

Центральный Банк  
Российской Федерации (Банк России)  
**ЗАРЕГИСТРИРОВАНО**  
Дата 23 июня 2015 г.  
РБ-52-2/1308

УТВЕРЖДЕНЫ

Наблюдательным советом  
Банка «Национальный Клиринговый Центр»  
(Акционерное общество)

Протокол № 2 от 26 июня 2015 года

Председатель Наблюдательного совета  
Банка «Национальный Клиринговый Центр»  
(Акционерное общество)



Лыков С.П.

**ПРАВИЛА КЛИРИНГА  
БАНКА «НАЦИОНАЛЬНЫЙ КЛИРИНГОВЫЙ ЦЕНТР»  
(АКЦИОНЕРНОЕ ОБЩЕСТВО).  
ЧАСТЬ IV. ПРАВИЛА КЛИРИНГА НА ВАЛЮТНОМ РЫНКЕ И РЫНКЕ  
ДРАГОЦЕННЫХ МЕТАЛЛОВ**

г. Москва  
2015 г.

## **СОДЕРЖАНИЕ**

<b>РАЗДЕЛ I. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ .....</b>	<b>4</b>
Статья 1. Термины и определения .....	4
Статья 2. Общие положения .....	5
Статья 3. Особенности использования Аналога собственноручной подписи .....	7
Статья 4. Клиринговые регистры .....	7
<b>РАЗДЕЛ II. ТРЕБОВАНИЯ К УЧАСТНИКАМ КЛИРИНГА .....</b>	<b>9</b>
Статья 5. Условия клирингового обслуживания. Порядок предоставления допуска к клиринговому обслуживанию .....	9
Статья 6. Особенности регистрации Участников клиринга, порядок присвоения Участникам клиринга Расчетных кодов и Клиринговых идентификаторов .....	11
Статья 7. Особенности приостановления и прекращения допуска к клиринговому обслуживанию .....	12
<b>РАЗДЕЛ III. МЕРЫ, НАПРАВЛЕННЫЕ НА УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ ПРИ ОСУЩЕСТВЛЕНИИ КЛИРИНГА .....</b>	<b>14</b>
Статья 8. Перечень мер, направленных на управление рисками при осуществлении клиринга .....	14
Статья 9. Единый лимит и риск-параметры .....	15
Статья 10. Порядок подачи и исполнения Поручений на управление риском .....	18
<b>РАЗДЕЛ IV. ПОРЯДОК И УСЛОВИЯ ДОПУСКА ОБЯЗАТЕЛЬСТВ К КЛИРИНГУ ....</b>	<b>19</b>
Статья 11. Порядок взаимодействия с Биржей при подаче заявок и заключении Сделок .....	19
<b>РАЗДЕЛ V. ПОРЯДОК ПРОВЕДЕНИЯ КЛИРИНГА .....</b>	<b>24</b>
<b>ПОДРАЗДЕЛ V-I. ПОРЯДОК ВНЕСЕНИЯ И ВОЗВРАТА ОБЕСПЕЧЕНИЯ .....</b>	<b>24</b>
Статья 12. Порядок внесения Обеспечения .....	24
Статья 13. Порядок возврата Обеспечения .....	25
<b>ПОДРАЗДЕЛ V-II. КЛИРИНГОВЫЕ СЕССИИ .....</b>	<b>29</b>
Статья 14. Порядок проведения клиринговых сессий. Порядок возникновения и исполнения Маржинальных требований .....	29
Статья 15. Вариационная маржа и Гарантийные переводы .....	30
<b>ПОДРАЗДЕЛ V-III. ПОРЯДОК ОПРЕДЕЛЕНИЯ И ИСПОЛНЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ ПО СДЕЛКАМ .....</b>	<b>35</b>

Статья 16. Порядок исполнения / прекращения обязательств по Сделкам и обязательств по возврату Гарантийных переводов .....	35
Статья 17. Порядок действий в случае неисполнения обязательств по Сделкам .....	41
РАЗДЕЛ VI. ПОРЯДОК ОПЛАТЫ УСЛУГ. ОТЧЕТЫ ПО ИТОГАМ КЛИРИНГА .....	51
Статья 18. Порядок оплаты услуг Клирингового центра, Биржи и Технического центра .....	51
Статья 19. Порядок предоставления отчетов по итогам клиринга.....	55
РАЗДЕЛ VII. ПРОЧИЕ УСЛОВИЯ .....	58
Статья 20. Особенности перевода обязательств и Обеспечения одного Участника клиринга другому Участнику клиринга .....	58
Приложение № 1 Временной регламент на валютном рынке и рынке драгоценных металлов .....	59

## РАЗДЕЛ I. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ

Настоящие «Правила клиринга Банка «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество). Часть IV. Правила клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов» (далее – Правила клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов) являются неотъемлемой частью Правил клиринга Банка «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество) и совместно с «Правилами клиринга Банка «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество). Часть I. Общая часть» (далее – общая часть Правил клиринга) и «Правилами клиринга Банка «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество). Часть II. Тарифы» (далее – Тарифы Клирингового центра) регулируют отношения, связанные с исполнением сделок с иностранной валютой и драгоценными металлами, заключенных на торгах, организуемых ПАО Московская Биржа.

### Статья 1. Термины и определения

1.1. В Правилах клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов используются термины, определенные в общей части Правил клиринга, а также следующие термины:

<b>Биржевое свидетельство –</b>	документ, предоставляемый Клиринговым центром Участнику клиринга, содержащий информацию об Итоговых нетто-обязательствах и/или Итоговых нетто-требованиях, обязательстве / требовании Участника клиринга по возврату Гарантийных переводов.
<b>Гарантийный перевод -</b>	обеспечение Участника клиринга или Клирингового центра, рассчитываемое в порядке, предусмотренном Правилами клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов и являющееся обеспечением исполнения обязательств по Сделкам, заключенным между данным Участником клиринга и Клиринговым центром.
<b>Договор о взаимодействии -</b>	Договор о взаимодействии при проведении организованных торгов и осуществлении клиринга сделок с иностранной валютой и драгоценными металлами, заключенный между Банком России, Биржей и Клиринговым центром.
<b>Клиринговый идентификатор Участника клиринга (Клиринговый идентификатор) -</b>	уникальный буквенно-цифровой код, присваиваемый Участнику клиринга Клиринговым центром в целях совершения операций в Клиринговой системе.
<b>Методика определения риск-параметров валютного рынка и рынка драгоценных металлов -</b>	внутренний документ Клирингового центра, устанавливающий порядок определения риск-параметров валютного рынка и рынка драгоценных металлов ПАО Московская Биржа.
<b>Расчетная цена -</b>	цена, используемая для расчета вариационной маржи по своп контракту / фьючерсному контракту, определяемая в соответствии с Правилами клиринга на валютном рынке и

	рынке драгоценных металлов.
<b>Сделка -</b>	каждая из заключаемых на торгах Биржи сделок с иностранной валютой / драгоценным металлом, в т.ч. сделка спот, сделка своп, своп контракт или фьючерсный контракт.
<b>Система «Клиент-КлирингБанк» -</b>	автоматизированная система дистанционного банковского и клирингового обслуживания, предназначенная для осуществления электронного документооборота между Участниками клиринга и Клиринговым центром.
<b>Счет обеспечения в драгоценном металле -</b>	открытый в Клиринговом центре обезличенный металлический счет Участника клиринга, предназначенный для учета Обеспечения Участника клиринга в соответствующем драгоценном металле.
<b>Торговый лимит -</b>	величина (в российских рублях), ограничивающая сумму денежных средств Участника клиринга, учитываемых при расчете Единого лимита Участника клиринга; устанавливается на основании запроса Участника клиринга или на основании решения Клирингового центра в случаях и порядке, определенных Правилами клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.
<b>Уполномоченный участник клиринга -</b>	Участник клиринга, предоставляющий Клиринговому центру денежные средства путем заключения между ним и Клиринговым центром сделок своп в соответствии с Правилами клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов с целью исполнения Клиринговым центром своих обязательств по Сделкам перед Добросовестными участниками клиринга, а также в целях исполнения Клиринговым центром своих обязательств на других биржевых рынках, на которых Клиринговый центр осуществляет функции клиринговой организации и/или центрального контрагента.

## **Статья 2. Общие положения**

- 2.1. Клиринговый центр осуществляет клиринг, выполняя функции центрального контрагента по всем Сделкам, стороной по которым являются Участники клиринга.
- 2.2. Клиринговый центр осуществляет клиринг с частичным обеспечением и клиринг с полным обеспечением.
- 2.3. Клиринговый центр вправе принять решение об осуществлении по отдельным инструментам исключительно клиринга с полным обеспечением.
- 2.4. Клиринговый центр осуществляет клиринг с частичным обеспечением по Сделкам, заключенным Участниками клиринга категории «О» и «Б» по инструментам, по которым Клиринговым центром не принято решение об осуществлении исключительно клиринга с полным обеспечением.
- 2.5. Клиринговый центр осуществляет клиринг с полным обеспечением по валюте лота и сопряженной валюте:

- по Сделкам, заключенным Участниками клиринга категории «В»;
  - по Сделкам, заключенным Участниками клиринга категории «О» и «Б» по инструментам, по которым Клиринговым центром принято решение об осуществлении исключительно клиринга с полным обеспечением.
- 2.6. Клиринговый центр вправе установить признак «запрет коротких продаж» по иностранной валюте / драгоценному металлу.  
Признак «запрет коротких продаж» по иностранной валюте / драгоценному металлу означает, что по Сделкам с такой иностранной валютой / драгоценным металлом осуществляется клиринг с полным обеспечением по такой иностранной валюте / драгоценному металлу, а Нижняя граница диапазона оценки рыночных рисков по такой иностранной валюте / драгоценному металлу равна нулю.
- 2.7. Обеспечение Участника клиринга в иностранной валюте и/или драгоценных металлах является имуществом, переданным Участником клиринга Клиринговому центру для обеспечения исполнения обязательств Участника клиринга перед Клиринговым центром по Сделкам в соответствии с Правилами клиринга и для исполнения обязательств Участника клиринга перед Клиринговым центром по Сделкам, а также для обеспечения исполнения нетто-обязательств Участника клиринга, определяемых в порядке и случаях, установленных общей частью Правил клиринга.
- 2.8. Учет обязательств и Обеспечения Участника клиринга в драгоценных металлах осуществляется в граммах.
- 2.9. Обмен электронными документами между Участником клиринга и Клиринговым центром осуществляется посредством Подсистемы ЭДО НКЦ и/или системы S.W.I.F.T., порядок использования которых установлен общей частью Правил клиринга, и/или посредством системы «Клиент-КлирингБанк».
- 2.9.1. Порядок формирования и передачи электронных документов посредством системы «Клиент-КлирингБанк» предусмотрен Договором об участии в системе «Клиент-КлирингБанк» ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр», заключенным Участником клиринга с Клиринговым центром.
- 2.9.2. Электронные документы, направляемые посредством Системы «Клиент–КлирингБанк», формируются исключительно средствами Системы «Клиент–КлирингБанк» в формате, поддерживаемом программным обеспечением Системы «Клиент–КлирингБанк».
- 2.9.3. В случае несоответствия информации, содержащейся в электронном документе, направленном посредством Подсистемы ЭДО НКЦ, и электронном документе, направленном посредством системы «Клиент-КлирингБанк», и электронном документе, направленном посредством системы S.W.I.F.T., Участники клиринга и Клиринговый центр в первую очередь руководствуются информацией, содержащейся в электронном документе, направленном посредством Подсистемы ЭДО НКЦ, во вторую - посредством системы «Клиент-КлирингБанк», в третью - посредством системы S.W.I.F.T.
- 2.10. Формы и форматы документов, предоставляемых Участниками клиринга и/или их клиентами Клиринговому центру в соответствии с Правилами клиринга на

валютном рынке и рынке драгоценных металлов и способ их предоставления установлены документом «Формы и форматы документов, предоставляемых Участниками клиринга, клиентами Участников клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов», если иное не установлено Правилами клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.

- 2.11. Сроки исполнения обязательств, определенных Правилами клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, время проведения клиринговых сессий, а также сроки проведения клиринговых операций, сроки предоставления документов Клиринговому центру / Клиринговым центром в процессе взаимодействия с Участниками клиринга при проведении клиринга и расчетов по Сделкам в соответствии с Правилами клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, установлены Временным регламентом на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, являющимся приложением № 1 к Правилам клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.
- 2.12. Техническим центром на валютном рынке и рынке драгоценных металлов является ПАО Московская Биржа.

### **Статья 3. Особенности использования Аналога собственноручной подписи**

- 3.1. Аналогом собственноручной подписи признается Клиринговый идентификатор, позволяющий однозначно идентифицировать Участника клиринга или Клиринговый центр, направивших электронное сообщение и достоверно установить, что электронное сообщение исходит от Участника клиринга или Клирингового центра, которому присвоен данный Клиринговый идентификатор.
- 3.2. Присвоение Клирингового идентификатора Участнику клиринга или Клиринговому центру осуществляется Клиринговым центром.  
Порядок присвоения Клирингового идентификатора Участнику клиринга определен пунктом 6.6 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.  
Включение информации о Клиринговом идентификаторе Участника клиринга в состав ежедневного Отчета о Клиринговых идентификаторах, считается уведомлением о присвоении Клирингового идентификатора Участнику клиринга.  
Сведения о присвоенных Клиринговых идентификаторах относятся к конфиденциальным. Участник клиринга и Клиринговый центр обеспечивают соблюдение требований о конфиденциальности и несут риск последствий, связанных с нарушением таких требований.

### **Статья 4. Клиринговые регистры**

- 4.1. Клиринговый центр осуществляет внутренний учет, предусмотренный Законом о клиринге, на клиринговых регистрах. Клиринговые регистры ведутся Клиринговым центром в Клиринговой системе.
- 4.2. При осуществлении клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов на клиринговых регистрах Клиринговый центр учитывает:

- Единый лимит по Расчетным кодам;
  - Торговый лимит каждого Участника клиринга, для которого указанный Торговый лимит установлен, в разрезе Расчетных кодов;
  - обязанности и требования Участника клиринга по каждому обязательству по Сделке, допущенному к клирингу;
  - совокупность Поручений на управление риском;
  - обязательства Участников клиринга и Клирингового центра по уплате вариационной маржи / Гарантийных переводов в разрезе Расчетных кодов;
  - обязательства Участников клиринга и Клирингового центра по возврату Гарантийных переводов в разрезе Расчетных кодов;
  - Нетто-обязательства / Нетто-требования Участника клиринга с каждой Датой исполнения в каждой валюте и каждом драгоценном металле в разрезе Расчетных кодов;
  - Итоговое нетто-обязательство / Итоговое нетто-требование Участника клиринга в каждой валюте и каждом драгоценном металле в разрезе Расчетных кодов;
  - Обеспечение Участника клиринга в каждой валюте и каждом драгоценном металле в разрезе Расчетных кодов;
  - Маржинальное требование Участника клиринга в разрезе Расчетных кодов (в случае наличия).
- 4.3. Обеспечение Участника клиринга в российских рублях и иностранной валюте по Расчетному коду учитывается по Счетам обеспечения в соответствующей валюте, соответствующим Расчетному коду.
- 4.4. Порядок ведения клиринговых регистров определен в соответствующих статьях разделов IV и V Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.

## **РАЗДЕЛ II. ТРЕБОВАНИЯ К УЧАСТНИКАМ КЛИРИНГА**

### **Статья 5. Условия клирингового обслуживания. Порядок предоставления допуска к клиринговому обслуживанию**

- 5.1. На валютном рынке и рынке драгоценных металлов Участникам клиринга могут быть присвоены следующие категории Участников клиринга:
- Участники клиринга категории «А»;
  - Участники клиринга категории «О»;
  - Участники клиринга категории «Б»;
  - Участники клиринга категории «В».
- 5.2. Допуск к клиринговому обслуживанию на валютном рынке и рынке драгоценных металлов предоставляется Участнику клиринга, соответствующему требованиям, установленным для соответствующей категории Участников клиринга в общей части Правил клиринга, а также требованиям, указанным в пунктах 5.3 или 5.4 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.
- 5.3. Для допуска к клиринговому обслуживанию Участник клиринга категории «Б» должен дополнительно соответствовать следующему требованию:
- 5.3.1. Участник клиринга - Некредитная организация имеет собственные средства (капитал) не менее 180 000 000 (ста восьмидесяти миллионов) российских рублей.
- 5.4. Для допуска к клиринговому обслуживанию Участник клиринга категории «О» должен дополнительно соответствовать следующим требованиям:
- 5.4.1. иметь собственные средства (капитал) не менее, чем 50 000 000 000 (пятьдесят миллиардов) российских рублей, либо
- 5.4.2. иметь собственные средства (капитал) не менее, чем 20 000 000 000 (двадцать миллиардов) российских рублей и рейтинг по международной шкале долгосрочной кредитоспособности по обязательствам в российских рублях или в иностранной валюте не ниже, чем на один уровень меньше суверенного рейтинга Российской Федерации, либо
- 5.4.3. иметь собственные средства (капитал) не менее, чем 20 000 000 000 (двадцать миллиардов) российских рублей при условии, что рейтинг организации, имеющей право прямо или косвенно осуществлять контроль за деятельностью Участника клиринга, по международной шкале долгосрочной кредитоспособности по обязательствам в российских рублях или в иностранной валюте не ниже, чем на один уровень меньше суверенного рейтинга Российской Федерации.
- 5.4.4. иметь лицензию Банка России на осуществление банковских операций со средствами в рублях и иностранной валюте и/или лицензию на осуществление клиринговой деятельности (для Участников клиринга – Резидентов).
- 5.4.5. Для проверки соответствия собственных средств (капитала) Участника клиринга – Нерезидента требованиям, установленным подпунктами 5.4.1-5.4.3 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, размер собственных средств (капитала) Участника клиринга – Нерезидента в иностранной валюте

пересчитывается в российские рубли по курсу иностранной валюты к российскому рублю, установленному Банком России на первое число календарного квартала предоставления Участником клиринга Заявления о предоставлении допуска к клиринговому обслуживанию с категорией «О».

5.5. Клиринговый центр вправе запросить у Участника клиринга, предоставившего Клиринговому центру Заявление о предоставлении допуска к клиринговому обслуживанию с категорией «О» или Заявление об изменении категории Участника клиринга на категорию «О»:

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

5.6. Клиринговый центр вправе запросить у Участника клиринга, соответствующего требованиям подпункта 5.4.3 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов и предоставившего Клиринговому центру Заявление о предоставлении допуска к клиринговому обслуживанию с категорией «О» или Заявление об изменении категории Участника клиринга на категорию «О», письмо, выданное организацией, имеющей право прямо или косвенно осуществлять контроль за деятельностью Участника клиринга, содержащее:

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

Указанное в настоящем пункте Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов письмо может быть предоставлено на русском или английском языке.

5.7. На основании анализа информации и/или документов, полученных Клиринговым центром от Участника клиринга в соответствии с пунктами 5.5 и 5.6 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, или в случае непредоставления указанной информации и/или документов, Клиринговый центр вправе отказать Участнику клиринга в исполнении Заявления о предоставлении допуска к клиринговому обслуживанию с категорией «О» или Заявления об изменении категории Участника клиринга на категорию «О».

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

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

## **Статья 6. Особенности регистрации Участников клиринга, порядок присвоения Участникам клиринга Расчетных кодов и Клиринговых идентификаторов**

6.1. Процедура регистрации Участника клиринга Клиринговым центром предусматривает присвоение Участнику клиринга следующего идентификатора, помимо кодов, установленных общей частью Правил клиринга:

- основной Идентификатор (присваивается Клиринговым центром). Если Участник клиринга является Участником торгов, Идентификатор присваивается на основании данных, полученных от Биржи.

6.1.1. Клиринговым центром Участнику клиринга могут быть присвоены дополнительные Идентификаторы. При этом для каждого Участника клиринга устанавливается однозначное соответствие всех Идентификаторов коду Участника клиринга, присвоенному в соответствии с общей частью Правил клиринга.

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

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

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

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

По Сделкам, заключенным с указанием Расчетного кода с признаком «запрет коротких продаж», осуществляется клиринг с полным обеспечением по валюте лота.

По Сделкам, заключенным с указанием Расчетного кода с признаком «запрет необеспеченных покупок», осуществляется клиринг с полным обеспечением по сопряженной валюте.

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

6.5. Расчет Единого лимита, определение Нетто-обязательств / Нетто-требований, Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований, Задолженностей

Участника клиринга, проверка возможности регистрации заявок, перечисление и учет денежных средств и драгоценных металлов Участника клиринга, исполнение (прекращение) обязательств по Сделкам, возникновение и прекращение Маржинального требования, уплата комиссионных вознаграждений осуществляется по Расчетному коду Участника клиринга.

- 6.6. Участнику клиринга, получившему допуск к клиринговому обслуживанию, Клиринговым центром присваиваются Клиринговые идентификаторы на основании Заявления о присвоении Клирингового идентификатора, предоставленного Участником клиринга Клиринговому центру.
- 6.6.1. Клиринговый идентификатор соответствует одному Идентификатору Участника клиринга. Одному Идентификатору Участника клиринга может соответствовать более одного Клирингового идентификатора.
- 6.6.2. 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.
- 6.6.3. Клиринговый центр информирует Участника клиринга о присвоенном ему Клиринговом идентификаторе не позднее рабочего дня, следующего за днем присвоения Клирингового идентификатора, путем включения информации о Клиринговом идентификаторе Участника клиринга в состав ежедневного Отчета о Клиринговых идентификаторах.
- 6.6.4. Аннулирование присвоенного Участнику клиринга Клирингового идентификатора по инициативе Участника клиринга осуществляется на основании Заявления об аннулировании Клирингового идентификатора, предоставленного Участником клиринга Клиринговому центру.

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

## **Статья 7. Особенности приостановления и прекращения допуска к клиринговому обслуживанию**

- 7.1. Клиринговый центр вправе установить Участнику клиринга категории «Б» категорию «В» по основаниям, предусмотренным общей частью Правил клиринга, а также в следующем случае:
  - 7.1.1. при несоответствии размера собственных средств (капитала) Участника клиринга требованию, установленному подпунктом 5.3.1 Правил клиринга.
- 7.2. Клиринговый центр вправе установить по всем Расчетным кодам Участника клиринга категории «О» признак «запрет коротких продаж» и признак «запрет необеспеченных покупок» по основаниям, предусмотренным общей частью Правил клиринга в качестве оснований приостановления допуска к клиринговому

обслуживанию, а также:

- 7.2.1. при несоответствии размера вноса Участника клиринга в Гарантийный фонд размеру, установленному в соответствии с пунктом 8.3 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов;
- 7.2.2. при несоответствии размера Обеспечения под стресс Участника клиринга размеру, установленному в соответствии с пунктом 8.4 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов;
- 7.2.3. при несоответствии Участника клиринга требованиям, установленным подпунктом 5.4.1, или подпунктом 5.4.2, или подпунктом 5.4.3 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.  
При этом в целях проверки соответствия собственных средств (капитала) Участника клиринга – Нерезидента требованиям, установленным подпунктами 5.4.1-5.4.3 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, размер собственных средств (капитала) Участника клиринга – Нерезидента в иностранной валюте пересчитывается в российские рубли по курсу иностранной валюты к российскому рублю, установленному Банком России на первое число каждого календарного квартала.
- 7.3. В случае если действие оснований для установления Участнику клиринга категории «О» признака «запрет коротких продаж» и признака «запрет необеспеченных покупок» не прекращено в течение 3-х рабочих дней после установления указанного признака в соответствии с пунктами 7.2, 8.5 или 8.6 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, Клиринговый центр вправе приостановить допуск к клиринговому обслуживанию Участника клиринга категории «О», начиная с 4-го рабочего дня с даты установления указанного признака.
- 7.4. Клиринговый центр вправе установить Участнику клиринга категории «О» категорию «Б» в случае, если в течение 2-х (двух) лет с даты присвоения Участнику клиринга категории «О» Участник клиринга не предоставил Клиринговому центру информацию ни об одном Участнике торгов, который вправе подавать заявки с указанием Расчетных кодов данного Участника клиринга, в соответствии с пунктом 6.2 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.
- 7.5. Клиринговый центр прекращает допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию (независимо от его категории) по любому из оснований, предусмотренных общей частью Правил клиринга, а также:
  - 7.5.1. отзыв (аннулирование) Банком России лицензии на осуществление клиринговой деятельности у Участника клиринга категории «О».

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

#### **Статья 8. Перечень мер, направленных на управление рисками при осуществлении клиринга**

- 8.1. В целях снижения рисков, связанных с осуществлением клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, Клиринговый центр применяет меры, предусмотренные общей частью Правил клиринга.
- 8.2. Предельная доля иностранной валюты, принимаемой в Обеспечение Участника клиринга, составляет 100%.  
Предельная доля драгоценных металлов, принимаемых в Обеспечение Участника клиринга, составляет 100%.
- 8.2.1. Клиринговый центр вправе установить ограничение на предельную сумму иностранной валюты / предельное количество драгоценного металла, принимаемого в Обеспечение Участника клиринга, путем установления равной нулю любой из Нижних границ диапазона оценки рыночных рисков по такой иностранной валюте / драгоценному металлу для отдельного Участника клиринга или для всех Участников клиринга.
- 8.3. Гарантийный фонд формируется Клиринговым центром за счет взносов в Гарантийный фонд всех Участников клиринга категорий «О» и «Б».  
Размер взноса в Гарантийный фонд каждого Участника клиринга категорий «О» и «Б» составляет 3 000 000 (три миллиона) российских рублей.
- 8.4. Обеспечение под стресс обязаны вносить Участники клиринга категорий «О» и «Б».  
Порядок определения размера Обеспечения под стресс Участника клиринга установлен Методикой определения размера Обеспечения под стресс.
- 8.5. При неисполнении Участником клиринга Маржинального требования по фондам и/или Маржинального требования по обеспечению под стресс, порядок выставления и исполнения которых определен общей частью Правил клиринга:
- Участнику клиринга категории «Б» устанавливается категория «В»;
  - Участнику клиринга категории «О» по всем Расчетным кодам Участника клиринга устанавливается признак «запрет коротких продаж» и признак «запрет необеспеченных покупок».
- 8.6. При использовании взноса Участника клиринга в Гарантийный фонд валютного рынка и рынка драгоценных металлов и/или Обеспечения под стресс на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, Участнику клиринга категории «Б» устанавливается категория «В», Участнику клиринга категории «О» по всем Расчетным кодам Участника клиринга устанавливается признак «запрет коротких продаж» и признак «запрет необеспеченных покупок».
- 8.7. В случае возмещения Недобросовестным участником клиринга средств Гарантийного фонда валютного рынка и рынка драгоценных металлов и

Обеспечения под стресс на валютном рынке и рынке драгоценных металлов в течение 1 (одного) Расчетного дня после направления Клиринговым центром такому Недобросовестному Участнику клиринга Маржинального требования по фонду и/или Маржинального требования по Обеспечению под стресс, Участнику клиринга категории «В» устанавливается категория «Б», Участнику клиринга категории «О» снимается признак «запрет коротких продаж» и признак «запрет необеспеченных покупок».

8.8. Выделенный капитал Клирингового центра на валютном рынке и рынке драгоценных металлов составляет 2 500 000 000 (два миллиарда пятьсот миллионов) российских рублей.

## **Статья 9. Единый лимит и риск-параметры**

9.1. 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.

9.2. Единый лимит Участника клиринга используется для проверки возможности подачи Участником торгов заявок на заключение Сделок, стороной по которым будет являться Участник клиринга, возврата Участнику клиринга Обеспечения в денежных средствах / драгоценных металлах, а также выполнения иных операций, предусмотренных Правилами клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов. Указанная проверка осуществляется, исходя из анализа изменения значения Единого лимита Участника клиринга до и после проведения операции.

9.3. Единый лимит Участника клиринга рассчитывается с учетом:

- Обеспечения Участника клиринга в российских рублях, Обеспечения Участника клиринга в иностранной валюте и драгоценных металлах, за исключением иностранной валюты, по Сделкам с которой осуществляется только клиринг с полным обеспечением;
- Нетто-обязательств / Нетто-требований Участника клиринга в российских рублях / иностранной валюте / драгоценных металлах, за исключением иностранной валюты, по Сделкам с которой осуществляется только клиринг с полным обеспечением;
- совокупности действующих Поручений на управление риском, поданных Участником клиринга;
- обязательств по уплате комиссионных вознаграждений, учитываемых по Расчетному коду;
- задолженности Участника клиринга перед Клиринговым центром в российских рублях;
- корректировки Единого лимита с учетом Индикативных курсов сделок своп.

9.4. В случае если для Участника клиринга установлен Торговый лимит, размер Обеспечения Участника клиринга в российских рублях и стоимость в российских

рублях Обеспечения Участника клиринга в иностранной валюте и/или драгоценных металлах, учитываемая при расчете Единого лимита Участника клиринга, ограничивается величиной Торгового лимита такого Участника клиринга, который устанавливается в следующем порядке:

- 9.4.1. Торговый лимит Участника клиринга устанавливается на основании Запроса об установлении Торгового лимита, направляемого Участником клиринга в Клиринговый центр, или на основании решения Клирингового центра, принимаемого в связи с наличием фактов ухудшения финансового состояния Участника клиринга и/или информации, дающей основания считать возможным ухудшение финансового состояния Участника клиринга.
- 9.4.2. Запрос об установлении Торгового лимита исполняется Клиринговым центром, начиная с первого Торгового дня, следующего за датой предоставления указанного запроса.  
Запрос об установлении Торгового лимита действует до его отмены Участником клиринга.
- 9.4.3. Торговый лимит Участника клиринга на основании решения Клирингового центра устанавливается, начиная с первого Торгового дня, следующего за датой принятия указанного решения, если иное не указано в решении Клирингового центра.  
Торговый лимит Участника клиринга, установленный на основании решения Клирингового центра, действует до отмены указанного решения.
- 9.4.4. В случае установления Торгового лимита Участника клиринга на основании решения Клирингового центра, Запросы об установлении Торгового лимита Участника клиринга не исполняются.
- 9.5. Единый лимит Участника клиринга в ходе торгов рассчитывается Клиринговым центром с учетом:
- поданных Участником торгов и зарегистрированных заявок на заключение Сделок, по которым осуществляется клиринг с частичным обеспечением, стороной которых будет являться Участник клиринга;
  - поданных Участником торгов и зарегистрированных заявок на покупку на заключение Сделок, по которым осуществляется клиринг с полным обеспечением, стороной которых будет являться Участник клиринга.
- 9.6. Базовыми риск-параметрами, используемыми Клиринговым центром для контроля и управления рисками, являются:
- Центральный курс;
  - Верхняя и Нижняя границы ценового коридора;
  - Верхняя и Нижняя границы диапазона оценки рыночных рисков;
  - Центральное значение Индикативного курса сделок своп;
  - Верхнее и Нижнее значения Индикативного курса сделок своп.
- Помимо базовых риск-параметров Клиринговым центром используются дополнительные риск-параметры, приведенные в Методике определения риск-параметров валютного рынка и рынка драгоценных металлов.
- 9.7. Верхняя и Нижняя границы диапазона оценки рыночных рисков и Верхнее и

Нижнее значения Индикативного курса сделок своп, используемые при расчете Единого лимита Участника клиринга, зависят от объема обязательств Участника клиринга по Сделкам.

- 9.8. Клиринговый центр вправе установить индивидуальные Верхние и Нижние границы диапазона оценки рыночных рисков и Верхние и Нижние значения Индикативного курса сделок своп, расширяющие указанные диапазоны, для одного или нескольких Участников клиринга.
- 9.9. Участник клиринга категории «О» или «Б» вправе с использованием Клиринговой системы установить индивидуальные Верхние и Нижние границы диапазона оценки рыночных рисков и Верхние и Нижние значения Индикативного курса сделок своп, расширяющие указанные диапазоны, для определенных Расчетных кодов Участника клиринга.
- 9.10. Расчет и изменение риск-параметров осуществляется Клиринговым центром каждый Расчетный день по состоянию на 19:00 по московскому времени.  
Клиринговый центр может принять решение об изменении риск-параметров до начала и в ходе торгов.  
Изменения риск-параметров в ходе торгов, проводимых после 19:00 по московскому времени, не производится.  
Порядок расчета и изменения риск-параметров установлен Методикой определения риск-параметров валютного рынка и рынка драгоценных металлов.
- 9.11. Единый лимит Участника клиринга рассчитывается Клиринговым центром исходя из оценки в российских рублях максимально возможного уменьшения в течение срока, необходимого для прекращения обязательств по Сделкам в случае неисполнения Участником клиринга Маржинального требования, общей стоимости активов и обязательств Участника клиринга, указанных в пункте 9.3, в связи с изменением Центральных курсов и/или изменением процентных ставок по сделкам своп.  
При расчете Единого лимита Участника клиринга обязательства по Сделкам, которые могут быть заключены на основании зарегистрированных заявок, Нетто-обязательства и Задолженности учитываются со знаком «минус», требования по Сделкам, которые могут быть заключены на основании зарегистрированных заявок, Нетто-требования и Обеспечение – со знаком «плюс».  
Для целей расчета Единого лимита Участника клиринга Нетто-обязательства и Нетто-требования Участника клиринга в одной валюте / в одном и том же драгоценном металле с разными Датами исполнения складываются с учетом знака.  
Указанная оценка проводится с использованием Верхних и Нижних границ диапазона оценки рыночных рисков и верхних и нижних значений Индикативного курса сделок своп.  
Рассчитанный в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов Единый лимит корректируется (складывается с учетом знака) с итоговой корректировкой Единого лимита с учетом Индикативных курсов сделок своп, рассчитанной как сумма с учетом знака корректировок Единого лимита с учетом Индикативных курсов сделок своп по каждой валюте / драгоценному металлу и каждой Дате исполнения, отстоящей от

текущей даты более, чем на 1 (один) Расчетный день.

## **Статья 10. Порядок подачи и исполнения Поручений на управление риском**

- 10.1. В целях оптимизации расчета Единого лимита с учетом сделок, заключенных Участником клиринга на срочном рынке Биржи, Участник клиринга вправе предоставить Клиринговому центру Поручение на управление риском.  
Для получения указанной возможности Участник клиринга обязан заблаговременно предоставить Клиринговому центру Заявление о соответствии Брокерской фирмы Расчетному коду валютного рынка.  
Порядок предоставления Заявления о соответствии Брокерской фирмы Расчетному коду валютного рынка и Поручения на управление риском определен Правилами клиринга на срочном рынке.
- 10.2. Поручение на управление риском исполняется при одновременном исполнении следующих условий:
- 1) при условии невозникновения в соответствии с Правилами клиринга на срочном рынке Маржинального требования по разделу регистра учета позиций, указанному в Поручении на управление риском, а также по Брокерской фирме и Расчетной фирме, соответствующим разделу регистра учета позиций, указанному в Поручении на управление риском;
  - 2) если Единый лимит Участника клиринга по Расчетному коду, указанному в Поручении на управление риском, в результате исполнения такого Поручения не станет отрицательным, или отрицательный Единый лимит Участника клиринга по такому Расчетному коду в результате исполнения такого Поручения не уменьшится.
- 10.3. Клиринговый центр учитывает совокупность поданных Участником клиринга Поручений на управление риском по каждой валюте по каждому инструменту управления риском по Расчетному коду, указанному в Поручении на управление риском, в Дате исполнения, соответствующей Расчетному дню, следующему за текущим Расчетным днем, и учитывает их при расчете Единого лимита Участника клиринга по тому же Расчетному коду в соответствии со статьей 9 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.
- 10.4. Информация о поданных Участником клиринга в течение Расчетного дня Поручениях на управление риском предоставляется Клиринговым центром Участнику клиринга в составе Отчета о Поручениях на управление риском.

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

##### **Статья 11. Порядок взаимодействия с Биржей при подаче заявок и заключении Сделок**

- 11.1. Немедленно после того, как информация о поданной Участником торгов заявке на продажу, направленной на заключение Сделки, по которой осуществляется клиринг с полным обеспечением по иностранной валюте / драгоценному металлу, являющемуся валютой лота, стороной которой будет являться Участник клиринга, стала доступной Клиринговому центру посредством ПТК ТЦ, Клиринговый центр:
- 11.1.1. проверяет, что значение цены, указанной в заявке, больше либо равно Нижней границе ценового коридора и меньше либо равно Верхней границе ценового коридора, установленных Клиринговым центром;
- 11.1.2. рассчитывает сумму денежных средств Участника клиринга в валюте лота, которая может быть использована для заключения Сделки, с учетом:
- Обеспечения Участника клиринга в валюте лота, учитываемого по Расчетному коду, указанному в заявке;
  - Нетто-обязательств и/или Нетто-требований Участника клиринга в валюте лота, учитываемых по Расчетному коду, указанному в заявке;
  - всех зарегистрированных заявок на продажу, поданных Участниками торгов с указанием Расчетного кода Участника клиринга и направленных на заключение сделок купли-продажи иностранной валюты, являющейся валютой лота в поданной заявке, стороной которых будет являться Участник клиринга;
- 11.1.3. проверяет, что размер обязательства в валюте лота по Сделке, которая может быть заключена на основании поданной заявки, в Дату его исполнения не превышает суммы денежных средств Участника клиринга, рассчитанной в соответствии с подпунктом 11.1.2 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, с учетом обязательств и требований Участника клиринга в валюте лота по Сделкам и поданным заявкам на заключение Сделок с Датой исполнения не позднее, чем Дата исполнения обязательства по заключаемой Сделке.
- Для заявок на заключение сделок своп и своп контрактов проверки, указанные в настоящем подпункте Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, осуществляются для первой и второй части сделки своп / своп контракта с учетом одновременности возникновения обязательств по первой и второй части сделки своп / своп контракта;
- 11.1.4. проверяет достаточность Единого лимита Участника клиринга по Расчетному коду, указанному в заявке, в соответствии с пунктом 11.4 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.
- 11.2. Немедленно после того как информация о поданной Участником торгов заявке на покупку, направленной на заключение Сделки, по которой осуществляется клиринг с полным обеспечением по иностранной валюте, являющейся сопряженной валютой, стороной которой будет являться Участник клиринга, стала доступной Клиринговому центру посредством ПТК ТЦ, Клиринговый центр:

- 11.2.1. проверяет, что значение цены, указанной в заявке, больше либо равно Нижней границе ценового коридора и меньше либо равно Верхней границе ценового коридора, установленных Клиринговым центром;
- 11.2.2. рассчитывает сумму денежных средств Участников клиринга в сопряженной валюте, которая может быть использована для заключения Сделки, с учетом:
- Обеспечения Участника клиринга в сопряженной валюте, учитываемого по Расчетному коду, указанному в заявке;
  - Нетто-обязательств и/или Нетто-требований Участника клиринга в сопряженной валюте, учитываемых по Расчетному коду, указанному в заявке;
  - всех зарегистрированных заявок на покупку, поданных Участниками торгов с указанием Расчетного кода Участника клиринга и направленных на заключение сделок купли-продажи иностранной валюты / драгоценных металлов за сопряженную валюту, стороной которых будет являться Участник клиринга;
- 11.2.3. проверяет, что размер обязательства в сопряженной валюте по Сделке, которая может быть заключена на основании поданной заявки, в Дату его исполнения не превышает суммы денежных средств Участника клиринга, рассчитанной в соответствии с подпунктом 11.2.2 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, с учетом обязательств и требований Участника клиринга в сопряженной валюте по Сделкам и поданным заявкам на заключение Сделок с Датой исполнения не позднее, чем Дата исполнения обязательства по заключаемой Сделке.
- Для заявок на заключение сделок своп и своп контрактов проверки, указанные в настоящем подпункте Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, осуществляются для первой и второй части сделки своп / своп контракта с учетом одновременности возникновения обязательств по первой и второй части сделки своп / своп контракта;
- 11.2.4. проверяет достаточность Единого лимита Участника клиринга по Расчетному коду, указанному в заявке, в соответствии с пунктом 11.4 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.
- 11.3. Немедленно после того, как информация о поданной Участником торгов заявке, направленной на заключение Сделки, по которой осуществляется клиринг с частичным обеспечением, стороной которой будет являться Участник клиринга, стала доступной Клиринговому центру посредством ПТК ТЦ, Клиринговый центр:
- 11.3.1. проверяет, что значение цены, указанной в заявке, больше либо равно Нижней границе ценового коридора и меньше либо равно Верхней границе ценового коридора, установленных Клиринговым центром для инструмента, по которому подана заявка;
- 11.3.2. рассчитывает значение Единого лимита Участника клиринга по Расчетному коду, указанному в заявке, с учетом поданной заявки;
- 11.3.3. проверяет достаточность Единого лимита Участника клиринга по Расчетному коду, указанному в заявке, в соответствии с пунктом 11.4 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.
- 11.4. Единый лимит Участника клиринга по Расчетному коду является достаточным для

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

- 11.5. Немедленно после проведения Клиринговым центром проверок, предусмотренных настоящей статьёй Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов для соответствующих заявок, информация о результате таких проверок становится доступной Бирже посредством ПТК ТЦ: в случае положительного результата всех необходимых проверок – информация о возможности регистрации заявки, в случае отрицательного результата хотя бы одной из необходимых проверок – информация о невозможности регистрации заявки.
- 11.5.1. В случае возможности регистрации заявки, Клиринговый центр начинает учитывать значение Единого лимита Участника клиринга по Расчетному коду, указанному в заявке, рассчитанное при проверке возможности регистрации заявки, в качестве нового значения Единого лимита Участника клиринга по такому Расчетному коду.
- 11.5.2. В случае невозможности регистрации заявки, Клиринговый центр не изменяет значение Единого лимита Участника клиринга по Расчетному коду, указанному в заявке.
- 11.6. После того, как информация о снятии зарегистрированной заявки, в которой Участник клиринга был указан в качестве стороны Сделки, стала доступной Клиринговому центру посредством ПТК ТЦ, Клиринговый центр рассчитывает Единый лимит Участника клиринга по Расчетному коду, указанному в заявке, без учета отозванной заявки.
- 11.7. При регистрации заявки, являющейся в соответствии с Правилами торгов на валютном рынке допустимой встречной по отношению к ранее зарегистрированной заявке, Клиринговый центр заключает Сделку с каждым из Участников клиринга, указанным в заявке в качестве стороны по Сделке.
- 11.8. После того, как информация о регистрации Сделки стала доступной Клиринговому центру посредством ПТК ТЦ, Клиринговый центр:
- рассчитывает Единый лимит Участника клиринга по Расчетному коду, указанному в заявке, на основании которой заключена Сделка, без учета такой заявки (части такой заявки) и с учетом заключенной Сделки;
  - допускает к клирингу обязательства по заключенной Сделке;
  - изменяет с учетом заключенной Сделки Нетто-обязательство и/или Нетто-требование Участника клиринга по Расчетному коду, указанному в заявке, на основании которой заключена Сделка, с Датами исполнения, соответствующими Дате (Датам) исполнения обязательств по заключенной Сделке.

11.9. Участник клиринга имеет право завершить заключение Сделок с Клиринговым центром по инструментам с Датой исполнения, отличной от текущей, ранее установленного Биржей времени окончания торгов. Для реализации указанного права Участник клиринга должен предоставить Клиринговому центру Запрос на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром или Постоянное поручение на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром.

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

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

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

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

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

11.10. В случае принятия нормативного (правового) акта Российской Федерации о переносе выходных дней, в соответствии с которым Дата исполнения заключенных с Участниками клиринга Сделок станет выходным днем по законодательству Российской Федерации, либо в случае получения от Биржи уведомления, в соответствии с которым Дата исполнения заключенных с Участниками клиринга Сделок перестанет являться Расчетным днем по соответствующей валюте / соответствующему драгоценному металлу, Клиринговый центр в течение 10 (десяти) рабочих дней с даты опубликования такого нормативного (правового) акта / получения уведомления от Биржи изменяет Даты исполнения таких заключенных Сделок на ближайший следующий Расчетный день.

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

$RateN = RateO + Rate\_delta$ , где

RateN – цена Сделки после изменения Даты исполнения,

RateO – цена Сделки до изменения Даты исполнения,

Rate\_delta - корректировка цены Сделки,

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

Rate\_delta – корректировка цены Сделки,

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

SWAPCRate\_dO – центральное значение Индикативного курса сделок своп на

первоначальную Дату исполнения Сделки (до изменения).

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

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

После изменения Дат исполнения и сумм Сделок Клиринговый центр формирует и передает Участникам клиринга Отчеты о сделках, Дата исполнения которых перенесена.

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

## **РАЗДЕЛ V. ПОРЯДОК ПРОВЕДЕНИЯ КЛИРИНГА**

### **ПОДРАЗДЕЛ V-I. ПОРЯДОК ВНЕСЕНИЯ И ВОЗВРАТА ОБЕСПЕЧЕНИЯ**

#### **Статья 12. Порядок внесения Обеспечения**

- 12.1. Участник клиринга обязан перечислять денежные средства в соответствующей валюте, которые предоставляются им в качестве Обеспечения в российских рублях и/или Обеспечения в иностранной валюте, на соответствующий клиринговый банковский или корреспондентский счет Клирингового центра по реквизитам, размещенным на сайте Клирингового центра, с обязательным указанием в назначении платежа соответствующего Расчетного кода Участника клиринга.
- 12.2. Внесение Обеспечения в драгоценных металлах осуществляется путем перечисления драгоценных металлов на Счет обеспечения Участника клиринга.
- 12.3. Клиринговый центр учитывает в Клиринговой системе денежные средства / драгоценные металлы, перечисленные Участником клиринга, в качестве Обеспечения Участника клиринга, и увеличивает Единый лимит Участника клиринга с учетом перечисленной суммы денежных средств / перечисленного количества драгоценного металла.
- 12.4. Денежные средства и драгоценные металлы, учитываемые в качестве Обеспечения Участника клиринга, используются для расчета Единого лимита, обеспечения исполнения обязательств по Сделкам, исполнения Итоговых нетто-обязательств в соответствующей валюте / соответствующем драгоценном металле и обязательств по уплате комиссионных вознаграждений по Расчетному коду, по которому указанное Обеспечение учитывается.
- 12.5. Участник клиринга может перевести денежные средства / драгоценные металлы, учитываемые в качестве Обеспечения, между своими Расчетными кодами, подав в Клиринговый центр Заявление о переводе.

Данное заявление не принимается Клиринговым центром к исполнению, если сумма денежных средств в определенной валюте / количество определенного драгоценного металла, указанная(-ое) Участником клиринга в заявлении, превышает сумму денежных средств / количество драгоценного металла, учитываемую(-ое) в качестве Обеспечения Участника клиринга по Расчетному коду, с которого денежные средства / драгоценные металлы должны быть списаны, или если Единый лимит Участника клиринга по Расчетному коду, с которого денежные средства / драгоценные металлы, учитываемые в качестве Обеспечения Участника клиринга, должны быть списаны, в результате такого списания станет отрицательным, или отрицательный Единый лимит Участника клиринга по такому Расчетному коду в результате такого списания уменьшится.

В случае если в соответствии с поданным Заявлением о переводе списание денежных средств / драгоценных металлов осуществляется с Расчетного кода с признаком «запрет коротких продаж» и/или признаком «запрет необеспеченных покупок» и/или с Расчетного кода Участника клиринга категории «В» и/или при списании валюты / драгоценного металла, по которому установлен признак «запрет коротких продаж», дополнительным условием исполнения такого заявления

является непревышение размера обязательств по Сделкам в валюте / драгоценном металле, указанной(-ом) в Заявлении о переводе, по каждой Дате исполнения, учитываемых по Расчетному коду, Обеспечения Участника клиринга в соответствующей валюте / драгоценном металле по Расчетному коду с учетом обязательств и требований Участника клиринга в соответствующей валюте / драгоценном металле по Сделкам с Датой исполнения не позднее, чем проверяемая Дата исполнения, и без учета списываемых денежных средств / драгоценных металлов.

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

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

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

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

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

12.8. После перечисления Участником клиринга денежных средств на счет Клирингового центра, открытый в Расчетной организации / Расчетном банке, и учета их в качестве Обеспечения Участника клиринга, у Клирингового центра возникает обязательство вернуть денежные средства Участнику клиринга в размере, определяемом в соответствии с пунктами 13.4, 13.5 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.

## **Статья 13. Порядок возврата Обеспечения**

13.1. Списание со Счета обеспечения драгоценных металлов, перечисленных

Участником клиринга или Клиринговым центром на Счет обеспечения Участника клиринга (далее – возврат драгоценных металлов), осуществляется в порядке, определенном настоящей статьей Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.

13.2. Возврат Клиринговым центром Участнику клиринга денежных средств / драгоценных металлов, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга, осуществляется на основании Запроса о возврате, Постоянного поручения на возврат или в результате прекращения Итогового нетто-требования Участника клиринга в соответствии с пунктами 16.11-16.15 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.

13.2.1. В случае если между Участником клиринга и Клиринговым центром предусмотрен обмен сообщениями по системе S.W.I.F.T., Участник клиринга вправе направить Запрос о возврате денежных средств в форме сообщения по системе S.W.I.F.T.

Запросы о возврате принимаются Клиринговым центром в Расчетные дни в период времени, установленный Временным регламентом на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.

При предоставлении Запроса о возврате позднее времени, указанного во Временном регламенте на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, Клиринговый центр вправе не исполнять Запрос о возврате.

Запрос о возврате действует в день его предоставления.

Запрос о возврате, полученный в сроки, установленные Временным регламентом на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, исполняется после его получения при соблюдении условия, указанного в пункте 13.4 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.

13.2.2. Постоянное поручение на возврат исполняется Клиринговым центром каждый Расчетный день, начиная с первого Расчетного дня, следующего за датой предоставления указанного поручения, после исполнения Участником клиринга Итоговых нетто-обязательств в соответствующей валюте / драгоценном металле и обязательств по уплате комиссионных вознаграждений в сумме, определенной в соответствии с пунктом 13.5 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.

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

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

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

13.2.3. Условия возврата денежных средств / драгоценных металлов, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга, в результате прекращения Итогового нетто-требования Участника клиринга, определены пунктами 16.11-16.16 Правил

клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.

- 13.3. При непредоставлении Участником клиринга Запроса о возврате или Постоянного поручения на возврат оставшееся Обеспечение Участника клиринга будет учтено Клиринговым центром для его использования в торгах следующего торгового дня.
- 13.4. Возврат Клиринговым центром Участнику клиринга денежных средств / драгоценных металлов в соответствии с Запросом о возврате осуществляется только в том случае, если Единый лимит Участника клиринга, рассчитанный без учета возвращаемой суммы денежных средств / количества драгоценного металла, не станет отрицательным.
- В случае возврата денежных средств / драгоценных металлов с Расчетного кода с признаком «запрет коротких продаж» и/или признаком «запрет необеспеченных покупок» и/или с Расчетного кода Участника клиринга категории «В» и/или при возврате валюты / драгоценного металла, по которому установлен признак «запрет коротких продаж», дополнительным условием исполнения такого возврата является непревышение размера обязательств по Сделкам в валюте / драгоценном металле, указанном в Запросе о возврате, по каждой Дате исполнения, учитываемых по Расчетному коду, Обеспечения Участника клиринга в соответствующей валюте / драгоценном металле по Расчетному коду с учетом обязательств и требований Участника клиринга в соответствующей валюте / драгоценном металле по Сделкам с Датой исполнения не позднее, чем проверяемая Дата исполнения, и без учета возвращаемых денежных средств / драгоценных металлов.
- 13.5. Возврат Клиринговым центром Участнику клиринга денежных средств / драгоценных металлов в соответствии с Постоянным поручением на возврат осуществляется в сумме, без учета которой Единый лимит Участника клиринга не станет отрицательным.
- 13.6. Для исполнения своего обязательства по возврату Участнику клиринга денежных средств в соответствующей валюте / соответствующего драгоценного металла Клиринговый центр перечисляет денежные средства в данной валюте / данные драгоценные металлы на соответствующий Счет для возврата, зарегистрированный в Клиринговом центре для соответствующего Расчетного кода Участника клиринга.
- 13.7. Обязательство Клирингового центра по возврату денежных средств Участнику клиринга считается исполненным с момента списания Расчетной организацией или Расчетным банком, в котором открыт клиринговый банковский счет или корреспондентский счет Клирингового центра для учета Обеспечения, денежных средств с соответствующего счета Клирингового центра.
- Обязательство Клирингового центра по возврату драгоценных металлов Участнику клиринга считается исполненным с момента списания Клиринговым центром драгоценных металлов со Счета обеспечения Участника клиринга.
- Клиринговый центр не несет ответственности за неисполнение (ненадлежащее исполнение) Расчетной организацией или Расчетным банком распоряжения Клирингового центра о списании денежных средств в пользу Участника клиринга за исключением случаев, если такое неисполнение явилось следствием вины Клирингового центра.

- 13.8. При возврате Участнику клиринга денежных средств в соответствующей валюте / соответствующего драгоценного металла размер Обеспечения Участника клиринга в этой валюте / этом драгоценном металле уменьшается на сумму возвращаемых денежных средств / количество возвращаемого драгоценного металла.
- 13.9. Клиринговый центр вправе осуществить в любое время зачет денежных требований Участника клиринга по возврату ему денежных средств в соответствующей валюте с денежными требованиями Клирингового центра к этому Участнику клиринга в соответствующей валюте.
- 13.10. Информация об операциях с Обеспечением Участника клиринга передается Участнику клиринга в составе Отчета о движении денежных средств.
- 13.11. В случае прекращения допуска к клиринговому обслуживанию Клиринговый центр возвращает Участнику клиринга денежные средства и/или драгоценные металлы, учитываемые в качестве Обеспечения на дату прекращения допуска к клиринговому обслуживанию, не позднее 3 (трех) рабочих дней с даты прекращения Договора об оказании клиринговых услуг, российские рубли - на корреспондентский счет Участника клиринга – Кредитной организации, открытый в Банке России, российские рубли Участникам клиринга, не являющимся Кредитной организацией, и иностранную валюту, драгоценные металлы - по реквизитам Счета для возврата в соответствующей валюте / драгоценном металле, зарегистрированного Участником клиринга в соответствии с правилами клиринга Клирингового центра, с учетом положений общей части Правил клиринга.

## **ПОДРАЗДЕЛ V-II. КЛИРИНГОВЫЕ СЕССИИ**

### **Статья 14. Порядок проведения клиринговых сессий. Порядок возникновения и исполнения Маржинальных требований**

- 14.1. Каждый Рабочий день до начала торгов в установленное Временным регламентом на валютном рынке и рынке драгоценных металлов время Клиринговый центр проводит клиринговую сессию, в ходе которой Клиринговый центр:
- устанавливает риск-параметры в соответствии с Методикой определения риск-параметров валютного рынка и рынка драгоценных металлов;
  - определяет Расчетные цены в соответствии с пунктом 14.2 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов;
  - для каждого Участника клиринга рассчитывает и устанавливает новые значения Единых лимитов и Торговых лимитов Участника клиринга;
  - определяет обязательства Участников клиринга и Клирингового центра по уплате вариационной маржи / Гарантийных переводов в соответствии со статьей 15 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов;
  - формирует и передает каждому Участнику клиринга, имеющему обязательства по Сделкам, Дата исполнения которых не наступила, Отчет об обязательствах и/или Отчет об обязательствах по ПФИ;
  - формирует и передает Участникам клиринга, у которых возникли Задолженности, Отчет «Требование о погашении Задолженности»;
  - определяет Участников клиринга, у которых возникли Маржинальные требования и суммы указанных Маржинальных требований: Маржинальное требование возникает у Участника клиринга, Единый лимит которого стал отрицательным; сумма Маржинального требования равна абсолютному значению текущего Единого лимита Участника клиринга;
  - формирует и передает Участникам клиринга, у которых возникли Маржинальные требования, Отчет о Маржинальном требовании, содержащий информацию о его сумме.
- 14.2. Расчетная цена для определенного базисного актива и определенной Даты исполнения определяется как сумма Центрального курса сделок купли-продажи иностранной валюты / драгоценного металла, являющейся / являющегося таким базисным активом, за российские рубли, установленного Клиринговым центром на текущий Расчетный день, и центрального значения Индикативного курса сделок своп на дату, соответствующую такой Дате исполнения.
- 14.3. Маржинальное требование, возникшее у Участника клиринга по итогам клиринговой сессии, должно быть исполнено Участником клиринга не позднее установленного Временным регламентом на валютном рынке и рынке драгоценных металлов времени текущего Рабочего дня.
- 14.4. Маржинальное требование должно быть исполнено Участником клиринга путем перечисления денежных средств в любой валюте, по Сделкам с которой может осуществляться клиринг с частичным обеспечением, на соответствующий счет

Клирингового центра либо путем внесения Обеспечения в драгоценных металлах на соответствующий Счет обеспечения в порядке, определенном статьей 12 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.

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

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

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

14.6. В случае неисполнения Участником клиринга Маржинального требования по Расчетному коду в срок, установленный Временным регламентом на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, между Клиринговым центром и Участником клиринга, не исполнившим Маржинальное требование по Расчетному коду, без подачи заявок заключаются закрывающие Сделки с иностранной валютой / драгоценными металлами, приводящие к увеличению Единого лимита данного Участника клиринга по Расчетному коду.

Условия указанных закрывающих Сделок соответствуют установленным в Правилах торгов на валютном рынке условиям соответствующих Сделок, а цены - ценам балансирующих сделок, порядок заключения которых определен общей частью Правил клиринга.

Указанные Сделки заключаются до момента исполнения Маржинального требования Участника клиринга по Расчетному коду или до момента невозможности заключения указанных Сделок.

Указанные Сделки не заключаются в случае, если у Участника клиринга, не исполнившего Маржинальное требование по Расчетному коду, отозвана (аннулирована) лицензия Банка России на осуществление банковских операций.

Указанные Сделки с драгоценными металлами не заключаются в случае отзыва (аннулирования) у Недобросовестного участника клиринга лицензии Банка России на привлечение во вклады и размещение драгоценных металлов.

Сделки, заключенные в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, учитываются при расчете Нетто-обязательств / Нетто-требований Участника клиринга в валюте / драгоценных металлах по соответствующим Датам исполнения.

## **Статья 15. Вариационная маржа и Гарантийные переводы**

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

$$VM_O = (Rc - (BR + SR)) \times L, \text{ где}$$

$VM_O$  – вариационная маржа по своп контракту;

$Rc$  – Расчетная цена, определенная в текущий Расчетный день;

$BR$  – базовый курс своп контракта;

SR – цена своп контракта;

L – лот своп контракта.

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

$$VM_T = (R_c - R_{c_p}) \times L, \text{ где}$$

$VM_T$  – вариационная маржа по своп контракту;

$R_c$  – Расчетная цена, определенная в текущий Расчетный день;

$R_{c_p}$  – Расчетная цена, определенная в предыдущий Расчетный день;

L – лот своп контракта.

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

$$VM_O = (R_c - Price) \times L, \text{ где}$$

$VM_O$  – вариационная маржа по фьючерсному контракту;

$R_c$  – Расчетная цена, определенная в текущий Расчетный день;

Price – цена фьючерсного контракта;

L – лот фьючерсного контракта.

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

$$VM_T = (R_c - R_{c_p}) \times L, \text{ где}$$

$VM_T$  – вариационная маржа по фьючерсному контракту;

$R_c$  – Расчетная цена, определенная в текущий Расчетный день;

$R_{c_p}$  – Расчетная цена, определенная в предыдущий Расчетный день;

L – лот фьючерсного контракта.

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

$$VM_S = -VOL_i \times VM, \text{ где}$$

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

$VM$  – вариационная маржа по своп контракту / фьючерсному контракту, рассчитанная в соответствии с пунктами 15.1-15.2 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.

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

$$VM_B = VOL_i \times VM, \text{ где}$$

$VOL_i$  – количество заключенных своп контрактов / фьючерсных контрактов с  $i$ -м

базисным активом, по которым Участник клиринга является покупателем;

VM – вариационная маржа по своп контракту / фьючерсному контракту, рассчитанная в соответствии с пунктами 15.1-15.2 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.

- 15.5. Если значение, рассчитанное в соответствии с пунктом 15.3 или 15.4 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, отрицательное, это означает наличие обязанности Участника клиринга по уплате вариационной маржи Клиринговому центру в размере, равном абсолютному значению  $VM_S$  или  $VM_B$ , если положительное – наличие требования Участника клиринга к Клиринговому центру по получению вариационной маржи в размере, равном значению  $VM_S$  или  $VM_B$ .

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

- 15.6. После определения обязательств по уплате вариационной маржи в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, Клиринговый центр:

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

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

15.6.3. пересчитывает Нетто-обязательства / Нетто-требования в российских рублях с соответствующей Датой исполнения с учетом изменения суммы обязательств по второй части своп контрактов / по фьючерсным контрактам, рассчитанной в соответствии с подпунктами 15.6.1, 15.6.2 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.

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

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

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

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

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

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

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

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

$\sum_i$  – сумма по Датам исполнения;

$\sum_j$  - сумма по валютам и драгоценным металлам  $VAL$ .

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

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

- 15.8. После определения обязательств по уплате Гарантийного перевода в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, Клиринговый центр рассчитывает размер обязательства Участника клиринга и Клирингового центра по возврату Гарантийных переводов по формуле:

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

$RET\_RUB_{new}$  – размер обязательства по возврату Гарантийных переводов (с учетом знака);

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

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

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

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

- 15.10. Обязанность Участника клиринга по уплате вариационной маржи / Гарантийного перевода по Расчетному коду исполняется за счет Обеспечения Участника клиринга в российских рублях, учитываемого по тому же Расчетному коду. Клиринговый центр зачитывает обязательство Участника клиринга по уплате вариационной маржи / Гарантийного перевода с его требованием к Клиринговому

центру по возврату Обеспечения. Размер Обеспечения Участника клиринга в российских рублях уменьшается на размер исполненного обязательства Участника клиринга по уплате вариационной маржи / Гарантийного перевода.

- 15.11. Если Обеспечения Участника клиринга в российских рублях недостаточно для исполнения обязательства Участника клиринга по уплате вариационной маржи / Гарантийного перевода в полном объеме, неисполненное обязательство (неисполненная часть обязательства) Участника клиринга по уплате вариационной маржи / Гарантийного перевода учитывается Клиринговым центром как Задолженность Участника клиринга перед Клиринговым центром.

Указанная Задолженность должна быть погашена Участником клиринга до установленного Временным регламентом на валютном рынке и рынке драгоценных металлов времени текущего Рабочего дня.

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

- 15.12. Порядок действий Клирингового центра при неисполнении Участником клиринга Задолженности в срок, установленный в пункте 15.11 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, определен в статье 17 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.

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

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

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

### Статья 16. Порядок исполнения / прекращения обязательств по Сделкам и обязательств по возврату Гарантийных переводов

16.1. В сроки, установленные Временным регламентом на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, Клиринговый центр определяет Итоговые нетто-обязательства / Итоговые нетто-требования Участников клиринга в каждой валюте и каждом драгоценном металле.

16.1.1. В случае если для какой-либо иностранной валюты время окончания торгов, на которых заключаются Сделки с исполнением обязательств в дату их заключения, раньше, чем время окончания всех торгов, на которых заключаются Сделки с исполнением обязательств в дату их заключения, то по окончании торгов по такой иностранной валюте и получения от Биржи выписки из реестра сделок по итогам указанных торгов Клиринговый центр:

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

16.1.2. Порядок исполнения / прекращения Итогового нетто-обязательства или Итогового нетто-требования, определенного в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга, определен настоящим разделом Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, сроки исполнения – Временным регламентом на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.

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

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

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

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

RET\_RUB – размер обязательства Участника клиринга и Клирингового

центра по возврату Гарантийных переводов (в российских рублях);

OBL\_VAL<sub>j</sub> – Нетто-обязательство / Нетто-требование Участника клиринга (с учетом знака) в иностранной валюте / драгоценном металле VAL<sub>j</sub> с наступившей Датой исполнения, рассчитанное без учета Сделок, обязательства по уплате Гарантийных переводов по которым в соответствии с Правилами клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов не возникают;

OBL\_RUB - Нетто-обязательство / Нетто-требование Участника клиринга (с учетом знака) в российских рублях с наступившей Датой исполнения, рассчитанное без учета Сделок, обязательства по уплате Гарантийных переводов по которым в соответствии с Правилами клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов не возникают;

Rc\_RUB\_VAL<sub>j</sub> – Центральный курс сделок купли-продажи иностранной валюты / драгоценных металлов VAL<sub>j</sub> за российские рубли, рассчитанный в день T-2, где T – текущий Рабочий день;

$\sum_j$  - сумма по валютам VAL.

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

16.2.2. включает в клиринговый пул:

- неисполненные обязательства и требования Участника клиринга и Клирингового центра по Сделкам с наступившей Датой исполнения, в том числе обязательства / требования в российских рублях по Сделкам, являющимся производными финансовыми инструментами, определенные в соответствии с подпунктами 15.6.1, 15.6.2 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов;
- обязательства / требования Участника клиринга по возврату Гарантийных переводов, определенные в соответствии с подпунктом 16.2.1 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов;
- обязательства Участника клиринга по уплате комиссионных вознаграждений, определенные в соответствии со статьей 18 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов;

16.2.3. зачитывает встречные однородные обязательства и требования Участника клиринга и Клирингового центра, включенные в клиринговый пул, а в части, в которой обязательства и требования не были зачтены – определяет Итоговые нетто-обязательства и/или Итоговые нетто-требования каждого Участника клиринга в каждой валюте / каждом драгоценном металле.

16.3. Процедуры, указанные в пункте 16.2 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, могут быть выполнены Клиринговым центром в отношении отдельных Участников клиринга до окончания торгов, на которых заключаются Сделки с исполнением обязательств в дату их заключения, в случае получения от Участника клиринга Запроса на проведение ранних расчетов или Постоянного поручения на проведение ранних расчетов.

- 16.3.1. Запрос на проведение ранних расчетов действует в день его предоставления.
- 16.3.2. Постоянное поручение на проведение ранних расчетов исполняется Клиринговым центром каждый Расчетный день, начиная с первого Расчетного дня, следующего за датой предоставления указанного поручения.
- Постоянное поручение на проведение ранних расчетов действует до его отмены Участником клиринга.
- Отмена Постоянного поручения на проведение ранних расчетов осуществляется с использованием Клиринговой системы или путем направления Участником клиринга Клиринговому центру документа на бумажном носителе в свободной форме.
- 16.3.3. После получения от Участника клиринга Запроса на проведение ранних расчетов или в установленный Временным регламентом на валютном рынке и рынке драгоценных металлов момент времени, Клиринговый центр направляет Бирже уведомление о проведении ранних расчетов в отношении Участника клиринга, предоставившего Клиринговому центру Запрос на проведение ранних расчетов или Постоянное поручение на проведение ранних расчетов соответственно.
- 16.4. После определения обязательств Участников клиринга, указанных в пункте 16.1 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, Клиринговый центр формирует и передает Участникам клиринга Клиринговые отчеты и Биржевые свидетельства.
- 16.5. Необходимым условием исполнения Клиринговым центром Итоговых нетто-требований Участника клиринга является исполнение Участником клиринга своих Итоговых нетто-обязательств перед Клиринговым центром, за исключением случая, предусмотренного пунктом 16.14 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.
- 16.6. Участник клиринга обязан исполнить свои Итоговые нетто-обязательства в соответствующей валюте / драгоценных металлах до времени, указанного во Временном регламенте на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.
- В случае исполнения Участником клиринга Итоговых нетто-обязательств в каждой валюте / каждом драгоценном металле в полном объеме в указанный срок данный Участник клиринга признается Добросовестным участником клиринга.
- В случае неисполнения Участником клиринга Итоговых нетто-обязательств в любой валюте / любом драгоценном металле в полном объеме и/или в указанный срок данный Участник клиринга признается Недобросовестным участником клиринга.
- 16.7. Порядок действий Клирингового центра при неисполнении или ненадлежащем исполнении Участником клиринга своих Итоговых нетто-обязательств определен в статье 17 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.
- 16.8. Для исполнения Итоговых нетто-обязательств Участника клиринга в соответствующей валюте / соответствующем драгоценном металле используется Обеспечение Участника клиринга в соответствующей валюте / соответствующем драгоценном металле, в порядке, определенном пунктами 12.6-12.7 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

- 16.11. Обязательство Клирингового центра по исполнению Итогового нетто-требования Участника клиринга в соответствующей валюте прекращается возникновением обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга денежных средств в соответствующей валюте, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга, в размере Итогового нетто-требования Участника клиринга в этой валюте.

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

- 16.11.1. После этого Клиринговый центр осуществляет возврат Участникам клиринга

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

Возврат Участникам клиринга денежных средств в соответствии с настоящим подпунктом Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов осуществляется в день, являющийся Расчетным днем для соответствующей валюты.

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

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

- 16.11.2. В случае предоставления Участником клиринга Клиринговому центру Запроса о депонировании денежных средств, сумма денежных средств в соответствующей валюте, подлежащая возврату Клиринговым центром Участнику клиринга в соответствии с подпунктом 16.11.1 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, уменьшается на сумму денежных средств в этой валюте, указанную Участником клиринга в Запросе о депонировании денежных средств.

При предоставлении Запроса о депонировании денежных средств позднее времени, указанного во Временном регламенте на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, Клиринговый центр исполняет Запрос о депонировании денежных средств только в случае, если на момент получения указанного запроса возврат денежных средств Участнику клиринга в соответствии с подпунктом 16.11.1 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов еще не осуществлен.

Запрос о депонировании денежных средств действует в день его предоставления.

- 16.12. Возврат Клиринговым центром Участнику клиринга денежных средств в соответствующей валюте в соответствии с пунктом 16.11 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов осуществляется путем перечисления денежных средств в данной валюте на зарегистрированный Участником клиринга в Клиринговом центре соответствующий Счет для возврата.

- 16.13. При возврате Участнику клиринга денежных средств в соответствующей валюте, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга, размер Обеспечения Участника клиринга в этой валюте уменьшается на сумму возвращаемых денежных средств.
- 16.14. Для исполнения Итогового нетто-требования Участника клиринга в соответствующем драгоценном металле Клиринговый центр зачисляет соответствующий драгоценный металл в количестве, равном объему Итогового нетто-требования Участника клиринга в этом драгоценном металле, на Счет обеспечения Участника клиринга.
- При этом размер Обеспечения Участника клиринга в соответствующем драгоценном металле увеличивается на сумму исполненного Итогового нетто-требования Участника клиринга в этом драгоценном металле.
- 16.15. При частичном своевременном исполнении Участником клиринга своих Итоговых нетто-обязательств в соответствующей валюте / соответствующем драгоценном металле Клиринговый центр частично исполняет Итоговые нетто-требования Участника клиринга в соответствующей валюте / соответствующем драгоценном металле в порядке, определенном пунктом 16.10 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, в сумме / количестве, определяемых Клиринговым центром, и имеет право вернуть Участнику клиринга денежные средства в указанной сумме в порядке, определенном пунктом 16.12 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.
- Клиринговый центр вправе не возвращать денежные средства Участнику клиринга, частично исполнившему свои Итоговые нетто-обязательства в соответствующей валюте / соответствующем драгоценном металле, до полного исполнения Участником клиринга своих Итоговых нетто-обязательств в соответствующей валюте / соответствующем драгоценном металле.
- Если Участник клиринга имеет требования к Клиринговому центру по возврату денежных средств в разных валютах, то их исполнение в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов осуществляется в следующем порядке: сначала возвращаются денежные средства в той валюте, Итоговые нетто-обязательства Участника клиринга в которой имеют более ранний срок исполнения в течение одного Расчетного дня, установленный Временным регламентом на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.
- 16.16. В случае предоставления Участником клиринга Клиринговому центру Постоянного поручения на депонирование денежных средств, денежные средства в соответствующей валюте Клиринговым центром Участнику клиринга в соответствии с пунктом 16.11 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов не возвращаются. В этом случае возврат Участнику клиринга денежных средств осуществляется только на основании Запроса о возврате либо Постоянного поручения на возврат в порядке, определенном статьей 13 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.
- Постоянное поручение на депонирование денежных средств исполняется Клиринговым центром каждый Расчетный день, начиная с первого Расчетного дня, следующего за датой предоставления указанного поручения.
- Постоянное поручение на депонирование денежных средств действует до его

отмены Участником клиринга.

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

## **Статья 17. Порядок действий в случае неисполнения обязательств по Сделкам**

17.1. В случае непогашения Участником клиринга до времени, установленного Временным регламентом на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, Задолженности, учитываемой по Расчетному коду, Участник клиринга обязан уплатить Клиринговому центру пеню, рассчитываемую по формуле:

$$\text{Fine} = D \times 2 \times S \times n / 365, \text{ где}$$

Fine – сумма пени, в российских рублях,

D – сумма Задолженности, в российских рублях,

S – ключевая ставка, установленная Банком России на дату расчета суммы пени,

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

Сумма пени, рассчитанная в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, не облагается НДС.

17.2. Клиринговый центр зачитывает обязательство Участника клиринга по уплате пени, рассчитанной в соответствии с пунктом 17.1 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, с требованием Участника клиринга по возврату денежных средств в российских рублях, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга, за исключением случаев введения в отношении Участника клиринга одной из процедур банкротства, а в отношении Участника клиринга – кредитной организации - отзыва (аннулирования) у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций.

17.3. В случаях:

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

- частичного неисполнения или неисполнения в полном объеме Клиринговым центром Итоговых нетто-требований Участника клиринга в соответствующей валюте,

в период времени, установленный Временным регламентом на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, между Клиринговым центром и Участником клиринга, без подачи заявок заключается сделка своп с иностранной валютой / драгоценным металлом.

- 17.4. Клиринговый центр, действуя от имени Участника клиринга в отношении себя лично, осуществляет все юридические и фактические действия, необходимые для заключения сделок в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов без специального полномочия (доверенности), а также без согласия Участника клиринга.
- 17.5. Сделки своп, указанные в пункте 17.3 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, заключаются при соблюдении следующих условий:
- 17.5.1. у Участника клиринга – кредитной организации не отозвана (не аннулирована) лицензия Банка России на осуществление банковских операций;
- 17.5.2. 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;
- 17.5.3. у Клирингового центра отсутствует информация об обстоятельствах в отношении Участника клиринга, перечисленных в общей части Правил клиринга, при наступлении которых допуск к клиринговому обслуживанию Участника клиринга будет приостановлен в следующий Расчетный день;
- 17.5.4. количество Расчетных дней, в течение которых Участник клиринга не исполняет Итоговое нетто-обязательство в соответствующей валюте / соответствующем драгоценном металле по одному Расчетному коду, не превышает 2 (двух) Расчетных дней подряд.
- 17.5.5. Сделки своп с драгоценными металлами, указанные в пункте 17.3 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, с Участником клиринга – кредитной организацией не заключаются в случае, если у такого Участника клиринга отозвана (аннулирована) лицензия Банка России на привлечение во вклады и размещение драгоценных металлов.
- 17.6. Условие, указанное в подпункте 17.5.4 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, не применяется, если причиной неисполнения Участником клиринга Итогового нетто-обязательства в соответствующей валюте является несвоевременное зачисление денежных средств на клиринговые / корреспондентские счета Клирингового центра в Расчетной организации / Расчетных банках, вызванное проведением процедур комплаенс-контроля в банках-корреспондентах, сбоями в работе платежных систем, а также обстоятельствами непреодолимой силы, определенными в пункте 17.10 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.
- Участник клиринга обязан предоставить Клиринговому центру документы, подтверждающие действие причин, указанных в настоящем пункте Правил

клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.

- 17.7. Условия сделок своп, заключаемых между Клиринговым центром и Недобросовестным участником клиринга в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, соответствуют определенным Правилами торгов на валютном рынке условиям сделок своп с учетом следующих особенностей:
- 17.7.1. в случае наличия у Участника клиринга неисполненного Итогового нетто-обязательства в иностранной валюте / драгоценном металле, по первой части сделки своп у Участника клиринга возникают требования в соответствующей иностранной валюте / драгоценном металле в объеме, равном указанному неисполненному Итоговому нетто-обязательству Участника клиринга в иностранной валюте / драгоценном металле, и обязательства в российских рублях;
- 17.7.2. в случае наличия у Участника клиринга неисполненного Итогового нетто-обязательства в российских рублях, по первой части сделки своп у Участника клиринга возникают требования в российских рублях и обязательства в иностранной валюте / драгоценном металле в объеме, равном Итоговому нетто-требованию Участника клиринга в иностранной валюте / драгоценном металле и/или размеру Обеспечения Участника клиринга в иностранной валюте / драгоценном металле, соответствующему неисполненному Участником клиринга Итоговому нетто-обязательству в российских рублях;
- 17.7.3. в случае наличия у Участника клиринга Задолженности, по первой части сделки своп у Участника клиринга возникают требования в российских рублях и обязательства в иностранной валюте / драгоценном металле в объеме, равном размеру Обеспечения Участника клиринга в иностранной валюте / драгоценном металле, соответствующему сумме Задолженности;
- 17.7.4. Датой исполнения обязательств по первой части сделки своп является день ее заключения;
- 17.7.5. Датой исполнения обязательств по второй части сделки своп является Расчетный день, следующий за днем ее заключения;
- 17.7.6. Базовый курс сделки своп определяется в соответствии с пунктом 17.9 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.
- 17.8. При необходимости заключения сделок своп с Добросовестными участниками клиринга в соответствии с пунктом 17.23 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, условия сделок своп, заключаемых между Клиринговым центром и Добросовестным участником клиринга в случае частичного неисполнения или неисполнения в полном объеме Клиринговым центром Итоговых нетто-требований Участника клиринга в иностранной валюте / драгоценном металле, соответствуют определенным Правилами торгов на валютном рынке условиям сделок своп с учетом следующих особенностей:
- 17.8.1. по первой части сделки своп у Участника клиринга возникают обязательства в соответствующей иностранной валюте / соответствующем драгоценном металле в объеме, равном сумме указанного неисполненного Итогового нетто-требования Участника клиринга в иностранной валюте / драгоценном металле;
- 17.8.2. Датой исполнения обязательств по первой части сделки своп является день ее

заклучения;

- 17.8.3. Датой исполнения обязательств по второй части сделки своп является Расчетный день, следующий за днем ее заключения;
- 17.8.4. Базовый курс сделки своп определяется в соответствии с пунктом 17.9 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.
- 17.9. Базовый курс сделки своп, заключаемой в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, устанавливается равным Центральному курсу, определенному в 19:00 по московскому времени текущего Рабочего дня.

Цена сделки своп рассчитывается по следующей формуле:

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

Swap\_Price – цена сделки своп,

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

R<sub>c\_RUB\_VAL</sub> – Центральный курс сделок купли-продажи иностранной валюты / драгоценного металла VAL за российские рубли, рассчитанный в 19:00 по московскому времени текущего Рабочего дня,

VAL – валюта лота сделки своп,

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

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

- 17.10. В случае невозможности исполнения Участником клиринга своих Итоговых нетто-обязательств в соответствующей валюте / соответствующем драгоценном металле вследствие непреодолимой силы или сбоя в платежной системе Банка России, Клиринговым центром с Участником клиринга заключаются сделки своп с Ценой сделки своп, равной нулю.

Под обстоятельствами непреодолимой силы понимаются:

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

О возникновении обстоятельств непреодолимой силы, вследствие которых исполнение Участником клиринга своих Итоговых нетто-обязательств в

соответствующей валюте / соответствующем драгоценном металле невозможно, Участник клиринга обязан уведомить Клиринговый центр любыми доступными средствами связи до установленного Временным регламентом на валютном рынке и рынке драгоценных металлов времени заключения сделок в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.

Участник клиринга обязан предоставить Клиринговому центру документы, подтверждающие обстоятельства непреодолимой силы в течение 7 (семи) дней. В случае непредоставления Участником клиринга Клиринговому центру таких документов в указанный срок с Участника клиринга по решению Клирингового центра взыскивается неустойка, равная Цене сделки своп, рассчитанной в соответствии с пунктом 17.9 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов в расчете на количество календарных дней между датой исполнения первой части сделки своп и датой расчета неустойки.

Уплата Участником клиринга неустойки в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов не освобождает Участника клиринга от исполнения обязательств по второй части сделки своп, заключенной в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.

- 17.11. При наличии у Клирингового центра информации об обстоятельствах в отношении Участника клиринга, перечисленных в общей части Правил клиринга, при наступлении которых допуск к клиринговому обслуживанию Участника клиринга будет приостановлен в следующий Расчетный день, а также в случае отзыва (аннулирования) у Участника клиринга – кредитной организации лицензии Банка России на привлечение во вклады и размещение драгоценных металлов, Клиринговый центр вправе принять решение о том, что Дата исполнения обязательств по Сделкам, стороной которых является такой Участник клиринга, считается наступившей в текущий Расчетный день.
- 17.11.1. Обязательства по Сделкам, в отношении которых Клиринговым центром принято решение в соответствии с пунктом 17.11 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, включаются в клиринговый пул и участвуют в определении Итогового нетто-обязательства / Итогового нетто-требования Участника клиринга в соответствии со статьей 16 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, при этом при наличии неисполненного Итогового нетто-обязательства Участника клиринга в иностранной валюте / драгоценном металле между Клиринговым центром и Недобросовестным участником клиринга заключается закрывающая сделка купли-продажи иностранной валюты / драгоценного металла, условия которой соответствуют условиям, указанным в подпунктах 17.12.1-17.12.4 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.
- 17.12. При наличии случаев, указанных в пункте 17.3 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, и несоблюдении любого из условий, указанных в подпунктах 17.5.3-17.5.4 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, между Клиринговым центром и Участником клиринга заключается закрывающая сделка купли-продажи иностранной валюты / драгоценного металла, условия которой соответствуют определенным Правилами

торгов на валютном рынке условиям сделок спот с учетом следующих особенностей:

- 17.12.1. в случае наличия у Участника клиринга неисполненного Итогового нетто-обязательства в иностранной валюте / драгоценном металле, у Участника клиринга возникают требования в соответствующей иностранной валюте / драгоценном металле в объеме, равном указанному неисполненному Итоговому нетто-обязательству Участника клиринга в иностранной валюте / драгоценном металле;
- 17.12.2. в случае наличия у Участника клиринга неисполненного Итогового нетто-обязательства в российских рублях, у Участника клиринга возникают требования в российских рублях и обязательства в иностранной валюте / драгоценном металле в объеме, равном Итоговому нетто-требованию Участника клиринга в иностранной валюте / драгоценном металле и/или размеру Обеспечения Участника клиринга в иностранной валюте / драгоценном металле, соответствующим неисполненному Участником клиринга Итоговому нетто-обязательству в российских рублях;
- 17.12.3. Датой исполнения обязательств по сделке является день ее заключения;
- 17.12.4. цена сделки устанавливается равной цене балансирующей сделки с соответствующей иностранной валютой / драгоценным металлом, порядок заключения которой определен общей частью Правил клиринга.
- 17.13. Обязательства по первым частям сделок своп, заключенным в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, включаются в клиринговый пул.
- 17.14. При наличии случаев, указанных в пункте 17.3 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, и несоблюдении условия, указанного в подпункте 17.5.4 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, по Расчетному коду Участника клиринга, имеющего неисполненное Итоговое нетто-обязательство в иностранной валюте / драгоценных металлах / российских рублях, Клиринговый центр устанавливает признак «запрет коротких продаж» и «запрет необеспеченных покупок», и с Участника клиринга взимается штраф, рассчитываемый по формуле:  
$$\text{Penalty} = \text{ROUND} (\text{VAL\_OBL} \times \text{C} \times \text{K} \times \text{R} / 365; 2), \text{ где}$$

Penalty – сумма штрафа, в российских рублях,  
VAL\_OBL – необеспеченное средствами под исполнение Итоговое нетто-обязательство в иностранной валюте / драгоценных металлах / российских рублях,  
C – Центральный курс иностранной валюты / Расчетная цена драгоценного металла / C=1 для российских рублей;  
K – коэффициент, установленный решением Клирингового центра; по умолчанию K=5;  
R – штрафная ставка, равная ставке, установленной Клиринговым центром в соответствии с Методикой определения риск-параметров валютного рынка и рынка драгоценных металлов.  
Сумма штрафа, рассчитанная в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, не облагается НДС.  
Обязательство по уплате штрафа, рассчитанное в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов,

учитывается по основному Расчетному коду.

- 17.15. Клиринговый центр зачитывает обязательство Участника клиринга по уплате штрафа, учитываемое по основному Расчетному коду, сумма которого рассчитана в соответствии с пунктом 17.14 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, с требованием Участника клиринга по возврату Обеспечения в российских рублях, учитываемого по основному Расчетному коду, за исключением случаев введения в отношении Участника клиринга одной из процедур банкротства, а в отношении Участника клиринга – кредитной организации - отзыва (аннулирования) у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций.
- 17.16. После заключения сделок своп в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов Клиринговый центр зачитывает встречные однородные Итоговые нетто-обязательства в соответствующей валюте / соответствующем драгоценном металле и/или Задолженности в российских рублях Участника клиринга с требованиями в соответствующих валютах / соответствующих драгоценных металлах по первым частям заключенных сделок своп, а Итоговые нетто-требования в соответствующей валюте / соответствующем драгоценном металле Участника клиринга с обязательствами в соответствующих валютах / соответствующих драгоценных металлах по первым частям заключенных сделок своп, и направляет Участнику клиринга новый Клиринговый отчет, а также новое Биржевое свидетельство. Биржевое свидетельство, ранее направленное Участнику клиринга, утрачивает силу с момента направления ему Клиринговым центром Биржевого свидетельства в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.
- 17.17. Клиринговый центр зачитывает Итоговое нетто-обязательство Участника клиринга в соответствующей валюте, определенное в соответствии с пунктом 17.16 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, с требованием Участника клиринга по возврату денежных средств в соответствующей валюте, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга. Клиринговый центр списывает соответствующий драгоценный металл в количестве, равном объему Итогового нетто-обязательства Участника клиринга в этом драгоценном металле, определенного в соответствии с пунктом 17.16 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, со Счета обеспечения Участника клиринга в счет исполнения указанного Итогового нетто-обязательства Участника клиринга в этом драгоценном металле. При этом размер Обеспечения Участника клиринга в соответствующей валюте / соответствующем драгоценном металле уменьшается на сумму прекращенного / исполненного Итогового нетто-обязательства в этой валюте / драгоценном металле.
- 17.18. После заключения сделок своп в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов или, в случае незаключения указанных сделок, в срок, установленный Временным регламентом на валютном рынке и рынке драгоценных металлов для исполнения Участниками клиринга Итоговых нетто-обязательств в долларах США и российских рублях перед Клиринговым центром, обязательства по Сделкам, включенным в

клиринговый пул, прекращаются.

- 17.19. Итоговое нетто-обязательство в российских рублях Участника клиринга, не прекращенное после проведения указанного в пункте 17.17 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов зачета, учитывается Клиринговым центром как Задолженность Участника клиринга перед Клиринговым центром.

Указанная Задолженность должна быть погашена Участником клиринга не позднее установленного Временным регламентом на валютном рынке и рынке драгоценных металлов времени Рабочего дня, следующего за днем возникновения указанной задолженности.

Информация о наличии у Участника клиринга Задолженности и ее размере передается Участнику клиринга в составе отчета «Требование о погашении Задолженности», направляемом Участнику клиринга в соответствии с пунктом 15.11 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.

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

- 17.20. Если Задолженность Участника клиринга не погашена в установленные Временным регламентом на валютном рынке и рынке драгоценных металлов сроки, Клиринговый центр использует Обеспечение Участника клиринга, учитываемое по иным Расчетным кодам в соответствии с Правилами клиринга, а также средства гарантийных фондов и/или обеспечение под стресс в порядке, определенном общей частью Правил клиринга.

- 17.21. Обязательство Клирингового центра по исполнению Итогового нетто-требования Участника клиринга в соответствующей валюте, определенного в соответствии с пунктом 17.16 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, прекращается возникновением обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга денежных средств в соответствующей валюте, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга, в размере Итогового нетто-требования Участника клиринга в соответствующей валюте.

Для исполнения Итогового нетто-требования Участника клиринга в соответствующем драгоценном металле, определенного в соответствии с пунктом 17.16 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, Клиринговый центр зачисляет соответствующий драгоценный металл в количестве, равном объему указанного Итогового нетто-требования Участника клиринга в этом драгоценном металле, на Счет обеспечения Участника клиринга.

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

Возврат денежных средств / драгоценных металлов Участнику клиринга после исполнения (прекращения) обязательств в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов не

производится.

- 17.22. Обязательства / требования в соответствующих валютах / драгоценных металлах по вторым частям сделок своп, заключенных в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, учитываются в составе Нетто-обязательств / Нетто-требований Участника клиринга с Датой исполнения, соответствующей дате исполнения обязательств по вторым частям указанных сделок своп.
- 17.23. При наличии Недобросовестных участников клиринга, не исполнивших полностью или частично свои Итоговые нетто-обязательства в соответствующей валюте / драгоценном металле, для исполнения Итоговых нетто-требований в соответствующей валюте / драгоценном металле Добросовестных участников клиринга Клиринговый центр осуществляет действия в следующей последовательности:
- использует свободные собственные денежные средства / драгоценные металлы;
  - в случае недостаточности свободных собственных денежных средств, заключает сделки своп с Уполномоченными участниками клиринга, за исключением Банка России;
  - в случае невозможности заключения сделок своп с Уполномоченными участниками клиринга, за исключением Банка России, заключает в соответствии с Договором о взаимодействии сделки своп с Банком России, за исключением сделок своп с драгоценными металлами;
  - в случае невозможности заключения сделок своп с Уполномоченными участниками клиринга, включая Банк России, заключает сделки своп в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов с Добросовестными участниками клиринга.
- 17.23.1. Базовый курс и цена сделки своп, заключаемой Клиринговым центром с Уполномоченным участником клиринга, за исключением Банка России, определяются в соответствии с договором, заключенным Клиринговым центром с соответствующим Уполномоченным участником клиринга.
- 17.23.2. Клиринговый центр зачитывает встречные однородные Итоговые нетто-обязательства / Итоговые нетто-требования в соответствующей валюте / соответствующем драгоценном металле Уполномоченных участников клиринга, за исключением Банка России, с обязательствами / требованиями в соответствующей валюте / соответствующем драгоценном металле по первым частям сделок своп, заключенных с таким Уполномоченным участником клиринга в соответствии с пунктом 17.23 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, и направляет ему Клиринговый отчет и Биржевое свидетельство.
- 17.24. Порядок исполнения (прекращения) Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований в соответствующей валюте / соответствующем драгоценном металле Уполномоченных участников клиринга, за исключением Банка России, определен пунктами 17.17, 17.21 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, порядок учета обязательств / требований Уполномоченных участников клиринга по вторым частям сделок своп, заключенных Клиринговым

центром с таким Уполномоченным участником клиринга, - пунктом 17.22 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.

17.25. Условия сделок своп, заключаемых Клиринговым центром с Банком России в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, и порядок их исполнения, определены Договором о взаимодействии.

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

- принять решение об осуществлении исключительно клиринга с полным обеспечением по инструментам с такой иностранной валютой;
- прекратить обязательства Участников клиринга и Клирингового центра в такой иностранной валюте выплатой отступного, сумма которого рассчитывается по формуле:

$Penalty = |S|$ , где

$Penalty$  – сумма отступного, в российских рублях,

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

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

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

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

$Rc\_RUB\_VAL$  – Центральный курс сделок купли-продажи иностранной валюты  $VAL$ , обязательства в которых прекращаются выплатой отступного, рассчитанный в 19:00 по московскому времени текущего Расчетного дня.

Если  $S < 0$ , отступное, рассчитанное в соответствии с настоящим подпунктом Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, уплачивает Участник клиринга Клиринговому центру,

если  $S > 0$ , Клиринговый центр - Участнику клиринга.

Сумма отступного, рассчитанная в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, не облагается НДС.

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

### **Статья 18. Порядок оплаты услуг Клирингового центра, Биржи и Технического центра**

- 18.1. На валютном рынке и рынке драгоценных металлов Клиринговый центр взимает:
- комиссионное вознаграждение в пользу Клирингового центра за клиринговое обслуживание (далее – комиссионное вознаграждение Клирингового центра);
  - комиссионное вознаграждение в пользу Биржи за организацию торгов;
  - вознаграждение в пользу Технического центра за предоставление интегрированного технологического сервиса (ИТС), включая дополнительный комиссионный сбор за предоставление ИТС, установленный документами Технического центра (далее – Дополнительный комиссионный сбор).
- 18.2. Участник клиринга исполняет обязательства по уплате комиссионных вознаграждений Биржи и Технического центра за Участников торгов, имеющих право подавать заявки с указанием Расчетных кодов данного Участника клиринга.
- 18.3. Размер комиссионного вознаграждения Биржи за организацию торгов, вознаграждения Технического центра за предоставление ИТС и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за клиринговое обслуживание по сделкам с иностранной валютой, рассчитывается с учетом действующего для Участника торгов и/или Участника клиринга тарифного плана.
- 18.3.1. Тарифный план действует для Регистрационного кода (идентификатора) Участника торгов / для Идентификатора Участника клиринга и для всех Расчетных кодов, открытых в рамках Идентификатора Участника клиринга.
- 18.3.2. Тарифный план по сделкам своп применяется к сделкам своп, своп контрактам и фьючерсным контрактам.
- Выбор или изменение Участником торгов / Участником клиринга тарифного плана по сделкам своп осуществляется путем предоставления Клиринговому центру Заявления о выборе (смене) тарифного плана по сделкам своп.
- Заявление о выборе (смене) тарифного плана по сделкам своп предоставляется в Клиринговый центр не позднее, чем за 5 (пять) рабочих дней до начала календарного месяца, с которого будет применяться соответствующий тарифный план, за исключением случаев первоначального допуска к клиринговому обслуживанию.
- Тарифные планы по сделкам своп применяются с первого числа календарного месяца, за исключением Тарифного плана SWP\_0, который, в случае первоначального допуска к клиринговому обслуживанию, может применяться с любого числа календарного месяца.
- Участникам торгов / Участникам клиринга, не выбравшим ни один из тарифных планов по сделкам своп устанавливается тарифный план SWP\_0, который устанавливается с даты допуска Участника торгов к торгам / с даты допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию и действует до начала применения иного тарифного плана, выбранного Участником торгов / Участником

клиринга.

- 18.3.3. Тарифный план по сделкам спот применяется к сделкам спот с иностранной валютой.

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

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

Тарифные планы по сделкам спот применяются с первого числа календарного месяца, за исключением Тарифного плана SPT\_0, который, в случае первоначального допуска к клиринговому обслуживанию, может применяться с любого числа календарного месяца.

Участникам торгов / Участникам клиринга, не выбравшим ни один из тарифных планов по сделкам спот, устанавливается тарифный план SPT\_0, который устанавливается с даты допуска Участника торгов к торгам / с даты допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию и действует до начала применения иного тарифного плана, выбранного Участником торгов / Участником клиринга.

- 18.4. Размер оборотной части комиссионного вознаграждения Биржи за организацию торгов, оборотной части вознаграждения Технического центра за предоставление ИТС и оборотной части комиссионного вознаграждения Клирингового центра за клиринговое обслуживание по сделкам с иностранной валютой / драгоценными металлами рассчитывается после заключения Сделки и удерживается Клиринговым центром с Участника клиринга ежедневно в дату заключения Сделки в срок, установленный Временным регламентом на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.
- 18.5. Постоянная часть комиссионного вознаграждения Биржи за организацию торгов, постоянная часть вознаграждения Технического центра за предоставление ИТС и постоянная часть комиссионного вознаграждения Клирингового центра за клиринговое обслуживание по сделкам с иностранной валютой удерживается Клиринговым центром с Участника клиринга в первый Рабочий день календарного месяца, за который взимается постоянная часть комиссионного вознаграждения, в срок, установленный Временным регламентом на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, по Расчетному коду, указанному Участником клиринга в Заявлении о выборе Расчетного кода для списания комиссионных вознаграждений (в случае предоставления указанного заявления) либо по основному Расчетному коду.
- 18.5.1. Участник клиринга категории «О» вправе указать в Заявлении о выборе Расчетного кода для списания комиссионных вознаграждений Регистрационный код (идентификатор) и наименование Участника торгов в целях списания с указанного в заявлении Расчетного кода подлежащих уплате данным Участником торгов постоянных/фиксированных частей вознаграждений Биржи и/или Технического центра, минимальных ежемесячных комиссионных вознаграждений, а также

Дополнительного комиссионного сбора.

- 18.5.2. Заявление о выборе Расчетного кода для списания комиссионных вознаграждений действует, начиная с дня, следующего за днем его предоставления.
- 18.6. В случае приостановки / прекращения допуска Участника торгов к торгам / Участника клиринга к клиринговому обслуживанию в течение календарного месяца, постоянная часть комиссионного вознаграждения Биржи за организацию торгов, постоянная часть вознаграждения Технического центра за предоставление ИТС и/или постоянная часть комиссионного вознаграждения Клирингового центра за клиринговое обслуживание по сделкам с иностранной валютой, уплаченная Участником торгов / Участником клиринга, не пересчитывается и Участнику торгов / Участнику клиринга не возвращается.
- 18.7. В случае если для Участника торгов / Участника клиринга действует тарифный план SPT\_0 по сделкам спот и по итогам месяца:
- а) сумма рассчитанной оборотной части комиссионного вознаграждения Клирингового центра за клиринговое обслуживание по сделкам спот с иностранной валютой, подлежащего уплате Участником клиринга в течение истекшего месяца по всем Расчетным кодам, открытым в рамках одного Идентификатора Участника клиринга, меньше, чем минимальное ежемесячное комиссионное вознаграждение, установленное Тарифами Клирингового центра, и/или
  - б) сумма рассчитанной оборотной части комиссионного вознаграждения Биржи за организацию торгов по сделкам спот с иностранной валютой, подлежащего уплате Участником торгов в течение истекшего месяца по всем Расчетным кодам, соответствующим одному Регистрационному коду (идентификатору) Участника торгов, меньше, чем минимальное ежемесячное комиссионное вознаграждение, установленное Тарифами Биржи, и/или
  - в) сумма рассчитанной оборотной части вознаграждения Технического центра за предоставление ИТС по сделкам спот с иностранной валютой, подлежащего уплате Участником торгов в течение истекшего месяца по всем Расчетным кодам, соответствующим одному Регистрационному коду (идентификатору) Участника торгов, меньше, чем минимальное ежемесячное комиссионное вознаграждение, установленное Тарифами Технического центра,

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

Указанная разница удерживается в случае, если Участник клиринга / Участник торгов имел доступ к клиринговому обслуживанию / торгам в течение одного и более дней в календарном месяце, вне зависимости от факта подачи заявок, заключения и/или исполнения Сделок, в последний Рабочий день месяца по Расчетному коду, указанному Участником клиринга в Заявлении о выборе Расчетного кода для списания комиссионных вознаграждений, предоставленном в соответствии с пунктом 18.5 Правил клиринга на валютном рынке и рынке

драгоценных металлов (в случае предоставления указанного заявления), либо по основному Расчетному коду, соответствующему Регистрационному коду (идентификатору) Участника торгов / Идентификатору Участника клиринга, по которому зафиксировано превышение соответствующего минимального ежемесячного комиссионного вознаграждения над суммой, указанной, соответственно, в подпункте «а», и/или «б», и/или «в» настоящего пункта Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.

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

- 18.8. Фиксированная часть вознаграждения за предоставление ИТС удерживается Клиринговым центром с Участника клиринга в первый Рабочий день календарного месяца, следующего за месяцем фактического оказания услуг по предоставлению ИТС, в срок, установленный Временным регламентом на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, по Расчетному коду, указанному Участником клиринга в Заявлении о выборе Расчетного кода для списания комиссионных вознаграждений, предоставленном в соответствии с пунктом 18.5 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов (в случае предоставления указанного заявления), либо основному Расчетному коду.

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

- 18.9. Подлежащий уплате в соответствии с Тарифами Технического центра Дополнительный комиссионный сбор, рассчитанный в отношении Участника торгов / Клиента, удерживается Клиринговым центром с Участника клиринга в Расчетный день, по итогам которого указанное дополнительное вознаграждение рассчитано, в срок, установленный Временным регламентом на валютном рынке и рынке драгоценных металлов для уплаты комиссионного вознаграждения, по Расчетному коду, с указанием которого Участником торгов в течение данного Расчетного дня были поданы заявки на заключение Сделок за свой счет или за счет указанного Клиента (в случае если такой Расчетный код – единственный) либо по Расчетному коду, указанному Участником клиринга в Заявлении о выборе Расчетного кода для списания комиссионных вознаграждений, предоставленном в соответствии с пунктом 18.5 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов (в случае предоставления указанного заявления), либо по основному Расчетному коду, если Участником торгов в течение данного Расчетного дня были поданы заявки на заключение Сделок за свой счет или за счет указанного Клиента с указанием нескольких Расчетных кодов.

- 18.10. Комиссионное вознаграждение Клирингового центра за учет клирингового обеспечения удерживается Клиринговым центром с Участника клиринга в первый Рабочий день календарного месяца, следующего за месяцем оказания услуг, по

Расчетному коду, указанному Участником клиринга в Заявлении о выборе Расчетного кода для списания комиссионных вознаграждений (в случае предоставления указанного заявления) либо по основному Расчетному коду, за исключением случаев, предусмотренных Тарифами Клирингового центра.

Клиринговый центр ежемесячно направляет Участнику клиринга Отчет о комиссионном вознаграждении за учет клирингового обеспечения.

- 18.11. Информация о размере комиссионного вознаграждения Биржи, Технического центра и Клирингового центра, подлежащего уплате Участником торгов / Участником клиринга в отчетную дату, указывается в Отчете о комиссионных вознаграждениях, направляемом Клиринговым центром Участникам клиринга в сроки, установленные Временным регламентом на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.
- 18.12. Клиринговый центр зачитывает требование Участника клиринга к Клиринговому центру по возврату Участнику клиринга денежных средств в российских рублях, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга, с обязательством Участника клиринга по уплате комиссионных вознаграждений.
- При этом размер Обеспечения Участника клиринга в российских рублях уменьшается на сумму обязательства Участника клиринга по уплате комиссионных вознаграждений.
- 18.13. Информация о рассчитанном Клиринговым центром размере оборотной части комиссионного вознаграждения Биржи за организацию торгов, оборотной части вознаграждения Технического центра за предоставление ИТС и оборотной части комиссионного вознаграждения Клирингового центра за клиринговое обслуживание по каждой заключенной Сделке становится доступной Бирже посредством ПТК ТЦ немедленно после его расчета.
- 18.13.1. Участник торгов не имеет доступа к информации об оборотной части комиссионного вознаграждения Клирингового центра за клиринговое обслуживание, подлежащей уплате Участником клиринга, не являющимся таким Участником торгов, по Сделкам, заключенным данным Участником торгов.

## **Статья 19. Порядок предоставления отчетов по итогам клиринга**

- 19.1. Клиринговый центр обеспечивает Участнику клиринга с использованием рабочего места Участника клиринга возможность получения следующей информации из Клиринговой системы:
- о Сделках, стороной по которым является Участник клиринга;
  - о размере Обеспечения Участника клиринга в каждой валюте / каждом драгоценном металле;
  - о размере Единого лимита Участника клиринга;
  - о размере Торгового лимита Участника клиринга (в случае если для Участника клиринга установлен Торговый лимит);
  - о значении Нетто-обязательства и/или Нетто-требования Участника клиринга в каждой валюте / каждом драгоценном металле и с каждой Датой исполнения;

- о размере Обеспечения Участника клиринга в каждой валюте / каждом драгоценном металле, недостающего для исполнения Нетто-обязательства Участника клиринга в соответствующей валюте / соответствующем драгоценном металле с наступившей Датой исполнения;
- о наличии / отсутствии Маржинального требования Участника клиринга, о сумме Маржинального требования в российских рублях (в случае наличия);
- о наличии / отсутствии Задолженности Участника клиринга перед Клиринговым центром, о сумме Задолженности Участника клиринга (в случае наличия).

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

- Отчет об обязательствах, содержащий информацию о допущенных к клирингу обязательствах по Сделкам, не являющимся производными финансовыми инструментами, по всем Датам исполнения;
- Отчет об обязательствах по ПФИ, содержащий информацию о допущенных к клирингу обязательствах по своп контрактам и фьючерсным контрактам и обязательствах по уплате вариационной маржи;
- Клиринговый отчет, содержащий информацию об обязательствах, включенных в клиринговый пул;
- Биржевое свидетельство, предварительное Биржевое свидетельство, содержащие информацию об обязательствах, определенных по результатам клиринга;
- Отчет о сделках, дата исполнения которых перенесена, содержащий информацию об обязательствах, исключенных из клирингового пула;
- Отчет о движении денежных средств, содержащий информацию о размере Обеспечения Участника клиринга в денежных средствах / драгоценных металлах, об изменении размера такого Обеспечения, включая информацию об использовании Обеспечения, в том числе для исполнения обязательств, определенных по итогам клиринга;
- Отчет о комиссионных вознаграждениях;
- Отчет о Клиринговых идентификаторах;
- Требование о погашении Задолженности;
- Отчет о Маржинальном требовании;
- Отчет о Поручениях на управление риском;
- Отчет о комиссионном вознаграждении за учет клирингового обеспечения.

19.3. Отчеты, указанные в пункте 19.2 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, направляются Участнику клиринга в форме электронных документов в соответствии с Порядком ЭДО.

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

Копии электронных документов на бумажном носителе и отчеты по итогам клиринга на бумажном носителе подписываются уполномоченным лицом Клирингового центра и передаются сотруднику Участника клиринга, действующему на основании доверенности, либо направляются Участнику

клиринга по почте заказным письмом с уведомлением.

19.4. Формы и форматы отчетов по итогам клиринга, предоставляемых Клиринговым центром Участникам клиринга в соответствии с Правилами клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, установлены документом «Формы и форматы отчетов, предоставляемых Участникам клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов», раскрываемом на Сайте Клирингового центра.

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

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

## **РАЗДЕЛ VII. ПРОЧИЕ УСЛОВИЯ**

### **Статья 20. Особенности перевода обязательств и Обеспечения одного Участника клиринга другому Участнику клиринга**

20.1. Согласие на прием, предоставляемое Участником клиринга - реципиентом, помимо информации, предусмотренной общей частью Правил клиринга, должно содержать информацию о Расчетных кодах Участника клиринга – реципиента, по которым необходимо учесть переводимые обязательства и Обеспечение.

Согласие на прием может содержать информацию о Расчетных кодах, открытых Базовым Участником клиринга для Обособленного клиента, и информацию о соответствующих им клиентском Расчетном коде (Расчетных кодах), открытых для Обособленного клиента Участником клиринга - реципиентом, или информацию о клиентском Расчетном коде Участника клиринга – реципиента, по которым необходимо учесть переводимые обязательства и Обеспечение.

20.2. Для исполнения Заявления на перевод обязательств и Обеспечения Клиринговый центр помимо действий, предусмотренных общей частью Правил клиринга:

- списывает драгоценные металлы со Счета обеспечения Базового Участника клиринга, соответствующего Расчетному коду, за которым закреплен Обособленный клиент, предоставивший Заявление на перевод обязательств и Обеспечения, и зачисляет на Счет обеспечения, соответствующий Расчетному коду Участника клиринга – реципиента.

**Приложение № 1**

к Правилам клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов

**Временной регламент на валютном рынке и рынке драгоценных металлов**

<b>№ п/п</b>	<b>Наименование операции</b>	<b>Время (москowsкое)</b>
1.	Передача Участником клиринга в Клиринговый центр Запроса на проведение ранних расчетов.	до 16:30 Расчетного дня
2.	Определение Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований в юанях, белорусских рублях, тенге, гонконгских долларах, сомони.	11:00 Даты исполнения
3.	Определение Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований в евро, фунтах стерлингов и гривнах Участников клиринга, не предоставивших Запрос на проведение ранних расчетов или Постоянное поручение на проведение ранних расчетов.	15:15 Даты исполнения
4.	Определение Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований:	
	- Участников клиринга, предоставивших Запрос на проведение ранних расчетов до 11:00 или Постоянное поручение на проведение ранних расчетов с указанием времени 11:00;	11:00 Даты исполнения
	- Участников клиринга, предоставивших Запрос на проведение ранних расчетов с 11:00 до 14:00;	в течение 15 минут после получения Клиринговым центром Запроса на проведение ранних расчетов
	- Участников клиринга, предоставивших Запрос на проведение ранних расчетов с 14:00 до 15:15 или Постоянное поручение на проведение ранних расчетов с указанием времени 15:15;	15:15 Даты исполнения
	- Участников клиринга, предоставивших Запрос на проведение ранних расчетов с 15:15 до 16:30;	в течение 15 минут после получения Клиринговым центром Запроса на проведение ранних расчетов
	- Участников клиринга, не предоставивших Запрос на проведение ранних расчетов или Постоянное поручение на проведение ранних расчетов.	17:30 Даты исполнения
5.	Определение Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований Участников клиринга, которыми превышено количество Расчетных дней, в течение которых у Участника клиринга может возникать неисполненное Итоговое нетто-обязательство.	10:00
6.	Передача Клиринговым центром предварительных Биржевых свидетельств, содержащих обязательства в юанях, белорусских рублях, тенге и гонконгских долларах, сомони.	с 11:00 до 11:15 Даты исполнения

№ п/п	Наименование операции	Время (московское)
7.	Передача Клиринговым центром предварительных Биржевых свидетельств, содержащих обязательства в евро, фунтах стерлингов, гривнах, Участникам клиринга, не предоставившим Запрос на проведение ранних расчетов или Постоянное поручение на проведение ранних расчетов.	с 15:15 до 15:30 Даты исполнения
8.	Передача Клиринговым центром Клиринговых отчетов, Биржевых свидетельств:	
	- Участникам клиринга, предоставившим Запрос на проведение ранних расчетов до 11:00 или Постоянное поручение на проведение ранних расчетов с указанием времени 11:00;	с 11:00 до 11:15 Даты исполнения
	- Участникам клиринга, предоставившим Запрос на проведение ранних расчетов с 11:00 до 14:00;	в течение 15 минут после получения Клиринговым центром Запроса на проведение ранних расчетов
	- Участникам клиринга, предоставившим Запрос на проведение ранних расчетов с 14:00 до 15:15 или Постоянное поручение на проведение ранних расчетов с указанием времени 15:15;	с 15:15 до 15:30 Даты исполнения
	- Участникам клиринга, предоставившим Запрос на проведение ранних расчетов с 15:15 до 16:30;	в течение 15 минут после получения Клиринговым центром Запроса на проведение ранних расчетов
	- Участникам клиринга, не предоставившим Запрос на проведение ранних расчетов или Постоянное поручение на проведение ранних расчетов.	с 17:30 до 17:45 Даты исполнения
9.	Передача в Клиринговый центр Запросов о депонировании денежных средств:	
	- в тенге, белорусских рублях, юанях, гонконгских долларах, сомони;	до 11:15 Даты исполнения
	- в долларах США, российских рублях, евро, фунтах стерлингов, гривнах:	
	Участником клиринга, предоставившим Запрос на проведение ранних расчетов до 11:00 или Постоянное поручение на проведение ранних расчетов с указанием времени 11:00;	до 11:15 Даты исполнения
	Участником клиринга, предоставившим Постоянное поручение на проведение ранних расчетов с указанием времени 15:15;	до 15:30 Даты исполнения
	Участником клиринга, предоставившим Запрос на проведение ранних расчетов после 11:00 и до 16:30;	до направления Запроса на проведение ранних расчетов
	Участником клиринга, не предоставившим Запрос на проведение ранних расчетов или Постоянное поручение на проведение ранних расчетов.	до 17:45 Даты исполнения – по долларам США и российским рублям; до 15:30 Даты исполнения - по евро, фунтам стерлингов, гривнам
10.	Проведение клиринговой сессии.	с 9:30 до 10:00 Расчетного дня

№ п/п	Наименование операции	Время (московское)
11.	Передача Клиринговым центром Участникам клиринга Отчетов об обязательствах, Отчетов об обязательствах по ПФИ, Отчетов о Маржинальном требовании, Требований о погашении задолженности.	до 10:15 Расчетного дня
12.	Передача Клиринговым центром Участникам клиринга Отчетов о движении денежных средств.	до 11:00 Расчетного дня, следующего за днем, за который формируется отчет
13.	Исполнение Маржинальных требований.	до 17:30 дня возникновения Маржинального требования
14.	Заключение сделок с иностранной валютой / драгоценными металлами в случае неисполнения Участником клиринга Маржинального требования.	с 17:30 дня возникновения Маржинального требования
15.	Погашение Задолженности, возникшей в связи с неисполнением обязательства по уплате Гарантийных переводов / вариационной маржи.	до 20:00 дня возникновения Задолженности
16.	Погашение Задолженности, возникшей в связи с неисполнением Итогового нетто-обязательства по денежным средствам.	до 20:00 Расчетного дня, следующего за днем возникновения Задолженности
17.	Передача Клиринговым центром Отчетов о комиссионных вознаграждениях и Клиринговых отчетов, содержащих информацию о Сделках с Датой исполнения в дату их заключения, заключенных после 17:30:	
	- Участникам клиринга, предоставившим Запрос или Постоянное поручение на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром в 18:00;	до 18:15 Даты исполнения
	- Участникам клиринга, предоставившим Запрос или Постоянное поручение на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром в 19:00;	до 19:15 Даты исполнения
	- Участникам клиринга, не предоставившим Запрос или Постоянное поручение на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром.	до 09:30 Расчетного дня, следующего за Датой исполнения
18.	Исполнение Участниками клиринга Итоговых нетто-обязательств перед Клиринговым центром:	
	- в тенге;	до 11:00 Даты исполнения
	- в юанях, белорусских рублях, гонконгских долларах, сомони;	до 12:00 <sup>1</sup> Даты исполнения
	- в гривнах;	до 15:15 Даты исполнения
	- в евро, фунтах стерлингов;	до 17:00 <sup>1</sup> Даты исполнения
	- в долларах США, российских рублях и драгоценных металлах.	до 20:00 <sup>1</sup> Даты исполнения
19.	Исполнение Итоговых нетто-обязательств Участниками клиринга, которыми превышено количество Расчетных дней, в течение которых у Участника клиринга может возникать неисполненное Итоговое нетто-обязательство.	10:00

№ п/п	Наименование операции	Время (московское)
20.	Исполнение обязательств по уплате комиссионных вознаграждений:	
	- Участниками клиринга, предоставившими Клиринговому центру Запрос на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром или Постоянное поручение на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром;	до 20:00 <sup>1</sup> даты заключения Сделки
	- Участниками клиринга, не предоставившими Клиринговому центру Запрос на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром или Постоянное поручение на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром.	до 20:00 <sup>1</sup> Расчетного дня, следующего за датой заключения Сделки
21.	Заключение сделок своп в целях урегулирования неисполненных обязательств по Сделкам.	с 20:00 <sup>1</sup> до 20:30 <sup>1</sup> Расчетного дня
22.	Передача Клиринговым центром Участникам клиринга Клиринговых отчетов и Биржевых свидетельств по итогам заключения сделок своп в целях урегулирования неисполненных обязательств по Сделкам.	до 20:45 <sup>1</sup> Расчетного дня
23.	Прекращение Клиринговым центром Итоговых нетто-требований Участников клиринга.	В Дату исполнения
24.	Возврат Клиринговым центром Участникам клиринга денежных средств, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга в результате прекращения Итоговых нетто-требований Участников клиринга, если прекращение Итоговых нетто-требований Участника клиринга в соответствующей валюте осуществлено до указанного времени:	в Дату исполнения
	- в тенге;	до 11:45 Даты исполнения
	- в юанях, белорусских рублях, гонконгских долларах, сомони;	до 12:45 Даты исполнения
	- в фунтах стерлингов, евро, гривнах <sup>2</sup> ;	до 17:45 Даты исполнения
	- в долларах США, российских рублях;	до 20:00 Даты исполнения
25.	Исполнение Итоговых нетто-требований Участников клиринга в драгоценных металлах.	в Дату исполнения
26.	Передача Участником клиринга в Клиринговый центр Запросов о возврате:	
	- гривен с зачислением на счет получателя не позднее Расчетного дня, следующего за датой получения запроса;	до 10:30 Расчетного дня
	- гривен с зачислением на счет получателя не позднее второго Расчетного дня после даты получения запроса;	с 10:30 до 17:30 Расчетного дня
	- юаней, гонконгских долларов;	до 11:00 Расчетного дня
	- белорусских рублей, тенге, сомони;	до 12:00 Расчетного дня
	- евро, фунтов стерлингов;	до 17:00 Расчетного дня

<b>№ п/п</b>	<b>Наименование операции</b>	<b>Время (московское)</b>
	- долларов США, российских рублей, драгоценных металлов.	до 20:00 Расчетного дня

<sup>1</sup> - при наличии сбоя в платежных системах указанное время может быть продлено по решению Клирингового центра до устранения указанного сбоя.

<sup>2</sup> - зачисление на Счет для возврата будет произведено в соответствии со сроками исполнения распоряжений в иностранной валюте по корреспондентским счетам Расчетного банка, опубликованными на официальном сайте Расчетного банка в сети Интернет.