, установленный пунктом 22.5 Правил клиринга:
- при недостаточности взноса Участника клиринга в Фонд финансовой стабильности, Участнику клиринга категории «Б» устанавливается категория «В».
- 22.8. После перечисления Участником клиринга денежных средств / ценных бумаг на клиринговый банковский счет Клирингового центра, открытый в Расчетной организации и предназначенный для учета коллективного клирингового обеспечения / субсчет депо, и учета их в качестве взносов Участника клиринга в соответствующий Гарантийный фонд, у Клирингового центра возникает обязательство вернуть Участнику клиринга денежные средства / ценные бумаги, учитываемые в качестве взносов Участника клиринга в соответствующий Гарантийный фонд.

Статья 23. Порядок возврата взносов в Гарантийные фонды

- 23.1. Возврат Участнику клиринга его взносов в Гарантийные фонды осуществляется при прекращении Договора об оказании клиринговых услуг в соответствии с пунктом 3.10 Правил клиринга.
- 23.2. Возврат Участнику клиринга денежных средств / ценных бумаг, учитываемых в качестве взносов Участника клиринга в Гарантийные фонды, без прекращения участия в Гарантийных фондах осуществляется на основании Запроса о возврате денежных средств / ценных бумаг из Гарантийных фондов.
- 23.2.1. Возврат денежных средств на основании Запроса о возврате денежных средств из Гарантийных фондов, осуществляется на Счет для возврата денежных средств, предварительно зарегистрированный в Клиринговом центре в порядке, установленном подпунктом 21.1.1 Правил клиринга.

- 23.2.2. Запрос о возврате денежных средств из Гарантийных фондов должен содержать указание на Расчетный код Участника клиринга для учета взносов в Гарантийные фонды, валюту и сумму денежных средств.
- 23.2.3. Запрос о возврате денежных средств из Гарантийных фондов 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 Гарантийных фондов в форме сообщения по системе S.W.I.F.T.
- 23.2.4. Запрос о возврате ценных бумаг из Гарантийных фондов должен содержать указание на Торгово-клиринговый счет для учета взносов в Гарантийные фонды, Торгово-клиринговый счет Участника клиринга, на который ценные бумаги должны быть зачислены, код и количество ценных бумаг.
- В качестве Торгово-клирингового счета Участника клиринга, на который ценные бумаги должны быть зачислены, может быть указан только Торгово-клиринговый счет, в состав которого входит Раздел, открытый на торговом счете депо владельца Участника клиринга.
- 23.2.5. Сроки предоставления Запросов о возврате денежных средств / ценных бумаг из Гарантийных фондов установлены Временным регламентом.
- 23.2.6. При предоставлении Запроса о возврате денежных средств / ценных бумаг, учитываемых в качестве взносов в Гарантийные фонды, позднее времени, указанного во Временном регламенте, указанный запрос не исполняется.
- 23.2.7. Запрос о возврате денежных средств / ценных бумаг из Гарантийных фондов подлежит исполнению в день его получения Клиринговым центром при условии соблюдения требований, установленных пунктом 23.2.8 / 23.2.9 Правил клиринга.
- 23.2.8. Запрос о возврате денежных средств из Гарантийных фондов исполняется в случае, если сумма денежных средств, подлежащая возврату, не превышает значения позиции по денежным средствам в соответствующей валюте, учитываемой по Расчетному коду для учета взносов в Гарантийные фонды, у Участника клиринга отсутствуют Задолженности и Единый лимит Участника клиринга по Торгово-клиринговому счету для учета взносов в Гарантийные фонды, рассчитанный без учета возвращаемой суммы денежных средств, не станет отрицательным.
- 23.2.9. Запрос о возврате ценных бумаг из Гарантийных фондов исполняется в случае, если значение позиции по ценным бумагам по субсчету депо больше либо равно количеству ценных бумаг, указанному в запросе, у Участника клиринга отсутствуют Задолженности и Единый лимит Участника клиринга по Торгово-клиринговому счету для учета взносов в Гарантийные фонды, рассчитанный без учета возвращаемого количества ценных бумаг, не станет отрицательным.
- 23.2.10. Для исполнения запроса о возврате денежных средств из Гарантийных фондов Клиринговый центр перечисляет денежные средства, учитываемые в качестве взносов в Гарантийные фонды, по реквизитам Счета для возврата денежных средств.
- 23.2.11. Для исполнения запроса о возврате ценных бумаг из Гарантийных фондов Клиринговый центр направляет Расчетному депозитарию распоряжение в соответствии с пунктом 36.12 Правил клиринга.
- 23.3. Для возврата денежных средств и/или ценных бумаг, учитываемых в качестве взносов Участника клиринга в Гарантийные фонды, в целях прекращения участия в

соответствующем Гарантийном фонде Участник клиринга вправе предоставить Клиринговому центру Заявление об изменении категории Участника клиринга (для прекращения участия в Фонде финансовой стабильности) .

- 23.3.1. При получении от Участника клиринга Заявления об изменении категории Участника клиринга Клиринговый центр присваивает Участнику клиринга категорию «В» и незамедлительно информирует Биржу об изменении категории Участника клиринга.

Клиринговый центр прекращает участие Участника клиринга в Фонде финансовой стабильности, если условия, указанные в подпунктах 18.1.7, 18.1.9 Правил клиринга соблюдаются для всех Торгово-клиринговых счетов Участника клиринга.

- 23.3.2. После прекращения участия Участника клиринга в соответствующем Гарантийном фонде, Клиринговый центр прекращает учет обязательств Участника клиринга по внесению взноса в соответствующий Гарантийный фонд, после чего возврат денежных средств и/или ценных бумаг, учитываемых в качестве взносов Участника клиринга в Гарантийные фонды, осуществляется в порядке, предусмотренном пунктом 23.2 Правил клиринга.

ПОДРАЗДЕЛ V-II. КЛИРИНГОВЫЕ СЕССИИ

Статья 24. Порядок проведения клиринговых сессий

24.1. 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 Задолженности, Отчет «Требование о погашении задолженности»;
- определяет Участников клиринга, у которых возникли Маржинальные требования и суммы указанных Маржинальных требований: Маржинальное требование возникает у Участника клиринга, Единый лимит которого стал отрицательным; сумма Маржинального требования равна абсолютному значению текущего Единого лимита Участника клиринга;
- формирует и передает Участникам клиринга, у которых возникли Маржинальные требования, Отчет о Маржинальном требовании, содержащий информацию о его сумме;
- для каждого Участника клиринга рассчитывает значение Единого лимита по Торгово-клиринговому счету для учета взносов в Гарантийные фонды; Участникам клиринга, Единые лимиты которых отрицательные, направляет требования о приведении взносов Участника клиринга в Гарантийные фонды в соответствие установленным размерам взносов.

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

24.3. Размер обязательства Участника клиринга и Клирингового центра по уплате Гарантийного перевода по Счету обеспечения T+ рассчитывается по обязательствам по Сделкам T+, Дата исполнения которых отстоит от текущей даты более, чем на два 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 T+ с i-ой Датой исполнения, учитываемые по Разделам T+, 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 T+ с i-ой Датой исполнения,

учитываемое по Счету обеспечения T+;

R_{c_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 T+.

- 24.4. 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} .

- 24.5. 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 плановое значение позиции по денежным средствам в российских рублях по тому же Счету обеспечения T+.

- 24.6. Если плановое значение позиции по денежным средствам в российских рублях по Счету обеспечения T+ за вычетом соответствующего Ограничительного лимита меньше, чем сумма обязательства по уплате Гарантийного перевода по Счету обеспечения T+, то указанного обязательства исполняется частично в сумме,

равной плановому значению позиции по денежным средствам за вычетом соответствующего Ограничительного лимита, а неисполненное обязательство (неисполненная часть обязательства) Участника клиринга по уплате Гарантийного перевода по Счету обеспечения T+ учитывается Клиринговым центром как Задолженность по Счету обеспечения T+ Участника клиринга перед Клиринговым центром.

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

Информация о наличии Задолженности, возникшей в связи с неисполнением обязательства по уплате Гарантийного перевода, по Счету обеспечения T+ 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.

24.7. Порядок действий Клирингового центра при непогашении Участником клиринга Задолженности, возникшей в связи с неисполнением обязательства по уплате Гарантийного перевода, в срок, установленный в пункте 24.6 Правил клиринга, определен в статье 32 Правил клиринга.

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

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

24.10. Маржинальное требование должно быть исполнено Участником клиринга путем внесения денежных средств в российских рублях и иностранной валюте и/или ценных бумаг в Обеспечение в порядке, установленном статьей 20 Правил клиринга.

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

- исполнения обязательств по Сделкам T+ с наступившей Датой исполнения;
- заключения Сделок T+, приводящих к увеличению Единого лимита Участника клиринга.

24.11. 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.

24.12. 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, Y1/Yn, приводящие к увеличению Единого лимита данного Участника клиринга по Расчетному коду.

Условия указанных сделок соответствуют условиям, определенным Правилами торгов для сделок с кодом расчетов Y0/Yn, Y1/Yn, а также условиям сделок,

заключенных Клиринговым центром в соответствии с пунктом 32.13 Правил клиринга.

Указанные сделки заключаются до момента исполнения Маржинального требования Участника клиринга по Расчетному коду. Указанные сделки заключаются только при условии, что их заключение приводит к увеличению Единого лимита Участника клиринга по Расчетному коду, по которому имеется неисполненное Маржинальное требование.

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 T+, 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.

ПОДРАЗДЕЛ V-III. ПОРЯДОК ВКЛЮЧЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ В КЛИРИНГОВЫЙ ПУЛ

Статья 25. Общие требования к порядку исполнения обязательств по сделкам и обязательств по внесению компенсационных взносов

25.1. Для исполнения обязательств по сделкам Участники клиринга категории «Б1», «Б2» и «В» обязаны обеспечивать наличие денежных средств на Счетах обеспечения в Клиринговом центре и/или ценных бумаг на Разделах в Расчетном депозитарии, по которым должны исполняться обязательства по сделке.

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

Для исполнения обязательств по заключенным Сделкам Т+ 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 Т+).

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

Для исполнения обязательств по денежным средствам по сделкам, за исключением Сделок Т+, Участник клиринга категории «А» обязан внести денежные средства на Счета обеспечения Т+ до установленного Временным регламентом момента окончания Процедуры контроля обеспечения по сделкам с расчетами в соответствующей валюте.

25.3. Исполнение обязательств по сделкам купли-продажи с кодом расчетов Т0, К0, первым частям сделок РЕПО с кодом расчетов Rb, а также по Сделкам Т+ осуществляется в моменты времени, установленные Временным регламентом.

25.3.1. Порядок включения в клиринговый пул обязательств по Сделкам Т+ определен статьей 31 Правил клиринга.

25.4. Участник клиринга вправе в Дату исполнения обязательств по сделкам купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов Yn, первой или второй части сделок РЕПО с кодом расчетов Y0/Yn, Y1/Yn, второй части сделок РЕПО с кодом расчетов T0/Yn, заключенным на основании адресных заявок, исполнить их досрочно, путем подачи в Клиринговую систему Отчета на исполнение, Специального отчета на исполнение или Срочного отчета на исполнение при выполнении условий, установленных пунктами 26.11, 29.9, 29.10 Правил клиринга соответственно.

25.5. Порядок подачи и регистрации в Клиринговой системе Отчета на исполнение определен в статье 26 Правил клиринга, Специального и Срочного отчета на исполнение - в статье 29 Правил клиринга.

- 25.6. Исполнение обязательств по сделкам купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов В0-В30, первым и вторым частям сделок РЕПО с кодом расчетов S0-S2, вторым частям сделок РЕПО с кодом расчетов Z0 или Rb осуществляется путем подачи Участником клиринга в Клиринговую систему Отчета на исполнение, Специального отчета на исполнение или Срочного отчета на исполнение.
- 25.7. Исполнение обязательства по внесению компенсационного вноса осуществляется путем подачи Участником клиринга в Клиринговую систему Поручения на внесение компенсационного вноса.
- Исполнение обязательств по внесению компенсационного вноса не осуществляется, в случае отказа контрагента от получения компенсационного вноса.
- Порядок подачи и регистрации в Клиринговой системе Поручений на внесение компенсационных взносов и Поручений на отказ от компенсационных взносов определен в статье 27 Правил клиринга.
- Участник клиринга вправе для исполнения обязательств по внесению компенсационного вноса (компенсационных взносов) включить их в Специальный или Срочный отчет на исполнение.
- 25.8. Участник клиринга, имеющий обязательства по внесению компенсационных взносов и/или по сделкам купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов В0-В30, первым и вторым частям сделок РЕПО с кодом расчетов S0-S2, вторым частям сделок РЕПО с кодом расчетов Z0 или Rb, Дата исполнения обязательств по которым наступила и которые были включены им в Специальный или Срочный отчет на исполнение, но не были обеспечены средствами под исполнение до момента окончания периода получения Клиринговым центром от Участников клиринга Специальных и Срочных отчетов на исполнение, обязан до момента окончания периода регистрации поручений зарегистрировать в Клиринговой системе Отчет на исполнение по каждой такой сделке (первой или второй части такой сделки РЕПО), и/или Поручение на внесение каждого такого компенсационного вноса.
- 25.9. По сделкам, не обеспеченным средствами под исполнение, Участник клиринга вправе до момента окончания периода регистрации поручений заменить Торгово-клиринговый счет в сделках.
- 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.
- 25.10. После замены Торгово-клирингового счета в сделке обязательства по сделке и обязательства по уплате компенсационных взносов по такой сделке исполняются по Счетам обеспечения и Разделам, входящим в состав нового Торгово-клирингового счета.
- 25.11. Участник клиринга вправе по согласованию с контрагентом отказаться от исполнения обязательств по сделке РЕПО с кодом расчетов S0-S2 до момента исполнения первой части такой сделки РЕПО.

Порядок подачи и исполнения Поручений на отказ от исполнения сделки РЕПО определен в статье 28 Правил клиринга.

- 25.12. В случаях если между датой заключения Сделки T+ и Датой исполнения обязательств по Сделке T+ в отношении ценных бумаг, с которыми заключена Сделка T+, происходят корпоративные действия, такие как реорганизация эмитента ценных бумаг, конвертация ценных бумаг, проводимая без реорганизации эмитента ценных бумаг, или иные действия, влияющие на исполнение обязательств по Сделкам T+, в том числе, которые приводят к изменению предмета Сделки T+, Клиринговый центр вправе принять в отношении таких Сделок T+ одно из следующих решений:
- 25.12.1. об изменении в одностороннем порядке предмета (объекта) Сделок T+, обязательства по которым не исполнены, и/или порядка исполнения обязательств по Сделкам T+, с учетом условий реорганизации эмитента ценных бумаг или условий иного действия, установленных эмитентом ценных бумаг;
- 25.12.2. о том, что Дата исполнения обязательств по Сделкам T+ считается наступившей в Расчетный день, предшествующий дню приостановления операций с ценными бумагами по счетам депо, проводимого в связи с корпоративным действием, в случае если информация о таком приостановлении получена Клиринговым центром от Расчетного депозитария до 18:00 дня указанного Расчетного дня.
- 25.13. Включение в Клиринговый пул по Сделкам T+ обязательств по Сделкам T+, в отношении которых Клиринговым центром принято решение в соответствии с подпунктом 25.12.2 Правил клиринга, осуществляется в соответствии со статьей 31 Правил клиринга, при этом при наличии Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам и/или ценным бумагам, не обеспеченного средствами под исполнение, Клиринговый центр предпринимает действия, предусмотренные подпунктом 32.6.1 Правил клиринга.
- 25.14. Информация о решении, принятом Клиринговым центром в соответствии с пунктом 25.12 Правил клиринга, раскрывается на Сайте Клирингового центра, а также направляется Участникам клиринга с использованием Подсистемы ЭДО НКЦ.

Статья 26. Порядок подачи и регистрации Отчетов на исполнение

- 26.1. Отчет на исполнение может быть подан по сделке купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов B0-B30, первой части сделки РЕПО с кодом расчетов S0-S2, второй части сделки РЕПО с кодом расчетов S0-S2, Z0 и Rb, а также по сделке купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов Yn, первой или второй части сделки РЕПО с кодом расчетов Y0/Yn, Y1/Yn, второй части сделки РЕПО с кодом расчетов T0/Yn, заключенным на основании адресных заявок.
- 26.2. Отчет на исполнение может быть подан Участником клиринга в Клиринговую систему в ходе периода регистрации поручений в следующие даты:
- по биржевой сделке с кодом расчетов B0 - с даты заключения до Даты прекращения исполнения;
 - по внебиржевой сделке с кодом расчетов B0 - с даты регистрации данных о сделке в Клиринговой системе до Даты прекращения исполнения;
 - по биржевой сделке с кодом расчетов B01-B30 - с Расчетного дня, следующего за датой ее заключения, до Даты прекращения исполнения;

- по внебиржевой сделке с кодом расчетов В01-В30 - с Расчетного дня, следующего за датой регистрации данных о сделке в Клиринговой системе до Даты прекращения исполнения;
 - по первой части сделки РЕПО с кодом расчетов S0-S2 с Даты исполнения первой части сделки РЕПО до Даты прекращения ее исполнения;
 - по второй части сделки РЕПО с кодом расчетов S0-S2, Z0 и Rb с Даты исполнения первой части сделки РЕПО до Даты прекращения исполнения второй части сделки РЕПО;
 - по сделке купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов Yn, первой или второй части сделки РЕПО с кодом расчетов Y0/Yn, Y1/Yn, второй части сделки РЕПО с кодом расчетов T0/Yn, заключенным на основании адресных заявок, - в Дату исполнения.
- 26.3. Отчет на исполнение по второй части сделки РЕПО с кодом расчетов S0-S2, Z0 и Rb может быть подан Участником клиринга в Клиринговую систему при условии того, что первая часть сделки РЕПО является обеспеченной средствами под исполнение.
- Отчет на исполнение по второй части сделки РЕПО с кодом расчетов Y0/Yn, Y1/Yn, T0/Yn, заключенной на основании адресных заявок, может быть подан Участником клиринга в Клиринговую систему при условии исполнения первой части сделки РЕПО.
- 26.4. Отчет на исполнение, поданный Участником клиринга - покупателем, регистрируется в Клиринговой системе только при условии превышения (равенства) планового значения позиции по денежным средствам по Счету обеспечения, по которому должны исполняться обязательства по сделке, в момент подачи Отчета на исполнение, за вычетом соответствующего Ограничительного лимита, величины(е) обязательства данного Участника клиринга по денежным средствам, возникшего по данной сделке (первой или второй части сделки РЕПО) (с учетом НКД).
- 26.5. Отчет на исполнение, поданный Участником клиринга - продавцом, регистрируется в Клиринговой системе только при условии превышения (равенства) планового значения позиции депо по Разделу, по которому должны исполняться обязательства по сделке, 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).
- 26.6. Дополнительным условием регистрации в Клиринговой системе Отчета на исполнение по сделке купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов В0-В30, первой и второй части сделки РЕПО с кодом расчетов S0-S2, второй части сделки РЕПО с кодом расчетов Z0 и Rb, обязательства по которой должны исполняться по Разделу T+ и/или Счету обеспечения T+, а также Отчета на исполнение по сделке купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов Yn, первой или второй части сделки РЕПО с кодом расчетов Y0/Yn, Y1/Yn, второй части сделки РЕПО с кодом расчетов T0/Yn является проверка, что значение Единого лимита Участника клиринга по Расчетному коду, соответствующему такому Разделу T+ и/или Счету обеспечения T+, , с учетом обязательств по сделке не стало отрицательным, или, если Единый лимит Участника клиринга по такому Расчетному коду был отрицательным до момента проверки, - проверку того, что Единый лимит Участника клиринга по такому Расчетному коду, рассчитанный с учетом

- обязательств по сделке, не стал меньше, чем Единый лимит Участника клиринга по этому Расчетному коду, рассчитанный до момента проверки.
- 26.7. Проверки, указанные в пунктах 26.4-26.6 Правил клиринга, осуществляются с учетом положений подпункта 18.1.12 Правил клиринга.
- 26.8. Отсутствие в Клиринговой системе зарегистрированного Отчета на исполнение по не обеспеченной средствами под исполнение сделке купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов B0-B30, первой части сделки РЕПО 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 признается нарушением со стороны Участника клиринга требований Правил клиринга, повлекшим неисполнение обязательств по данной сделке (первой или второй части сделки РЕПО) в Дату исполнения.
- 26.9. Участнику клиринга в Клиринговой системе раскрывается информация о регистрации Отчета на исполнение по сделке купли-продажи ценных бумаг, первой или второй части сделки РЕПО, поданного в Клиринговую систему его контрагентом / конечным контрагентом.
- 26.10. Участники клиринга вправе до окончания периода регистрации поручений отзываться зарегистрированные Отчеты на исполнение и подавать новые Отчеты на исполнение при условии, что сделки (первые или вторые части сделки РЕПО), по которым подан Отчет на исполнение не являются обеспеченными средствами под исполнение в соответствии с пунктом 26.11 настоящей статьи.
- 26.11. При условии регистрации в Клиринговой системе Отчетов на исполнение по сделке купли-продажи ценных бумаг (первой или второй части сделки РЕПО), поданных обоими Участниками клиринга - сторонами по данной сделке / конечными контрагентами по парным сделкам, данная сделка / сделки (первая или вторая часть сделки РЕПО) считается обеспеченной / обеспеченными средствами под исполнение, и обязательства по данной сделке / сделкам (первой или второй части сделки РЕПО) включаются в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов / в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов по сделкам с центральным контрагентом с ближайшим временем исполнения.
- 26.12. В случае если вторая часть биржевой сделки РЕПО становится обеспеченной средствами под исполнение до Даты исполнения Клиринговый центр формирует и передает Бирже Отчет о досрочном исполнении сделок РЕПО.
- 26.13. Отчет на исполнение по Сделке T+, не обеспеченной средствами под исполнение на установленное Временным регламентом время исполнения обязательств по Сделкам T+, исключается из Клиринговой системы и не подлежит исполнению. Исполнение (прекращение) обязательств по такой Сделке T+ осуществляется в сроки, установленные Временным регламентом, путем включения их в Клиринговый пул по Сделкам T+ в порядке, определенном статьей 31 Правил клиринга.
- Отчет на исполнение, не обеспеченный средствами под исполнение до окончания периода регистрации поручений, после его окончания исключается из Клиринговой системы и не подлежит исполнению.

Статья 27. Порядок подачи и регистрации поручений на внесение компенсационных взносов и поручений на отказ от компенсационных взносов

- 27.1. Для исполнения обязательств по внесению компенсационного взноса Участник клиринга, имеющий такое обязательство, в Дату внесения компенсационного взноса формирует и подает в Клиринговую систему Поручение на внесение компенсационного взноса.
- 27.2. Поручение на внесение компенсационных взносов может быть подано в Клиринговую систему в ходе периода регистрации поручений в Дату внесения компенсационных взносов.
- 27.2.1. Поручение на внесение компенсационного взноса в виде денежных средств, поданное Участником клиринга, регистрируется в Клиринговой системе только при условии превышения (равенства) планового значения позиции по денежным средствам по Счету обеспечения, по которому должны исполняться обязательства по сделке, в момент подачи Поручения, за вычетом соответствующего Ограничительного лимита, 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 позиции депо по Разделу, по которому должны исполняться обязательства по сделке, в момент подачи Поручения величины(е) обязательства данного Участника клиринга по внесению компенсационного взноса.

Дополнительным условием регистрации в Клиринговой системе Поручения на внесение компенсационного взноса по сделке, обязательства по которой должны исполняться по Разделу Т+ и/или Счету обеспечения Т+, является проверка, что значение Единого лимита Участника клиринга по Расчетному коду, соответствующему такому Разделу Т+ и/или Счету обеспечения Т+, с учетом обязательства по внесению данного компенсационного взноса не стало отрицательным, или, если Единый лимит Участника клиринга по такому Расчетному коду был отрицательным до момента проверки, - проверку того, что Единый лимит Участника клиринга по такому Расчетному коду, рассчитанный с учетом обязательства по внесению данного компенсационного взноса, не стал меньше, чем Единый лимит Участника клиринга по этому Расчетному коду, рассчитанный до момента проверки.

Проверки, указанные в настоящем пункте Правил клиринга, осуществляются с учетом положений подпункта 18.1.12 Правил клиринга.

- 27.3. При условии регистрации в Клиринговой системе Поручения на внесение компенсационного взноса, поданного Участником клиринга, компенсационный взнос считается обеспеченным средствами под исполнение, и обязательства по внесению данного компенсационного взноса включаются в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов с ближайшим временем исполнения.
- 27.4. Участнику клиринга в Клиринговой системе раскрывается информация о регистрации Поручения на внесение компенсационного взноса, поданного в Клиринговую систему его контрагентом по соответствующей сделке.
- 27.5. 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 не является обеспеченным средствами под исполнение в соответствии с пунктом 27.3 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.

- 27.6. Участнику клиринга в Клиринговой системе раскрывается информация о регистрации Поручения на отказ от компенсационного взноса, поданного в Клиринговую систему его контрагентом.
- 27.7. Отзыв Участником клиринга ранее зарегистрированного в Клиринговой системе Поручения на отказ от компенсационного взноса возможен только до момента регистрации в Клиринговой системе Поручения на отказ от компенсационного взноса, поданного его контрагентом.

Статья 28. Порядок подачи и исполнения Поручений на отказ от исполнения сделки РЕПО

- 28.1. Поручение на отказ от исполнения сделки РЕПО с кодом расчетов S0-S2 может быть подано в Клиринговую систему Участником клиринга, являющемся стороной по сделке, в ходе Периода регистрации с даты заключения сделки РЕПО до Даты исполнения первой части сделки РЕПО.
- 28.2. Поручение на отказ от исполнения сделки РЕПО не может быть подано Участником клиринга, если обязательства по первой части сделки РЕПО исполнены, или первая часть сделки РЕПО является обеспеченной средствами под исполнение в соответствии с Правилами клиринга.
- 28.3. Если по первой части сделки РЕПО подан Отчет на исполнение (информация о первой части сделки РЕПО включена в Специальный или Срочный отчет на исполнение), но первая часть сделки РЕПО не является обеспеченной средствами под исполнение, то для подачи Поручения на отказ от исполнения сделки РЕПО необходимо сначала отозвать Отчет на исполнение (исключить информация о первой части сделки РЕПО из Специального или Срочного отчета на исполнение).
- 28.4. Поручение на отказ от исполнения сделки РЕПО содержит номер первой части сделки РЕПО, от исполнения которой Участник клиринга желает отказаться, а также величину отступного за отказ от исполнения сделки РЕПО.
- 28.4.1. Величина отступного может быть указана в процентах от суммы РЕПО или как сумма отступного в той валюте, в которой проводятся расчеты по сделке РЕПО.
- 28.4.2. В качестве величины отступного может быть указано отрицательное значение. Положительная величина отступного означает, что Участник клиринга, подавший Поручение на отказ от исполнения сделки РЕПО, обязан получить сумму отступного от контрагента по сделке, отрицательная – уплатить.

- 28.5. Поручение на отказ от исполнения сделки РЕПО, поданное Участником клиринга, обязанным уплатить отступное, регистрируется в Клиринговой системе только при условии превышения (равенства) планового значения позиции по денежным средствам по Счету обеспечения, по которому должны исполняться обязательства по сделке, в момент подачи Поручения, за вычетом соответствующего Ограничительного лимита, величины(е) обязательства данного Участника клиринга по уплате отступного.
- 28.5.1. Дополнительным условием регистрации в Клиринговой системе Поручения на отказ от исполнения сделки РЕПО, обязательства по которой должны исполняться по Разделу T+ и/или Счету обеспечения T+, поданного Участником клиринга, обязанным уплатить отступное, является проверка, что значение Единого лимита Участника клиринга по Расчетному коду, соответствующему такому Разделу T+ и/или Счету обеспечения T+, с учетом обязательства по уплате отступного не стало отрицательным, или, если Единый лимит Участника клиринга по такому Расчетному коду был отрицательным до момента проверки, - проверку того, что Единый лимит Участника клиринга по такому Расчетному коду, рассчитанный с учетом обязательства по уплате отступного, не стал меньше, чем Единый лимит Участника клиринга по этому Расчетному коду, рассчитанный до момента проверки.
- 28.5.2. Проверки, указанные в настоящем пункте Правил клиринга, осуществляются с учетом положений подпункта 18.1.12 Правил клиринга.
- 28.6. Участнику клиринга в Клиринговой системе раскрывается информация о регистрации Поручения на отказ от исполнения сделки РЕПО, поданного в Клиринговую систему его контрагентом по соответствующей сделке.
- 28.7. При условии регистрации в Клиринговой системе Поручений на отказ от исполнения сделки РЕПО, поданных обоими Участниками клиринга – сторонами по сделке:
- обязательство по уплате отступного считается обеспеченными средствами под исполнение, и включается в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов;
 - обязательства по сделке РЕПО считаются прекращенными выплатой отступного.

Статья 29. Порядок подачи и регистрации Специальных и Срочных отчетов на исполнение

- 29.1. Участник клиринга вправе включить в Специальный или Срочный отчет на исполнение:
- сделки купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов B0-B30;
 - первые части сделок РЕПО с кодом расчетов S0-S2;
 - вторые части сделок РЕПО с кодом расчетов S0-S2, Z0 и Rb;
 - сделки купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов Yn, заключенные на основании адресных заявок;
 - первые и вторые части сделок РЕПО с кодом расчетов Y0/Yn, Y1/Yn, заключенных на основании адресных заявок;
 - вторые части сделок РЕПО с кодом расчетов T0/Yn, заключенных на основании адресных заявок;

- обязательства по внесению компенсационных взносов по биржевым и внебиржевым сделкам РЕПО.
- 29.2. Специальный или Срочный отчет на исполнение может быть подан в Клиринговую систему в ходе периода регистрации поручений до установленного Временным регламентом момента окончания периода получения Клиринговым центром от Участников клиринга Специальных и Срочных отчетов на исполнение.
- 29.3. В Специальный или Срочный отчет на исполнение могут быть включены сделки и/или обязательства, возникшие из сделок, заключенных с одним контрагентом / парных сделок, заключенных с одним конечным контрагентом.
- 29.4. По всем сделкам и/или обязательствам, указанным в пункте 29.1 Правил клиринга и включенным в Специальный или Срочный отчет на исполнение, Клиринговый центр для каждой позиции по Счету обеспечения и/или Разделу, по которым должны исполняться обязательства по сделкам, включенным в Специальный или Срочный отчет на исполнение, рассчитывает нетто-обязательство (нетто-требование) Участника клиринга по денежным средствам или ценным бумагам.
- 29.4.1. 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 включенным в Специальный или Срочный отчет на исполнение сделкам и/или обязательствам.

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

Нетто-обязательство (нетто-требование) Участника клиринга по денежным средствам, рассчитанное в соответствии с настоящим подпунктом Правил клиринга по обязательствам, включенным в Срочный отчет на исполнение, является Нетто-обязательством (нетто-требованием) по денежным средствам по сделкам клирингового пула (для Клирингового пула для расчетов в ходе торгов).

- 29.4.2. 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 включенным в Специальный или Срочный отчет на исполнение сделкам и/или обязательствам.

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

Нетто-обязательство (нетто-требование) Участника клиринга по ценным бумагам, рассчитанное в соответствии с настоящим подпунктом Правил клиринга по

обязательствам, включенным в Срочный отчет на исполнение, является Нетто-обязательством (нетто-требованием) по ценным бумагам по сделкам клирингового пула (для Клирингового пула для расчетов в ходе торгов).

- 29.5. Специальный или Срочный отчет на исполнение Участника клиринга, имеющего нетто-обязательство по денежным средствам, регистрируется в Клиринговой системе только при условии превышения (равенства) планового значения позиции по денежным средствам по Счету обеспечения, по которому должны исполняться обязательства по сделке, в момент подачи Специального или Срочного отчета на исполнение, за вычетом соответствующего Ограничительного лимита, величины(е) нетто-обязательства данного Участника клиринга по денежным средствам.

Специальный отчет на исполнение Участника клиринга, имеющего нетто-обязательство по ценным бумагам, регистрируется в Клиринговой системе только при условии превышения (равенства) планового значения позиции депо по Разделу, по которому должны исполняться обязательства по сделке, в момент подачи Специального или Срочного отчета на исполнение величины(е) нетто-обязательства данного Участника клиринга по ценным бумагам.

Срочный отчет на исполнение Участника клиринга, имеющего нетто-обязательство по ценным бумагам, регистрируется в Клиринговой системе только при условии непревышения в момент подачи Срочного отчета на исполнение данного нетто-обязательства по ценным бумагам меньшей из двух величин: планового или начального значения позиции по ценным бумагам по Разделу, по которому должны исполняться обязательства по сделке.

- 29.5.1. Дополнительным условием регистрации в Клиринговой системе Специального или Срочного отчета на исполнение, в который включены сделки, обязательства по которым должны исполняться по Разделам Т+ и/или Счетам обеспечения Т+, является проверка, что значение Единого лимита Участника клиринга по всем Расчетным кодам, соответствующим такому Разделу Т+ и/или Счету обеспечения Т+, с учетом величин соответствующих нетто-обязательств данного Участника клиринга не стало отрицательным, или, если Единый лимит Участника клиринга по хотя бы одному Расчетному коду был отрицательным до момента проверки, - проверку того, что Единый лимит Участника клиринга по такому Расчетному коду, рассчитанный с учетом величины соответствующего нетто-обязательства, не стал меньше, чем Единый лимит Участника клиринга по этому Расчетному коду, рассчитанный до момента проверки.

Проверки, указанные в настоящем пункте Правил клиринга, осуществляются с учетом положений подпункта 18.1.12 Правил клиринга.

- 29.6. Участнику клиринга в Клиринговой системе раскрывается информация о регистрации Специального или Срочного отчета на исполнение, поданного в Клиринговую систему его контрагентом / конечным контрагентом.
- 29.7. Участники клиринга вправе до окончания периода регистрации поручений отзывать зарегистрированные Специальные или Срочные отчеты на исполнение и подавать новые Специальные или Срочные отчеты на исполнение при условии, что сделки и/или обязательства, включенные в Специальный или Срочный отчет на исполнение, еще не являются обеспеченными средствами под исполнение в соответствии с подпунктом 29.9 / 29.10 Правил клиринга.
- 29.8. Специальные и Срочные отчеты на исполнение, содержащие Сделки Т+ и не обеспеченные средствами под исполнение на установленное Временным

регламентом время исполнения обязательств по Сделкам T+, исключаются из Клиринговой системы и не подлежат исполнению. Исполнение (прекращение) обязательств по Сделкам T+, ранее включенным в такие отчеты, осуществляется в сроки, установленные Временным регламентом, путем включения их в Клиринговый пул по Сделкам T+ в порядке, определенном статьей 31 Правил клиринга.

Специальные и Срочные отчеты на исполнение, не обеспеченные средствами под исполнение до окончания периода регистрации поручений, после его окончания исключаются из Клиринговой системы и не подлежат исполнению.

- 29.9. При условии регистрации в Клиринговой системе Специальных отчетов на исполнение, поданных обоими Участниками клиринга - контрагентами / конечными контрагентами и содержащих одинаковый набор сделок / парных сделок и/или обязательств, указанные сделки и/или обязательства считаются обеспеченными средствами под исполнение, а обязательства (требования) Участников клиринга по денежным средствам или ценным бумагам по сделкам и/или обязательствам, включенным в такие Специальные отчеты на исполнение, включаются в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов / Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов по сделкам с центральным контрагентом с ближайшим временем исполнения.
- 29.10. При условии регистрации в Клиринговой системе Срочных отчетов на исполнение, поданных обоими Участниками клиринга - контрагентами / конечными контрагентами и содержащих одинаковый набор сделок / парных сделок и/или обязательств, указанные сделки и/или обязательства считаются обеспеченными средствами под исполнение, а нетто-обязательства (нетто-требования) Участников клиринга по денежным средствам или ценным бумагам, рассчитанные по сделкам и/или обязательствам, включенным в такие Срочные отчеты на исполнение, включаются в Клиринговый пул для расчетов в ходе торгов / Клиринговый пул для расчетов в ходе торгов по сделкам с центральным контрагентом.

Статья 30. Порядок включения в клиринговый пул обязательств Участников клиринга по уплате Возмещения

- 30.1. 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.
- 30.2. 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.
- 30.3. Обязательство Участника клиринга по уплате Возмещения подлежит исполнению начиная с Расчетного дня, следующего за Датой прекращения исполнения соответствующей биржевой сделки. При этом в Расчетный день, следующий за

Датой прекращения исполнения биржевой сделки с ценными бумагами, величина обязательства по уплате Возмещения по этой сделке включается в Клиринговой системе в Ограничительный лимит по счету, определенному в соответствии с пунктом 10.7 Правил клиринга.

В случае неисполнения обязательств по уплате Возмещения, значение Ограничительного лимита устанавливается в Клиринговой системе в размере совокупных неисполненных обязательств Участника клиринга по уплате Возмещения ежедневно до тех пор, пока обязательства по уплате Возмещения учитываются в Клиринговой системе.

- 30.4. 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.
- 30.5. Обязательства Участника клиринга по уплате Возмещения исполняются после исполнения всех обязательств Участника клиринга по уплате Комиссионного вознаграждения, определенных в соответствии со статьей 39 Правил клиринга.
- 30.5.1. Возмещение по биржевым сделкам с ценными бумагами удерживается с Участников клиринга в порядке возрастания номеров сделок.
- 30.5.2. Возмещение по биржевой сделке с ценными бумагами может быть удержано только в полном объеме, частичное удержание Возмещения по биржевой сделке не допускается.
- 30.6. Обязательства по уплате Возмещения считается обеспеченным средствами под исполнение при условиях:
- 1) превышения (равенства) планового значения позиции по денежным средствам по Счету обеспечения, по которому должны исполняться обязательства по уплате Возмещения, в момент формирования Клирингового пула для расчетов по итогам торгов после включения в него всех иных обязательств, за вычетом соответствующего Ограничительного лимита, величины(е) данного обязательства Участника клиринга по уплате Возмещения (за исключением Ограничительного лимита в размере обязательств по уплате Возмещений);
 - 2) значение Единого лимита Участника клиринга по Расчетному коду, соответствующему Счету обеспечения Т+, по которому должны исполняться обязательства по уплате Возмещения, с учетом данного обязательства по уплате Возмещения не стало отрицательным, или, если Единый лимит Участника клиринга по такому Расчетному коду был отрицательным до момента проверки, - проверку того, что Единый лимит Участника клиринга по такому Расчетному коду, рассчитанный с учетом данного обязательства по уплате Возмещения, не стал меньше, чем Единый лимит Участника клиринга по этому Расчетному коду, рассчитанный до момента проверки.
- 30.7. Обязательства по уплате Возмещения, обеспеченные средствами под исполнение, включаются в последний в течение Расчетного дня Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов и исполняются в порядке, определенном статьей 34 Правил клиринга.

30.8. Неисполненные обязательства по уплате Возмещения по сделкам РЕПО учитываются в Клиринговой системе только в Расчетный день, следующий за Датой прекращения исполнения сделки, по иным сделкам - в течение 3 (трех) месяцев с Расчетного дня, следующего за Датой прекращения исполнения сделки, по которой возникли указанные обязательства по уплате Возмещения.

По истечении указанного срока обязательства по уплате Возмещения не подлежат исполнению в Клиринговой системе.

30.8.1. Прекращение учета обязательств по уплате Возмещения в Клиринговой системе не влечет прекращение указанных обязательств. Требования о надлежащем исполнении указанных обязательств могут быть предъявлены любой из сторон в соответствии с гражданским законодательством при условии соблюдения порядка разрешения споров, предусмотренного Правилами клиринга и Правилами торгов.

Клиринговый центр уведомляет Биржу о неисполнении обязательств по уплате Возмещения в Дату прекращения обязательств по сделке, а также о прекращении учета обязательств по уплате Возмещения в Клиринговой системе.

Статья 31. Порядок включения в клиринговый пул обязательств по Сделкам T+ и обязательств по возврату Гарантийных переводов

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

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

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 T+ с наступившей Датой исполнения, учитываемые по Разделам T+, относящимся к тому же Расчетному коду, что и Счет обеспечения T+, по которому рассчитывается обязательство по возврату Гарантийных переводов, рассчитанные без учета Сделок T+, 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 T+ с наступившей Датой исполнения, учитываемое по Счету обеспечения T+, рассчитанное без учета Сделок T+, обязательства по уплате Гарантийных переводов по которым в соответствии с Правилами клиринга не возникают;

R_{cj} – Расчетная цена j-ой ценной бумаги, рассчитанная в день T-4, где T – 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 T+ в размере, равном значению RET_RUB.

- 31.2. Во время, установленное Временным регламентом как время исполнения Участниками клиринга Итоговых нетто-обязательств перед Клиринговым центром, Клиринговый центр:
- 31.2.1. включает в Клиринговый пул по Сделкам T+:
- обязательства и требования Участника клиринга и Клирингового центра по денежным средствам и ценным бумагам по Сделкам T+ с наступившей Датой исполнения, не обеспеченных средствами под исполнения на момент формирования Клирингового пула;
 - обязательства / требования Участника клиринга по возврату Гарантийных переводов, определенные в соответствии с пунктом 31.1 Правил клиринга (только для первого в течение Расчетного дня Клирингового пула по Сделкам T+);
 - обязательства / требования Участника клиринга и Клирингового центра по Сделкам РЕПО Клирингового центра и/или Договорам займа Клирингового центра, заключенным в соответствии с пунктом 32.10 Правил клиринга;
 - обязательства по передаче / требования по получению Дохода, определенные в соответствии со статьей 38 Правил клиринга (только для первого в течение Расчетного дня Клирингового пула по Сделкам T+);
 - обязательства по уплате Комиссионных вознаграждений, определенные в соответствии со статьей 39 Правил клиринга, которые должны исполняться по Счетам обеспечения T+ (только для последнего в течение Расчетного дня Клирингового пула по Сделкам T+).
- 31.2.2. зачитывает встречные однородные обязательства и требования Участника клиринга и Клирингового центра по денежным средствам и ценным бумагам, включенные в Клиринговый пул по Сделкам T+, учитываемые по определенному Счету обеспечения T+ / Разделу T+, 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 T+ / Разделу T+;
- 31.2.3. формирует и передает Участникам клиринга отчеты, содержащие информацию об Итоговых нетто-обязательствах / Итоговых нетто-требованиях по денежным средствам / ценным бумагам;
- 31.2.4. устанавливает Ограничительный лимит по Счету обеспечения T+ / Разделу T+ в размере Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам, учитываемого по Счету обеспечения T+ / Разделу T+.
- 31.3. 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.
- 31.4. 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 20 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.

Итоговое нетто-обязательство Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам, учитываемое по Счету обеспечения T+ / Разделу T+, является обеспеченным средствами под исполнение, если плановое значение позиции по денежным средствам / ценным бумагам по Счету обеспечения T+ / Разделу T+ больше или равно величине указанного обязательства, учитываемого по тому же Счету обеспечения T+ / Разделу T+, и не обеспеченным – если меньше.

- 31.4.1. Если Итоговое нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам, учитываемое по Счету обеспечения T+ / Разделу T+, не является обеспеченным средствами под исполнение, и у Участника клиринга зарегистрирован Счет обеспечения T0 / Раздел T0, соответствующий / связанный с указанным Счетом обеспечения T+ / Разделом T+, Клиринговый центр вправе сформировать в Клиринговой системе распоряжение на внесение денежных средств / ценных бумаг в Обеспечение в сумме / количестве, недостающем для исполнения Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам, либо в размере Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам, в случае предоставления Участником клиринга Заявления о порядке использования денежных средств и ценных бумаг, предусмотренного пунктом 21.3 Правил клиринга и содержащего соответствующее указание.

Указанное в настоящем подпункте Правил клиринга распоряжение Клирингового центра по денежным средствам / ценным бумагам исполняется при выполнении условий, указанных в подпункте 20.6.1 или подпункте 20.6.2 Правил клиринга соответственно.

Указанное в настоящем подпункте Правил клиринга распоряжение Клирингового центра не формируется, в случае предоставления Участником клиринга Заявления о порядке использования денежных средств и ценных бумаг, предусмотренного пунктом 21.3 Правил клиринга и содержащего указание 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 T+.

- 31.4.2. Если в результате действий, определенных в подпункте 31.4.1 Правил клиринга, Итоговое нетто-обязательство Участника клиринга по денежным средствам и/или ценным бумагам остается не обеспеченным средствами под исполнение, данный Участник клиринга признается Недобросовестным участником клиринга, и Клиринговый центр выполняет действия, предусмотренные статьей 32 Правил клиринга.
- 31.5. Итоговые нетто-обязательства / Итоговые нетто-требования Участников клиринга по денежным средствам / ценным бумагам, в том числе определенные по итогам выполнения действий, предусмотренных статьей 32 Правил клиринга, Клиринговый центр включает в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов с таким же временем исполнения, как и время исполнения указанных обязательств, и исполняет их в порядке, определенном статьей 34 Правил клиринга.
- 31.5.1. В случае если Участником клиринга предоставлено Заявление о порядке использования денежных средств и ценных бумаг, в соответствии с которым Участник клиринга дает указание Клиринговому центру перечислять денежные средства / ценные бумаги со Счетов обеспечения T+ / Разделов T+ на Счета обеспечения T0 / Разделы T0 после прекращения обязательств по Сделкам T+, то после прекращения указанных обязательств Клиринговый центр осуществляет возврат денежных средств и/или ценных бумаг в соответствии с Заявлением о порядке использования денежных средств и ценных бумаг.

Порядок предоставления и исполнения Заявления о порядке использования денежных средств и ценных бумаг определен в статье 20 Правил клиринга.

ПОДРАЗДЕЛ V-IV. ПОРЯДОК ДЕЙСТВИЙ В СЛУЧАЯХ НЕИСПОЛНЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ

Статья 32. Порядок действий в случаях неисполнения обязательств по Сделкам Т+

32.1. В случае непогашения Участником клиринга до времени, установленного Временным регламентом, Задолженности, учитываемой по Расчетному коду, Участник клиринга обязан уплатить Клиринговому центру пеню, рассчитываемую по формуле:

$$\text{Fine} = D \times S \times n / 365, \text{ где}$$

Fine – сумма пени, в российских рублях,

D – сумма Задолженности, в российских рублях,

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

n - количество календарных дней между датой расчета суммы пени и следующим Расчетным днем,

Сумма пени, рассчитанная в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга, не облагается НДС.

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

32.2. Клиринговый центр зачитывает обязательство Участника клиринга по уплате пени, учитываемое по Расчетному коду, сумма которого рассчитана в соответствии с пунктом 32.1 Правил клиринга, с требованием Участника клиринга по возврату Обеспечения в российских рублях, учитываемого по Счету обеспечения Т+, соответствующему Расчетному коду, за исключением случаев отзыва (аннулирования) лицензии Банка России на осуществление банковских операций со средствами в рублях и иностранной валюте в связи с банкротством Участника клиринга, созданного в соответствии с законодательством Российской Федерации.

32.3. В случаях:

32.3.1. если Итоговые нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам и/или ценным бумагам не обеспечены средствами под исполнение (полностью или частично);

32.3.2. непогашения Участником клиринга до времени, установленного Временным регламентом, Задолженности и наличия Обеспечения Участника клиринга в ценных бумагах;

в ходе формирования Клирингового пула по Сделкам Т+, проводимого в соответствии со статьей 31 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).

32.4. Сделки РЕПО (сделки купли-продажи ценных бумаг), указанные в пункте 32.3 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 Участника клиринга – Банка-нерезидента не отозвано (не аннулировано) специальное разрешение (лицензия или иное основание) компетентного органа государства учреждения Банка-нерезидента, в соответствии с которым Банк-нерезидент имеет право осуществлять банковские операции;
- в) 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;
- г) количество Расчетных дней, в течение которых у Участника клиринга возникает Итоговое нетто-обязательство по денежным средствам по одному Счету обеспечения T+ или Итоговое нетто-обязательство по соответствующим ценным бумагам по Разделам T+, относящимся к одному Расчетному коду, не обеспеченное средствами под исполнение, не превышает 45 (сорока пяти) календарных дней подряд;
- д) отсутствует решение об исключении ценной бумаги, по которой учитывается Итоговое нетто-обязательство не обеспеченное средствами под исполнение, из Клирингового листа со следующего Расчетного дня.

32.4.1. Сделки купли-продажи, указанные в пункте 32.3 Правил клиринга, заключаются по Торгово-клиринговым счетам, предназначенным для учета ценных бумаг и денежных средств, находящихся в доверительном управлении Участника клиринга, а также 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.

32.5. Условия сделок РЕПО (двух сделок купли-продажи), заключаемых между Клиринговым центром и Недобросовестным участником клиринга в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга, соответствуют условиям определенным Правилами торгов Сделок T+, заключенных в Секторе рынка Основной рынок, с учетом следующих особенностей:

- в случае наличия у Участника клиринга не обеспеченного полностью или частично средствами под исполнение 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 Итоговому нетто-обязательству Участника клиринга по ценным бумагам в объеме, равном величине не обеспеченного средствами под исполнение Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по ценным бумагам (части указанного обязательства);
- в случае наличия у Участника клиринга не обеспеченного полностью или частично средствами под исполнение 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 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 не обеспеченному полностью или частично средствами под исполнение Итоговому нетто-обязательству

Участника клиринга по денежным средствам, и размера планового значения позиции Участника клиринга по соответствующим ценным бумагам по Разделу Т+;

- в случае наличия у Участника клиринга Задолженности, по первой части сделки РЕПО (по первой сделке купли-продажи) у Участника клиринга возникают требования в российских рублях, противоположные Задолженности, и обязательства по ценным бумагам в объеме, не превышающем размера планового значения позиции Участника клиринга по ценным бумагам по Разделу Т+, соответствующем сумме Задолженности;
- 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 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;
- Стоимость обратного выкупа (сумма второй сделки купли-продажи) определяется по формуле:

$$S_2 = S_1 * \left(1 + \frac{R}{100} \times \left(\frac{T_{365}}{365} + \frac{T_{366}}{366} \right) \right), \text{ где}$$

S_2 - Стоимость обратного выкупа (сумма второй сделки купли-продажи);

S_1 - Сумма РЕПО (сумма первой сделки купли-продажи);

R - ставка, равная Верхней или Нижней Штрафной ставке РЕПО, установленной Клиринговым центром в соответствии с Методикой определения риск-параметров рынка ценных бумаг;

T_{365} - число дней между исполнением первой и второй частей сделки РЕПО (первой и второй сделкой купли-продажи), приходящихся на календарный год, состоящий из 365 дней;

T_{366} - число дней между исполнением первой и второй частей сделки РЕПО (первой и второй сделкой купли-продажи), приходящихся на календарный год, состоящий из 366 дней.

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

32.5.1. 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 32.5 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).

32.6. При наличии случаев, указанных в пункте 32.3 Правил клиринга, и несоблюдении хотя бы одного из условий, указанных в подпункте 32.4 Правил клиринга, в ходе формирования Клирингового пула по Сделкам Т+, проводимого в соответствии со статьей 31 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 пункте 32.5 Правил клиринга, за исключением цены сделки купли-продажи ценных бумаг, которая рассчитывается по формуле для цены второй части сделки РЕПО (второй сделки купли-продажи).

32.6.1. При наличии случаев, указанных в пункте 32.3 Правил клиринга, и при принятии Клиринговым центром решения в соответствии с подпунктом 25.12.2 Правил клиринга, в ходе формирования Клирингового пула по Сделкам Т+, проводимого в соответствии со статьей 31 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 пункте 32.5 Правил клиринга, за исключением суммы сделки

купли-продажи, которая определяется как произведение количества ценных бумаг в сделке и последней определенной Клиринговым центром Расчетной цены ценных бумаг.

- 32.7. Заключение сделок в соответствии с пунктами 32.3-32.6 Правил клиринга осуществляется в отношении всех Участников клиринга, имеющих Итоговые нетто-обязательства по денежным средствам / ценным бумагам, не обеспеченные средствами под исполнение.
- 32.8. В случае непогашения Участником клиринга Задолженности, учитываемой по Расчетному коду в установленный Временным регламентом срок, а также при невозможности заключения сделок в соответствии с пунктами 32.3-32.6 Правил клиринга и наличии у Участника клиринга Обеспечения в иностранной валюте, учитываемого по тому же Расчетному коду, Клиринговый центр использует Обеспечение Участника клиринга в иностранной валюте для удовлетворения требований Клирингового центра по Задолженности Участника клиринга путем продажи Клиринговым центром иностранной валюты, являющейся Обеспечением Участника клиринга, за российские рубли по курсу, не меньшему, чем Нижняя граница диапазона оценки рисков сделок по покупке и продаже иностранной валюты за российские рубли, установленная Клиринговым центром в соответствии с Методикой определения риск-параметров валютного рынка на конец Расчетного дня даты удовлетворения требований.

Удовлетворение требований за счет Обеспечения Участника клиринга в иностранной валюте осуществляется Клиринговым центром без предварительного уведомления Участника клиринга.

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

Входящее и плановое значение позиции по денежным средствам по Счету обеспечения Т+ в иностранной валюте уменьшается на сумму использованных средств Обеспечения Участника клиринга.

- 32.9. В случае отсутствия у Участника клиринга Обеспечения в иностранной валюте либо если в результате использования Клиринговым центром Обеспечения Участника клиринга в иностранной валюте в соответствии с пунктом 32.8 Правил клиринга Задолженность Участника клиринга по Расчетному коду не погашена полностью, Клиринговый центр использует Обеспечение Участника клиринга, учитываемое по иным Расчетным кодам в соответствии с Правилами клиринга и иными Правилами клиринга Клирингового центра, а также средства Гарантийных фондов в порядке, определенном статьей 33 Правил клиринга.
- 32.10. При наличии Недобросовестных участников клиринга, имеющих не обеспеченные полностью или частично средствами под исполнение 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 в соответствии со статьей 37 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 37 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.

32.10.1. Сделки купли-продажи в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга заключаются по Торгово-клиринговым счетам, предназначенным для учета ценных бумаг и денежных средств, находящихся в доверительном управлении Участника клиринга, а также в случае предоставления Участником клиринга Клиринговому центру Заявления о заключении сделок купли-продажи, предусмотренного подпунктом 32.4.1 Правил клиринга.

32.10.2. Условия сделок РЕПО (двух сделок купли-продажи), заключаемых между Клиринговым центром и Добросовестным участником клиринга в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга, соответствуют условиям, определенным Правилами торгов для биржевых Сделок T+, 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 Итоговому нетто-требованию Добросовестного участника клиринга по ценным бумагам в объеме, равном 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 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 Итоговому нетто-требованию Добросовестного участника клиринга по денежным средствам;
- иные условия заключаемых сделок соответствуют условиям сделок, определенных в пункте 32.5, 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.

32.11. Сделки РЕПО (две сделки купли-продажи), указанные в пункте 32.10 Правил клиринга, могут заключаться Клиринговым центром с одним Добросовестным участником клиринга не более, чем 45 (сорок пять) календарных дней подряд, при наличии у Добросовестного участника клиринга Итогового нетто-требования по ценным бумагам.

32.11.1. В случае невозможности Клирингового центра исполнить Итоговые нетто-требования по ценной бумаге одного или нескольких Добросовестных участников

клиринга в течение 45 (сорока пяти) календарных дней подряд, Клиринговый центр:

- исключает указанную ценную бумагу из Клирингового листа;
- 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 32.10.2 Правил клиринга, за исключением цены сделки купли-продажи ценных бумаг, которая рассчитывается по формуле для цены второй части сделки РЕПО (второй сделки купли-продажи).

32.12. После заключения сделок в соответствии с пунктами 32.1-32.11 Правил клиринга Клиринговый центр включает обязательства по указанным сделкам с наступившей Датой исполнения в Клиринговый пул по Сделкам Т+ и зачитывает встречные однородные Итоговые нетто-обязательства / Итоговые нетто-требования по денежным средствам и ценным бумагам и/или Задолженности Участника клиринга с обязательствами и требованиями по указанным заключенным сделкам с наступившей Датой исполнения.

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

Прекращение указанного Итогового нетто-обязательства / Итогового нетто-требования Участника клиринга по денежным средствам осуществляется в порядке, определенном статьей 34 Правил клиринга.

32.12.1. 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 32.1-32.11 Правил клиринга, учитываются в составе Нетто-обязательств / Нетто-требований Участника клиринга по Сделкам Т+ с Датой исполнения, соответствующей дате исполнения указанных обязательств и требований.

32.13. В случае заключения Клиринговым центром сделок в соответствии с пунктом 24.12 Правил клиринга с Участником клиринга, не исполнившим Маржинальное требование, и/или сделок в соответствии с пунктом 32.6 Правил клиринга с Недобросовестным участником клиринга, Клиринговый центр заключает сделки на основании пункта 17.7 Правил клиринга и/или внебиржевые сделки с целью обеспечения равенства суммы обязательств и суммы требований Клирингового центра по ценным бумагам по всем Датам исполнения.

Статья 33. Порядок использования и возмещения Гарантийных фондов

33.1. Настоящая статья Правил клиринга применяется, если Задолженность Участника клиринга, учитываемая по Расчетному коду, не погашена в результате действий, предпринятых Клиринговым центром в соответствии с пунктом 32.8 Правил клиринга.

33.2. Индивидуальное клиринговое обеспечение Недобросовестного участника клиринга и средства Гарантийных фондов используются для погашения Задолженности Участника клиринга, учитываемой по Расчетному коду, в следующей очередности:

- 1) Обеспечение Недобросовестного участника клиринга в денежных средствах, учитываемое в соответствии с Правилами клиринга по Расчетным кодам, предназначенным для учета денежных средств Участника клиринга, и Обеспечение Недобросовестного участника клиринга в ценных бумагах, учитываемое в соответствии с Правилами клиринга по Разделам, соответствующим указанным Расчетным кодам;
 - 2) индивидуальное клиринговое обеспечение Недобросовестного участника клиринга в денежных средствах / драгоценных металлах, учитываемое Клиринговым центром в соответствии с иными правилами клиринга Клирингового центра по Расчетным кодам, предназначенным для учета денежных средств Участника клиринга, и Обеспечение Недобросовестного участника клиринга в ценных бумагах, учитываемое в соответствии с иными правилами клиринга Клирингового центра по Разделам / разделам депо регистра обеспечения, соответствующим указанным Расчетным кодам;
 - 3) взнос в Фонд финансовой стабильности Недобросовестного участника клиринга, учитываемый в соответствии с Правилами клиринга;
 - 4) взносы в Гарантийные фонды Недобросовестных участников клиринга, учитываемых в соответствии с иными правилами клиринга Клирингового центра;
 - 5) взносы в Фонд финансовой стабильности Добросовестных участников клиринга, учитываемые в соответствии с Правилами клиринга (с учетом условия пункта 33.8 Правил клиринга).
- 33.3. Взносы в Гарантийные фонды и иные средства Участников клиринга каждой очереди, указанной в пункте 33.2 Правил клиринга, используются в следующей очередности:
- 1) российские рубли;
 - 2) иностранная валюта;
 - 3) ценные бумаги;
 - 4) драгоценные металлы.
- 33.4. Использование средств Гарантийных фондов и иных средств следующей очереди в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга осуществляется в случае, если Задолженность Участника клиринга не погашена при использовании средств предыдущей очереди.
- 33.5. Индивидуальное клиринговое обеспечение Недобросовестного участника клиринга используется для погашения Задолженности такого Участника клиринга в соответствии с порядком, установленным теми правилами клиринга Клирингового центра, в соответствии с которыми оно учитывается.
- 33.6. Если после использования индивидуального клирингового обеспечения Недобросовестного участника клиринга, учитываемого по всем Расчетным кодам, предназначенным для учета денежных средств Участника клиринга, Задолженность Участника клиринга не погашена, между Клиринговым центром и Недобросовестным участником клиринга по указанным Расчетным кодам, присвоенным в соответствии с Правилами клиринга, без подачи заявок заключаются сделки в порядке, аналогичном порядку, указанному в пункте 24.12 Правил клиринга, затем – сделки по указанным Расчетным кодам, присвоенным в соответствии с иными правилами клиринга Клирингового центра, направленные на прекращение обязательств Недобросовестного участника клиринга, учитываемых в

соответствии с иными правилами клиринга Клирингового центра, и увеличение объема свободного индивидуального клирингового обеспечения Недобросовестного участника клиринга, учитываемого по таким Расчетным кодам.

Указанные сделки заключаются до момента погашения задолженности Участника клиринга, учитываемой по Расчетному коду.

- 33.7. При использовании взноса Участника клиринга в Гарантийный фонд, учитываемый в соответствии с Правилами клиринга или иными правилами клиринга Клирингового центра, Участнику клиринга устанавливается Режим закрытия позиций по всем Расчетным кодам, присвоенным Участнику клиринга в соответствии с такими правилами клиринга.
- 33.8. Взносы в Гарантийные фонды Добросовестных участников клиринга используются в случае, если сумма Задолженностей Недобросовестных участников клиринга перед Клиринговым центром превышает 1 (один) миллиард российских рублей.
- 33.9. Для погашения задолженности одного Недобросовестного Участника клиринга используется не более $\frac{1}{2}$ Фонда финансовой стабильности.
- 33.10. В случае возникновения нескольких задолженностей одного или нескольких Недобросовестных Участников клиринга в соответствии с Правилами клиринга и иными правилами клиринга Клирингового центра, взнос Недобросовестного участника клиринга в Фонд финансовой стабильности используется, в первую очередь, для погашения Задолженности Участника клиринга, учитываемой в соответствии с Правилами клиринга, во вторую – задолженностей, учитываемых в соответствии с иными правилами клиринга Клирингового центра.
- 33.11. Взносы в Гарантийные фонды Недобросовестного участника клиринга используются для удовлетворения требований Клирингового центра по Задолженности Недобросовестного участника клиринга путем передачи денежных средств / ценных бумаг, учитываемых в качестве взноса в соответствующий Гарантийный фонд Недобросовестного участника клиринга, Клиринговому центру в счет погашения Задолженности Недобросовестного участника клиринга.
- 33.11.1. При этом сумма денежных средств в иностранной валюте, подлежащая передаче Клиринговому центру из взноса Участника клиринга в соответствующий Гарантийный фонд, рассчитывается исходя из суммы Задолженности и курса иностранной валюты, равного Нижней границе диапазона оценки рисков сделок купли-продажи такой иностранной валюты за российские рубли, установленной Клиринговым центром в соответствии с Методикой определения риск-параметров валютного рынка и рынка драгоценных металлов на дату удовлетворения требований, а количество ценных бумаг – исходя из суммы Задолженности и Нижней границы диапазона оценки рыночных рисков сделок купли-продажи ценных бумаг, установленная Клиринговым центром для указанных ценных бумаг в соответствии с Правилами клиринга на дату удовлетворения требований.
- 33.11.2. Удовлетворение требований за счет взноса в Гарантийный фонд Недобросовестного участника клиринга осуществляется Клиринговым центром без предварительного уведомления Недобросовестного участника клиринга.
- 33.11.3. Значение позиции по денежным средствам / ценным бумагам, учитываемым в качестве взносов Недобросовестного участника клиринга в Гарантийные фонды, уменьшается на сумму / количество использованных денежных средств / ценных бумаг из взноса Недобросовестного участника клиринга в Гарантийный фонд.

- 33.12. Взносы в Гарантийные фонды Добросовестных участников клиринга используются в размере превышения суммы Задолженностей Недобросовестных участников клиринга величины, установленной в соответствии с пунктом 33.8 Правил клиринга.
- 33.12.1. Использование взносов в соответствующий Гарантийный фонд Добросовестных участников клиринга осуществляется в равных долях.
- 33.12.2. Взносы в Гарантийные фонды Добросовестного участника клиринга используются для удовлетворения требований Клирингового центра по Задолженности Недобросовестного участника клиринга путем передачи денежных средств / ценных бумаг, составляющих взнос в соответствующий Гарантийный фонд Добросовестного участника клиринга Клиринговому центру в счет погашения Задолженности Недобросовестного участника клиринга.
- При этом сумма денежных средств в иностранной валюте / ценных бумаг, подлежащая передаче Клиринговому центру из вноса Добросовестного участника клиринга в соответствующий Гарантийный фонд, рассчитывается в соответствии с подпунктом 33.11.1 Правил клиринга.
- 33.12.3. Удовлетворение требований за счет вноса в Гарантийный фонд Добросовестного участника клиринга осуществляется Клиринговым центром без предварительного уведомления Добросовестного участника клиринга.
- 33.12.4. Значение позиции по денежным средствам / ценным бумагам, учитываемым в качестве взносов в Гарантийные фонды Добросовестного участника клиринга уменьшается на сумму / количество использованных денежных средств / ценных бумаг из вноса Добросовестного участника клиринга в Гарантийный фонд.
- 33.13. В случае необходимости использования ценных бумаг, учитываемых в качестве взносов Участников клиринга в Гарантийные фонды, Клиринговый центр направляет Расчетному депозитарию распоряжение на перевод ценных бумаг с субсчета депо Участника клиринга на субсчет депо Клирингового центра в соответствии с пунктом 36.11 Правил клиринга.
- 33.14. 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.
- 33.15. В случае использования взносов в Гарантийный фонд Добросовестных Участников клиринга, Недобросовестный участник клиринга обязан в течение 1 (одного) Расчетного дня возместить Клиринговому центру в российских рублях использованные средства Гарантийного фонда.
- Уведомление о необходимости возмещения средств соответствующего Гарантийного фонда, содержащее информацию о сумме в российских рублях, подлежащей возмещению Участником клиринга, о реквизитах счета для возмещения средств Гарантийного фонда, о сроке, в течение которого средства Гарантийного фонда должны быть возмещены, направляется Участнику клиринга в форме электронного документа не позднее рабочего дня, следующего за датой использования соответствующего Гарантийного фонда.
- В случае невозмещения Недобросовестным участником клиринга средств Гарантийного фонда в срок, указанный в настоящем пункте, Участнику клиринга устанавливается категория «В».

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

- 33.16. После возмещения Недобросовестным участником клиринга использованных средств Гарантийных фондов, Клиринговый центр возмещает в российских рублях использованные взносы в Гарантийные фонды Добросовестных участников клиринга и средства Клирингового центра.

Возмещение взносов в Гарантийные фонды Добросовестных участников клиринга и средств Клирингового центра осуществляется порядке, обратном порядку их использования.

Если полученных от Недобросовестного участника клиринга денежных средств недостаточно для полного возмещения взносов в соответствующий Гарантийный фонд Добросовестных участников клиринга, осуществляется частичное возмещение таких взносов в размере, пропорциональном сумме использованных средств соответствующего Гарантийного фонда из взноса каждого Участника клиринга.

При этом значение позиции по денежным средствам / ценным бумагам, учитываемым в качестве взносов в Гарантийные фонды Добросовестного участника клиринга, и размер обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга взноса в соответствующий Гарантийный фонд увеличиваются на сумму возмещенных денежных средств / ценных бумаг.

- 33.17. После возмещения Недобросовестным участником клиринга использованных средств Гарантийных фондов такой Участник клиринга обязан возместить (внести) свой взнос (свои взносы) в Гарантийные фонды в установленном Клиринговым центром размере.

После возмещения взноса (взносов) в Гарантийные фонды Участнику клиринга снимается ранее установленный Режим закрытия позиций по всем Расчетным кодам и всем правилам клиринга клирингового центра.

- 33.18. Клиринговый центр уведомляет Биржу о возмещении Недобросовестным участником клиринга средств Гарантийных фондов и его взноса (взносов) в Гарантийные фонды.

- 33.19. В случае использования взносов в соответствующий Гарантийный фонд Добросовестных участников клиринга, Добросовестные участники клиринга обязаны в течение 1 (одного) Расчетного дня после направления Клиринговым центром требований в соответствии с пунктом 22.5 Правил клиринга восполнить в российских рублях свои взносы в соответствующий Гарантийный фонд до размера, установленного Клиринговым центром.

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

ПОДРАЗДЕЛ V-V. ПОРЯДОК ИСПОЛНЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ, ВКЛЮЧЕННЫХ В КЛИРИНГОВЫЙ ПУЛ

Статья 34. Порядок исполнения обязательств и требований Участников клиринга и Клирингового центра, включенных в клиринговый пул

34.1. 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.

34.2. Исполнение обязательств по сделкам, включенным в Клиринговый пул для расчетов в ходе торгов / Клиринговый пул для расчетов в ходе торгов по сделкам с центральным контрагентом, осуществляется сразу после их включения в соответствующий клиринговый пул.

34.2.1. По обязательствам, включенным в Клиринговый пул для расчетов в ходе торгов по сделкам с центральным контрагентом на основании Срочного отчета на исполнение, проводится неттинг, по итогам которого определяются нетто-обязательства / нетто-требования Участников клиринга и Клирингового центра по денежным средствам и по ценным бумагам, которые затем включаются в Клиринговый пул для расчетов в ходе торгов.

34.2.2. По обязательствам, включенным в Клиринговый пул для расчетов в ходе торгов, проводится неттинг, по итогам которого определяются Нетто-обязательства / нетто-требования Участников клиринга и Клирингового центра по денежным средствам и по ценным бумагам по сделкам клирингового пула в соответствии с подпунктами 29.4.1 и 29.4.2 Правил клиринга.

34.3. Исполнение обязательств по сделкам, включенным в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов и Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов по сделкам с центральным контрагентом, осуществляется в периоды времени, установленные Временным регламентом. Для каждого периода времени, установленного Временным регламентом в качестве времени исполнения указанных обязательств, формируется отдельный Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов и отдельный Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов по сделкам с центральным контрагентом.

34.4. По обязательствам по сделкам с ценными бумагами с кодами расчетов T0, K0 и обязательствам по первым частям сделок РЕПО с кодом расчетов T0/Yn, а также обязательствам по иным Сделкам T+, 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, которые затем включаются в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов.

34.5. 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 по сделкам клирингового пула.

34.5.1. 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 или Счета обеспечения T+, 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 включенным в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов:

- 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 34.2 Правил клиринга;
- первым частям сделок РЕПО с кодом расчетов Rb;
- сделкам купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов B0-B30;
- первым частям сделок РЕПО с кодом расчетов S0-S2;
- вторым частям сделок РЕПО с кодом расчетов S0-S2, Z0 и Rb;
- обязательствам по внесению / требованиям по получению компенсационных взносов;
- обязательствам по уплате / требованиям по получению отступного за отказ от исполнения сделки РЕПО;
- обязательствам по передаче отступного за отказ от заключения сделки;
- требованиям по зачислению денежных средств на Счет обеспечения T0 / Счет обеспечения T+ по исполненным в Клиринговой системе возвратам денежных средств из Обеспечения / распоряжениям на внесение денежных средств в Обеспечение;
- обязательствам по списанию денежных средств со Счета обеспечения T0 / Счет обеспечения T+ по исполненным в Клиринговой системе распоряжениям на внесение денежных средств в Обеспечение / возвратам денежных средств из Обеспечения;
- Итоговым нетто-обязательствам / Итоговым нетто-требованиям Участников клиринга по денежным средствам, определенным по Сделкам T+, обязательства по которым были включены в Клиринговый пул по Сделкам T+, в соответствии с пунктом 31.5 Правил клиринга (только для Счетов обеспечения T+);
- обязательствам по уплате Комиссионных вознаграждений и неустоек, определенным в соответствии со статьей 39 Правил клиринга (только для последнего в течение Расчетного дня Клирингового пула для расчетов по итогам торгов и Счетов обеспечения T0);

- обязательствам по уплате / требованиям по получению Возмещения, определенных в соответствии со статьей 30 Правил клиринга (только для последнего в течение Расчетного дня Клирингового пула для расчетов по итогам торгов).

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.

- 34.5.2. 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 / Раздела Т+ 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 включенным в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов:

- 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 34.2 Правил клиринга;
- первым частям сделок РЕПО с кодом расчетов Rb;
- сделкам купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов B0-B30;
- первым частям сделок РЕПО с кодом расчетов S0-S2;
- вторым частям сделок РЕПО с кодом расчетов S0-S2, Z0 и Rb;
- обязательствам по внесению / требованиям по получению компенсационных взносов;
- требованиям по зачислению ценных бумаг на Раздел Т0 / Раздел Т+ по исполненным в Клиринговой системе возвратам ценных бумаг из Обеспечения / распоряжениям на внесение ценных бумаг в Обеспечение;
- обязательствам по списанию ценных бумаг с Раздела Т0 / Раздела Т+ по исполненным в Клиринговой системе распоряжениям на внесение ценных бумаг в Обеспечение / возвратам ценных бумаг из Обеспечения;
- Итоговым нетто-обязательствам / Итоговым нетто-требованиям Участников клиринга по ценным бумагам, определенным по Сделкам Т+, обязательства по которым были включены в Клиринговый пул по Сделкам Т+, в соответствии с пунктом 31.5 Правил клиринга (только для Разделов Т+).

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.

- 34.6. Нетто-обязательства (нетто-требования) Участников клиринга по ценным бумагам по сделкам клирингового пула, рассчитанные в соответствии с подпунктом 34.5.2 Правил клиринга, включаются в распоряжение на проведение операций по торговым разделам, направляемое Клиринговым центром Расчетному депозитарию в соответствии с пунктом 36.11 Правил клиринга.

- 34.7. Обязательства / требования по передаче ценных бумаг по сделкам купли-продажи с кодом расчетов Z0, X0 и первым частям сделок РЕПО с кодом расчетов Z0 или Нетто-обязательства (нетто-требования) Участников клиринга по ценным бумагам по сделкам клирингового пула, рассчитанные в соответствии с подпунктом 29.4.2 Правил клиринга по обязательствам, включенным в Срочный отчет на исполнение, включаются в распоряжение на проведение операций по торговым разделам, направляемое Клиринговым центром Расчетному депозитарию в соответствии с пунктом 36.10 Правил клиринга.
- 34.8. Обязательства по оплате ценных бумаг по сделкам купли-продажи с кодом расчетов Z0, X0 и первым частям сделок РЕПО с кодом расчетов Z0, Нетто-обязательства Участников клиринга по денежным средствам по сделкам клирингового пула, рассчитанные в соответствии с подпунктом 29.4.1 Правил клиринга по обязательствам, включенным в Срочный отчет на исполнение, или в соответствии с подпунктом 34.5.1 Правил клиринга в отношении Счета обеспечения T0 или Счета обеспечения T+, исполняются за счет денежных средств, учитываемых по тому же Счету обеспечения T0 / Счету обеспечения T+.
- 34.8.1. Обязательство по оплате ценных бумаг или Нетто-обязательство Участника клиринга по денежным средствам по сделкам клирингового пула, определенное в отношении Счета обеспечения T0 / Счета обеспечения T+, считается исполненным, если значение начальной позиции по денежным средствам по тому же Счету обеспечения T0 / Счету обеспечения T+ не меньше, чем соответствующее обязательство / Нетто-обязательство Участника клиринга.
- 34.8.2. Если значение начальной позиции по денежным средствам по Счету обеспечения T0 меньше, чем Обязательство по оплате ценных бумаг или Нетто-обязательство Участника клиринга по денежным средствам по сделкам клирингового пула, определенное в отношении Счета обеспечения T0, соответствующее обязательство / Нетто-обязательство прекращается в части, соответствующей размеру указанной начальной позиции, а неисполненная часть соответствующего обязательства / Нетто-обязательства на следующий Расчетный день включается в Ограничительный лимит по Счету обеспечения T0.
- 34.8.3. Если значение начальной позиции по денежным средствам по Счету обеспечения T+ меньше, чем Обязательство по оплате ценных бумаг или Нетто-обязательство Участника клиринга по денежным средствам по сделкам клирингового пула, определенное в отношении Счета обеспечения T+, соответствующее обязательство / Нетто-обязательство прекращается в части, соответствующей размеру указанной начальной позиции, а неисполненная часть соответствующего обязательства / Нетто-обязательства учитывается как Задолженность.
- 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 подпунктом 24.6 Правил клиринга.
- Задолженность считается погашенной, если на момент времени, установленный Временным регламентом в качестве времени погашения соответствующей Задолженности, значение начальной позиции по денежным средствам по Счету обеспечения T+, по которому учитывалась Задолженность, является неотрицательным.

Порядок действий Клирингового центра при непогашении Участником клиринга Задолженности в установленный Временным регламентом срок, определен в статье 32 Правил клиринга.

- 34.8.4. Клиринговый центр зачитывает Обязательство по оплате ценных бумаг, Нетто-обязательство Участника клиринга по денежным средствам по сделкам клирингового пула (или его часть), определенное в отношении Счета обеспечения T0 / Счета обеспечения T+, с требованием Участника клиринга по возврату денежных средств, учитываемых по тому же Счету обеспечения T0 / Счету обеспечения T+, а значение начальной и плановой позиции по денежным средствам по тому же Счету обеспечения T0 / Счету обеспечения T+ уменьшается на сумму такого исполненного обязательства / Нетто-обязательства (или его части).
- 34.9. Требование по оплате ценных бумаг по сделкам купли-продажи с кодом расчетов Z0, X0 и первым частям сделок РЕПО с кодом расчетов Z0 или Нетто-требование Участника клиринга по денежным средствам, рассчитанные в соответствии с подпунктом 29.4.1 Правил клиринга по обязательствам, включенным в Срочный отчет на исполнение, или в соответствии с подпунктом 34.5.1 Правил клиринга в отношении Счета обеспечения T0 / Счета обеспечения T+, прекращается возникновением обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга денежных средств, учитываемых по тому же Счету обеспечения T0 / Счету обеспечения T+, в размере соответствующего требования / Нетто-требования Участника клиринга.
- При этом значение начальной и плановой позиции по денежным средствам по Счету обеспечения T0 / Счету обеспечения T+ увеличивается на сумму такого прекращенного требования / Нетто-требования.
- 34.10. После исполнения (прекращения) Нетто-обязательств (нетто-требований) Участников клиринга по денежным средствам по сделкам клирингового пула в соответствии с пунктами 34.8 или 34.9 Правил клиринга и направления в Расчетный депозитарий распоряжения на проведение операций по Разделам в соответствии с пунктом 36.10 или 36.11 Правил клиринга обязательства Участников клиринга и Клирингового центра по оплате и передаче ценных бумаг (по сделкам с ценными бумагами), включенные в соответствующий клиринговый пул, считаются прекращенными в соответствующем клиринговом пуле.
- После получения от Расчетного депозитария отчета о проведении операций по Разделам в соответствии с пунктом 36.12 Правил клиринга расчеты по ценным бумагам по итогам клиринга считаются завершенными.
- 34.11. Не исполненные обязательства и требования Участников клиринга по сделкам, за исключением Сделок T+, учитываются в Клиринговой системе и являются допущенными к клирингу вплоть до Даты прекращения исполнения таких сделок.
- С Даты прекращения исполнения обязательства Участников клиринга по сделкам исключаются из числа обязательств, допущенных к клирингу, и не подлежат исполнению в Клиринговой системе, неисполненные сделки исключаются из Клиринговой системы.
- 34.12. 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 торгов.

- 34.13. 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 компенсационным взносам не подлежат исполнению в Клиринговой системе.

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

Статья 35. Порядок взаимодействия с Расчетной организацией

- 35.1. 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.
- 35.2. 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.
- 35.3. Клиринговый центр соглашается с проведением любых операций зачисления на Торговый счет на основании распоряжений лица, которому открыт такой Торговый счет.
- 35.4. 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.
- 35.5. 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 Т0, открытых к соответствующим Торговым счетам, и устанавливает начальные и плановые значения основных и дополнительных позиций по денежным средствам, определяемых в отношении Счетов обеспечения Т0, равными суммам денежных средств, учитываемых на соответствующих Счетах обеспечения Т0.
- 35.6. 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 плановых 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.
- 35.7. 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

соответствующего Ограничительного лимита, и направляет Расчетной организации распоряжение на перевод денежных средств с клирингового банковского счета на Торговые счета на сумму списания.

- 35.8. 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 Т0, учитываемых в Клиринговой системе после прекращения обязательств, включенных в последний в течение Расчетного дня Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов.
- 35.9. После исполнения Расчетной организацией распоряжения на проведение операций по Торговым счетам, направленного Клиринговым центром в соответствии с пунктом 35.8 Правил клиринга, Клиринговый центр направляет Расчетной организации уведомление о согласии на проведение операций по Торговым счетам. Направление Расчетной организации указанного уведомления 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.
- 35.10. При получении от Расчетной организации уведомления о приостановлении или прекращении участия Участника клиринга / клиента Участника клиринга в платежной системе Расчетной организации Клиринговый центр прекращает проведение операций по Торговым счетам такого Участника клиринга / клиента Участника клиринга с рабочего дня, следующего за днем получения от Расчетной организации указанного уведомления.

Статья 36. Порядок взаимодействия с Расчетным депозитарием и иными депозитариями

- 36.1. 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.
- 36.2. 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.
- 36.2.1. Учет ценных бумаг, принадлежащих Участнику клиринга на праве собственности и переданных Участником клиринга в Гарантийный фонд, осуществляется на субсчетах депо. Для открытия субсчета депо Участник клиринга должен предоставить в Расчетный депозитарий комплект документов, предусмотренный Условиями осуществления депозитарной деятельности Расчетного депозитария, а также предоставить заявление на перечисление причитающихся ему доходов и иных выплат по ценным бумагам в Гарантийный фонд.
- 36.2.2. Списание / зачисление ценных бумаг с субсчетов / на субсчета депо осуществляется на основании распоряжений Клирингового центра.
- 36.2.3. Доходы и иные выплаты, причитающиеся Участникам клиринга по ценным бумагам, учитываемые на субсчетах депо, перечисляются в Гарантийный фонд, на

соответствующий клиринговый счет Клирингового центра, в порядке, предусмотренном договором Клирингового центра с Расчетным депозитарием.

Доходы и иные выплаты по ценным бумагам, перечисленные в Гарантийный фонд в соответствии с заявлением Участника клиринга, указанным в подпункте 36.2.1 Правил клиринга, учитываются как средства, перечисленные Участником клиринга на клиринговые счета Клирингового центра, предназначенные для учета коллективного клирингового обеспечения.

- 36.3. Клиринговый центр соглашается с проведением любых операций зачисления на Разделы торгового счета депо на основании распоряжений лица, которому открыт такой торговый счет депо.
- 36.4. В случае если торговые счета депо Участников клиринга, клиентов Участника клиринга 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.
- 36.5. Каждый Расчетный день до начала Торгов, Клиринговый центр направляет Расчетному депозитарию запрос выписки по Разделам / субсчетам депо, в ответ на который Расчетный депозитарий передает Клиринговому центру список Разделов / субсчетов депо и выписку по Разделам / субсчетам депо.
- 36.6. После получения от Расчетного депозитария выписки по Разделам / субсчетам депо Клиринговый центр устанавливает в Клиринговой системе начальные и плановые значения позиций депо по Разделам / субсчетам депо Участников клиринга в соответствии с информацией о количестве ценных бумаг, учитываемых на Разделах / субсчетам депо, полученной от Расчетного депозитария в Выписке по Разделам / субсчетам депо.
- 36.7. Установление начальных и плановых значений учетных позиций Участников клиринга осуществляется только в дату размещения акций, определяемую в соответствии с зарегистрированными в установленном порядке Решением о выпуске и/или Проспектом ценных бумаг. При этом начальные и плановые 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 Проспекте 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.
- 36.8. 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 и

плановых значениях позиций депо Участников клиринга по Разделам T0 / Разделам T+.

- 36.9. 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 количество ценных бумаг, подлежащих списанию, не превышает планового и начального значения соответствующей позиции депо Участника клиринга, и в результате такого списания Единый лимит Участника клиринга по Расчетному коду, к которому относится указанный Раздел T+, не станет отрицательным.

В случае если в соответствии с полученным Клиринговым центром запросом, списание ценных бумаг осуществляется с Раздела T+, входящего в состав Торгово-клирингового счета с признаком «запрет коротких продаж», и/или с Раздела T+ Участника клиринга категории «B», и/или по ценной бумаге с признаком «запрет коротких продаж», дополнительным условием для получения согласия Клирингового центра на такое списание является не превышение количества ценных бумаг, подлежащего списанию, планового значения позиции по ценным бумагам, рассчитанного по всем Датам исполнения, по Разделу T+.

При согласии Клирингового центра на списание ценных бумаг плановое и начальное значение позиции по ценным бумагам по Разделу уменьшается на количество ценных бумаг, указанное в запросе.

- 36.10. Проведение расчетов по ценным бумагам в ходе торгов осуществляется Расчетным депозитарием на основании полученного от Клирингового центра распоряжения на проведение операций по Разделам / субсчетам депо, содержащего обязательства и требования Участника клиринга по передаче ценных бумаг по сделкам с кодом расчетов Z0 / X0, включенные в Клиринговый пул для расчетов в ходе торгов.

- 36.10.1. Распоряжение на проведение операций по Разделам / субсчетам депо, содержащее обязательства и требования Участника клиринга по передаче размещаемых ценных бумаг по сделкам размещения с кодом расчетов X0, направляется Клиринговым центром Расчетному депозитарию сразу после получения от Расчетного депозитария информации о зачислении размещаемых ценных бумаг на счет Расчетного депозитария в реестре.

- 36.11. Проведение расчетов по ценным бумагам по итогам и в ходе торгов осуществляется Расчетным депозитарием на основании полученного от Клирингового центра распоряжения на проведение операций по Разделам / субсчетам депо, 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 или Клиринговый пул для расчетов в ходе торгов.

В случае необходимости использования ценных бумаг, учитываемых в качестве взносов Участников клиринга в Гарантийные фонды, Клиринговый центр включает в распоряжение на проведение операций по Разделам / субсчетам депо,

направляемое Расчетному депозитарию в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга, распоряжение на списание ценных бумаг с субсчетов депо Участников клиринга.

Исполнение распоряжения на проведение операций по Разделам / субсчетам депо, полученного от Клирингового центра в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга, осуществляться Расчетным депозитарием в корреспонденции с субсчетом депо Клирингового центра, открытым в рамках клирингового счета депо Клирингового центра в Расчетном депозитарии.

- 36.12. При получении от Участника клиринга распоряжения на перечисление ценных бумаг в Гарантийные фонды или запроса о возврате ценных бумаг из Гарантийных фондов Клиринговый центр направляет Расчетному депозитарию распоряжение на проведение операций по Разделам / субсчетам депо, содержащее распоряжения на перечисление ценных бумаг между Разделами и субсчетами депо.
- 36.13. После исполнения распоряжения на проведение операций по Разделам / субсчетам депо, полученного от Клирингового центра, Расчетный депозитарий направляет Клиринговому центру отчет о проведении операций по Разделам / субсчетам депо.
- 36.14. После окончания установленного Временным регламентом времени передачи Участниками клиринга в Клиринговый центр Запросов о возврате ценных бумаг из Обеспечения, Клиринговый центр направляет Расчетному депозитарию Уведомление о согласии на проведение операций по Разделам.

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

ПОДРАЗДЕЛ V-VII. СДЕЛКИ РЕПО КЛИРИНГОВОГО ЦЕНТРА И ДОГОВОРЫ ЗАЙМА КЛИРИНГОВОГО ЦЕНТРА

Статья 37. Условия Сделок РЕПО Клирингового центра и Договоров займа Клирингового центра, порядок их заключения и исполнения

37.1. Сделки РЕПО Клирингового центра и/или Договоры займа Клирингового центра заключаются между Клиринговым центром и Участником клиринга в случае, установленном пунктом 32.10 Правил клиринга.

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

37.2. Предметом Сделок РЕПО Клирингового центра и Договоров займа Клирингового центра могут являться ценные бумаги, включенные в Клиринговый лист (далее в настоящей статье – Ценные бумаги).

37.3. 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.

37.4. Клиринговый центр вправе заключить Сделку РЕПО Клирингового центра или Договор займа Клирингового центра с любым Участником клиринга категорий «Б1» или «Б2» с использованием любого Раздела Т+, открытого на Торговом счете депо владельца Участника клиринга в Расчетном депозитарии.

37.5. 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 37.4 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.

37.6. 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.

37.7. Условия Сделки РЕПО Клирингового центра соответствуют условиям сделок РЕПО, заключаемых в Режиме торгов «РЕПО с ЦК – Адресные заявки», определенным Правилами торгов, с учетом следующих особенностей:

- 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, уменьшенной на последний определенный Клиринговым центром дисконт по ценным бумагам;
- 5) Ставка по Сделкам РЕПО Клирингового центра устанавливается в процентах годовых. 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 38 Правил клиринга. Иной Доход Клиринговый центр передает Участнику клиринга в течение десяти Расчетных дней, следующих за днем получения Клиринговым центром такого Дохода.

37.8. 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, уменьшенной на последний определенный Клиринговым центром дисконт по ценным бумагам;
- 3) Ставка по Договорам займа Клирингового центра устанавливается в процентах годовых. 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 38 Правил клиринга. Иной Доход Клиринговый центр передает Участнику клиринга в течение десяти Расчетных дней, следующих за днем получения Клиринговым центром такого Дохода.
- 37.9. 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 37.4 Правил клиринга, или с Участниками клиринга, предоставившими заявление, указанное в пункте 37.5 Правил клиринга, с использованием Разделов Т+, указанных в данном заявлении, при условии, что на таком Разделе Т+ учитываются недостающие у Клирингового центра ценные бумаги.
- 37.10. Сделки РЕПО Клирингового центра и Договоры займа Клирингового центра заключаются без подачи заявок.
- 37.11. 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 Т+ в Дату их исполнения в порядке, установленном статьей 31 Правил клиринга.
- 37.12. 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 40 Правил клиринга. Указанный отчет является документом, удостоверяющим передачу Участником клиринга Клиринговому центру Ценных бумаг.

ПОДРАЗДЕЛ V-VIII. ПОРЯДОК ПЕРЕДАЧИ ДОХОДА

Статья 38. Порядок передачи Доходов по сделкам РЕПО, Договорам займа и сделкам купли-продажи ценных бумаг, заключенным с Клиринговым центром

38.1. Обязательства по передаче Дохода возникают:

- по сделке РЕПО, заключенной с Клиринговым центром, в том числе Сделке РЕПО Клирингового центра, с ценными бумагами, по которым принято решение о выплате Дохода, и список лиц, имеющих право на его получение, определяется в период после исполнения обязательств по передаче ценных бумаг по первой части сделки РЕПО и до исполнения обязательств по передаче ценных бумаг по второй части сделки РЕПО;
- по заключенной в соответствии с пунктом 32.3 Правил клиринга второй сделке купли-продажи ценных бумаг, по которым принято решение о выплате Дохода, и список лиц, имеющих право на его получение, определяется в период после исполнения обязательств по передаче ценных бумаг по первой сделке купли-продажи ценных бумаг и до исполнения обязательств по передаче ценных бумаг по второй сделке купли-продажи ценных бумаг;
- по Договору займа Клирингового центра ценных бумаг, по которым принято решение о выплате Дохода, и список лиц, имеющих право на его получение, определяется в период после заключения Договора займа Клирингового центра и до исполнения обязательств по возврату ценных бумаг по Договору займа Клирингового центра.

38.2. По сделке с акциями размер обязательства по передаче / требования по получению Дохода в форме денежных средств рассчитывается по формуле:

$Inc = \text{ОКРУГЛ}(N \times d \times 0.91; 2)$, где	
Inc	размер обязательства по передаче / требования по получению Дохода по сделке (в рублях Российской Федерации);
N	размер обязательства / требования Участника клиринга по ценным бумагам по сделке, указанной в пункте 38.1 Правил клиринга (в штуках);
d	сумма начисления на одну акцию, установленная эмитентом ценных бумаг (в рублях Российской Федерации).

38.3. В случае выплаты Дохода ценными бумагами, размер обязательства по передаче / требования по получению Дохода в форме ценных бумаг по сделке рассчитывается по формуле:

$Inc = N \times d$, где	
Inc	размер обязательства по передаче / требования по получению Дохода по сделке (в штуках);
N	размер обязательства / требования Участника клиринга по ценным бумагам по сделке, указанной в пункте 38.1 Правил клиринга (в штуках);
d	количество ценных бумаг передаваемых эмитентом на одну акцию, установленное эмитентом ценных бумаг (в штуках).

38.4. По сделки с облигациями размер обязательства по передаче / требования по получению Дохода в форме денежных средств рассчитывается по формуле:

Inc = ОКРУГЛ($N \times (d + m)$; 2), где	
Inc	размер обязательства по передаче / требования по получению Дохода по сделке (в рублях Российской Федерации);
N	размер обязательства / требования Участника клиринга по ценным бумагам по сделке, указанной в пункте 38.1 Правил клиринга (в штуках);
d	размер начисленного купона на одну облигацию, установленный эмитентом ценных бумаг (в рублях Российской Федерации);
m	сумма погашения части основного долга.

- 38.5. Датой исполнения обязательств по передаче / требований по получению Дохода, определенных в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга, является Расчетный день, следующий за датой выплаты / передачи Дохода эмитентом (полностью или частично).
- 38.6. Отчет об обязательствах по передаче / требованиях по получению Дохода, содержащий информацию об указанных обязательствах по каждой сделке, формируется Клиринговым центром и направляется Участникам клиринга в Дату исполнения указанных обязательств и требований.
- 38.7. В Дату исполнения обязательств по передаче / требований по получению Дохода, определенных в соответствии с пунктами 38.2-38.4 Правил клиринга, Клиринговый центр зачитывает встречные однородные обязательства по передаче и требования по получению Дохода по сделке, определенные в отношении одного Раздела T+ Участника клиринга.
- Обязательства по передаче / требования по получению Дохода, определенные после проведения зачета в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга, учитываются в Клиринговой системе и являются обязательствами, подлежащими исполнению.
- 38.8. 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+.
- 38.9. Обязательства по передаче / требования по получению Дохода включаются в Клиринговый пул по Сделкам T+ в порядке, установленном статьей 31 Правил клиринга.
- 38.10. Информация об исполненных обязательствах по передаче Дохода включается в Отчет об Обеспечении.

РАЗДЕЛ VI. ПОРЯДОК ОПЛАТЫ УСЛУГ. ОТЧЕТЫ ПО ИТОГАМ КЛИРИНГА

Статья 39. Порядок оплаты услуг Клирингового центра, Биржи и Технического центра

- 39.1. Клиринговый центр взимает:
- 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);
 - неустойки в пользу Биржи, установленные Правилами торгов.
- 39.2. 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).
- 39.3. Комиссионное вознаграждение Биржи за организацию торгов и вознаграждение Технического центра подлежит уплате Участником торгов.
- 39.4. Комиссионное вознаграждение Биржи за организацию торгов взимается Клиринговым центром в соответствии с действующими размерами комиссионного вознаграждения за организацию торгов, утвержденными Биржей (далее – Тарифы Биржи), на основании договора, заключенного с Биржей.
- 39.5. Неустойки в пользу Биржи, установленные Правилами торгов, взимаются Клиринговым центром в размере, указанном в полученном от Биржи уведомлении.
- 39.6. Вознаграждение Технического центра взимается Клиринговым центром в соответствии с действующими размерами вознаграждения за предоставление ИТС, утвержденными Техническим центром (далее – Тарифы Технического центра), на основании договора, заключенного с Техническим центром.
- 39.7. Обязательства по уплате Комиссионных вознаграждений Клирингового центра, Биржи и Технического центра исполняются в российских рублях.
- 39.7.1. Для сделок с расчетами в иностранной валюте сумма Комиссионного вознаграждения пересчитывается в российские рубли по курсу, установленному Банком России на дату заключения сделки.
- 39.8. Размер обязательства Участника торгов / Участника клиринга по уплате Комиссионного вознаграждения по биржевым сделкам РЕПО и по биржевым сделкам купли-продажи акций рассчитывается с учетом выбранного Участником торгов / Участником клиринга тарифного плана.
- 39.8.1. Выбор или изменение тарифного плана по биржевым сделкам РЕПО осуществляется Участником торгов / Участником клиринга путем предоставления Клиринговому центру Заявления о выборе (смене) тарифного плана по сделкам РЕПО.

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

Тарифные планы по сделкам РЕПО или по сделкам купли-продажи акций применяются с первого числа календарного месяца, за исключением тарифного плана РЕПО_0 (по биржевым сделкам РЕПО) и Тарифного плана 1 (по биржевым сделкам купли-продажи акций), которые, в случае первоначального допуска к клиринговому обслуживанию, могут применяться с любого числа календарного месяца.

- 39.8.2. Заявления о выборе (смене) тарифного плана предоставляются Участником торгов / 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, за исключением случаев первоначального допуска к торгам / клиринговому обслуживанию.

- 39.8.3. Участником торгов / Участникам клиринга, не выбравшим ни один из тарифных планов по сделкам РЕПО или по сделкам купли-продажи акций, устанавливается тарифный план РЕПО_0 по биржевым сделкам РЕПО и/или Тарифный план 1 по биржевым сделкам купли-продажи акций, который, в случае первоначального допуска к торгам / клиринговому обслуживанию, устанавливается с даты допуска Участника торгов к торгам / Участника клиринга к клиринговому обслуживанию и действует до начала применения иного тарифного плана, выбранного Участником торгов / Участником клиринга.

- 39.9. В случае выбора Участником торгов / 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 определяемого для последнего в течение Расчетного дня Клирингового пула для расчетов в ходе торгов Нетто-обязательства по сделкам клирингового пула по денежным средствам по Счету для возмещения и комиссии, порядок определения которого установлен пунктом 10.7 Правил клиринга.

- 39.10. 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, порядок определения которого установлен пунктом 10.7.1 Правил клиринга, по окончании Торгов в дату заключения сделки обязательства по уплате указанного Комиссионного вознаграждения включается в состав определяемого для последнего в течение Расчетного дня Клирингового пула для расчетов в ходе торгов Нетто-обязательства по сделкам клирингового пула по денежным средствам по указанному Счету обеспечения.

- 39.11. Премия предоставляется по итогам календарного месяца Участникам торгов / Участникам клиринга, выполнившим условия, необходимые для получения премии, предусмотренные Тарифами Клирингового центра и Тарифами Биржи.

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

Премия перечисляется Участнику торгов / Участнику клиринга Биржей и Клиринговым центром на Счет для возмещения и комиссии, порядок выбора которого установлен пунктом 10.7 Правил клиринга, не позднее третьего Расчетного дня месяца, следующего за месяцем оказания клиринговых услуг.

- 39.12. Комиссионное вознаграждение по внебиржевым сделкам рассчитывается по окончании Торгов в дату регистрации Поручения на клиринг внебиржевой сделки, и включается в состав определяемого для последнего в течение Расчетного дня Клирингового пула для расчетов в ходе торгов Нетто-обязательства по сделкам клирингового пула по денежным средствам по Счету обеспечения Т0, соответствующего Торговому счету, указанному в Поручении на клиринг внебиржевой сделки (за исключением внебиржевых сделок, заключаемых в иностранной валюте).
- 39.13. Абонентская плата, определенная в соответствии с Тарифами Биржи, подлежит уплате Участником торгов 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 определяемого для последнего в течение Расчетного дня Клирингового пула для расчетов в ходе торгов Нетто-обязательства по сделкам клирингового пула по денежным средствам по Счету для возмещения и комиссии, порядок определения которого установлен пунктом 10.7 Правил клиринга.
- 39.14. Неустойка в пользу Биржи, установленная Правилами торгов, взимается Клиринговым центром в Расчетный день нарушения Участником торгов обязательства, за которое установлена соответствующая неустойка, и, по окончании Торгов в данный Расчетный день, включается в состав определяемого для последнего в течение Расчетного дня Клирингового пула для расчетов в ходе торгов Нетто-обязательства по сделкам клирингового пула по денежным средствам по Счету для возмещения и комиссии, порядок определения которого установлен пунктом 10.7 Правил клиринга.
- 39.15. 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 определяемого для последнего в течение Расчетного дня Клирингового пула для расчетов в ходе торгов Нетто-обязательства по сделкам клирингового пула по денежным средствам по Счету для возмещения и комиссии, порядок определения которого установлен пунктом 10.7 Правил клиринга.
- 39.16. Участник торгов / 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 торгов / Участником клиринга в бумажной форме.
- Заявление предоставляется Участником торгов / 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 торгов / Участником клиринга тарифного плана «Размещения-фиксированный» Участник торгов / 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 торгов / Участника клиринга о выборе тарифного плана «Размещения-фиксированный», в которых Участник торгов / 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 торгов / 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 торгов / Участника клиринга, выбравшего тарифный план «Размещения-фиксированный», не взимаются.

Комиссионное вознаграждение по тарифному плану «Размещения-фиксированный» подлежит уплате Участником торгов / 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 определяемого для последнего в течение Расчетного дня Клирингового пула для расчетов в ходе торгов Нетто-обязательства по сделкам клирингового пула по денежным средствам по Счету для возмещения и комиссии, порядок определения которого установлен пунктом 10.7 Правил клиринга.

- 39.17. Определенное в соответствии с Тарифами Технического центра, отличное от нуля Дополнительное вознаграждение, рассчитанное в отношении Участника торгов / Клиента, подлежит уплате Участником торгов в Расчетный день, по итогам которого указанное дополнительное вознаграждение рассчитано, и по окончании Торгов в данный Расчетный день, включается в состав определяемого для последнего в течение Расчетного дня Клирингового пула для расчетов в ходе торгов Нетто-обязательства по сделкам клирингового пула по денежным средствам по Счету обеспечения T0 / Счету обеспечения T+, входящему в состав Торгово-клирингового счета, с указанием которого Участником торгов в течение данного Расчетного дня были поданы заявки на заключение сделок за свой счет или за счет указанного Клиента, если такой Торгово-клиринговый счет – единственный, либо по Счету для возмещения и комиссии, порядок определения которого установлен пунктом 10.7 Правил клиринга, если Участником торгов в течение данного Расчетного дня были поданы заявки на заключение сделок за свой счет или за счет указанного Клиента с указанием нескольких Торгово-клиринговых счетов.
- 39.18. Участник клиринга исполняет обязательства по уплате комиссионных вознаграждений Биржи и Технического центра за Участников торгов, имеющих право подавать заявки с указанием Торгово-клиринговых счетов данного Участника клиринга.

39.19. Комиссионное вознаграждение Биржи и Технического центра по сделкам, клиринг по которым осуществляет иная клиринговая организация, рассчитывается при подаче заявки на заключение сделки, на его сумму уменьшается плановое значение позиции по денежным средствам, определяемая в отношении Счета для возмещения и комиссии, порядок определения которого установлен пунктом 10.7 Правил клиринга, по окончании Торгов в дату заключения сделки обязательства по уплате указанного Комиссионного вознаграждения включается в состав определяемого для последнего в течение Расчетного дня Клирингового пула для расчетов в ходе торгов Нетто-обязательства по сделкам клирингового пула по денежным средствам по указанному Счету обеспечения.

Клиринговый центр взимает Комиссионное вознаграждение Биржи и Технического центра по сделкам, клиринг по которым осуществляет иная клиринговая организация, только с Участников клиринга, являющихся Участниками торгов.

39.20. Обязательства Участника торгов / Участника клиринга по уплате Комиссионного вознаграждения и неустоек исполняются после исполнения иных обязательств Участника клиринга по денежным средствам, определенных в соответствии со статьей 34 Правил клиринга, за исключением обязательств по уплате Возмещения.

39.21. В случае недостаточности денежных средств на соответствующем Счете обеспечения T0 / Счете обеспечения T+ для исполнения обязательств Участника торгов / Участника клиринга по уплате Комиссионного вознаграждения, указанные обязательства исполняются в следующей очередности:

- в первую очередь исполняются обязательства по уплате неустойки, установленные Правилами торгов;
- 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 T0 / Счете обеспечения T+ для исполнения обязательств Участника торгов / 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;
- 8) Комиссионное вознаграждение Биржи и Технического центра по сделкам, клиринг по которым осуществляет иная клиринговая организация.

В случае недостаточности денежных средств на соответствующем Счете обеспечения T0 / Счете обеспечения T+ для исполнения обязательств Участника

торгов / 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.

Статья 40. Порядок представления отчетов по итогам клиринга

40.1. 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;
- 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 Участника клиринга;
- Отчет о Клиринговых идентификаторах Участника клиринга;
- Выписка из протокола внесения компенсационных взносов;
- Уведомление о замене Торгово-клирингового счета;
- Отчет об обязательствах по Сделкам Т+, содержащий информацию о допущенных к клирингу обязательствах по Сделкам Т+;
- Отчет об Итоговых нетто-обязательствах / нетто-требованиях, содержащий информацию об обязательствах по Сделкам Т+, 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;
- Отчет об обязательствах по передаче / требованиям по получению Дохода;
- Отчет о гарантийных фондах;
- Требование о погашении Задолженности;
- Отчет о Маржинальном требовании;
- Отчет о премии.

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

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

Указанный отчет направляется Участнику клиринга (для передачи их клиенту Участника клиринга) и/или уполномоченной им организации.

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.

- 40.3. 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.

- 40.4. 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.

- 40.5. Отчеты, указанные в пунктах 40.1 и 40.2 Правил клиринга, направляются Участнику клиринга (Держателю, Клиринговому банку) в форме электронных документов в соответствии с Порядком ЭДО.

- 40.6. Отчеты, направляемые в форме электронных документов, имеют категорию «В»² и составляются в текстовом формате (ASCII) в соответствии с Порядком ЭДО.

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

- 40.8. Участнику клиринга на основании его письменного запроса могут быть выданы повторно отчеты в бумажной форме или в форме электронных документов, а также

² Понятие категории электронного документа определяется в Правилах ЭДО

- отчеты, не предусмотренные пунктами 40.1 и 40.2 Правил клиринга (далее - нестандартные отчеты), в бумажной форме.
- 40.9. Для получения в бумажной форме отчетов, указанных в пункте 40.8 Правил клиринга, Участник клиринга обязан предоставить Клиринговому центру Доверенность на получение и предоставление документов.
- 40.10. Отчеты в бумажной форме или в форме электронных документов, указанные в пункте 40.8 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.
- 40.11. 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.
- 40.12. 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 41. Перевод обязательств и перевод Обеспечения клиента Участника клиринга от одного Участника клиринга другому Участнику клиринга

- 41.1. Клиринговый центр осуществляет перевод долга и уступку требований одного Участника клиринга (далее – Базовый Участник клиринга) по обязательствам по Сделкам Т+, учитываемым по Торгово-клиринговому счету, за которым закреплен Обособленный клиент (далее – Перевод обязательств), другому Участнику клиринга (далее – Участник клиринга – реципиент) при наличии Заявления на перевод обязательств (далее также – Заявление), предоставляемого Обособленным клиентом. В Заявлении должны быть указаны наименование Участника клиринга – реципиента, а также не менее чем одно из следующих оснований в отношении Базового Участника клиринга для осуществления Перевода обязательств:
- 41.1.1. основания, предусмотренные подпунктами 11.1.4, 11.1.6-11.1.11, пунктом 11.6 Правил клиринга;
 - 41.1.2. наличие дела о банкротстве в отношении Базового Участника клиринга в производстве арбитражного суда более 2 (двух) месяцев с момента подачи соответствующего заявления;
 - 41.1.3. нарушение Базовым Участником клиринга правил российских или иностранных организатора торгов или клиринговой организации;
 - 41.1.4. включение в повестку дня органов управления Базового Участника клиринга вопроса о ликвидации Базового Участника клиринга либо принятие решения органами управления Базового Участника клиринга о ликвидации Базового Участника клиринга;
 - 41.1.5. принятие органами управления Базового Участника клиринга решения о реорганизации Базового Участника клиринга (за исключением случаев реорганизации, которые не влекут прекращения деятельности Базового Участника клиринга);
 - 41.1.6. принятие судебного акта о взыскании, наложении ареста либо ином обременении в отношении имущества Базового Участника клиринга;
 - 41.1.7. наличие Задолженности Базового Участника клиринга, не погашенной в установленные Регламентом сроки;
 - 41.1.8. предоставление Базовым Участником клиринга Клиринговому центру поручения на перевод обязательств и Обеспечения.
- 41.2. Заявление на регистрацию ТКС для Обособленного клиента, предоставленное Базовым участником клиринга Клиринговому центру в порядке, предусмотренном подпунктом 10.6 Правил клиринга, является основанием для перевода Обеспечения, учитываемого по такому Торгово-клиринговому счету (далее – Перевод Обеспечения) при подаче соответствующим Обособленным клиентом Базового участника клиринга Заявления в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга.
- Перевод Обеспечения осуществляется одновременно с Переводом обязательств в порядке и на условиях, предусмотренных настоящей статьей Правил клиринга.

Подача Базовым Участником клиринга Заявления на регистрацию ТКС для Обособленного клиента является безусловным согласием Базового участника клиринга на перевод Клиринговым центром Участнику клирингу – реципиенту Обеспечения в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга, а также согласием на раскрытие Клиринговым центром Участнику клиринга – реципиенту информации о Базовом участнике, предусмотренной пунктом 41.6 Правил клиринга. Такое согласие не может быть отозвано Базовым Участником клиринга.

- 41.3. Перевод обязательств и Перевод Обеспечения не осуществляется:
- 41.3.1. в случае принятия решения арбитражного суда о введении в отношении Базового Участника клиринга – некредитной организации одной из процедур банкротства;
 - 41.3.2. в случае отзыва (аннулирования) Банком России лицензии на осуществление банковских операций у Базового Участника клиринга – кредитной организации;
 - 41.3.3. при отсутствии согласия Участника клиринга – реципиента, предусмотренного пунктом 41.7 Правил клиринга.
- 41.4. Заявление на перевод обязательств предоставляется Обособленным клиентом на бумажном носителе вместе с копией документа, подтверждающего полномочия лица, подписавшего Заявление (в случае если такой документ не был предоставлен Клиринговому центру ранее). подача Заявления на перевод обязательств является безусловным согласием Обособленного клиента на раскрытие Клиринговым центром Участнику клиринга – реципиенту информации, предусмотренной пунктом 41.6 Правил клиринга.
- 41.4.1. В случае если между Обособленным клиентом и Клиринговым центром предусмотрен обмен сообщениями с использованием Подсистемы ЭДО НКЦ, Обособленный клиент вправе направить Заявление на перевод обязательств в форме сообщения с использованием Подсистемы ЭДО НКЦ.
 - 41.4.2. Клиринговый центр не осуществляет проверку достоверности оснований для Перевода обязательств, указанных Обособленным клиентом в Заявлении. При этом Клиринговый центр вправе отказать Обособленному клиенту в исполнении Заявления на перевод обязательств при наличии информации об отсутствии указанных в Заявлении оснований.
 - 41.4.3. Клиринговый центр не несет ответственности за убытки, понесенные Базовым участником клиринга / Обособленным клиентом в случае исполнения / неисполнения Клиринговым центром Заявления, поданного Обособленным клиентом в соответствии с пунктом 41.1 Правил клиринга.
- 41.5. В случае если между Обособленным клиентом и Клиринговым центром предусмотрен обмен сообщениями с использованием Подсистемы ЭДО НКЦ, и Клиринговому центру стало известно о наступлении в отношении Базового Участника клиринга одного или нескольких оснований для Перевода обязательств, предусмотренных пунктом 41.1 Правил клиринга, а Заявление на перевод обязательств от Обособленного клиента, закрепленного за Торгово-клиринговым счетом Базового Участника клиринга, не получено, Клиринговый центр вправе сообщить Обособленному клиенту о наличии таких оснований путем направления сообщения с использованием Подсистемы ЭДО НКЦ.
- 41.6. При получении от Обособленного клиента Заявления на перевод обязательств и при отсутствии у Клирингового центра оснований для отказа в исполнении Заявления, Клиринговый центр передает с использованием Подсистемы ЭДО НКЦ

Участнику клиринга – реципиенту сообщение о размере обязательств / требований Базового Участника клиринга в денежных средствах / ценных бумагах по обязательствам по Сделкам Т+, а также о размере Обеспечения Базового Участника клиринга в денежных средствах / ценных бумагах, учитываемых по Торгово-клиринговому счету Базового Участника клиринга, за которым закреплен Обособленный клиент, предоставивший Заявление на перевод обязательств.

41.7. Участник клиринга – реципиент обязан предоставить Клиринговому центру согласие на прием обязательств / требований Базового Участника клиринга в денежных средствах / ценных бумагах, определенных в пункте 41.6 Правил клиринга (далее – Согласие на прием), не позднее 20:00 по московскому времени Расчетного дня получения от Клирингового центра информации в соответствии с пунктом 41.6 Правил клиринга. Указанное согласие направляется с использованием Подсистемы ЭДО НКЦ.

Предоставление указанного Согласия на прием является также согласием Участника клиринга – реципиента на перевод ему Обеспечения, определенного в пункте 41.6 Правил клиринга, и предоставляет Участнику клиринга – реципиенту право требовать от Клирингового центра перевода такого Обеспечения.

41.8. Для исполнения Заявления на перевод обязательств Клиринговый центр:

41.8.1. Незамедлительно после получения согласия Участника клиринга – реципиента в соответствии с пунктом 41.7 Правил клиринга уведомляет Биржу о необходимости установления запрета на подачу Участниками торгов заявок на заключение сделок, стороной по которым будет являться Базовый Участник клиринга, с указанием Торгово-клирингового счета, за которым закреплен Обособленный клиент, предоставивший Заявление на перевод обязательств, и о необходимости снятия таких зарегистрированных заявок.

41.8.2. После получения от Участника клиринга - реципиента Согласия на прием в соответствии с пунктом 41.7 Правил клиринга и до начала клиринговой сессии следующего Расчетного дня:

- регистрирует Торгово-клиринговый счет, за которым закреплен Обособленный клиент, предоставивший Заявление на перевод обязательств, за Участником клиринга - реципиентом;
- прекращает учитывать обязательства / требования Базового Участника клиринга в денежных средствах / ценных бумагах, определенные в пункте 41.6 Правил клиринга, как обязательства и требования Базового Участника клиринга в отношении Клирингового центра;
- начинает учитывать обязательства / требования Базового Участника клиринга в денежных средствах / ценных бумагах, определенные в пункте 41.6 Правил клиринга, как обязательства и требования Участника клиринга – реципиента в отношении Клирингового центра.

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

- 41.9.1. В случае если между Обособленным клиентом и Клиринговым центром предусмотрен обмен сообщениями с использованием Подсистемы ЭДО НКЦ или по системе S.W.I.F.T., Обособленный клиент вправе направить Заявление об отзыве в форме сообщения с использованием Подсистемы ЭДО НКЦ или по системе S.W.I.F.T.
- 41.10. Обособленный клиент вправе до получения Клиринговым центром от Участника клиринга – реципиента Соглашения на прием заменить первоначально указанного Участника клиринга – реципиента на другого Участника клиринга – реципиента путем направления Клиринговому центру Заявления на перевод обязательств с указанием наименования нового Участника клиринга – реципиента. Такое Заявление на перевод обязательств должно содержать сведения, предусмотренные пунктом 41.1 Правил клиринга и предоставляться в порядке, предусмотренном настоящей статьей Правил клиринга.
- 41.11. За осуществление процедур Перевода обязательств и Перевода Обеспечения с Участника клиринга – реципиента взимается плата в размере, установленном приложением № 2 к Правилам клиринга.
- 41.11.1. Порядок исполнения обязательства Участника клиринга – реципиента по внесению платы за осуществление процедур Перевода обязательств и Перевода Обеспечения определен в статье 39 Правил клиринга.

Статья 42. Порядок действий в случае включения Участника клиринга в перечень организаций, в отношении которых имеются сведения об их причастности к экстремистской деятельности или терроризму

- 42.1. В дату включения Участника клиринга в перечень, определенного в подпункте 11.5.6, Клиринговый центр незамедлительно:
- блокирует (замораживает) операции с денежными средствами / ценными бумагами, учитываемыми в качестве Обеспечения и взносов в Гарантийные фонды Участника клиринга, и иные операции такого Участника клиринга, предусмотренные Правилами клиринга;
 - прекращает допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию;
 - уведомляет Биржу о необходимости установления запрета на подачу Участниками торгов заявок на заключение сделок, стороной по которым будет являться Участник клиринга, и о необходимости снятия таких зарегистрированных заявок.
- 42.2. В дату включения Участника клиринга в перечень обязательства Участника клиринга, включенного в перечень, по сделкам, заключенным с Клиринговым центром, прекращаются полностью возникновением нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга, рассчитываемого в российских рублях как сумма с учетом знака:
- по каждой ценной бумаге суммы обязательств / требований по ценной бумаге по сделкам, заключенным с Клиринговым центром, по всем Разделам Участника клиринга, учитываемых на дату включения Участника клиринга в перечень, пересчитанной в российские рубли по Расчетной цене соответствующей ценной бумаги, установленной Клиринговым центром на дату включения Участника клиринга в перечень;
 - суммы обязательств / требований по денежным средствам по сделкам, заключенным с Клиринговым центром, по всем Счетам обеспечения

Участника клиринга, учитываемых на дату включения Участника клиринга в перечень.

При этом значения в иностранной валюте, рассчитанные в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга, пересчитываются в российские рубли по курсу, установленному Банком России на дату включения Участника клиринга в перечень.

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

- 42.3. Клиринговый центр вправе предъявить к Участнику клиринга требование о взыскании нетто-обязательства Участника клиринга, рассчитанного в порядке, предусмотренном пунктом 42.2 Правил клиринга.

Клиринговый центр вправе использовать средства Фонда финансовой стабильности, за исключением средств Участника клиринга, включенного в перечень, для исполнения указанного нетто-обязательства в порядке, предусмотренном статьей 33 Правил клиринга.

Статья 43. Порядок урегулирования обязательств в случае прекращения допуска к клиринговому обслуживанию

- 43.1. В случае отзыва (аннулирования) Банком России у Участника клиринга – кредитной организации лицензии на осуществление банковских операций, допуск к клиринговому обслуживанию и клиринговое обслуживание Участника клиринга – кредитной организации прекращается с даты отзыва (аннулирования) Банком России у такого Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций, за исключением расчета Клиринговым центром нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга – кредитной организации в соответствии с пунктом 43.4 Правил клиринга.

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

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

Указанные обязательства по Сделкам Т+ прекращаются возникновением нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга – кредитной организации, рассчитанного в соответствии с пунктом 43.4 Правил клиринга.

Указанные обязательства по сделкам купли-продажи с кодами расчетов В0-В30, сделкам РЕПО с кодами 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 43.7 Правил клиринга.

- 43.1.3. 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).

- 43.1.4. Клиринговый центр заключает сделки на основании пункта 17.7 Правил клиринга и/или внебиржевые сделки с целью обеспечения равенства суммы обязательств и суммы требований Клирингового центра по ценным бумагам по всем Датам исполнения и в порядке, предусмотренном пунктом 43.4 Правил клиринга, рассчитывает сумму нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга - кредитной организации.

- 43.1.5. Клиринговый центр направляет Участнику клиринга - кредитной организации, у которого отозвана (аннулирована) лицензия на осуществление банковских операций, уведомление о прекращении обязательств по сделкам в течение 3 (трех) рабочих дней, следующих за датой отзыва (аннулирования) такой лицензии. Указанное уведомление также содержит информацию о рассчитанном в соответствии с пунктом 43.4 Правил клиринга нетто-обязательстве / нетто-требовании Участника клиринга – кредитной организации в отношении Клирингового центра, а также о рассчитанных в соответствии с пунктом 43.7 Правил клиринга нетто-обязательствах / нетто-требованиях Участника клиринга – кредитной организации в отношении его контрагентов по сделкам купли-продажи с кодами расчетов В0-В30, сделкам РЕПО с кодами расчетов Rb, S0-S2, Z0.

Уведомления о прекращении обязательств по сделкам купли-продажи с кодами расчетов В0-В30, сделкам РЕПО с кодами 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 те же сроки.

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

- 43.1.6. Возврат денежных средств Участнику клиринга – кредитной организации осуществляется Клиринговым центром не позднее 3 (трех) рабочих дней с даты прекращения Договора об оказании клиринговых услуг, российских рублей - на корреспондентский счет Участника клиринга – кредитной организации, открытый в Банке России, иностранной валюты - по реквизитам Счета для возврата в соответствующей валюте, зарегистрированного для основного Расчетного кода

основного Регистрационного кода (идентификатора) Участника клиринга, или по реквизитам, указанным в письме о возврате денежных средств, в случае если это письмо получено Клиринговым центром от уполномоченного органа Участника клиринга до момента перечисления Участнику клиринга денежных средств в соответствии с настоящим подпунктом Правил клиринга.

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

Возврат денежных средств в российских рублях Участнику клиринга – кредитной организации осуществляется Клиринговым центром в сумме нетто-требования Участника клиринга, рассчитанного в порядке, предусмотренном пунктом 43.4 Правил клиринга, возврат денежных средств в иностранной валюте / ценных бумаг - в размере обязательств Клирингового центра по возврату Обеспечения / взносов в Гарантийные фонды Участника клиринга в соответствующей иностранной валюте / соответствующих ценных бумаг, оставшихся после определения нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в порядке, предусмотренном пунктом 43.4 Правил клиринга.

Ценные бумаги, оставшиеся на Разделах Участника клиринга после определения нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в порядке, предусмотренном пунктом 43.4 Правил клиринга, списываются с Разделов Участника клиринга без согласия Клирингового центра.

- 43.1.7. Клиринговый центр вправе предъявить к Участнику клиринга – кредитной организации требование о взыскании нетто-обязательства Участника клиринга, рассчитанного соответственно в порядке, предусмотренном пунктом 43.4 Правил клиринга, в общем порядке, предусмотренном законодательством о несостоятельности (банкротстве).
- 43.2. В случае назначения временной администрации или принятия арбитражным судом решения о введении в отношении Участника клиринга – некредитной организации одной из процедур банкротства, допуск к клиринговому обслуживанию и клиринговое обслуживание Участника клиринга – некредитной организации прекращается с даты назначения временной администрации или даты принятия арбитражным судом решения о введении в отношении Участника клиринга одной из процедур банкротства, в зависимости от того, какая дата наступила ранее, а допуск к клиринговому обслуживанию и клиринговое обслуживание Нерезидента – некредитной организации прекращается со дня, в который Клиринговый центр узнал о назначении временной администрации или принятии арбитражным судом решения о введении в отношении Нерезидента – некредитной организации одной из процедур банкротства, за исключением расчета Клиринговым центром нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в соответствии с пунктом 43.5 / 43.6 Правил клиринга.
- 43.2.1. Подтверждением факта назначения временной администрации или принятия арбитражным судом решения о введении в отношении Нерезидента – некредитной организации одной из процедур банкротства является письменное уведомление компетентного органа государства учреждения Нерезидента – некредитной организации, направленное Клиринговому центру (в том числе, посредством факсимильной связи), и/или размещенная на сайте компетентного органа государства учреждения Нерезидента – некредитной организации или на сайте Нерезидента – некредитной организации в сети Интернет информация о назначении временной администрации или принятии арбитражным судом решения

о введении в отношении Нерезидента – некредитной организации одной из процедур банкротства.

- 43.2.2. В случае назначения временной администрации или принятия арбитражным судом решения о введении в отношении Участника клиринга – некредитной организации одной из процедур банкротства, обязательства по сделкам прекращаются полностью в дату прекращения клирингового обслуживания или в Рабочий день, предшествующий дате принятия арбитражным судом решения о признании Участника клиринга банкротом и об открытии конкурсного производства, в зависимости от того, какая из указанных дат наступила ранее.

В случае назначения временной администрации или принятия арбитражным судом решения о введении в отношении Участника клиринга - Нерезидента – некредитной организации одной из процедур банкротства, обязательства по сделкам прекращаются полностью в дату прекращения клирингового обслуживания.

Указанные обязательства по Сделкам Т+ Участника клиринга – некредитной организации прекращаются возникновением нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга – некредитной организации, рассчитанных в соответствии с пунктом 43.5 Правил клиринга.

Указанные обязательства по Сделкам Т+ Участника клиринга – Нерезидента - некредитной организации прекращаются возникновением нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга – Нерезидента - некредитной организации, рассчитанных в соответствии с пунктом 43.6 Правил клиринга.

Указанные обязательства по сделкам купли-продажи с кодами расчетов В0-В30, сделкам РЕПО с кодами расчетов Rb, S0-S2, Z0 прекращаются возникновением нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга – некредитной организации / Участника клиринга – Нерезидента - некредитной организации в отношении других Участников клиринга – его контрагентов по указанным сделкам. Размер указанных нетто-обязательств / нетто-требований рассчитывается в соответствии с пунктом 43.7 Правил клиринга.

- 43.2.3. Клиринговый центр заключает сделки на основании пункта 17.7 Правил клиринга и/или внебиржевые сделки с целью обеспечения равенства суммы обязательств и суммы требований Клирингового центра по ценным бумагам по всем Датам исполнения и в порядке, предусмотренном пунктом 43.5 или пунктом 43.6 Правил клиринга, рассчитывает сумму нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга - некредитной организации / Участника клиринга – Нерезидента - некредитной организации.

- 43.2.4. Клиринговый центр направляет такому Участнику клиринга уведомление о прекращении обязательств по сделкам в течение 3 (трех) рабочих дней, следующих за датой прекращения обязательств по указанным сделкам. Указанное уведомление также содержит информацию о рассчитанной в соответствии с пунктом 43.5 / 43.6 Правил клиринга сумме нетто-обязательства или нетто-требования Участника клиринга в отношении Клирингового центра, а также о рассчитанных в соответствии с пунктом 43.7 Правил клиринга нетто-обязательствах / нетто-требованиях Участника клиринга в отношении его контрагентов по сделкам купли-продажи с кодами расчетов В0-В30, сделкам РЕПО с кодами расчетов Rb, S0-S2, Z0.

Уведомления о прекращении обязательств по сделкам купли-продажи с кодами расчетов В0-В30, сделкам РЕПО с кодами 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 - некредитной организации / Участника клиринга – Нерезидента - некредитной организации, в отношении которого назначена временная администрация или введена одна из процедур банкротства, по указанным сделкам, направляются указанным Участникам клиринга – контрагентам в те же сроки.

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

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

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

Возврат денежных средств в российских рублях Участнику клиринга осуществляется Клиринговым центром в сумме нетто-требования Участника клиринга, рассчитанного в порядке, предусмотренном пунктом 43.5 / 43.6 Правил клиринга, возврат денежных средств в иностранной валюте / ценных бумаг - в размере обязательств Клирингового центра по возврату Обеспечения / взносов в Гарантийные фонды Участника клиринга в соответствующей иностранной валюте / соответствующих ценных бумагах, оставшихся после определения нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в порядке, предусмотренном пунктом 43.5 / 43.6 Правил клиринга.

Ценные бумаги, оставшиеся на Разделах Участника клиринга после определения нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в порядке, предусмотренном пунктом 43.5 / 43.6 Правил клиринга, списываются с Разделов Участника клиринга без согласия Клирингового центра.

- 43.2.6. Клиринговый центр вправе предъявить к Участнику клиринга - некредитной организации требование о взыскании нетто-обязательства Участника клиринга, рассчитанного в порядке, предусмотренном пунктом 43.5 Правил клиринга, а также неустоек (штрафов, пеней), и комиссионных вознаграждений, подлежащих уплате в соответствии с Правилами клиринга, в общем порядке, предусмотренном законодательством о несостоятельности (банкротстве).
- 43.2.7. Клиринговый центр вправе предъявить к Участнику клиринга - Нерезиденту - некредитной организации требование о взыскании нетто-обязательства Участника клиринга, рассчитанного в порядке, предусмотренном пунктом 43.6 Правил клиринга, в общем порядке, предусмотренном законодательством о несостоятельности (банкротстве).

- 43.3. В случае отзыва (аннулирования) специального разрешения (лицензии или иного основания), выданного компетентным органом государства учреждения Банка-нерезидента, на основании которого Банк-нерезидент имеет право осуществлять банковские операции, предусмотренные личным законом Банка-нерезидента,

допуск к клиринговому обслуживанию и клиринговое обслуживание Участника клиринга – Банка-нерезидента прекращается со дня, в который Клиринговый центр узнал об отзыве (аннулировании) такого специального разрешения (лицензии или иного основания), за исключением расчета Клиринговым центром нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга – Банка-нерезидента в соответствии с пунктом 43.6 Правил клиринга.

- 43.3.1. Подтверждением факта отзыва (аннулирования) указанного специального разрешения (лицензии или иного основания), выданного компетентным органом государства учреждения Банка-нерезидента, является письменное уведомление компетентного органа государства учреждения Банка-нерезидента, направленное Клиринговому центру (в том числе, посредством факсимильной связи) и/или размещенная компетентным органом государства учреждения Банка-нерезидента на сайте вышеуказанного компетентного органа в сети Интернет информации о принятом решении об отзыве (аннулировании) выданного Банку-нерезиденту специального разрешения (лицензии или иного основания), в соответствии с которым Банк-нерезидент имеет право осуществлять банковские операции, предусмотренные национальным законодательством государства учреждения Банка-нерезидента, и/или направленное компетентным органом по электронному адресу Клирингового центра соответствующее электронное сообщение.
- 43.3.2. В случае отзыва (аннулирования) специального разрешения (лицензии или иного основания), выданного компетентным органом государства учреждения Банка-нерезидента, в соответствии с которым Банк-нерезидент имеет право осуществлять банковские операции, предусмотренные личным законом Банка-нерезидента, обязательства по сделкам, стороной по которым является Участник клиринга - Банк-нерезидент, прекращаются полностью на дату, в которую Клиринговый центр узнал об отзыве (аннулировании) компетентным органом государства учреждения Банка-нерезидента соответствующего специального разрешения (лицензии или иного основания).
- Указанные обязательства по Сделкам Т+ прекращаются возникновением нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга – Банка-нерезидента, рассчитанного в соответствии с пунктом 43.6 Правил клиринга.
- Указанные обязательства по сделкам купли-продажи с кодами расчетов В0-В30, сделкам РЕПО с кодами расчетов Rb, S0-S2, Z0 прекращаются возникновением нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга – Банка-нерезидента в отношении других Участников клиринга – его контрагентов по указанным сделкам. Размер указанных нетто-обязательств / нетто-требований рассчитывается в соответствии с пунктом 43.7 Правил клиринга.
- 43.3.3. Клиринговый центр заключает сделки на основании пункта 17.7 Правил клиринга и/или внебиржевые сделки с целью обеспечения равенства суммы обязательств и суммы требований Клирингового центра по ценным бумагам по всем Датам исполнения и в порядке, предусмотренном пунктом 43.6 Правил клиринга, рассчитывает сумму нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга - Банка-нерезидента.
- 43.3.4. Клиринговый центр направляет такому Участнику клиринга – Банку-нерезиденту уведомление о прекращении обязательств по сделкам не позднее третьего рабочего дня, следующего за датой прекращения обязательств по сделкам. Указанное уведомление также содержит информацию о рассчитанном в соответствии с пунктом 43.6 Правил клиринга нетто-обязательстве / нетто-требовании Участника клиринга – Банка-нерезидента в отношении Клирингового центра, а также о рассчитанных в соответствии с пунктом 43.7 Правил клиринга нетто-

обязательствах / нетто-требованиях Участника клиринга – Банка-нерезидента в отношении его контрагентов по сделкам купли-продажи с кодами расчетов В0-В30, сделкам РЕПО с кодами расчетов Rb, S0-S2, Z0.

Уведомления о прекращении обязательств по сделкам купли-продажи с кодами расчетов В0-В30, сделкам РЕПО с кодами расчетов Rb, S0-S2, Z0, содержащие информацию о рассчитанных в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга нетто-обязательствах / нетто-требованиях Участников клиринга - контрагентов такого Участника клиринга – Банка-нерезидента по указанным сделкам, направляются указанным Участникам клиринга – контрагентам в те же сроки.

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

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

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

Возврат денежных средств в российских рублях Участнику клиринга – Банку-нерезиденту осуществляется Клиринговым центром в сумме нетто-требования Участника клиринга, рассчитанного в порядке, предусмотренном пунктом 43.6 Правил клиринга, возврат денежных средств в иностранной валюте / ценных бумаг - в размере обязательств Клирингового центра по возврату Обеспечения / взносов в Гарантийные фонды Участника клиринга в соответствующей валюте / соответствующих ценных бумагах, оставшихся после определения нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в порядке, предусмотренном пунктом 43.6 Правил клиринга.

Ценные бумаги, оставшиеся на Разделах Участника клиринга после определения нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в порядке, предусмотренном пунктом 43.6 Правил клиринга, списываются с Разделов Участника клиринга без согласия Клирингового центра.

- 43.3.6. Клиринговый центр вправе предъявить к Участнику клиринга – Банку-нерезиденту требование о взыскании нетто-обязательства Участника клиринга, рассчитанного в порядке, предусмотренном пунктом 43.6 Правил клиринга, в общем порядке, предусмотренном законодательством о несостоятельности (банкротстве).

- 43.4. В случае отзыва (аннулирования) Банком России у Участника клиринга – кредитной организации лицензии на осуществление банковских операций Клиринговый центр рассчитывает размер нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в российских рублях в порядке, предусмотренном подпунктами 43.4.1-43.4.2 Правил клиринга:

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

- а) величины SUM, рассчитанной по формуле:

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

POS_RUB_i - сумма значений (с учетом знака) Нетто-обязательств / Нетто-требований Участника клиринга по денежным средствам по Сделкам Т+ с i-ой ценной бумагой по всем Счетам обеспечения Т+ и Датам исполнения, учитываемых на конец Расчетного дня, предшествующего дате отзыва (аннулирования) у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций;

POS_i – сумма значений (с учетом знака) Нетто-обязательств / Нетто-требований Участника клиринга по i-ой ценной бумаге по Сделкам Т+ по всем Разделам Т+ и Датам исполнения, учитываемых на конец Расчетного дня, предшествующего дате отзыва (аннулирования) у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций;

C_i – цена сделки / средневзвешенная цена сделок, заключенной / заключенных Клиринговым центром в соответствии с пунктом 43.1.4 Правил клиринга с i-ой ценной бумагой (в российских рублях);

\sum_i – сумма по ценным бумагам,

и

- б) значения (с учетом знака) обязательства / требования Участника клиринга в российских рублях по возврату Гарантийных переводов, рассчитанного на Расчетный день, предшествующий дате отзыва (аннулирования) у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций, и
- в) Задолженности (со знаком «минус») Участника клиринга в российских рублях, возникшей до даты отзыва (аннулирования) у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций, и
- г) обязательств Участника клиринга по передаче Дохода, не исполненных по состоянию на день отзыва (аннулирования) у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций (учитываются со знаком «минус»), и
- д) обязательства Клирингового центра по передаче Дохода Участнику клиринга, не исполненных по состоянию на день отзыва (аннулирования) у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций (учитываются со знаком «плюс»).

Если величина, рассчитанная в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга, положительная, это означает наличие нетто-требования Участника клиринга по отношению к Клиринговому центру, при этом расчет нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга прекращается, если отрицательная – расчет нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга продолжается в соответствии с подпунктом 43.4.2 Правил клиринга.

- 43.4.2. Клиринговый центр рассчитывает сумму с учетом знака отрицательной величины, рассчитанной в соответствии с подпунктом 43.4.1 Правил клиринга, и следующих величин, учитываемых на конец Расчетного дня, предшествующего дате отзыва (аннулирования) у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций, в следующей очередности и размере:

- 1) величины обязательств Клирингового центра по возврату Участнику клиринга его Обеспечения в российских рублях (учитываются со знаком «плюс»);
- 2) величины обязательства Клирингового центра по возврату Участнику

- клиринга его взносов в Гарантийные фонды в российских рублях в размере, равном минимальной из двух величин: (1) величине указанного обязательства или (2) величине текущего размера абсолютного значения отрицательной величины, рассчитанной в соответствии с настоящим подпунктом Правил клиринга (учитывается со знаком «плюс»);
- 3) величины, равной минимальной из двух величин: (1) величине обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга его Обеспечения в иностранной валюте, пересчитанной в российские рубли по курсу, установленному Банком России на день отзыва у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций, или (2) величине текущего размера абсолютного значения отрицательной величины, рассчитанной в соответствии с настоящим подпунктом Правил клиринга (учитывается со знаком «плюс»);
 - 4) величины, равной минимальной из двух величин: (1) величине обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга его взносов в Гарантийные фонды в иностранной валюте, пересчитанной в российские рубли по курсу, установленному Банком России на день отзыва у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций, или (2) величине текущего размера абсолютного значения отрицательной величины, рассчитанной в соответствии с настоящим подпунктом Правил клиринга (учитывается со знаком «плюс»);
 - 5) величины, равной минимальной из двух величин: (1) величине обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга его Обеспечения в ценных бумагах, пересчитанной в российские рубли по Расчетной цене соответствующей ценной бумаги, установленной Клиринговым центром на день отзыва у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций, или (2) величине текущего размера абсолютного значения отрицательной величины, рассчитанной в соответствии с настоящим подпунктом Правил клиринга (учитывается со знаком «плюс»);
 - 6) величины, равной минимальной из двух величин: (1) величине обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга его взносов в Гарантийные фонды в ценных бумагах, пересчитанной в российские рубли по Расчетной цене соответствующей ценной бумаги, установленной Клиринговым центром на день отзыва у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций, или (2) величине текущего размера абсолютного значения отрицательной величины, рассчитанной в соответствии с настоящим подпунктом Правил клиринга (учитывается со знаком «плюс»).

Расчет нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга прекращается, если в результате последовательного выполнения любого из действий, предусмотренных пунктами 1 - 6 настоящего подпункта Правил клиринга, полученное значение является неотрицательной величиной.

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

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

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

- 43.5. В случае назначения временной администрации или принятия арбитражным судом решения о введении в отношении Участника клиринга – некредитной организации одной из процедур банкротства (за исключением конкурсного производства), Клиринговый центр рассчитывает размер нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в российских рублях по состоянию на конец дня, в который назначена временная администрация или принято арбитражным судом решение о введении в отношении Участника клиринга - некредитной организации одной из процедур банкротства (за исключением конкурсного производства), в зависимости от того, какая из указанных дат наступила ранее, в порядке, аналогичном предусмотренному пунктом 43.4 Правил клиринга. В случае назначения временной администрации при расчете размера нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга учитываются комиссионные вознаграждения, а также неустойки (штрафы, пени), подлежащие уплате Участником клиринга в соответствии с Правилами клиринга.
- 43.5.1. В случае принятия арбитражным судом решения о признании Участника клиринга – некредитной организации банкротом и об открытии конкурсного производства, Клиринговый центр рассчитывает размер нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в российских рублях по состоянию на конец Расчетного дня, предшествующего дате принятия арбитражным судом решения о признании Участника клиринга банкротом и об открытии конкурсного производства, в порядке, аналогичном предусмотренному пунктом 43.4 Правил клиринга.
- 43.6. В случае отзыва (аннулирования) специального разрешения (лицензии или иного основания), выданного компетентным органом государства учреждения Банка-нерезидента, на основании которого Банк-нерезидент имеет право осуществлять банковские операции, предусмотренные личным законом Банка-нерезидента, или в случае назначения временной администрации или принятия арбитражным судом решения о введении в отношении Нерезидента – некредитной организации одной из процедур банкротства, Клиринговый центр рассчитывает размер нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в российских рублях по состоянию на конец дня, в который Клиринговый центр узнал об отзыве (аннулировании) у Участника клиринга специального разрешения (лицензии или иного основания) компетентного органа государства учреждения Банка-нерезидента / по состоянию на конец дня, в который Клиринговый центр узнал о назначении временной администрации или принятии арбитражным судом решения о введении в отношении Нерезидента – некредитной организации одной из процедур банкротства, в порядке, аналогичном предусмотренному пунктом 43.4 Правил клиринга, при этом при расчете размера нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга учитываются комиссионные вознаграждения, а также неустойки (штрафы, пени), подлежащие уплате Участником клиринга в соответствии с Правилами клиринга.

43.7. 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.

43.7.1. Обязательство (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 - обязательство (требование) Ликвиданта по денежным средствам в соответствующей валюте;

СТ - сумма требований, а **СО** – сумма обязательств Ликвиданта по денежным средствам, учитываемых на дату прекращения обязательств по сделкам, 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.

При этом сумма обязательств и требований по вторым частям сделок РЕПО рассчитывается исходя из фактического срока сделки РЕПО, прошедшего от фактической даты исполнения обязательств по первой части РЕПО до даты прекращения обязательств по сделкам.

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

43.7.2. Обязательство (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 - обязательство (требование) Ликвиданта по ценной бумаге;

СТЦ - сумма требований, а **СОЦ** – сумма обязательств Ликвиданта по соответствующей ценной бумаге, учитываемых на дату прекращения обязательств по сделкам, 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 обязательство Ликвиданта по ценной бумаге, положительное значение НОЦ - требование Ликвиданта по ценной бумаге.

43.7.3. Определенное в соответствии с подпунктом 43.7.1 Правил клиринга обязательство (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 43.7.1 Правил клиринга обязательством (требованием) 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 43.7.2 Правил клиринга

обязательством (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.

- 43.8. В случае отзыва (аннулирования) лицензии на осуществление банковских операций у Клирингового центра, обязательства по Сделкам T+, 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 43.9 Правил клиринга.

- 43.8.1. В случае отзыва (аннулирования) лицензии на осуществление банковских операций у Клирингового центра, обязательства по Сделкам T+, 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).

- 43.9. В случае отзыва (аннулирования) лицензии на осуществление банковских операций у Клирингового центра размер нетто-обязательства / нетто-требования Клирингового центра в российских рублях в отношении каждого Участника клиринга рассчитывается как сумма с учетом знака:

- по каждой ценной бумаге суммы Нетто-обязательств / Нетто-требований по Сделкам T+ по всем Разделам T+ и Датам исполнения по ценной бумаге, учитываемых на конец дня, предшествующего дате отзыва (аннулирования) у Клирингового центра на осуществление банковских операций, пересчитанной в российские рубли по Расчетной цене соответствующей ценной бумаги, установленной Клиринговым центром на день отзыва у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций;
- суммы Нетто-обязательств / Нетто-требований по Сделкам T+ по всем Счетам обеспечения T+ и Датам исполнения по денежным средствам Участника клиринга, учитываемых на конец дня, предшествующего дате отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций;
- 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»);

- взносов Участника клиринга в Гарантийные фонды в российских рублях (учитываются со знаком «плюс»);
- взносов Участника клиринга в Гарантийные фонды в иностранной валюте, пересчитанных в российские рубли по курсу, установленному Банком России на день отзыва у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций (учитываются со знаком «плюс»);
- взносов Участника клиринга в Гарантийные фонды в ценных бумагах, пересчитанных в российские рубли по Расчетной цене соответствующей ценной бумаги, установленной Клиринговым центром на день отзыва у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций;
- 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 (учитывается со знаком «минус») Участника клиринга в российских рублях, возникшей до даты отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций;
- обязательств Участника клиринга по передаче Дохода, не исполненных по состоянию на день отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций (учитываются со знаком «минус»).

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

43.10. Информация о размере нетто-обязательства / нетто-требования Клирингового центра в российских рублях в отношении Участника клиринга, определенных в соответствии с пунктом 43.9 Правил клиринга, направляется Клиринговым центром Участнику клиринга.

Статья 44. Взаимодействие с Биржей при возникновении обстоятельств, которые могут повлиять на возможность проведения Торгов

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

Статья 45. Чрезвычайные ситуации

45.1. Чрезвычайной ситуацией может быть признана ситуация, связанная с наступлением обстоятельств, препятствующих клиринговому обслуживанию Участников клиринга и/или исполнению Клиринговым центром своих обязательств перед Участниками клиринга по возврату им денежных средств, в том числе:

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

45.2. Признание ситуации чрезвычайной осуществляется по решению Клирингового центра.

45.3. 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.

45.4. 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 исключении из клирингового пула обязательств по некоторым или всем сделкам;

- об изменении способа, порядка и Даты исполнения обязательств Участниками клиринга и/или Клиринговым центром;
- 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.

- 45.5. 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.
- 45.6. 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.
- 45.7. 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 45.1 Правил клиринга.

Статья 46. Порядок разрешения споров

- 46.1. 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.
- 46.2. 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 (НДС не облагается)
1.	Клиринговое обслуживание Участников клиринга по биржевым сделкам с акциями, депозитарными расписками на акции, инвестиционными паями биржевых фондов и иностранных биржевых фондов (ETF), ипотечными сертификатами участия, а также иными видами ценных бумаг, за исключением ценных бумаг, предусмотренных разделом 3 (кроме сделок РЕПО, сделок с кодом расчетов К0)	
1.1.	Постоянная часть комиссионного вознаграждения	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 по сделкам с ценными бумагами, за исключением сделок, предусмотренных пп. 1.3,1.4	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
1.3.	На период до 30 июня 2014 года включительно обратная часть комиссионного	в процентах от объема каждой сделки, взимается в дату

	вознаграждения по сделкам с акциями иностранных эмитентов и депозитарными расписками иностранных эмитентов на акции, за исключением сделок, предусмотренных пп. 1.2,1.4	заклучения сделки с каждой стороны сделки, не менее 0,01 рубля
1.3.1.	Тарифный план 1	0,002125%
1.3.2.	Тарифный план 1а	0,002125% ¹
1.3.3.	Тарифный план 2	0,00197625%
1.3.4.	Тарифный план 2а	0,00197625% ¹
1.3.5.	Тарифный план 3	0,00180625%
1.3.6.	Тарифный план 3а	0,00180625% ¹
1.3.7.	Тарифный план 4	0,00159375%
1.3.8.	Тарифный план 4а	0,00159375% ¹
1.3.9.	Тарифный план 5	0,00138125%
1.3.10.	Тарифный план 5а	0,00138125% ¹
1.4.	Оборотная часть комиссионного вознаграждения по внутриброкерским сделкам², заключенным в режимах торгов «Режим переговорных сделок» и «РПС с ЦК» на основании заявок, поданных в период с 9:30 по 10:00 и с 18:45 по 19:00	в российских рублях за каждую сделку, взимается в дату заключения сделки с каждой стороны сделки
	для всех тарифных планов	0,15
2.	Комиссионное вознаграждение по биржевым сделкам с акциями с кодом расчетов К0, НДС не облагается	в процентах от объема каждой сделки, взимается в дату заключения сделки с каждой стороны сделки, не менее 0,01 рубля
		0,004%
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)	взимается в дату заключения сделки с каждой стороны сделки, не менее 0,01 рубля
3.1.	Комиссионное вознаграждение по биржевым сделкам с облигациями, еврооблигациями и депозитарными расписками на облигации, кроме сделок с облигациями, предусмотренных пунктом 3.2.	
3.1.1	по сделкам, заключенным в Режиме основных торгов	произведение 0,0000425% от объема сделки на срок до погашения ³ , но не более 0,00425% от объема сделки
3.1.2.	по сделкам, заключенным в Режиме переговорных сделок и Режиме торгов «Квал.Инвесторы – РПС»	произведение 0,0000425% от объема сделки на срок до погашения ³ , но не более 0,00425% от объема сделки и не более 765 рублей
3.1.3.	по сделкам, заключенным в Режиме торгов «Исполнения обязательств по срочным контрактам»	0,0007% от объема сделки
3.1.4.	по сделкам, заключенным в режимах торгов, отличных от Режиме основных торгов, Режиме переговорных сделок, Режиме торгов «Квал.Инвесторы – РПС» и Режиме торгов	произведение 0,0000425% от объема сделки на срок до погашения ³ , но не более 0,0053125% от объема сделки

	«Исполнения обязательств по срочным контрактам»	
3.2.	Комиссионное вознаграждение по биржевым сделкам с облигациями, включая еврооблигации, и депозитарными расписками на облигации, обязательства по погашению которых не исполнены (истек срок до погашения), или срок до погашения которых не установлен	
3.2.1.	по сделкам, заключенным в Режиме основных торгов	0,00425% от объема сделки
3.2.2.	по сделкам, заключенным в Режиме переговорных сделок и Режиме торгов «Квал. Инвесторы – РПС»	0,00425% от объема сделки и не более 765 рублей
3.2.3.	по сделкам, заключенным в Режиме торгов «Исполнения обязательств по срочным контрактам»	0,0007% от объема сделки
3.2.4.	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»	0,00425% от объема сделки, 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	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 REPO_0	0
4.1.2.	Тарифный план REPO_150	105 000
4.1.3.	Тарифный план REPO_500	350 000
4.1.4.	Тарифный план REPO_6500	4 550 000
4.1.5.	Тарифный план REPO_16250	11 375 000
4.1.6.	Тарифный план REPO_32500	22 750 000
4.2.	Оборотная часть комиссионного вознаграждения по биржевым сделкам РЕПО, за исключением Сделок Т+	взимается в дату заключения сделки РЕПО с каждой стороны сделки, не менее 1,40 рублей ¹
4.2.1.	Тарифный план REPO_0	произведение 0,00016800% от суммы РЕПО на срок сделки РЕПО ⁴
4.2.2.	Тарифный план REPO_150	произведение 0,00011900% от суммы РЕПО на срок сделки РЕПО ⁴
4.2.3.	Тарифный план REPO_500	произведение 0,00009100% от суммы РЕПО на срок сделки РЕПО ⁴
4.2.4.	Тарифный план REPO_6500	произведение 0,0000700% от суммы РЕПО на срок сделки РЕПО ⁴
4.2.5.	Тарифный план REPO_16250	произведение 0,0000490% от суммы РЕПО на срок сделки РЕПО ⁴
4.2.6.	Тарифный план REPO_32500	произведение 0,0000350% от суммы РЕПО на срок сделки РЕПО ⁴

4.3.	Оборотная часть комиссионного вознаграждения по биржевым сделкам РЕПО, являющимся Сделками T+	взимается в дату заключения сделки РЕПО с каждой стороны сделки, не менее 1,40 рублей ⁵
4.3.1.	Тарифный план REPO_0	произведение 0,000350% от суммы РЕПО на срок сделки РЕПО ⁴
4.3.2.	Тарифный план REPO_150	произведение 0,0002450% от суммы РЕПО на срок сделки РЕПО ⁴
4.3.3.	Тарифный план REPO_500	произведение 0,0001890% от суммы РЕПО на срок сделки РЕПО ⁴
4.3.4.	Тарифный план REPO_6500	произведение 0,0001470% от суммы РЕПО на срок сделки РЕПО ⁴
4.3.5.	Тарифный план REPO_16250	произведение 0,0001050% от суммы РЕПО на срок сделки РЕПО ⁴
4.3.6.	Тарифный план REPO_32500	произведение 0,0000700% от суммы РЕПО на срок сделки РЕПО ⁴
5.	Клиринговое обслуживание Участников клиринга по внебиржевым сделкам (кроме сделок РЕПО)	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 «Б1», «Б2» или «В», по внебиржевым сделкам РЕПО	произведение 0,00015% от суммы РЕПО на срок сделки РЕПО ⁴ , 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	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	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»	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 о выборе тарифного плана «Размещения-фиксированный», в которых Участник клиринга будет являться продавцом при осуществлении размещения или доразмещения (отчуждения первичным владельцем), а также в которых Участник клиринга будет являться покупателем при осуществлении выкупа	3 706 500
10.	Комиссионное вознаграждение за процедуру Перевода обязательств и Перевода Обеспечения	В российских рублях, за одну процедуру, взимается с Участника клиринга – реципиента, к которому были переведены обязательства и Обеспечение
		3 000 руб.

¹ - Участникам клиринга предоставляется премия при выполнении следующих условий и в следующем порядке:

- премия предоставляется Участникам клиринга, выбравшим тарифные планы 1а, 2а, 3а, 4а, 5а по внутриброкерским² биржевым сделкам купли-продажи акций, за исключением сделок, предусмотренных п.1.4;
- премия предоставляется Участникам клиринга по внутриброкерским² биржевым сделкам РЕПО, за исключением Сделок Т+;
- премия не предоставляется Участнику клиринга - Маркет-мейкеру по сделке с ценными бумагами, заключенной на основании заявки, поданной им во исполнение обязательств Маркет-мейкера;
- размер премии по сделке составляет 50% от суммы оборотной части комиссионного вознаграждения по сделке, уплаченной Участником клиринга, при этом размер премии по сделке РЕПО не превышает разности между суммой оборотной части комиссионного вознаграждения по сделке РЕПО и 1,40 рублями;
- премия по сделкам РЕПО предоставляется Участнику клиринга в случае, если ее размер по итогам календарного месяца равен или превышает 15 000 (пятнадцать тысяч) рублей (при этом размер премии, рассчитанной за предыдущие календарные месяцы, не учитывается);
- премия предоставляется по итогам календарного месяца и перечисляется Участнику клиринга не позднее третьего Расчетного дня месяца, следующего за месяцем оказания клиринговых услуг.

² - под внутриброкерской сделкой для целей настоящих тарифов понимается сделка, заключенная без участия Центрального контрагента, в которой обеими сторонами сделки является один Участник клиринга, или сделка, заключенная с Центральным контрагентом на основании двух встречных заявок, поданных одним Участником клиринга.

³ - срок до погашения - количество календарных дней от даты заключения сделки, не включая эту дату, до даты погашения облигации, включая эту дату.

⁴ - 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.

⁵ - положения о взимании минимального размера оборотной части комиссионного вознаграждения (1,40 рубля) не применяются к сделкам РЕПО, заключенным без подачи заявок в Режиме торгов «Исполнение обязательств по Сделкам Т+: РЕПО».

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) Анкета физического лица – бенефициарного владельца на бумажном носителе за подписью руководителя организации или иного уполномоченного лица (с приложением нотариально удостоверенной копии доверенности, подтверждающей полномочия лица на подписание данной анкеты) и печатью организации и в электронном виде.³
- 9) В отношении единоличного исполнительного органа (далее по тексту - руководитель):
 - нотариально удостоверенная копия письма территориального учреждения Банка России с подтверждением согласования кандидатуры руководителя

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

(только для кредитных организаций);

- нотариально удостоверенная копия письма Банка России с подтверждением согласования кандидатуры руководителя (для некредитных организаций – профессиональных участников рынка ценных бумаг);
- подлинник или нотариально удостоверенная копия решения уполномоченного органа юридического лица (также могут быть предоставлены нотариально удостоверенная выписка из решения или подлинник выписки, заверенный подписью лица, уполномоченного на подписание решения) об избрании 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).

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

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

11) Нотариально удостоверенная копия карточки с образцами подписей и оттиска печати юридического лица.

12) Подлинник или нотариально удостоверенная копия решения уполномоченного органа юридического лица (также могут быть предоставлены нотариально удостоверенная выписка из решения или подлинник выписки, заверенный подписью лица, уполномоченного на подписание решения) об одобрении сделок, заключаемых в соответствии с Правилами клиринга с Клиринговым центром, а также Договора об оказании клиринговых услуг в случае, если сделки/договор между юридическим лицом и Клиринговым центром в соответствии с требованиями действующего законодательства признаются сделками с заинтересованностью, в противном случае юридическое лицо предоставляет письмо об отсутствии признаков заинтересованности в указанных сделках (договорах).

13) Согласие лиц, указанных в документах юридического лица, направляемых им в Клиринговый центр в соответствии с Правилами клиринга, на обработку персональных данных по форме, размещенной на Сайте Клирингового центра (в

случае, если документы содержат персональные данные субъекта персональных данных в соответствии с Федеральным законом «О персональных данных» и если иное не вытекает из требований законодательства).

- 14) Иные документы, которые могут быть запрошены Клиринговым центром в необходимых случаях в целях, не противоречащих действующему законодательству Российской Федерации.
- 15) Если физическое лицо, на которое требуется предоставить копию документа, удостоверяющего личность, заверенную подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица, является иностранным гражданином (лицом без гражданства), то дополнительно необходимо представить:
 - заверенную печатью юридического лица и подписью уполномоченного лица юридического лица копию документа, подтверждающего право иностранного гражданина (лица без гражданства) на пребывание (проживание) в Российской Федерации (вид на жительство, разрешение на временное проживание, виза, иной документ, подтверждающий в соответствии с законодательством Российской Федерации право иностранного гражданина или лица без гражданства на пребывание (проживание) в Российской Федерации);
 - заверенную печатью юридического лица и подписью уполномоченного лица юридического лица копию миграционной карты;
 - письмо со сведениями об адресе места жительства (регистрации) или места пребывания (в случае если такая информация не содержится в иных документах, представленных в соответствии с настоящим списком).
- 16) Отчетность, указанную в пунктах 1) или 2) приложения № 5 к Правилам клиринга: для кредитных организаций - за три последних отчетных месяца (за исключением отчета о финансовых результатах), а отчет о финансовых результатах - 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) Анкета физического лица – бенефициарного владельца на бумажном носителе за подписью руководителя организации или иного уполномоченного лица (с приложением нотариально удостоверенной копии доверенности, подтверждающей полномочия лица на подписание данной анкеты) и печатью организации и в электронном виде.⁴
- 11) Если физическое лицо, на которое требуется предоставить копию документа, удостоверяющего личность, заверенную подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица, является иностранным гражданином (лицом без гражданства), то дополнительно необходимо представить:
 - заверенную печатью юридического лица и подписью уполномоченного лица копию документа, подтверждающего право иностранного гражданина (лица без гражданства) на пребывание (проживание) в Российской Федерации (вид на жительство, разрешение на временное проживание, виза, иной документ, подтверждающий в соответствии с

⁴ Сведения о бенефициарных владельцах не предоставляются в случаях, перечисленных в статье 7 Федерального закона от 07.08.2001 №115-ФЗ «О противодействии легализации (отмыванию) доходов, полученных преступным путем, и финансированию терроризма»

законодательством Российской Федерации право иностранного гражданина или лица без гражданства на пребывание (проживание) в Российской Федерации);

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

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) («Базель III») (форма 0409123) – ежемесячно;
 - отчет о финансовых результатах кредитной организации (форма 0409102) – ежеквартально;
 - справку о численном значении норматива максимального размера риска на одного заемщика или группу связанных заемщиков (Н6) (по данным формы 0409118) – ежемесячно;
 - квартальный отчет профессионального участника рынка ценных бумаг (форма №1100) – ежеквартально.

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

- 3) Участники клиринга обязаны предоставлять отчетность, указанную в пунктах 1) -2) настоящего приложения к Правилам клиринга, в следующие сроки:
 - расчет собственных средств (капитала) («Базель III») (форма 0409123) - не позднее 15 рабочего дня месяца, следующего за отчетным месяцем (кредитными организациями);
 - расчет размера собственных средств - не позднее одного календарного месяца, следующего за отчетным месяцем (некредитными организациями).
 - оборотную ведомость по счетам бухгалтерского учета (форма 0409101) - не позднее 15 рабочего дня месяца, следующего за отчетным месяцем;
 - отчет о финансовых результатах (форма 0409102) - не позднее 15 рабочего дня месяца, следующего за отчетным кварталом;
 - бухгалтерский баланс некредитной организации (форма 0710001), отчет о финансовых результатах некредитной организации (форма 0710002) - не позднее 45 (сорока пяти) календарных дней, следующих за отчетным кварталом, за исключением отчетности по состоянию на 1 января, которая предоставляется не позднее 15 апреля года, следующего за отчетным;
 - информацию об обязательных нормативах и о других показателях деятельности кредитной организации (форма 0409135), справку о численном значении норматива максимального размера риска на одного заемщика или

- группу связанных заемщиков (Н6) кредитной организации (по данным формы 0409118) - не позднее 15 рабочего дня месяца, следующего за отчетным месяцем;
- квартальный отчет профессионального участника рынка ценных бумаг (форма №1100) - за I квартал - не позднее 25 мая текущего года; за II квартал - не позднее 25 августа текущего года; за III квартал - не позднее 25 ноября текущего года; за IV квартал - не позднее 25 апреля следующего года..
- 4) Форматы предоставления отчетности, указанной в пунктах 1)-2) настоящего приложения к Правилам клиринга, определены Порядком предоставления информации и отчетности.
- 5) Банки-нерезиденты и Нерезиденты – некредитные организации предоставляют Клиринговому центру:
- финансовую отчетность по МСФО или US GAAP на русском или английском языке - не позднее 15 (пятнадцати) рабочих дней с даты сдачи ежеквартальной отчетности или с даты, определенной компетентным органом государства учреждения Нерезидента для сдачи отчетности (в случае если сроки сдачи отчетности устанавливаются компетентным органом государства учреждения Нерезидента),
 - документ, содержащий информацию о финансовых показателях, данные о величине и структуре активов и обязательств, финансовых результатах деятельности, величине собственных средств (капитала), отраженных в отчетности Нерезидента – ежеквартально (по форме, установленной внутренним документом Клирингового центра, размещенном на Сайте Клирингового центра);
 - документ, подтверждающий сведения о фактических и допустимых значениях обязательных нормативов деятельности, установленных компетентным органом государства учреждения Нерезидента – ежеквартально (в случае если в соответствии с личным законом Нерезидента такие обязательные нормативы устанавливаются);
 - заверенную аудитором финансовую отчетность по МСФО или US GAAP на русском или английском языке – ежегодно, не позднее 15 (пятнадцати) рабочих дней с даты подписания отчетности организацией, проводившей аудит.
- 6) Банки ЕврАзЭс не позднее 15 (пятнадцати) рабочих дней с даты сдачи ежемесячной или квартальной отчетности соответственно или с даты, определенной компетентным органом государства учреждения Банка ЕврАзЭс для сдачи ежемесячной или квартальной отчетности соответственно (в случае если сроки сдачи отчетности устанавливаются компетентным органом государства учреждения Банка ЕврАзЭс), предоставляют Клиринговому центру следующие документы, составленные на русском или английском языке:
- баланс в форме оборотной ведомости по счетам бухгалтерского учета по национальным стандартам государства учреждения Банка ЕврАзЭс бухгалтерского учета и отчетности - ежемесячно;
 - документ, содержащий информацию о финансовых показателях за отчетный месяц, данные о величине и структуре активов и обязательств, финансовых результатах деятельности, величине собственных средств (капитала), отраженных в отчетности Банка ЕврАзЭс – ежемесячно (по форме, установленной внутренним документом Клирингового центра, размещенном на Сайте Клирингового центра);

- документ, подтверждающий сведения о фактических и допустимых значениях обязательных нормативов деятельности, установленных компетентным органом – ежемесячно (в случае если в соответствии с национальным законодательством государства учреждения Банка ЕврАзЭс такие обязательные нормативы устанавливаются);
- отчет о прибылях и убытках по национальным стандартам бухгалтерского учета и отчетности - ежеквартально;
- расчет собственных средств (капитала) по национальным стандартам бухгалтерского учета и отчетности (в случае если в соответствии с национальным законодательством государства учреждения Банка ЕврАзЭс такой расчет устанавливается) – ежемесячно;
- финансовую отчетность по МСФО (при наличии) – ежеквартально.

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

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

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 Т+, 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	
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.	Направление Участникам клиринга отчетных документов по итогам клиринга (в соответствии со статьей 40 Правил клиринга) в форме электронных документов.	Не позднее времени, указанного в нормативных актах Банка России

Таблица 2

NN	НАИМЕНОВАНИЕ ОПЕРАЦИИ	ВРЕМЯ
1.	Проведение клиринговой сессии.	с 9:45 до 10:00
2.	Передача Клиринговым центром Участникам клиринга Отчетов о Маржинальном требовании, Требований о погашении задолженности, Отчетов об Обеспечении, Отчетов об обязательствах по Сделкам Т+.	до 10:15
3.	Исполнение Маржинальных требований.	до 17:30 дня возникновения Маржинального требования
4.	Погашение Задолженности, возникшей в связи с неисполнением обязательства по уплате Гарантийного перевода.	до 17:30 дня возникновения Задолженности
5.	Погашение Задолженности, возникшей в связи с неисполнением Итогового нетто-обязательства по денежным средствам.	до 19:00 Рабочего дня, следующего за днем возникновения

		Задолженности
6.	Исполнение Участниками клиринга Итоговых нетто-обязательств перед Клиринговым центром, определенных по обязательствам по Сделкам T+ с наступившей Датой исполнения, заключенным до 16:00 Даты исполнения.	до 16:00 Даты исполнения
7.	Исполнение Клиринговым центром Итоговых нетто-требований перед Участниками клиринга.	с 16:00 до 16:30 Даты исполнения
8.	Исполнение обязательств по сделкам, заключенным до 16:00 Даты исполнения и включенным в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов и Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов по сделкам с центральным контрагентом.	с 16:00 до 16:30 Даты исполнения
9.	Исполнение Участниками клиринга Итоговых нетто-обязательств перед Клиринговым центром, определенных по обязательствам по Сделкам T+ с наступившей Датой исполнения, заключенным с 16:00:01 до 18:00 Даты исполнения.	до 19:00 Даты исполнения
10.	Исполнение Клиринговым центром Итоговых нетто-требований перед Участниками клиринга.	с 19:00 до 19:30 Даты исполнения
11.	Исполнение обязательств по сделкам, заключенным с 16:00:01 до 19:00 Даты исполнения и включенным в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов и Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов по сделкам с центральным контрагентом.	с 19:00 до 19:30 Даты исполнения
12.	Передача Участником клиринга Клиринговому центру распоряжений на внесение денежных средств в Обеспечение (с использованием Клиринговой системы).	с 10:00 до 20:00 Расчетного дня
13.	Передача Участником клиринга Клиринговому центру Запросов о возврате денежных средств из Обеспечения.	с 10:00 до 20:00 Расчетного дня
14.	Передача Участником клиринга Клиринговому центру распоряжений на внесение ценных бумаг в Обеспечение (с использованием Клиринговой системы).	с 10:00 до 20:30 Расчетного дня
15.	Передача Участником клиринга Клиринговому центру Запросов о возврате ценных бумаг из Обеспечения (с использованием Клиринговой системы).	с 10:00 до 20:30 Расчетного дня
16.	Исполнение Участниками клиринга обязательств по уплате комиссионных вознаграждений по Сделкам T+, заключенным до 19:00.	до 19:00 дня заключения сделки
17.	Исполнение Участниками клиринга обязательств по уплате комиссионных вознаграждений по Сделкам T+, заключенным после 19:00.	до 19:00 Расчетного дня, следующего за днем заключения сделки
18.	Передача Обособленным клиентом Клиринговому центру Заявления на перевод обязательств.	с 10:00 до 19:00 Расчетного дня
19.	Передача Клиринговым центром Участнику клиринга – реципиенту сообщения о размере обязательств / требований Базового Участника клиринга в денежных средствах / ценных бумагах по обязательствам, допущенным к клирингу, а также о размере Обеспечения Базового Участника клиринга в денежных средствах / ценных бумагах, учитываемых по Торгово-клиринговому счету Базового Участника клиринга, за которым закреплен Обособленный клиент, предоставивший Заявление на перевод обязательств.	с 10:00 до 19:45 Расчетного дня
20.	Передача Участником клиринга – реципиентом Клиринговому центру Согласия на прием.	до 20:00 дня передачи информации в соответствии с п.19

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.

Позиция+ (или П+) - позиция по ценным бумагам по Разделу Т+, или позиция по денежным средствам по Счету обеспечения Т+. Изменение планового значения Позиции+ на определенную дату влечет за собой аналогичное изменение плановых значений Позиции+ на все последующие даты.

Позиция0 (или П0) - позиция по ценным бумагам, соответствующая Разделу Т0, и позиция по денежным средствам, соответствующая Счетам обеспечения Т0.

↑ - увеличение.

↓ - уменьшение.

1. Порядок установления и изменения позиций по денежным средствам

№	Операция	Значение позиции по денежным средствам (в соответствующей валюте)	
		Начальное	Плановое
1.	Исполнение Расчетной организацией распоряжения на перевод денежных средств с Торговых счетов на клиринговый банковский счет после получения от Расчетной организации выписки по Торговым счетам (S – сумма денежных средств, учитываемых на Торговом счете)	= S (П0)	= S (П0)
2.	Зачисление / списание денежных средств		
2.1.	Зачисление денежных средств на клиринговый банковский счет после увеличения суммы денежных средств на Торговом счете на сумму S	↑ на S (П0)	↑ на S (П0)
2.2.	Зачисление денежных средств на клиринговый банковский счет на сумму S в качестве Обеспечения	↑ на S (П+)	↑ на S (П+)
2.3.	Исполнение распоряжения Участника клиринга или Клирингового центра на внесение денежных средств в Обеспечение со Счета обеспечения Т0 с использованием Клиринговой системы		↓ на S (П0) ↑ на S (П+)
2.4.	Исполнение Запроса о возврате денежных средств из Обеспечения на Счет обеспечения Т0, поданного с использованием Клиринговой системы		↓ на S (П+) ↑ на S (П0)
2.5.	Исполнение Запроса о возврате денежных средств из Обеспечения на Счет для возврата денежных средств		↓ на S (П+)
2.6.	Списание в ходе Торгов денежных средств с Торгового счета на основании запроса Расчетной организации		↓ на S (П0)
2.7.	Возврат Обеспечения в размере Итогового нетто-требования Участника клиринга на основании Заявления о порядке использования денежных средств и ценных бумаг	↓ на S (П+) ↑ на S (П0)	↓ на S (П+) ↑ на S (П0)

3.	Регистрация и снятие заявок на заключение сделок с кодом расчетов T0, Z0, X0, Rb (за счет П0 или П+)		
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 купли-продажи или сделки РЕПО с кодом расчетов Z0, X0; X=S+K		↓ на X
3.3.	Регистрация заявки на продажу на заключение сделки купли-продажи или сделки РЕПО с кодом расчетов Z0, X0		↓ на K
3.4.	Регистрация заявки на покупку / продажу на заключение сделки с кодом расчетов B0 – B30, S0 – S2		↓ на K
3.5.	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
3.6.	Регистрация заявки на покупку на заключение сделки купли-продажи или сделки РЕПО с кодом расчетов Z0, X0 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 с кодом расчетов B0 – B30, S0 – S2 в иностранной валюте; S – в иностранной валюте, K – в российских рублях		↓ на K
3.8.	Регистрация заявки на продажу на заключение сделки с любым кодом расчетов в иностранной валюте; S – в иностранной валюте, K – в российских рублях		↓ на K
3.9.	Снятие заявки на покупку на заключение сделки с кодом расчетов T0, Rb в российских рублях; X=S+K		↑ на X
3.10.	Снятие заявки на покупку на заключение сделки купли-продажи или сделки РЕПО с кодом расчетов Z0, X0; X=S+K		↑ на X
3.11.	Снятие заявки на продажу на заключение сделки купли-продажи или сделки РЕПО с кодом расчетов Z0, X0		↑ на K
3.12.	Снятие заявки на покупку на заключение сделки купли-продажи или сделки РЕПО с кодом расчетов Z0, X0 в иностранной валюте; S – в иностранной валюте, K – в российских рублях		↑ на S ↑ на K
3.13.	Снятие заявки на покупку / продажу на заключение сделки с кодом расчетов B0 – B30, S0 – S2, в российских рублях и иностранной валюте		↑ на K
3.14.	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
3.15.	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.	Регистрация и снятие заявок на заключение сделок с кодом расчетов T0/Уп , по которой осуществляется клиринг с частичным обеспечением по денежным средствам и ценным бумагам (изменение позиций по первой части сделки РЕПО		

	осуществляется за счет П+)		
4.1.	Регистрация заявки на покупку на заключение сделки РЕПО с кодом расчетов T0/Yn в российских рублях		↓ на S (П+)
4.2.	Снятие заявки на покупку на заключение сделки РЕПО с кодом T0/Yn в российских рублях		↑ на S (П+)
5.	Регистрация и снятие заявок на заключение сделок с кодом расчетов T0/Yn , по которой осуществляется клиринг с полным обеспечением по денежным средствам и/или ценным бумагам (изменение позиций по первой части сделки РЕПО осуществляется за счет П+)		
5.1.	Регистрация заявки на покупку на заключение сделки РЕПО с кодом расчетов T0/Yn в российских рублях X – положительная разность сумм первой и второй части сделки РЕПО или 0		↓ на S (П+) ↓ на X (П+ дня T+n)
5.2.	Регистрация заявки на продажу на заключение сделки РЕПО с кодом расчетов T0/Yn в российских рублях X – положительная разность сумм второй и первой части сделки РЕПО или 0		↓ на X (П+ дня T+n)
5.3.	Снятие заявки на покупку на заключение сделки РЕПО с кодом T0/Yn в российских рублях X – положительная разность сумм первой и второй части сделки РЕПО или 0		↑ на S (П+) ↑ на X (П+ дня T+n)
5.4.	Снятие заявки на продажу на заключение сделки РЕПО с кодом T0/Yn в российских рублях X – положительная разность сумм второй и первой части сделки РЕПО или 0		↑ на X (П+ дня T+n)
6.	Регистрация и снятие заявок с кодом расчетов Yn, Y0/Yn, Y1/Yn , по которой осуществляется клиринг с полным обеспечением по денежным средствам и/или ценным бумагам		
6.1.	Регистрация заявки на покупку на заключение сделки с кодом расчетов Yn;		↓ на S (П+ дня T+n)
6.2.	Регистрация заявки на продажу на заключение сделки с кодом расчетов Y0/Yn, Y1/Yn; X – положительная разность сумм второй и первой части сделки РЕПО или 0		↓ на X (П+ дня T+n)
6.3.	Регистрация заявки на покупку на заключение сделки с кодом расчетов Y0/Yn, Y1/Yn; X – положительная разность сумм первой и второй части сделки РЕПО или 0		↓ на S (П+ дня T+0 или T+1 соответственно) ↓ на X (П+ дня T+n)
6.4.	Снятие заявки на покупку на заключение сделки с кодом расчетов Yn;		↑ на S (П+ дня T+n)
6.5.	Снятие заявки на продажу на заключение сделки с кодом расчетов Y0/Yn, Y1/Yn; X – положительная разность сумм второй и первой части сделки РЕПО или 0		↑ на X (П+ дня T+n)
6.6.	Снятие заявки на покупку на заключение сделки с кодом расчетов Y0/Yn, Y1/Yn; X – положительная разность сумм первой и второй части сделки РЕПО или 0		↑ на S (П+ дня T+0 или T+1 соответственно) ↑ на X (П+ дня T+n)
7.	Регистрация и снятие заявок на заключение сделок с кодом расчетов Yn, Y0/Yn, Y1/Yn , по которым		

	осуществляется клиринг с частичным обеспечением по денежным средствам и ценным бумагам		
7.1.	Позиции не изменяются		
8.	Заклучение сделок с кодом расчетов T0, Rb, K0 (за счет П0 или П+)		
8.1.	Заклучение сделки по заявке на продажу с кодом расчетов T0, Rb, K0, в российских рублях; $X = \text{Сделки} - \text{Ксделки}$		↑ на X
8.2.	Заклучение сделки по заявке на покупку с кодом расчетов T0, Rb, в российских рублях; $X = S - \text{Сделки} + (K - \text{Ксделки})$		↑ на X
8.3.	Заклучение сделки по заявке на покупку с кодом расчетов K0, в российских рублях; $X = \text{Сделки} + \text{Ксделки}$		↓ на X
8.4.	Заклучение сделки по заявке на продажу с кодом расчетов T0, K0, Rb в иностранной валюте; S – в иностранной валюте		↑ на S
8.5.	Заклучение 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
8.6.	Заклучение сделки по заявке на покупку с кодом расчетов K0 в иностранной валюте; Сделки – в иностранной валюте, Ксделки – в российских рублях		↓ на Сделки ↓ на Ксделки
9.	Заклучение сделок с кодом расчетов T0/Yn , по которым осуществляется клиринг с частичным обеспечением по денежным средствам и ценным бумагам (изменение позиций по первой части сделки РЕПО осуществляется за счет П+)		
9.1.	Заклучение сделки РЕПО с кодом расчетов T0/Yn в российских рублях, по первой части которой Участник клиринга является продавцом		↑ на S (П+)
10.	Заклучение сделки с кодом расчетов T0/Yn , по которой осуществляется клиринг с полным обеспечением по денежным средствам и/или ценным бумагам (изменение позиций по первой части сделки РЕПО осуществляется за счет П+)		
10.1.	Заклучение сделки РЕПО с кодом расчетов T0/Yn в российских рублях, по первой части которой Участник клиринга является покупателем X – положительная разность сумм второй и первой части сделки РЕПО или 0		↑ на X (П+)
10.2.	Заклучение сделки РЕПО с кодом расчетов T0/Yn в российских рублях, по первой части которой Участник клиринга является продавцом X – положительная разность сумм первой и второй части сделки РЕПО или 0		↑ на S (П+) ↑ на X (П+)
11.	Заклучение сделок с кодом расчетов Yn, Y0/Yn, Y1/Yn , по которой осуществляется клиринг с полным обеспечением по денежным средствам и/или ценным бумагам		
11.1.	Заклучение сделки с кодом расчетов Yn, по которой Участник клиринга является продавцом		↑ на S (П+ дня T+n)
11.2.	Заклучение сделки РЕПО с кодом расчетов с кодом расчетов		↑ на S (П+ дня

	Y0/Yn, Y1/Yn, по первой части которой Участник клиринга является продавцом; X – положительная разность сумм первой и второй части сделки РЕПО или 0		T+0 или T+1 соответственно) ↑ на X(Π+ дня T+n)
11.3.	Заключение сделки РЕПО с кодом расчетов Y0/Yn, Y1/Yn, по первой части которой Участник клиринга является покупателем; X – положительная разность сумм второй и первой части сделки РЕПО или 0		↑ на X(Π+ дня T+n)
12.	Заключение сделок с кодом расчетов Yn, Y0/Yn, Y1/Yn , по которым осуществляется клиринг с частичным обеспечением по денежным средствам и ценным бумагам		
12.1.	Позиции не изменяются		
13.	Регистрация и отзыв Отчетов на исполнение (за счет Π0 или Π+)		
13.1.	Регистрация в Клиринговой системе Отчета на исполнение, содержащего обязательство по оплате ценных бумаг		↓ на Сделки
13.2.	Отзыв из Клиринговой системы Отчета на исполнение, содержащего обязательство по оплате ценных бумаг		↑ на Сделки
13.3.	Прохождение Отчетом на исполнение, содержащим требование по оплате ценных бумаг, Процедуры контроля обеспечения		↑ на Сделки
13.4.	Регистрация в Клиринговой системе Специального отчета на исполнение, содержащего условное двустороннее нетто-обязательство по денежным средствам (X, X<0)		↓ на (-X)
13.5.	Отзыв из Клиринговой системы Специального отчета на исполнение, содержащего условное двустороннее нетто-обязательство по денежным средствам (X, X<0)		↑ на (-X)
13.6.	Прохождение Специальным отчетом на исполнение, содержащим условное двустороннее нетто-требование по денежным средствам (X, X>0), Процедуры контроля обеспечения		↑ на X
13.7.	Регистрация в Клиринговой системе Срочного отчета на исполнение, содержащего нетто-обязательство по денежным средствам (X, X<0)		↓ на (-X)
13.8.	Отзыв из Клиринговой системы Срочного отчета на исполнение, содержащего нетто-обязательство по денежным средствам (X, X<0)		↑ на (-X)
13.9.	Регистрация в Клиринговой системе Поручения на внесение компенсационного взноса в виде денежных средств		↓ на S
13.10.	Регистрация в Клиринговой системе Поручения на внесение компенсационного взноса в виде денежных средств Участником клиринга – контрагентом по сделке		↑ на S
13.11.	Регистрация в Клиринговой системе Поручения на проведение расчетов по поставке (по поставочным контрактам срочного рынка):		
13.11.1	по обязательствам участника клиринга по оплате поставки базового актива		↓ на S
13.11.2	по требованиям участника клиринга по оплате поставки базового актива		↑ на S
14.	Уплата Гарантийного перевода (по Счету обеспечения T+)		Π+
14.1.	Обязательство / требование по уплате / получению Гарантийного перевода		↓ на S / ↑ на S

15.	Расчеты по итогам клиринга по сделкам с кодом расчетов Z0 и Срочным отчетам на исполнение (осуществляется за счет П0 или П+)		
15.1.	Исполнение обязательства по оплате ценных бумаг или нетто-обязательства по денежным средствам в размере X	↓ на X	↓ на X
15.2.	Исполнение требования по оплате ценных бумаг или нетто-требования по денежным средствам в размере X	↑ на X	↑ на X
16.	Расчеты по итогам клиринга по сделкам, обязательства по которым включены в клиринговый пул для расчетов по итогам торгов (осуществляется за счет П0 или П+)		
16.1.	Исполнение Нетто-обязательства по денежным средствам по сделкам клирингового пула в размере X	↓ на X	↓ на X
16.2.	Исполнение Нетто-требования по денежным средствам по сделкам клирингового пула в размере X	↑ на X	↑ на X

2. Порядок установления и изменения позиций по ценным бумагам

№	Операция	Значение позиций депо (по каждому коду ценных бумаг)	
		Начальное	Плановое
1.	Получение от Расчетного депозитария выписки по Разделам (V0 – количество ценных бумаг, учитываемых на Разделах T0) (V+ – количество ценных бумаг, учитываемых на Разделах T+)	= V0 (П0) = V+ (П+)	= V0 (П0) = V+ (П+)
2.	Зачисление / списание ценных бумаг		
2.1.	Увеличение количества ценных бумаг, учитываемых на Разделах T0 или T+ на количество V в случаях зачисления ценных бумаг на соответствующий раздел Торгового счета депо.	↑ на V	↑ на V
2.2.	Исполнение распоряжения Участника клиринга или Клирингового центра на внесение ценных бумаг в Обеспечение с Раздела T0 с использованием Клиринговой системы		↓ на V (П0) ↑ на V (П+)
2.3.	Исполнение Запроса о возврате ценных бумаг из Обеспечения на Раздел T0, поданного с использованием Клиринговой системы		↓ на V (П+) ↑ на V (П0)
2.4.	Списание в ходе Торгов ценных бумаг с Разделов T0 или T+ на основании запроса Расчетного депозитария	↓ на V	↓ на V
2.5.	Возврат Обеспечения в размере Итогового нетто-требования Участника клиринга на основании Заявления о порядке использования денежных средств и ценных бумаг	↓ на V (П+) ↑ на V (П0)	↓ на V (П+) ↑ на V (П0)
3.	Регистрация и снятие заявок T0, Rb, T0/Yn, Z0, X0 (осуществляется за счет П0 или П+, в зависимости от того, какой Торгово-клиринговый счет указан в заявке)		
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 с кодом расчетов Z0, X0 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-		↑ на V

	продажи с кодом расчетов Z0, X0 или сделки РЕПО с кодом расчетов Z0 в российских рублях и иностранной валюте		
4.	Регистрация и снятие заявки с кодом расчетов Yn, Y0/Yn, Y1/Yn на заключение сделки , по которой осуществляется клиринг с полным обеспечением по денежным средствам и/или ценным бумагам		
4.1.	Регистрация заявки на продажу на заключение сделки с кодом расчетов Yn;		↓ на V (Π+ дня T+n)
4.2.	Снятие заявки на продажу на заключение сделки с кодом расчетов Yn;		↑ на V (Π+ дня T+n)
4.3.	Регистрация заявки на продажу на заключение сделки с кодом расчетов Y0/Yn, Y1/Yn;		↓ на V (Π+ дня T+0 или T+1 соответственно)
4.4.	Снятие заявки на продажу на заключение сделки с кодом расчетов Y0/Yn, Y1/Yn;		↑ на V (Π+ дня T+0 или T+1 соответственно)
5.	Заключение сделок T0, K0, Rb, T0/Yn, Z0, X0 (за счет Π0 или Π+)		
5.1.	Заключение сделки по заявке на покупку с кодом расчетов T0, K0, Rb, T0/Yn, X0		↑ на V
5.2.	Заключение сделки по заявке на продажу с кодом расчетов K0 в российских рублях и иностранной валюте		↓ на V
6.	Заключение сделки с кодом расчетов Yn, Y0/Yn, Y1/Yn , по которой осуществляется клиринг с полным обеспечением по денежным средствам и/или ценным бумагам .		
6.1.	Заключение сделки по заявке на покупку с кодом расчетов Yn		↑ на V (Π+ дня T+n)
6.2.	Заключение сделки по заявке на покупку (по 1-й части РЕПО) с кодом расчетов Y0/Yn, Y1/Yn		↑ на V (Π+ дня T+0 или T+1 соответственно)
7.	Регистрация и отзыв Отчетов на исполнение (за счет Π0 или Π+)		
7.1.	Регистрация в Клиринговой системе Отчета на исполнение, содержащего обязательство по передаче ценных бумаг		↓ на V
7.2.	Отзыв из Клиринговой системы Отчета на исполнение, содержащего обязательство по передаче ценных бумаг		↑ на V
7.3.	Прохождение Отчетом на исполнение, содержащим требование по передаче ценных бумаг, Процедуры контроля обеспечения		↑ на V
7.4.	Регистрация в Клиринговой системе Специального отчета на исполнение, содержащего условное двустороннее нетто-обязательство по ценным бумагам (X, X<0)		↓ на (-X)
7.5.	Отзыв из Клиринговой системы Специального отчета на исполнение, содержащего условное двустороннее нетто-обязательство по ценным бумагам (X, X<0)		↑ на (-X)
7.6.	Прохождение Специальным отчетом на исполнение, содержащим условное двустороннее нетто-требование по ценным бумагам (X), Процедуры контроля обеспечения		↑ на X
7.7.	Регистрация в Клиринговой системе Срочного отчета на исполнение, содержащего нетто-обязательство по ценным бумагам (X, X<0)		↓ на (-X)
7.8.	Отзыв из Клиринговой системы Срочного отчета на исполнение, содержащего нетто-обязательство по ценным бумагам (X, X<0)		↑ на (-X)

7.9.	Регистрация в Клиринговой системе Поручения на внесение компенсационного взноса в виде ценных бумаг		↓ на V
7.10.	Регистрация в Клиринговой системе Поручения на внесение компенсационного взноса в виде ценных бумаг Участником клиринга – контрагентом по сделке		↑ на V
7.11.	Регистрация в Клиринговой системе Поручения на проведение расчетов по поставке (по поставочным контрактам срочного рынка)		
7.11.1.	по обязательствам участника клиринга по поставке базового актива		↓ на V
7.11.2.	по требованиям участника клиринга по поставке базового актива		↑ на V
8.	Расчеты по итогам клиринга по сделкам с кодом расчетов Z0 и Срочным отчетам на исполнение (осуществляется за счет П0 или П+)		
8.1.	Исполнение обязательства по передаче ценных бумаг или нетто-обязательства по ценным бумагам в размере V	↓ на V	↓ на V
8.2.	Исполнение требования по передаче ценных бумаг или нетто-требования по ценным бумагам в размере V	↑ на V	↑ на V
9.	Расчеты по итогам клиринга по сделкам, обязательства по которым включены в клиринговый пул для расчетов по итогам торгов (осуществляется за счет П0 или П+)		
9.1.	Исполнение Нетто-обязательства по ценным бумагам по сделкам клирингового пула в размере V	↓ на V	↓ на V
9.2.	Исполнение Нетто-требования по ценным бумагам по сделкам клирингового пула в размере V	↑ на V	↑ на V

Приложение № 8
к Правилам клиринга ЗАО АКБ «Национальный
Клиринговый Центр» на рынке ценных бумаг

**Методика определения размера переменного взноса
в Фонд финансовой стабильности**

1. Общие положения

1.1. В настоящей Методике определения размера переменного взноса в Фонд финансовой стабильности (далее – Методика) используются следующие обозначения:

№	Параметры	Обозначение
1	Обозначение Торгового дня, по итогам которого определяются риск–параметры (подстрочный индекс)	i
2	Обозначение ценной бумаги (подстрочный индекс)	$instr$
3	Период для расчета переменных взносов	T
4	Параметр IM_i , рассчитанный по итогам Торгового дня i	IM_i
5	Место участника клиринга в рэнкинге дня i по размеру параметра IM_i	$rank$
6	Количество неисполнений Маржинальных требований Участником клиринга с наибольшим размером параметра IM_i в случае реализации стрессового сценария	Def
7	Коэффициент концентрации риска	C_i
8	Коэффициент, определяющий размер убытков в случае реализации стрессового сценария	$StressLoss$
9	Размер взноса Участника клиринга в Фонд финансовой стабильности, рассчитанный по итогам Торгового дня i	REQ_i
10	Минимальный шаг изменения размера взноса	$MinStep$
11	Среднее значение размера взноса Участника клиринга в Фонд финансовой стабильности, рассчитанное за Период для расчета переменных взносов	\overline{REQ}
12	Размер переменного взноса	$FloatREQ$

1.2. Значения параметров, указанных под номерами 6, 8 и 10 в пункте 1.1 Методики, устанавливаются решением Клирингового центра.

2. Порядок применения Методики

2.1. Размер переменного взноса рассчитывается Клиринговым центром в соответствии с Методикой не чаще 7 раз в год и не реже, чем 1 раз в 3 месяца, не позднее 10-го рабочего дня с даты, на которую производится расчет.

2.1.1. Стандартные даты, на которые производится расчет, определяются как ближайшие Торговые дни, предшествующие датам 1 января, 1 апреля, 1 июля и 1 октября.

2.1.2. Клиринговый центр может принять решение об изменении стандартной даты либо о расчете в дату, не являющуюся стандартной.

- 2.1.3. Решение Клирингового центра об изменении стандартной даты расчета взноса либо о расчете в дату, не являющуюся стандартной, раскрывается на Сайте Клирингового центра не позднее даты, на которую будет произведен расчет в соответствии с принятым решением.
- 2.2. Период для расчета переменных взносов (параметр T) принимается равным количеству Торговых дней со дня последнего расчета переменных взносов, но не менее двадцати Торговых дней.
- 2.3. Клиринговый центр в течение пяти рабочих дней, следующих за днем расчета переменных взносов, извещает Участника клиринга о новом значении размера переменного взноса в Фонд финансовой стабильности путем направления соответствующего уведомления в форме электронного документа.
- 2.4. В случае если новое значение размера переменного взноса Участника клиринга больше, чем предыдущее, Участник клиринга обязан в течение 5 (пяти) Расчетных дней со дня получения им уведомления, указанного в пункте 2.3 Методики, внести недостающие средства в Фонд финансовой стабильности в соответствии с порядком, установленным Правилами клиринга.
- При невыполнении Участником клиринга указанного требования, Клиринговый центр вправе приостановить допуск к клиринговому обслуживанию такого Участника клиринга в порядке, установленном Правилами клиринга.
- 2.5. В случае если новое значение размера переменного взноса Участника клиринга меньше, чем предыдущее, Участник клиринга вправе предоставить Клиринговому центру письменное требование о возврате денежных средств в сумме, превышающей установленный Клиринговым центром размер взноса в Фонд финансовой стабильности.

3. Порядок расчета размера взноса Участника клиринга в Фонд финансовой стабильности по итогам Торгового дня

- 3.1. По итогам Торгового дня i для каждого Участника клиринга рассчитывается параметр IM_i в соответствии с разделом 5 Методики.
- 3.2. После расчета параметра IM_i каждому Участнику клиринга присваивается порядковый номер $rank$, соответствующий месту Участника клиринга в рэнкинге дня i по размеру параметра IM_i (наибольшему значению параметра IM_i присваивается $rank$ равный «1»).
- 3.3. Коэффициент концентрации риска по итогам Торгового дня i (параметр C_i) рассчитывается на основе значений параметра IM_i Участников клиринга по формуле:

$$C_i = \frac{\sum_{rank \leq Def} IM_i^{rank}}{\sum_{rank \leq All} IM_i^{rank}},$$

где Def - количество неисполнений Маржинальных требований Участником клиринга с наибольшим размером параметра IM_i в случае реализации стрессового сценария.

- 3.4. Для каждого Участника клиринга по итогам Торгового дня i рассчитывается размер его вноса в Фонд финансовой стабильности по формуле:

$$REQ_i = IM_i \times MIN[8\%; StressLoss \times C_i]$$

4. Порядок расчета размера переменного вноса Участника клиринга

- 4.1. Для каждого Участника клиринга по совокупности Торговых дней i , вошедших в Период для расчета переменных взносов, рассчитывается среднее значение размера вноса Участника клиринга в Фонд финансовой стабильности (параметр \overline{REQ}) за Период для расчета переменных взносов (параметр T).

- 4.2. Размер переменного вноса Участника клиринга рассчитывается по формуле:

$$FloatREQ = MAX[\overline{REQ} - MinREQ; 0]$$

где $MinREQ$ – обязательный минимальный размер вноса в Фонд финансовой стабильности, установленный Правилами клиринга.

Величина $FloatREQ$ округляется вниз до величины, кратной $MinStep$.

5. Порядок расчета параметра IM_i

- 5.1. Для каждого Участника клиринга рассчитывается размер параметра IM_i по итогам Торгового дня i по формуле:

$$IM_i = SecRisk_i + IRRisk_i,$$

где $SecRisk_i$ - рыночный риск Участника клиринга,

$IRRisk_i$ - процентный риск Участника клиринга.

- 5.2. Рыночный риск Участника клиринга рассчитывается по формуле:

$$SecRisk_i = \sum_{instr} P_{instr} \times Val_{instr} \times S_{instr}(Val_{instr}),$$

где P_{instr} – Расчетная цена ценной бумаги $instr$ (для облигаций – цена с учетом НКД),

$S_{instr}(Val_{instr})$ – функция, определяющая эффективную Ставку обеспечения с учетом Лимитов концентрации, установленных для ценной бумаги $instr$ в соответствии с Методикой определения риск-параметров рынка ценных бумаг;

Val_{instr} – значение, определяемое по формуле:

$$Val_{instr} = MAX \left[\sum_{TKC} POS_{TKC}; 0; - \sum_{TKC} (POS_{TKC} + DEPO_{TKC}) \right], \text{ где}$$

POS_{TKC} - Нетто-обязательство и/или Нетто-требование по ценной бумаге $instr$ по Сделкам T+ по Торгово-клиринговому счету (с учетом знака),

$DEPO_{TKC}$ - Обеспечение в ценной бумаге $instr$ + по Торгово-клиринговому счету,

\sum - суммирование по всем Торгово-клиринговым счетам.

5.3. Функция $S(Val)$ для $Val > 0$ имеет следующий вид:

$$S(Val) = \frac{1}{Val} \times \left(\begin{aligned} &MIN[LK1; Val] \times S_{-1} + \\ &+ MIN[LK2 - LK1; MAX[Val - LK1; 0]] \times S_{-2} + \\ &+ MAX[Val - LK2; 0] \times S_{-3} \end{aligned} \right),$$

где S_{-1}, S_{-2}, S_{-3} – Ставки рыночного риска 1-го, 2-го и 3-го уровней,
LK1, LK2 – Лимиты концентрации 1-го, 2-го уровней.

5.4. Для $Val=0$ значение функции $S(Val)$ принимается равным нулю.

5.5. Процентный риск Участника клиринга рассчитывается по формуле:

$$IRRisk_i = \sum_{instr} abs \left[\sum_t Val_{instr}^t \times P_{instr} \times \left(1 + RR_{instr}^t \times \frac{t}{36500} \right) \times \Delta_{instr}(Val_{instr}^t) \times \frac{t}{36500} \right],$$

где P_{instr} – Расчетная цена ценной бумаги $instr$,

RR_{instr}^t - расчетная ставка РЕПО на срок t ,

$\Delta_{instr}(Val_{instr}^t)$ – функция, определяющая эффективную Ставку обеспечения процентного риска с учетом Лимитов концентрации, установленных для ценной бумаги $instr$ в соответствии с Методикой определения риск-параметров рынка ценных бумаг,

где Val_{instr}^t – значение, определяемое по формуле:

$$Val_{instr}^t = \sum_{TKC} POS_{TKC}^t, \text{ где}$$

POS_{TKC}^t - Нетто-обязательство и/или Нетто-требование по ценной бумаге $instr$ по Сделкам Т+ по Торгово-клиринговому счету с Датой исполнения t ,

Σ - суммирование по всем Торгово-клиринговым счетам.

5.6. Функция $\Delta(Val)$ для $Val > 0$ имеет следующий вид:

$$\Delta(Val) = \frac{1}{Val} \times \left(\begin{aligned} &MIN[LK1; Val] \times \Delta_{-1} + \\ &+ MIN[LK2 - LK1; MAX[Val - LK1; 0]] \times \Delta_{-2} + \\ &+ MAX[Val - LK2; 0] \times \Delta_{-3} \end{aligned} \right),$$

где $\Delta_{-1}, \Delta_{-2}, \Delta_{-3}$ – Ставки процентного риска 1-го, 2-го и 3-го уровней,
LK1, LK2 – Лимиты концентрации 1-го, 2-го уровней.

5.7. Для $Val=0$ значение функции $\Delta(Val)$ принимается равным нулю.