

УТВЕРЖДЕНЫ

Центральный Банк
Российской Федерации (Банк России)
ЗАРЕГИСТРИРОВАНО
Дата 12 июля 2016 г.

решением Наблюдательного совета
Банка НКЦ (АО)

от «17» июня 2016 года (Протокол № 2)

Председатель Наблюдательного совета
Банка НКЦ (АО)



Денисов Ю.О.

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

Москва, 2016 г.

СОДЕРЖАНИЕ

РАЗДЕЛ I. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ	4
Статья 1. Термины и определения	4
Статья 2. Общие положения	5
Статья 3. Особенности использования Аналога собственноручной подписи	6
Статья 4. Клиринговые регистры	7
Статья 5. Клиринговые регистры по договору о ведении клиринговых регистров	8
РАЗДЕЛ II. ТРЕБОВАНИЯ К УЧАСТНИКАМ КЛИРИНГА	10
Статья 6. Условия клирингового обслуживания. Порядок предоставления допуска к клиринговому обслуживанию	10
Статья 7. Особенности приостановления и прекращения допуска к клиринговому обслуживанию	12
Статья 8. Особенности регистрации Участников клиринга и Торгово-клиринговых счетов, открытия Счетов обеспечения	14
РАЗДЕЛ III. МЕРЫ, НАПРАВЛЕННЫЕ НА УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ ПРИ ОСУЩЕСТВЛЕНИИ КЛИРИНГА	16
Статья 9. Перечень мер, направленных на управление рисками при осуществлении клиринга	16
Статья 10. Единый лимит по Расчетному коду и риск-параметры	16
Статья 11. Порядок исполнения Поручений на управление риском	20
РАЗДЕЛ IV. ПОРЯДОК И УСЛОВИЯ ДОПУСКА ОБЯЗАТЕЛЬСТВ К КЛИРИНГУ ...	21
Статья 12. Порядок взаимодействия с Биржей при подаче заявок и заключении Сделок	21
РАЗДЕЛ V. ПОРЯДОК ПРОВЕДЕНИЯ КЛИРИНГА	30
ПОДРАЗДЕЛ V-I. ПОРЯДОК ВНЕСЕНИЯ И ВОЗВРАТА ОБЕСПЕЧЕНИЯ	30
Статья 13. Порядок внесения Обеспечения	30
Статья 14. Порядок возврата Обеспечения	33
ПОДРАЗДЕЛ V-II. КЛИРИНГОВЫЕ СЕССИИ	38
Статья 15. Порядок проведения клиринговых сессий. Порядок возникновения и исполнения Маржинальных требований	38
Статья 16. Вариационная маржа	41
ПОДРАЗДЕЛ V-III. ПОРЯДОК ОПРЕДЕЛЕНИЯ И ИСПОЛНЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ ПО СДЕЛКАМ	46
Статья 17. Порядок исполнения / прекращения обязательств по Сделкам	46
Статья 18. Порядок действий в случае наличия Задолженности и/или обязательств по Сделкам, не обеспеченных средствами под исполнение	50
Статья 19. Порядок заключения и условия сделок своп / сделки купли-продажи с иностранной валютой / драгоценным металлом, заключаемых с Недобросовестными участниками клиринга	53
Статья 20. Порядок заключения и условия сделок своп / сделки купли-продажи с иностранной валютой / драгоценным металлом, заключаемых с Добросовестным участником клиринга	58

РАЗДЕЛ VI.	ПОРЯДОК ОПЛАТЫ УСЛУГ. ОТЧЕТЫ ПО ИТОГАМ КЛИРИНГА	60
Статья 21.	Порядок оплаты услуг Клирингового центра, Биржи и Технического центра	60
Статья 22.	Порядок предоставления информации и отчетов по итогам клиринга	66
РАЗДЕЛ VII.	ПРОЧИЕ УСЛОВИЯ	71
Статья 23.	Особенности перевода обязательств и Обеспечения одного Участника клиринга другому Участнику клиринга	71
Приложение № 1	Временной регламент на валютном рынке и рынке драгоценных металлов	72

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:

Биржевое свидетельство –	документ, предоставляемый Клиринговым центром Участнику клиринга, содержащий информацию об Итоговых нетто-обязательствах и/или Итоговых нетто-требованиях.
Договор о взаимодействии -	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.
Методика определения риск-параметров валютного рынка и рынка драгоценных металлов -	внутренний документ Клирингового центра, устанавливающий порядок определения риск-параметров валютного рынка и рынка драгоценных металлов ПАО Московская Биржа.
Расчетная цена -	цена, используемая для расчета вариационной маржи по своп контракту / фьючерсному контракту, определяемая в соответствии с Правилами клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.
Сделка -	каждая из заключаемых на торгах Биржи сделок с иностранной валютой / драгоценным металлом, в т.ч. сделка спот, сделка своп, своп контракт или фьючерсный контракт.
Система «Клиент-КлирингБанк» -	автоматизированная система дистанционного банковского и клирингового обслуживания, предназначенная для осуществления электронного документооборота между Участниками клиринга и Клиринговым центром.
Счет обеспечения в драгоценном металле -	открытый в Клиринговом центре обезличенный металлический счет Участника клиринга, предназначенный для учета Обеспечения Участника клиринга в соответствующем драгоценном металле.

Уполномоченный участник клиринга -	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 осуществляет клиринг с частичным обеспечением по Сделкам, заключенным Участниками клиринга категории «О» и «Б».
- 2.4. Клиринговый центр осуществляет клиринг с полным обеспечением по Сделкам, заключенным Участниками клиринга категории «В».
- 2.5. 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.
- 2.6. Обеспечение Участника клиринга в иностранной валюте и/или драгоценных металлах, не являющееся индивидуальным или коллективным клиринговым обеспечением, 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.
- 2.7. Учет обязательств и Обеспечения Участника клиринга в драгоценных металлах осуществляется в граммах.
- 2.8. 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».

- 2.8.1. Порядок формирования и передачи электронных документов посредством системы «Клиент-КлирингБанк» предусмотрен договором об участии в системе «Клиент - КлирингБанк» Банка «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество), заключенным Участником клиринга с Клиринговым центром.
- 2.8.2. Электронные документы, направляемые посредством Системы «Клиент–КлирингБанк», формируются исключительно средствами Системы «Клиент–КлирингБанк» в формате, поддерживаемом программным обеспечением Системы «Клиент–КлирингБанк».
- 2.8.3. 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.
- 2.9. 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, Участниками торгов на валютном рынке и рынке драгоценных металлов», если иное не установлено Правилами клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.
- 2.10. 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.
- 2.11. 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 / Участника торгов или Клиринговый центр, направивших электронное сообщение и достоверно установить, что электронное сообщение исходит от Участника клиринга / Участника торгов или Клирингового центра, которому присвоен данный Клиринговый идентификатор.
- 3.2. Присвоение Клирингового идентификатора Участнику клиринга, Участнику торгов или Клиринговому центру осуществляется Клиринговым центром.

Порядок присвоения Клирингового идентификатора Участнику клиринга / Участнику торгов определен общей частью Правил клиринга.

Включение информации о Клиринговом идентификаторе Участника клиринга / Участника торгов в состав ежедневного Отчета о Клиринговых идентификаторах, считается уведомлением о присвоении Клирингового идентификатора Участнику клиринга / Участнику торгов.

Сведения о присвоенных Клиринговых идентификаторах относятся к конфиденциальным. Участник клиринга, Участник торгов 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 Расчетному коду;
 - обязанности и требования Участника клиринга по каждому обязательству по Сделке, допущенному к клирингу;
 - совокупность Поручений на управление риском;
 - обязательства Участника клиринга и Клирингового центра по уплате вариационной маржи 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 или иностранной валюте, учитываемое по Расчетному коду, также учитывается на Счете обеспечения в соответствующей валюте, соответствующем Расчетному коду.
- Обеспечение Участника клиринга в драгоценном металле, учитываемое по Расчетному коду, также учитывается на Счете обеспечения в соответствующем драгоценном металле, соответствующем Расчетному коду.
- 4.4. По требованию Участника клиринга, предъявленному Клиринговому центру путем предоставления Заявления на регистрацию Торгово-клирингового счета 2-го уровня в соответствии с общей частью Правил клиринга, на клиринговых

регистрах Клиринговый центр учитывает в разрезе Расчетных кодов 2-го уровня:

- информацию об Обеспечении в каждой валюте и каждом драгоценном металле, внесенном с указанием Расчетного кода 2-го уровня;
- информацию о Нетто-обязательствах / Нетто-требованиях с каждой Датой исполнения в каждой валюте и каждом драгоценном металле, рассчитанных по Сделкам, заключенным с указанием Торгово-клирингового счета 2-го уровня, в состав которого входит Расчетный код 2-го уровня, и Сделкам, заключенным с указанием Торгово-клирингового счета 3-го уровня, в состав которого входит Расчетный код 3-го уровня, связанный с Расчетным кодом 2-го уровня;
- информацию об обязательствах по уплате вариационной маржи по Сделкам, заключенным с указанием Торгово-клирингового счета 2-го уровня, в состав которого входит Расчетный код 2-го уровня, и Сделкам, заключенным с указанием Торгово-клирингового счета 3-го уровня, в состав которого входит Расчетный код 3-го уровня, связанный с Расчетным кодом 2-го уровня;
- информацию о прекращении обязательств по Сделкам, заключенным с указанием Торгово-клирингового счета 2-го уровня, в состав которого входит Расчетный код 2-го уровня, и Сделкам, заключенным с указанием Торгово-клирингового счета 3-го уровня, в состав которого входит Расчетный код 3-го уровня, связанный с Расчетным кодом 2-го уровня, включая информацию о прекращении обязательств по уплате вариационной маржи по указанным Сделкам;
- информацию о Едином лимите по Расчетному коду 2-го уровня.

4.5. Порядок ведения клиринговых регистров определен в соответствующих статьях разделов IV и V Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.

Статья 5. Клиринговые регистры по договору о ведении клиринговых регистров

5.1. По требованию Участника торгов, предъявленному Клиринговому центру путем предоставления Заявления на регистрацию Торгово-клирингового счета 3-го уровня в соответствии с общей частью Правил клиринга, на регистрах Клиринговый центр учитывает в разрезе Расчетных кодов 3-го уровня:

- информацию об Обеспечении в каждой валюте и каждом драгоценном металле, внесенном с указанием Расчетного кода 3-го уровня;
- информацию о Нетто-обязательствах / Нетто-требованиях с каждой Датой исполнения в каждой валюте и каждом драгоценном металле, рассчитанных по Сделкам, заключенным с указанием Торгово-клирингового счета 3-го уровня, в состав которого входит Расчетный код 3-го уровня;
- информацию об обязательствах по уплате вариационной маржи по Сделкам, заключенным с указанием Торгово-клирингового счета 3-го уровня, в состав которого входит Расчетный код 3-го уровня;
- информацию о прекращении обязательств по Сделкам, заключенным с указанием Торгово-клирингового счета 3-го уровня, в состав которого входит Расчетный код 3-го уровня, включая информацию о прекращении обязательств по уплате вариационной маржи по указанным Сделкам;
- информацию о Едином лимите по Расчетному коду 3-го уровня.

- 5.2. Порядок ведения клиринговых регистров, открываемых по договору о ведении 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 6. Условия клирингового обслуживания. Порядок предоставления допуска к клиринговому обслуживанию

- 6.1. 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».
- 6.2. 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 6.3-6.5 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.
- 6.3. Для допуска к клиринговому обслуживанию Участник клиринга категории «В» должен дополнительно соответствовать следующему требованию:
- 6.3.1. Участник клиринга - Некредитная организация, не являющийся профессиональным участником рынка ценных бумаг, иметь собственные средства (капитал) не менее, чем 1 000 000 000 (один миллиард) российских рублей.
- 6.4. Для допуска к клиринговому обслуживанию Участник клиринга категории «Б» должен дополнительно соответствовать следующему требованию:
- 6.4.1. Участник клиринга - Некредитная организация, являющийся профессиональным участником рынка ценных бумаг, иметь собственные средства (капитал) не менее, чем 180 000 000 (сто восемьдесят миллионов) российских рублей;
- 6.4.2. Участник клиринга - Некредитная организация, не являющийся профессиональным участником рынка ценных бумаг, иметь собственные средства (капитал) не менее, чем 50 000 000 000 (пятьдесят миллиардов) российских рублей и рейтинг по международной шкале долгосрочной кредитоспособности по обязательствам в российских рублях или в иностранной валюте не ниже ВВ- по классификации рейтинговых агентств "Standard & Poor's" или "Fitch Ratings" либо "Ba3" по классификации рейтингового агентства "Moody's Investors Service".
- 6.5. Для допуска к клиринговому обслуживанию Участник клиринга категории «О» должен дополнительно соответствовать следующим требованиям:
- 6.5.1. иметь собственные средства (капитал) не менее, чем 50 000 000 000 (пятьдесят миллиардов) российских рублей, либо
- 6.5.2. 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 ВВ+ по классификации рейтинговых агентств "Standard & Poor's" или "Fitch Ratings" либо "Ba1" по классификации рейтингового агентства "Moody's"

Investors Service", либо

- 6.5.3. 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 ВВ+ по классификации рейтинговых агентств "Standard & Poor's" или "Fitch Ratings" либо "Ba1" по классификации рейтингового агентства "Moody's Investors Service".
- 6.5.4. 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).
- 6.5.5. Для проверки соответствия собственных средств (капитала) Участника клиринга – Нерезидента требованиям, установленным подпунктами 6.5.1-6.5.3 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».
- 6.6. В случае изменения суверенного рейтинга Российской Федерации, значения рейтингов по международной шкале долгосрочной кредитоспособности по обязательствам в российских рублях или в иностранной валюте, применяемые для предоставления допуска к клиринговому обслуживанию в соответствии с подпунктами 6.4.2 и/или 6.5.2 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, могут быть изменены решением Клирингового центра, раскрываемом на Сайте Клирингового центра.
- 6.7. 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.
- 6.8. Клиринговый центр вправе запросить у Участника клиринга, соответствующего требованиям подпункта 6.5.3 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.

- 6.9. На основании анализа информации и/или документов, полученных Клиринговым центром от Участника клиринга в соответствии с пунктами 6.6 и 6.8 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».
- 6.10. Клиринговый центр вправе предоставить Участнику клиринга допуск к клиринговому обслуживанию как по всем инструментам, так и по ограниченному перечню инструментов.
- 6.11. Для заключения сделок купли-продажи драгоценных металлов Участником клиринга должен быть открыт Счет обеспечения в соответствующем драгоценном металле.

Статья 7. Особенности приостановления и прекращения допуска к клиринговому обслуживанию

- 7.1. Клиринговый центр вправе приостановить допуск к клиринговому обслуживанию Участника клиринга категории «О», категории «Б» или категории «В» по всем сделкам или по отдельным видам сделок 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 6.3.1 Правил клиринга.
- 7.2. Клиринговый центр вправе установить Участнику клиринга категории «Б» категорию «В» по основаниям, предусмотренным общей частью Правил клиринга, а также в следующем случае:
 - 7.2.1. при несоответствии размера собственных средств (капитала) Участника клиринга требованию, установленному подпунктом 6.4.1 или подпунктом 6.4.2 Правил клиринга;
 - 7.2.2. при превышении установленного в подпункте 19.1.5 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов количества Расчетных дней, в течение которых у Участника клиринга может возникать Итоговое нетто-обязательство, не

обеспеченное средствами под исполнение.

- 7.3. Клиринговый центр вправе установить по всем Торгово-клиринговым счетам 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:
- 7.3.1. при превышении установленного в подпункте 19.1.5 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов количества Расчетных дней, в течение которых у Участника клиринга может возникать Итоговое нетто-обязательство, не обеспеченное средствами под исполнение;
- 7.3.2. при несоответствии размера взноса Участника клиринга в Гарантийный фонд размеру, установленному в соответствии с пунктом 9.2 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов;
- 7.3.3. при несоответствии размера Обеспечения под стресс Участника клиринга размеру, установленному в соответствии с пунктом 9.3 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов;
- 7.3.4. при несоответствии Участника клиринга требованиям, установленным подпунктом 6.5.1, или подпунктом 6.5.2, или подпунктом 6.5.3 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.
- При этом в целях проверки соответствия собственных средств (капитала) Участника клиринга – Нерезидента требованиям, установленным подпунктами 6.5.1-6.5.3 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.
- 7.4. В случае если действие оснований для установления Участнику клиринга категории «О» признака «запрет коротких продаж» и признака «запрет необеспеченных покупок», предусмотренных подпунктами 7.3.2-7.3.4 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, не прекращено в течение 3-х рабочих дней после установления указанного признака в соответствии с пунктами 7.3, 9.4 или 9.5 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.
- 7.5. Клиринговый центр вправе установить Участнику клиринга категории «О» категорию «Б» в случае, если в течение 2-х (двух) лет с даты присвоения Участнику клиринга категории «О» такому Участнику клиринга не было зарегистрировано Клиринговым центром ни одного Торгово-клирингового счета 2-го уровня для Участника торгов.
- 7.6. Клиринговый центр прекращает допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию (независимо от его категории) по любому из оснований, предусмотренных общей частью Правил клиринга, а также:

- 7.6.1. отзыв (аннулирование) Банком России лицензии на осуществление клиринговой деятельности у Участника клиринга категории «О», не имеющего лицензии Банка России на осуществление банковских операций.

Статья 8. Особенности регистрации Участников клиринга и Торгово-клиринговых счетов, открытия Счетов обеспечения

- 8.1. 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.
- 8.2. На валютном рынке и рынке драгоценных металлов необходима регистрация Торгово-клиринговых счетов Участника клиринга, а также возможна регистрация Торгово-клиринговых счетов Участника торгов / клиента Участников клиринга и Торгово-клиринговых счетов клиента Участников торгов.
- 8.3. Заявление на регистрацию Торгово-клирингового счета Участника клиринга должно содержать указание на тип Расчетного кода Участника клиринга, который будет входить в состав регистрируемого Торгово-клирингового счета Участника клиринга (в случае открытия нового Расчетного кода Участника клиринга).
- 8.3.1. Заявление на регистрацию Торгово-клирингового счета Участника клиринга может содержать признак, указывающий на необходимость открытия Счета обеспечения в определенной иностранной валюте.
- Открытие Счета обеспечения в иностранной валюте осуществляется Клиринговым центром только в случае указания соответствующего признака в Заявлении на регистрацию Торгово-клирингового счета Участника клиринга.
- 8.4. Участник клиринга категории «О» или «Б» вправе с использованием Клиринговой системы установить для Торгово-клирингового счета Участника клиринга признак «запрет коротких продаж» и/или признак «запрет необеспеченных покупок».
- По Сделкам, заключенным с указанием Торгово-клирингового счета Участника клиринга с признаком «запрет коротких продаж», осуществляется клиринг с полным обеспечением по валюте лота.
- По Сделкам, заключенным с указанием Торгово-клирингового счета Участника клиринга с признаком «запрет необеспеченных покупок», осуществляется клиринг с полным обеспечением по сопряженной валюте.
- 8.5. Участник клиринга вправе с использованием Клиринговой системы установить для Торгово-клирингового счета 2-го уровня признак «запрет коротких продаж» и/или признак «запрет необеспеченных покупок».
- 8.6. Участник торгов, заключивший с Клиринговым центром договор о ведении клиринговых регистров, предусмотренный общей частью Правил клиринга, вправе с использованием Клиринговой системы установить для Торгово-клирингового счета 3-го уровня признак «запрет коротких продаж» и/или признак «запрет

необеспеченных покупок».

- 8.7. Клиринговый центр посредством ПТК ТЦ передает Бирже информацию:
- о зарегистрированных Торгово-клиринговых счетах Участников клиринга, Торгово-клиринговых счетах 2-го и 3-го уровней;
 - об Участниках торгов, имеющих право подавать заявки с указанием Торгово-клиринговых счетов 2-го уровня;
 - о зарегистрированных клиентах Участников клиринга, в том числе об Обособленных клиентах;
 - иную информацию, предусмотренную Правилами торгов на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.
- 8.8. Расчет Единого лимита по Расчетному коду, 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.

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

Статья 9. Перечень мер, направленных на управление рисками при осуществлении клиринга

- 9.1. В целях снижения рисков, связанных с осуществлением клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, Клиринговый центр применяет меры, предусмотренные общей частью Правил клиринга.
- 9.2. 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.
- 9.3. 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.
- 9.4. 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».
- 9.5. 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».
- 9.6. 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».

Статья 10. Единый лимит по Расчетному коду и риск-параметры

- 10.1. Единый лимит по Расчетному коду 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.

- 10.2. Единый лимит по Расчетному коду 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 по Расчетному коду до и после проведения операции.
- 10.3. Единый лимит по Расчетному коду 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, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга;
 - 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, учитываемых по Расчетному коду Участника клиринга, по всем Датам исполнения;
 - совокупности действующих Поручений на управление риском, учитываемых по Расчетному коду Участника клиринга;
 - обязательств по уплате комиссионных вознаграждений, учитываемых по Расчетному коду Участника клиринга;
 - задолженности Участника клиринга перед Клиринговым центром в российских рублях, учитываемой по Расчетному коду Участника клиринга;
 - корректировки Единого лимита по Расчетному коду с учетом Индикативных курсов сделок своп.
- 10.4. Клиринговый центр вправе с использованием Клиринговой системы установить ограничение на минимальное допустимое отрицательное значение Единого лимита по Расчетному коду, рассчитанного без учета Обеспечения Участника клиринга.
- 10.5. Участник клиринга вправе с использованием Клиринговой системы установить ограничение на минимальное допустимое значение, в том числе отрицательное, Единого лимита по Расчетному коду, рассчитанного без учета Обеспечения Участника клиринга.
- 10.6. Единый лимит по Расчетному коду 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.

10.7. 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.

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

10.9. 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 Торгово-клиринговых счетов Участника клиринга.

10.10. 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 торгов, в том числе в ходе клиринговой сессии, 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.

10.11. Единый лимит по Расчетному коду 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 10.3, в связи с изменением Центральных курсов и/или изменением процентных ставок по сделкам своп.

Указанная оценка проводится с использованием Верхних и Нижних границ диапазона оценки рыночных рисков и верхних и нижних значений Индикативного курса сделок своп, в случае если Участником клиринга (Участником торгов) или установлены индивидуальные значения указанных риск-параметров, указанная оценка проводится с использованием таких индивидуальных значений указанных

риск-параметров.

Основные правила расчета Единого лимита по Расчетному коду определены в документе «Принципы расчета Единого лимита», раскрываемом на Сайте Клирингового центра.

- 10.12. Единый лимит по Расчетному коду 2-го уровня и Единый лимит по Расчетному коду 3-го уровня рассчитывается в соответствии с принципами расчета Единого лимита по Расчетному коду, установленными настоящей статьёй Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, с учетом значений, указанных в пункте 10.3 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, учитываемых по соответствующему Расчетному коду 2-го уровня / Расчетному коду 3-го уровня.
- 10.13. Участник клиринга вправе с использованием Клиринговой системы:
- установить индивидуальные Верхние и Нижние границы диапазона оценки рыночных рисков и Верхние и Нижние значения Индикативного курса сделок своп для определенных Торгово-клиринговых счетов 2-го уровня;
 - снять / установить признак, указывающий на необходимость контроля Единого лимита по Расчетному коду 2-го уровня, входящему в состав Торгово-клирингового счета 2-го уровня, и минимальное допустимое значение такого Единого лимита (по умолчанию указанный признак установлен, минимальное допустимое значение Единого лимита по Расчетному коду 2-го уровня равно нулю);
 - установить ограничение на минимальное допустимое значение, в том числе отрицательное, Единого лимита по Расчетному коду 2-го уровня, рассчитанного без учета Обеспечения, учитываемого по Расчетному коду 2-го уровня.
- 10.14. Участник торгов, заключивший с Клиринговым центром договор о ведении клиринговых регистров, предусмотренный общей частью Правил клиринга, вправе с использованием Клиринговой системы:
- установить индивидуальные Верхние и Нижние границы диапазона оценки рыночных рисков и Верхние и Нижние значения Индикативного курса сделок своп для определенных Торгово-клиринговых счетов 3-го уровня;
 - снять / установить признак, указывающий на необходимость контроля Единого лимита по Расчетному коду 3-го уровня, входящему в состав Торгово-клирингового счета 3-го уровня, и минимальное допустимое значение такого Единого лимита (по умолчанию указанный признак установлен, минимальное допустимое значение Единого лимита по Расчетному коду 3-го уровня равно нулю);
 - установить ограничение на минимальное допустимое значение, в том числе отрицательное, Единого лимита по Расчетному коду 3-го уровня, рассчитанного без учета Обеспечения, учитываемого по Расчетному коду 3-го уровня.

Статья 11. Порядок исполнения Поручений на управление риском

- 11.1. В целях оптимизации расчета Единого лимита по Расчетному коду 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.
- 11.2. Поручения на управление риском предоставляются в отношении Расчетных кодов Участника клиринга.
Предоставление Поручений на управление риском в отношении Расчетных кодов 2-го или 3-го уровня не допускается.
- 11.3. 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, имеющему такой же код, как раздел регистра учета позиций по управлению риском, указанный в Поручении на управление риском, а также по Брокерской фирме (в случае если расчет Гарантийного обеспечения по Расчетному коду осуществляется в соответствии с правилом расчета Гарантийного обеспечения по Расчетному коду с учетом Брокерских фирм) и Расчетному коду, соответствующим разделу регистра учета позиций, указанному в Поручении на управление риском;
 - 2) если Единый лимит по Расчетному коду, указанному в Поручении на управление риском, в результате исполнения такого Поручения не станет отрицательным, или отрицательный Единый лимит по такому Расчетному коду в результате исполнения такого Поручения не уменьшится.
- 11.4. 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 по тому же Расчетному коду в соответствии со статьей 10 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.
- 11.5. 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 12. Порядок взаимодействия с Биржей при подаче заявок и заключении Сделок

- 12.1. 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, и/или заявке на продажу, поданной с указанием Торгово-клирингового счета Участника клиринга с признаком «запрет коротких продаж» и/или Торгово-клирингового счета 2-го или 3-го уровня, соответствующего Торгово-клиринговому счету Участника клиринга с признаком «запрет коротких продаж», стороной по которой будет являться Участник клиринга, стала доступной Клиринговому центру посредством ПТК ТЦ, Клиринговый центр:
- 12.1.1. проверяет, что значение цены, указанной в заявке / цены сделки фикс, которая может быть заключена на основании поданной заявки, больше либо равно Нижней границе ценового коридора и меньше либо равно Верхней границе ценового коридора, установленных Клиринговым центром;
- 12.1.2. 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 Участника клиринга, входящему в состав Торгово-клирингового счета Участника клиринга / соответствующему Торгово-клиринговому счету 2-го или 3-го уровня, указанному в заявке;
 - Нетто-обязательств и/или Нетто-требований Участника клиринга в валюте лота, учитываемых по Расчетному коду Участника клиринга, входящему в состав Торгово-клирингового счета Участника клиринга / соответствующему Торгово-клиринговому счету 2-го или 3-го уровня, указанного в заявке;
 - всех зарегистрированных заявок на продажу, поданных с указанием Торгово-клиринговых счетов Участника клиринга, в состав которых входит Расчетный код Участника клиринга / Торгово-клиринговых счетов 2-го или 3-го уровня, соответствующих Расчетному коду Участника клиринга, и направленных на заключение сделок купли-продажи иностранной валюты, являющейся валютой лота в поданной заявке, стороной по которым будет являться Участник клиринга;
- 12.1.3. 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 12.1.2 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;
- 12.1.4. рассчитывает значение Единого лимита по Расчетному коду Участника клиринга, входящему в состав Торгово-клирингового счета Участника клиринга / соответствующему Торгово-клиринговому счету 2-го или 3-го уровня, указанному

в заявке, с учетом поданной заявки;

- 12.1.5. осуществляет контроль рассчитанного Единого лимита по Расчетному коду Участника клиринга в порядке, установленном пунктом 12.4 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов;
- 12.1.6. в случае установки Клиринговым центром или Участником клиринга ограничения в соответствии с пунктом 10.4 или 10.5 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов соответственно, рассчитывает значение Единого лимита по Расчетному коду Участника клиринга, входящему в состав Торгово-клирингового счета Участника клиринга / соответствующему Торгово-клиринговому счету 2-го или 3-го уровня, указанному в заявке, с учетом поданной заявки, без учета Обеспечения Участника клиринга, учитываемого по такому Расчетному коду Участника клиринга, и проверяет выполнение указанного ограничения.
- 12.2. 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, и/или заявке на покупку, поданной с указанием Торгово-клирингового счета Участника клиринга с признаком «запрет необеспеченных покупок» и/или Торгово-клирингового счета 2-го или 3-го уровня, соответствующего Торгово-клиринговому счету Участника клиринга с признаком «запрет необеспеченных покупок», стороной по которой будет являться Участник клиринга, стала доступной Клиринговому центру посредством ПТК ТЦ, Клиринговый центр:
- 12.2.1. проверяет, что значение цены, указанной в заявке / цены сделки фикс, которая может быть заключена на основании поданной заявки, больше либо равно Нижней границе ценового коридора и меньше либо равно Верхней границе ценового коридора, установленных Клиринговым центром;
- 12.2.2. рассчитывает сумму денежных средств Участника клиринга в сопряженной валюте, которая может быть использована для заключения Сделки, с учетом:
- Обеспечения Участника клиринга в сопряженной валюте, учитываемого по Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета Участника клиринга / соответствующему Торгово-клиринговому счету 2-го или 3-го уровня, указанному в заявке;
 - Нетто-обязательств и/или Нетто-требований Участника клиринга в сопряженной валюте, учитываемых по Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета Участника клиринга / соответствующему Торгово-клиринговому счету 2-го или 3-го уровня, указанному в заявке;
 - всех зарегистрированных заявок на покупку, поданных с указанием Торгово-клиринговых счетов Участника клиринга, в состав которых входит Расчетный код Участника клиринга / Торгово-клиринговых счетов 2-го или 3-го уровня, соответствующих Расчетному коду Участника клиринга, и направленных на заключение сделок купли-продажи иностранной валюты / драгоценных металлов за сопряженную валюту, стороной по которым будет являться Участник клиринга;
- 12.2.3. 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 12.2.2 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;
- 12.2.4. рассчитывает значение Единого лимита по Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета Участника клиринга / соответствующему Торгово-клиринговому счету 2-го или 3-го уровня, указанному в заявке, с учетом поданной заявки;
- 12.2.5. осуществляет контроль рассчитанного Единого лимита по Расчетному коду в порядке, установленном пунктом 12.4 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов;
- 12.2.6. в случае установки Клиринговым центром или Участником клиринга ограничения в соответствии с пунктом 10.4 или 10.5 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов соответственно, рассчитывает значение Единого лимита по Расчетному коду Участника клиринга, входящему в состав Торгово-клирингового счета Участника клиринга / соответствующему Торгово-клиринговому счету 2-го или 3-го уровня, указанному в заявке, с учетом поданной заявки, без учета Обеспечения Участника клиринга, учитываемого по такому Расчетному коду Участника клиринга, и проверяет выполнение указанного ограничения.
- 12.3. Немедленно после того, как информация о поданной Участником торгов заявке, направленной на заключение Сделки, по которой осуществляется клиринг с частичным обеспечением, стороной по которой будет являться Участник клиринга, стала доступной Клиринговому центру посредством ПТК ТЦ, Клиринговый центр:
- 12.3.1. проверяет, что значение цены, указанной в заявке / цены сделки фикс, которая может быть заключена на основании поданной заявки, больше либо равно Нижней границе ценового коридора и меньше либо равно Верхней границе ценового коридора, установленных Клиринговым центром для инструмента, по которому подана заявка;
- 12.3.2. рассчитывает значение Единого лимита по Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета Участника клиринга / соответствующему Торгово-клиринговому счету 2-го или 3-го уровня, указанному в заявке, с учетом поданной заявки;
- 12.3.3. осуществляет контроль рассчитанного Единого лимита по Расчетному коду в порядке, установленном пунктом 12.4 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов;
- 12.3.4. в случае установки Клиринговым центром или Участником клиринга ограничения в соответствии с пунктом 10.4 или 10.5 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов соответственно, рассчитывает значение Единого лимита по Расчетному коду Участника клиринга, входящему в состав Торгово-клирингового счета Участника клиринга / соответствующему Торгово-клиринговому счету 2-го или 3-го уровня, указанному в заявке, с учетом поданной заявки, без учета Обеспечения Участника клиринга, учитываемого по такому

Расчетному коду Участника клиринга, и проверяет выполнение указанного ограничения.

- 12.4. Контроль Единого лимита по Расчетному коду по заявке считается пройденным при условии, что значение Единого лимита по Расчетному коду с учетом обязательств по Сделке, которая может быть заключена на основании поданной заявки, не станет отрицательным, или, если Единый лимит по такому Расчетному коду был отрицательным до момента подачи заявки, при условии, что Единый лимит по такому Расчетному коду, рассчитанный с учетом указанных обязательств, не станет меньше, чем Единый лимит по этому Расчетному коду, рассчитанный до момента подачи заявки.
- 12.5. При проведении проверок, указанных в подпунктах 12.1.3, 12.1.5, 12.2.3, 12.2.5, 12.3.3 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, для заявок на заключение сделок своп и своп контрактов указанные проверки осуществляются для первой и второй частей сделки своп / своп контракта с учетом одновременности возникновения обязательств по первой и второй частям сделки своп / своп контракта.
- 12.6. При проведении проверок, указанных в подпунктах 12.1.1, 12.2.1, 12.3.1 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, для заявок на заключение сделок фикс цена сделки фикс для целей указанных проверок определяется как Центральное значение Индикативного курса сделок своп по соответствующей валюте, установленного для Даты исполнения обязательств по сделке, которая может быть заключена на основании поданной заявки, увеличенное / уменьшенное на премию / дисконт, указанные в заявке.
- При проведении проверок, указанных в подпунктах 12.1.3, 12.1.5, 12.2.3, 12.2.5, 12.3.3 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, для заявок на заключение сделок фикс цена сделки фикс для целей указанных проверок определяется как сумма соответствующих Нижних / Верхних границ диапазона оценки рыночных рисков 1-го уровня и Нижних / Верхних значений Индикативного курса сделок своп 1-го уровня по соответствующей валюте, установленных для Даты исполнения обязательств по сделке, которая может быть заключена на основании поданной заявки, увеличенная / уменьшенная на премию / дисконт, указанные в заявке.
- 12.7. В случае установки признака, указывающего на необходимость контроля Единого лимита по Расчетному коду 2-го уровня, Клиринговый центр:
- 12.7.1. рассчитывает значение Единого лимита по Расчетному коду 2-го уровня, входящему в состав Торгово-клирингового счета 2-го уровня / соответствующему Торгово-клиринговому счету 3-го уровня, указанному в заявке, с учетом поданной заявки;
- 12.7.2. осуществляет контроль рассчитанного Единого лимита по Расчетному коду 2-го уровня в порядке, установленном пунктом 12.9 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов;
- 12.7.3. в случае установки Участником клиринга ограничения в соответствии с пунктом 10.13 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, рассчитывает значение Единого лимита по Расчетному коду 2-го уровня,

входящему в состав Торгово-клирингового счета 2-го уровня / соответствующему Торгово-клиринговому счету 3-го уровня, указанному в заявке, с учетом поданной заявки, без учета Обеспечения, учитываемого по такому Расчетному коду 2-го уровня, и проверяет выполнение указанного ограничения.

- 12.8. В случае установки признака, указывающего на необходимость контроля Единого лимита по Расчетному коду 3-го уровня, Клиринговый центр:
- 12.8.1. рассчитывает значение Единого лимита по Расчетному коду 3-го уровня, входящему в состав Торгово-клирингового счета 3-го уровня, указанного в заявке, с учетом поданной заявки;
- 12.8.2. осуществляет контроль рассчитанного Единого лимита по Расчетному коду 3-го уровня в порядке, установленном пунктом 12.9 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов;
- 12.8.3. в случае установки Участником клиринга ограничения в соответствии с пунктом 10.14 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, рассчитывает значение Единого лимита по Расчетному коду 3-го уровня, входящему в состав Торгово-клирингового счета 3-го уровня, указанного в заявке, с учетом поданной заявки, без учета Обеспечения, учитываемого по такому Расчетному коду 3-го уровня, и проверяет выполнение указанного ограничения.
- 12.9. Контроль Единого лимита по Расчетному коду 2-го или 3-го уровня по заявке считается пройденным при условии, что значение Единого лимита по Расчетному коду соответствующего 2-го или 3-го уровня с учетом обязательств по Сделке, которая может быть заключена на основании поданной заявки:
- а) не станет отрицательным, или, если Единый лимит по такому Расчетному коду 2-го или 3-го уровня был отрицательным до момента подачи заявки, при условии, что Единый лимит по такому Расчетному коду 2-го или 3-го уровня, рассчитанный с учетом указанных обязательств, не станет меньше, чем Единый лимит по этому Расчетному коду 2-го или 3-го уровня, рассчитанный до момента подачи заявки (указанная проверка применяется в случае, если Участником клиринга / Участником торгов не было установлено минимальное допустимое значение Единого лимита по Расчетному коду 2-го или 3-го уровня в соответствии с пунктом 10.13 / 10.14 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов);
- б) не станет меньше минимального допустимого значения Единого лимита по Расчетному коду 2-го или 3-го уровня, установленного Участником клиринга / Участником торгов в соответствии с пунктом 10.13 / 10.14 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.
- 12.10. По заявке, поданной с указанием Торгово-клирингового счета 2-го уровня, в первую очередь, осуществляется контроль Единого лимита по Расчетному коду 2-го уровня, во вторую очередь, - Единого лимита по Расчетному коду Участника клиринга.
- По заявке, поданной с указанием Торгово-клирингового счета 3-го уровня, в первую очередь, осуществляется контроль Единого лимита по Расчетному коду 3-го уровня, во вторую очередь, - Единого лимита по Расчетному коду 2-го уровня, в третью очередь, - Единого лимита по Расчетному коду Участника клиринга.

- 12.10.1. Контроль Единого лимита по Расчетному коду 2-го и 3-го уровня осуществляется в случае установки соответствующего признака Участником клиринга / Участником торгов.
- 12.10.2. Контроль Единого лимита по Расчетному коду Участника клиринга является обязательным.
- 12.10.3. Контроль Единого лимита по заявке считается пройденным при условии прохождения контроля Единого лимита на всех уровнях контроля.
- 12.10.4. В случае если контроль Единого лимита по заявке не пройден на любом из уровней контроля, контроль Единого лимита на последующих уровнях контроля не осуществляется.
- 12.11. В случае установки Участником клиринга / Участником торгов для Торгово-клирингового счета 2-го уровня / 3-го уровня признака «запрет коротких продаж» и/или признака «запрет необеспеченных покупок» в соответствии с пунктом 8.5 / 8.6 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, при подаче заявки с указанием Торгово-клирингового счета 2-го уровня / 3-го уровня осуществляются проверки, аналогичные проверкам, указанным в подпунктах 12.1.3 / 12.2.3 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, с учетом Единого лимита, Обеспечения и обязательств, учитываемых по соответствующему Расчетному коду 2-го или 3-го уровня.
- 12.12. При подаче заявки с указанием Торгово-клирингового счета 1-го, 2-го или 3-го уровней, в состав которого входит Расчетный код соответствующего уровня, которому при регистрации были поставлены в соответствие идентификационные данные клиента Участника клиринга / клиента Участника торгов, дополнительно осуществляется проверка соответствия указанных идентификационных данных клиента Участника клиринга, в том числе Обособленного клиента / клиента Участника торгов, идентификационным данным клиента Участника торгов, в интересах которого подана такая заявка, или идентификационным данным Участника торгов.
 - 12.12.1. Проверка, указанная в настоящем пункте Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, осуществляется, в первую очередь, по Торгово-клиринговому счету 3-го уровня, во вторую очередь, - по Торгово-клиринговому счету 2-го уровня, в третью очередь, - по Торгово-клиринговому счету Участника клиринга (при наличии установленного соответствия между Расчетным кодом соответствующего уровня и идентификационными данными клиента Участника клиринга / клиента Участника торгов).
 - 12.12.2. Проверка, указанная в настоящем пункте Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, по заявке считается пройденной при условии прохождения указанной проверки на всех уровнях.
 - 12.12.3. В случае если указанная проверка по заявке не пройдена на любом из уровней, проверка на последующих уровнях не осуществляется.
- 12.13. Немедленно после проведения Клиринговым центром проверок, предусмотренных настоящей статьей 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.

- 12.13.1. В случае возможности регистрации заявки, Клиринговый центр начинает учитывать значения Единого лимита по Расчетному коду, Единого лимита по Расчетному коду 2-го уровня и/или Единого лимита по Расчетному коду 3-го уровня, рассчитанные при проверке возможности регистрации заявки, в качестве новых значений Единого лимита по таким Расчетным кодам соответствующего уровня.
- 12.13.2. В случае невозможности регистрации заявки, Клиринговый центр не изменяет значений Единого лимита по Расчетному коду, Единого лимита по Расчетному коду 2-го уровня и/или Единого лимита по Расчетному коду 3-го уровня.
- 12.14. 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 по Расчетному коду, Единый лимит по Расчетному коду 2-го уровня и/или Единый лимит по Расчетному коду 3-го уровня, входящему в состав Торгово-клирингового счета 1-го, 2-го или 3-го уровня, указанного в заявке, или соответствующему Торгово-клиринговому счету 2-го или 3-го уровня, указанному в заявке, без учета снятой заявки.
- 12.15. 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.
- 12.16. После того, как информация о регистрации Сделки стала доступной Клиринговому центру посредством ПТК ТЦ, Клиринговый центр:
- рассчитывает Единый лимит по Расчетному коду, Единый лимит по Расчетному коду 2-го уровня и/или Единый лимит по Расчетному коду 3-го уровня, входящему в состав Торгово-клирингового счета 1-го, 2-го или 3-го уровня, указанного в заявке, и/или соответствующему Торгово-клиринговому счету 2-го или 3-го уровня, 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;
 - по Сделке, заключенной с указанием Торгово-клирингового счета Участника клиринга, изменяет с учетом заключенной Сделки Нетто-обязательство и/или Нетто-требование Участника клиринга по Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета Участника клиринга, указанного в заявке, на основании которой заключена Сделка, с Датами исполнения, соответствующими Дате (Датам) исполнения обязательств по заключенной Сделке;
 - по Сделке, заключенной с указанием Торгово-клирингового счета 2-го уровня, изменяет с учетом заключенной Сделки Нетто-обязательство и/или Нетто-требование, учитываемое по Расчетному коду 2-го уровня, входящему в состав Торгово-клирингового счета 2-го уровня, указанного в заявке, и

Нетто-обязательство и/или Нетто-требование Участника клиринга по Расчетному коду, соответствующему Торгово-клиринговому счету 2-го уровня, указанному в заявке, на основании которой заключена Сделка, с Датами исполнения, соответствующими Дате (Датам) исполнения обязательств по заключенной Сделке;

- по Сделке, заключенной с указанием Торгово-клирингового счета 3-го уровня, изменяет с учетом заключенной Сделки Нетто-обязательство и/или Нетто-требование, учитываемое по Расчетному коду 3-го уровня, входящему в состав Торгово-клирингового счета 3-го уровня, указанного в заявке, и Нетто-обязательство и/или Нетто-требование, учитываемое по Расчетному коду / Расчетному коду 2-го уровня, соответствующему Торгово-клиринговому счету 3-го уровня, указанному в заявке, на основании которой заключена Сделка, с Датами исполнения, соответствующими Дате (Датам) исполнения обязательств по заключенной Сделке.

12.17. 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.

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

12.17.2. 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.

12.17.3. 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.

12.18. 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 по соответствующим Датам исполнения, учитываемые по Расчетным кодам 1-го, 2-го и/или 3-го уровня, 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 13. Порядок внесения Обеспечения

13.1. Обеспечение Участника клиринга в иностранной валюте, являющееся индивидуальным клиринговым обеспечением, вносится на клиринговый банковский счет Клирингового центра в Расчетной организации.

Обеспечение Участника клиринга в иностранной валюте, являющееся иным обеспечением, вносится на корреспондентский счет Клирингового центра в Расчетном банке.

13.2. Денежные средства в соответствующей валюте, предоставляемые в качестве Обеспечения в российских рублях и/или Обеспечения в иностранной валюте, перечисляются на соответствующий клиринговый банковский или корреспондентский счет Клирингового центра по реквизитам, размещенным на Сайте Клирингового центра, с обязательным указанием в назначении платежа Расчетного кода Участника клиринга либо Расчетного кода 2-го или 3-го уровня.

13.3. Внесение Обеспечения в драгоценных металлах осуществляется путем перечисления драгоценных металлов на Счет обеспечения в драгоценном металле Участника клиринга.

13.3.1. Клиринговый центр учитывает в Клиринговой системе денежные средства / драгоценные металлы, перечисленные с указанием в назначении платежа Расчетного кода Участника клиринга, в качестве Обеспечения Участника клиринга по такому Расчетному коду, и увеличивает Единый лимит по такому Расчетному коду с учетом перечисленной суммы денежных средств / перечисленного количества драгоценного металла.

Денежные средства / драгоценные металлы, перечисленные с указанием в назначении платежа Расчетного кода 2-го уровня, учитываются Клиринговым центром в качестве Обеспечения по Расчетному коду Участника клиринга, соответствующему Расчетному коду 2-го уровня, указанного в назначении платежа, информация о таком Обеспечении также учитывается по Расчетному коду 2-го уровня, указанному в назначении платежа.

Денежные средства / драгоценные металлы, перечисленные с указанием в назначении платежа Расчетного кода 3-го уровня, учитываются Клиринговым центром в качестве Обеспечения по Расчетному коду Участника клиринга, соответствующему Расчетному коду 3-го уровня, указанного в назначении платежа, информация о таком Обеспечении также учитывается по Расчетному коду 2-го уровня, соответствующему Расчетному коду 3-го уровня, указанному в назначении платежа, и по Расчетному коду 3-го уровня, указанному в назначении платежа.

13.3.2. Если Расчетный код 1-го, 2-го или 3-го уровня, указанный в назначении платежа, не найден среди зарегистрированных Клиринговым центром Расчетных кодов соответствующего уровня, Клиринговый центр вправе запросить у Участника клиринга уточнение назначения платежа. В случае получения от Участника клиринга уточнения назначения платежа, учет денежных средств / драгоценных

металлов в качестве Обеспечения Участника клиринга в соответствии с подпунктом 13.3.1 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, осуществляется Клиринговым центром после получения от Участника клиринга такого уточнения назначения платежа с правильно указанным Расчетным кодом соответствующего уровня.

- 13.3.3. Если в течение 5 (пяти) Расчетных дней по соответствующей валюте с даты, следующей за датой зачисления денежных средств в российских рублях / иностранной валюте на соответствующий клиринговый банковский / корреспондентский счет Клирингового центра с не указанным / неправильно указанным Расчетным кодом соответствующего уровня в назначении платежа, Участник клиринга не предоставит Клиринговому центру уточнение назначения платежа с правильно указанным Расчетным кодом соответствующего уровня, Клиринговый центр возвращает указанные денежные средства по реквизитам плательщика.
- 13.3.4. Денежные средства, зачисленные на соответствующий клиринговый банковский или корреспондентский счет Клирингового центра, позднее времени, установленного Временным регламентом на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, учитываются Клиринговым центром в следующем Расчетном дне.
- 13.4. Денежные средства и драгоценные металлы, учитываемые в качестве Обеспечения Участника клиринга, используются для расчета Единого лимита по Расчетному коду, 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.
- 13.5. 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.

- 13.6. Участник клиринга вправе с использованием Клиринговой системы изменить информацию об Обеспечении, учитываемую по Расчетному коду 2-го уровня.
- 13.6.1. Изменение информации об Обеспечении, учитываемой по Расчетному коду 2-го уровня, осуществляется безусловно, вне зависимости от наличия или отсутствия Обеспечения Участника клиринга, учитываемого по соответствующему Расчетному коду Участника клиринга.
- 13.6.2. После изменения информации об Обеспечении, учитываемой по Расчетному коду 2-го уровня, Клиринговый центр рассчитывает новое значение Единого лимита по такому Расчетному коду 2-го уровня.
- 13.7. Участник торгов, заключивший с Клиринговым центром договор о ведении клиринговых регистров, предусмотренный общей частью Правил клиринга, вправе с использованием Клиринговой системы изменить информацию об Обеспечении, учитываемую по Расчетному коду 3-го уровня.
- 13.7.1. Изменение информации об Обеспечении, учитываемой по Расчетному коду 3-го уровня, осуществляется безусловно, вне зависимости от наличия или отсутствия Обеспечения Участника клиринга, учитываемого по соответствующему Расчетному коду Участника клиринга / информации об Обеспечении, учитываемой по соответствующему Расчетному коду 2-го уровня.
- 13.7.2. После изменения информации об Обеспечении, учитываемой по Расчетному коду 3-го уровня, Клиринговый центр рассчитывает новое значение Единого лимита по такому Расчетному коду 3-го уровня.
- 13.8. Обеспечение Участника клиринга в российских рублях, учитываемое по Расчетному коду Участника клиринга, 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 по уплате вариационной маржи;
 - 4) для исполнения обязательств Участника клиринга в российских рублях по Сделкам с наступившей Датой исполнения;
 - 5) для исполнения обязательств Участника клиринга по уплате вознаграждений

(комиссионных вознаграждений);

б) для уплаты пеней за наличие непогашенной Задолженности.

13.9. Обеспечение Участника клиринга в иностранной валюте и драгоценных металлах, учитываемое по Расчетному коду Участника клиринга, 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.

13.10. После перечисления Участником клиринга денежных средств на счет Клирингового центра, открытый в Расчетной организации / Расчетном банке, и учета их в качестве Обеспечения Участника клиринга по Расчетному коду Участника клиринга, у Клирингового центра возникает обязательство вернуть денежные средства Участнику клиринга в размере, определяемом в соответствии с пунктами 14.7 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.

Статья 14. Порядок возврата Обеспечения

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

14.2. Возврат Клиринговым центром Участнику клиринга денежных средств / драгоценных металлов, учитываемых в качестве Обеспечения по Расчетному коду Участника клиринга, осуществляется на основании:

- Запроса о возврате;
- Постоянного поручения на возврат.

14.3. Запрос о возврате / Постоянное поручение на возврат должны содержать указание на Расчетный код Участника клиринга.

14.4. Запрос о возврате / Постоянное поручение на возврат могут содержать указание на Расчетный код 2-го или 3-го уровня.

14.4.1. Запрос о возврате / Постоянное поручение на возврат, содержащие указание на Расчетный код 2-го или 3-го уровня, не соответствующий Расчетному коду Участника клиринга, указанному в таком Запросе о возврате / Постоянном поручении на возврат, не исполняется Клиринговым центром.

14.5. Запрос о возврате может содержать:

- а) сумму денежных средств / количество драгоценного металла, или
- б) признак, указывающий на необходимость возврата всей доступной суммы денежных средств / всего доступного количества драгоценного металла.

14.5.1. Запросы о возврате соответствующей валюты / соответствующего драгоценного

металла принимаются Клиринговым центром в Расчетные дни по соответствующей валюте / соответствующему драгоценному металлу в период времени, установленный Временным регламентом на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.

14.5.2. 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.

14.5.3. Запрос о возврате действует в день его предоставления.

14.5.4. Запрос о возврате исполняется после его получения при соблюдении условий его исполнения.

Запрос о возврате, содержащий сумму денежных средств / количество драгоценного металла, исполняется при соблюдении условий, указанных в пункте 14.7 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, при этом проверка указанных условий осуществляется в отношении суммы денежных средств / количества драгоценного металла, указанных в Запросе о возврате.

Исполнение Клиринговым центром Запроса о возврате, содержащего признак, указывающий на необходимость возврата всей доступной суммы денежных средств / всего доступного количества драгоценного металла, осуществляется в максимально возможной сумме денежных средств / максимально возможном количестве драгоценного металла, при котором условия, указанные в пункте 14.7 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, будут выполняться.

14.5.5. Запрос о возврате, содержащий сумму денежных средств / количество драгоценного металла, не исполненный сразу после его получения по причине несоблюдения условий, указанных в пункте 14.7 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, может быть исполнен Клиринговым центром позднее, в период до окончания срока, установленного Временным регламентом на валютном рынке и рынке драгоценных металлов для передачи Участником клиринга в Клиринговый центр Запросов о возврате в соответствующей валюте / драгоценном металле, если будут соблюдены условия, указанные в пункте 14.7 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.

14.5.6. Запрос о возврате, содержащий признак, указывающий на необходимость возврата всей доступной суммы денежных средств / всего доступного количества драгоценного металла, не исполненный сразу после его получения по причине, что условия, указанные в пункте 14.7 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, не выполняются ни для какой суммы денежных средств / количества драгоценного металла, аннулируется.

14.5.7. 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.

14.6. Постоянное поручение на возврат может содержать:

а) признак, указывающий на необходимость возврата денежных средств / драгоценного металла в размере Итогового нетто-требования, или

б) признак, указывающий на необходимость возврата всей доступной суммы денежных средств / всего доступного количества драгоценного металла.

14.6.1. Постоянное поручение на возврат исполняется Клиринговым центром каждый Расчетный день по соответствующей валюте / соответствующему драгоценному металлу, начиная с первого Расчетного дня по соответствующей валюте / соответствующему драгоценному металлу, следующего за датой предоставления указанного поручения, при соблюдении условий его исполнения.

14.6.2. Исполнение Клиринговым центром Постоянного поручения на возврат, содержащего признак, указывающий на необходимость возврата денежных средств / драгоценного металла в размере Итогового нетто-требования, осуществляется после определения Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований Участника клиринга в размере Итогового нетто-требования в соответствующей валюте / драгоценном металле при соблюдении условий, указанных в пункте 14.7 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, при этом проверка указанных условий осуществляется в отношении указанного Итогового нетто-требования.

Исполнение Клиринговым центром Постоянного поручения на возврат, содержащего признак, указывающий на необходимость возврата всей доступной суммы денежных средств / всего доступного количества драгоценного металла, осуществляется непосредственно перед окончанием срока, установленного Временным регламентом на валютном рынке и рынке драгоценных металлов для передачи Участником клиринга в Клиринговый центр Запросов о возврате в соответствующей валюте / драгоценном металле, в максимально возможной сумме денежных средств / максимально возможном количестве драгоценного металла, при котором условия, указанные в пункте 14.7 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, будут выполняться.

14.6.3. Постоянное поручение на возврат, содержащее признак, указывающий на необходимость возврата денежных средств / драгоценного металла в размере Итогового нетто-требования, не исполненное сразу после определения Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований Участника клиринга по причине несоблюдения условий, указанных в пункте 14.7 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, может быть исполнено Клиринговым центром позднее, в период до окончания срока, установленного Временным регламентом на валютном рынке и рынке драгоценных металлов для передачи Участником клиринга в Клиринговый центр Запросов о возврате в соответствующей валюте / драгоценном металле, если будут соблюдены условия, указанные в пункте 14.7 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.

14.6.4. Постоянное поручение на возврат, содержащее признак, указывающий на необходимость возврата денежных средств / драгоценного металла в размере Итогового нетто-требования, не исполненное до окончания срока, установленного Временным регламентом на валютном рынке и рынке драгоценных металлов для передачи Участником клиринга в Клиринговый центр Запросов о возврате в соответствующей валюте / драгоценном металле по причине несоблюдения условий, указанных в пункте 14.7 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, исполняется Клиринговым центром непосредственно перед окончанием указанного срока в максимально возможной сумме денежных средств /

максимально возможном количестве драгоценного металла, при котором условия, указанные в пункте 14.7 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, будут выполняться.

- 14.6.5. 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.
- 14.6.6. Постоянное поручение на возврат действует до его отмены Участником клиринга или до даты принятия Клиринговым центром решения об аннулировании Постоянных поручений на возврат.
- 14.6.7. 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.
- 14.7. Исполнение Клиринговым центром Запроса о возврате осуществляется при соблюдении следующих условий:
- Единый лимит по Расчетному коду, указанному в Запросе о возврате, рассчитанный без учета возвращаемой суммы денежных средств / количества драгоценного металла, не станет отрицательным;
 - возвращаемая сумма денежных средств / количество драгоценного металла не превышает максимального из двух значений: (1) значения Обеспечения в соответствующей валюте / драгоценном металле, учитываемого по Расчетному коду, указанному в Запросе о возврате; (2) суммы (с учетом знака) значения Обеспечения и Нетто-обязательства / Нетто-требования в соответствующей валюте / драгоценном металле с текущей Датой исполнения, учитываемых по Расчетному коду, указанному в Запросе о возврате;
 - в случае возврата денежных средств / драгоценных металлов с Расчетного кода Участника клиринга 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», - непревышение размера обязательств по Сделкам в валюте / драгоценном металле, указанной (-ом) в Запросе о возврате, по каждой Дате исполнения, учитываемых по такому Расчетному коду Участника клиринга, Обеспечения в такой валюте / драгоценном металле, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, 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 возвращаемой суммы денежных средств / количества драгоценного металла.
- 14.8. 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.

- 14.9. 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 в драгоценном металле 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.

- 14.10. При возврате Участнику клиринга денежных средств в соответствующей валюте / соответствующего драгоценного металла размер Обеспечения, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, в этой валюте / этом драгоценном металле уменьшается на сумму возвращаемых денежных средств / количество возвращаемого драгоценного металла.

- 14.11. При указании в Запросе о возврате / Постоянном поручении на возврат Расчетного кода 2-го уровня Клиринговый центр также учитывает информацию о возврате Обеспечения, учитываемого по Расчетному коду 2-го уровня.

При указании в Запросе о возврате / Постоянном поручении на возврат Расчетного кода 3-го уровня Клиринговый центр также учитывает информацию о возврате Обеспечения, учитываемого по Расчетному коду 3-го уровня и Расчетному коду 2-го уровня, соответствующему Расчетному коду 3-го уровня, указанному в Запросе о возврате / Постоянном поручении на возврат.

При этом размер Обеспечения в соответствующей валюте / соответствующем драгоценном металле, информация о котором учитывается по Расчетному коду 2-го и/или 3-го уровня, уменьшается на сумму возвращаемых денежных средств / драгоценных металлов без учета проверки достаточности Обеспечения, учитываемого по Расчетному коду 2-го и/или 3-го уровня.

- 14.12. 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.

ПОДРАЗДЕЛ V-II. КЛИРИНГОВЫЕ СЕССИИ

Статья 15. Порядок проведения клиринговых сессий. Порядок возникновения и исполнения Маржинальных требований

- 15.1. Каждый Расчетный день в срок, установленный Временным регламентом на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, Клиринговый центр проводит клиринговую сессию, в ходе которой Клиринговый центр:
- 15.1.1. устанавливает риск-параметры в соответствии с Методикой определения риск-параметров валютного рынка и рынка драгоценных металлов;
 - 15.1.2. определяет Расчетные цены в соответствии с пунктом 15.2 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов;
 - 15.1.3. для каждого Участника клиринга рассчитывает и устанавливает новые значения Единых лимитов по Расчетному коду, Единых лимитов по Расчетному коду 2-го уровня;
 - 15.1.4. для каждого Участника торгов, заключившего с Клиринговым центром договор о ведении клиринговых регистров, предусмотренный общей частью Правил клиринга, рассчитывает и устанавливает новые значения Единых лимитов по Расчетному коду 3-го уровня;
 - 15.1.5. определяет обязательства Участников клиринга и Клирингового центра по уплате вариационной маржи в соответствии со статьей 16 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов;
 - 15.1.6. учитывает прекращение встречных однородных обязательств по фьючерсным контрактам и своп контрактам;
 - 15.1.7. формирует и направляет каждому Участнику клиринга, имеющему обязательства по фьючерсным контрактам и/или своп контрактам, Отчет об обязательствах по ПФИ;
 - 15.1.8. формирует и направляет каждому Участнику торгов, заключившему с Клиринговым центром договор о ведении клиринговых регистров, по Расчетному коду 2-го уровня, открытого для которого, учитывается информация об обязательствах по фьючерсным контрактам и/или своп контрактам, Отчет об обязательствах по ПФИ;
 - 15.1.9. формирует и направляет Участникам клиринга, у которых возникли Задолженности, Отчет «Требование о погашении Задолженности»;
 - 15.1.10. определяет Участников клиринга, у которых возникли Маржинальные требования и суммы указанных Маржинальных требований;
 - 15.1.11. формирует и направляет Участникам клиринга, у которых возникли Маржинальные требования, Отчет о Маржинальном требовании, содержащий информацию о его сумме.
- 15.2. 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.

- 15.3. Под встречными однородными обязательствами по фьючерсным контрактам и своп контрактам, подлежащими прекращению в ходе клиринговой сессии, понимаются обязательства по фьючерсному контракту и по второй части своп контракта, удовлетворяющие всем следующим требованиям:
- являющимися обязательствами противоположной направленности;
 - являющимися обязательствами по одному базисному активу и валюте, в которой выражены обязательства по оплате базисного актива;
 - являющимися обязательствами с одной Датой исполнения;
 - являющимися обязательствами с одинаковыми лотами;
 - являющимися обязательствами по фьючерсным контрактам и своп контрактам, заключенным на основании заявок, в которых указан один и тот же код клиента Участника торгов (либо код клиента Участника торгов в обеих заявках не указан) и один и тот же Торгово-клиринговый счет 1-го, 2-го или 3-го уровня.
- 15.4. В ходе клиринговой сессии, после определения обязательств по уплате вариационной маржи и выполнения иных действий, предусмотренных статьей 16 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, Клиринговый центр среди обязательств по фьючерсным контрактам и своп контрактам определяет обязательства, являющиеся встречными и однородными в соответствии с пунктом 15.3 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, и учитывает прекращение встречных и однородных обязательств по фьючерсным контрактам и своп контрактам, при этом в первую очередь прекращаются обязательства по фьючерсным контрактам и своп контрактам с более ранней датой и временем заключения (метод ФИФО).
- 15.4.1. При указании в заявке на заключение фьючерсного контракта или своп контракта Торгово-клирингового счета 2-го уровня Клиринговый центр также учитывает информацию о прекращении обязательств по указанным контрактам по Расчетному коду 2-го уровня, входящему в состав Торгово-клирингового счета 2-го уровня, указанного в заявке.
- 15.4.2. При указании в заявке на заключение фьючерсного контракта или своп контракта Торгово-клирингового счета 3-го уровня, Клиринговый центр также учитывает информацию о прекращении обязательств по указанным контрактам по Расчетному коду 2-го уровня, соответствующему Торгово-клиринговому счету 3-го уровня, указанному в заявке, и по Расчетному коду 3-го уровня, входящему в состав Торгово-клирингового счета 3-го уровня, указанного в заявке.
- 15.4.3. Информация о прекращении обязательств по фьючерсным контрактам и своп контрактам, учитываемым по Расчетным кодам 1-го и 2-го уровня, предоставляется Участнику клиринга в составе Отчета об обязательствах по ПФИ, направляемого Участнику клиринга в соответствии с подпунктом 15.1.7 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.
- 15.4.4. Информация о прекращении обязательств по фьючерсным контрактам и своп контрактам, учитываемым по Расчетным кодам 2-го и 3-го уровня, предоставляется

Участнику торгов в составе Отчета об обязательствах по ПФИ, направляемого Участнику торгов в соответствии с подпунктом 15.1.8 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.

- 15.5. Маржинальное требование возникает у Участника клиринга, Единый лимит по Расчетному коду которого по итогам клиринговой сессии стал отрицательным. Сумма Маржинального требования равна абсолютному значению Единого лимита по Расчетному коду, определенного по итогам клиринговой сессии.
- 15.6. 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 Расчетного дня.
- 15.7. 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 драгоценном металле в порядке, определенном статьей 13 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.
- 15.8. Маржинальное требование, учитываемое по Расчетному коду, возникшее у Участника клиринга, считается прекращенным в момент времени, когда Единый лимит по такому Расчетному коду станет неотрицательным.
- 15.9. В случае неисполнения Участником клиринга Маржинального требования, учитываемого по Расчетному коду, в срок, установленный Временным регламентом на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, Клиринговый центр:
- 15.9.1. направляет Бирже уведомление о необходимости приостановления возможности подачи заявок с указанием Торгово-клиринговых счетов соответствующих уровней, в состав которых входит Расчетный код или соответствующих Расчетному коду, по которому учитывается неисполненное Маржинальное требование;
- 15.9.2. вправе направить Бирже уведомление о необходимости снятия всех или части заявок с указанием Торгово-клиринговых счетов соответствующих уровней, в состав которых входит Расчетный код или соответствующих Расчетному коду, по которому учитывается неисполненное Маржинальное требование;
- 15.9.3. заключает с Участником клиринга, не исполнившим Маржинальное требование, закрывающие Сделки с иностранной валютой / драгоценными металлами, приводящие к увеличению Единого лимита по такому Расчетному коду.

Указанные сделки заключаются без подачи заявок.

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

Указанные Сделки заключаются до момента прекращения Маржинального требования, учитываемого по Расчетному коду, или до момента невозможности заключения указанных Сделок.

Указанные Сделки не заключаются в случае, если у Участника клиринга, не исполнившего Маржинальное требование, 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;

- 15.9.4. после завершения заключения Сделок в соответствии с подпунктом 15.9.3 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов Клиринговый центр направляет Бирже уведомление о снятии ограничений на подачу заявок с указанием Торгово-клиринговых счетов соответствующих уровней, в состав которых входит Расчетный код или соответствующих Расчетному коду, по которому учитывалось неисполненное Маржинальное требование.

Статья 16. Вариационная маржа

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

$$VM_0 = (Rc - (BR + SR)) \times L, \text{ где}$$

VM_0 – 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, обязательства по которому не прекращены, рассчитывается по формуле:

$$VM_T = (Rc - Rc_p) \times L, \text{ где}$$

VM_T – вариационная маржа по своп контракту;

Rc – Расчетная цена, определенная в текущий Расчетный день;

Rc_p – Расчетная цена, определенная в предыдущий Расчетный день;

L – лот своп контракта.

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

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

VM_O – вариационная маржа по фьючерсному контракту;

Rc – Расчетная цена, определенная в текущий Расчетный день;

$Price$ – цена фьючерсного контракта;

L – лот фьючерсного контракта.

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

$$VM_T = (Rc - Rc_p) \times L, \text{ где}$$

VM_T – вариационная маржа по фьючерсному контракту;

Rc – Расчетная цена, определенная в текущий Расчетный день;

Rc_p – Расчетная цена, определенная в предыдущий Расчетный день;

L – лот фьючерсного контракта.

- 16.3. 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, обязательства по которым не прекращены и по которым Участник клиринга является продавцом;

VM – вариационная маржа по своп контракту / фьючерсному контракту, рассчитанная в соответствии с пунктами 16.1-16.2 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.

- 16.4. 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, обязательства по которым не прекращены и по которым Участник клиринга является покупателем;

VM – вариационная маржа по своп контракту / фьючерсному контракту, рассчитанная в соответствии с пунктами 16.1-16.2 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.

- 16.5. Если значение, рассчитанное в соответствии с пунктом 16.3 или 16.4 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 .

- 16.5.1. Обязанности / требования по уплате вариационной маржи учитываются по Расчетному коду Участника клиринга, входящему в состав Торгово-клирингового счета Участника клиринга, указанного в заявке / соответствующему Торгово-клиринговому счету 2-го или 3-го уровня, указанному в заявке.
- 16.5.2. При указании в заявке на заключение фьючерсного контракта или своп контракта Торгово-клирингового счета 2-го уровня, Клиринговый центр также учитывает информацию об обязательствах по уплате вариационной маржи по Расчетному коду 2-го уровня, входящему в состав Торгово-клирингового счета 2-го уровня, указанного в заявке.
- 16.5.3. При указании в заявке на заключение фьючерсного контракта или своп контракта Торгово-клирингового счета 3-го уровня, Клиринговый центр также учитывает информацию об обязательствах по уплате вариационной маржи по Расчетному коду 2-го уровня, соответствующему Торгово-клиринговому счету 3-го уровня, указанному в заявке, и по Расчетному коду 3-го уровня, входящему в состав Торгово-клирингового счета 3-го уровня, указанного в заявке.
- 16.5.4. Информация о размере обязательств Участника клиринга по уплате вариационной маржи, учитываемых по Расчетному коду Участника клиринга, предоставляется Участнику клиринга в составе Отчета об обязательствах по ПФИ, направляемого Участнику клиринга в соответствии с подпунктом 15.1.7 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.
- 16.5.5. Информация об обязательствах по уплате вариационной маржи, учитываемая по Расчетному коду 2-го уровня, предоставляется Участнику клиринга в составе Отчета об обязательствах по ПФИ, направляемого Участнику клиринга в соответствии с подпунктом 15.1.7 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.
- 16.5.6. Информация об обязательствах по уплате вариационной маржи, учитываемая по Расчетному коду 2-го и/или 3-го уровня предоставляется Участнику торгов в составе Отчета об обязательствах по ПФИ, направляемого Участнику торгов в соответствии с подпунктом 15.1.8 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.
- 16.6. После определения обязательств по уплате вариационной маржи в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов и до учета прекращения обязательств по фьючерсным контрактам и своп контрактам в соответствии со статьей 15 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, Клиринговый центр:
 - 16.6.1. 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, обязательства по которым не прекращены;
 - 16.6.2. 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, обязательства по которым не прекращены;
- 16.6.3. пересчитывает Нетто-обязательства / Нетто-требования в российских рублях с соответствующей Датой исполнения, учитываемые по Расчетным кодам Участника клиринга, с учетом изменения суммы обязательств по второй части своп контрактов / по фьючерсным контрактам, рассчитанной в соответствии с подпунктами 16.6.1, 16.6.2 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов;
- 16.6.4. пересчитывает значения Нетто-обязательств / Нетто-требований в российских рублях с соответствующей Датой исполнения, информация о которых учитывается по Расчетным кодам 2-го и/или 3-го уровня, с учетом изменения суммы обязательств по второй части своп контрактов / по фьючерсным контрактам, рассчитанной в соответствии с подпунктами 16.6.1, 16.6.2 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.
- 16.7. Определенные в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов обязательства по уплате вариационной маржи, учитываемые по Расчетному коду Участника клиринга, допускаются к клирингу и включаются в клиринговый пул клиринговой сессии, в ходе которой они были определены.
- 16.8. Обязанность Участника клиринга по уплате вариационной маржи, учитываемая по Расчетному коду Участника клиринга, 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 с его требованием к Клиринговому центру по возврату Обеспечения. Размер Обеспечения Участника клиринга в российских рублях, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, уменьшается на размер исполненного обязательства Участника клиринга по уплате вариационной маржи.
- 16.9. Если Обеспечения Участника клиринга в российских рублях, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, недостаточно для исполнения обязанности Участника клиринга по уплате вариационной маржи в полном объеме, неисполненное обязательство (неисполненная часть обязательства) Участника клиринга по уплате вариационной маржи 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».
- 16.10. Порядок действий Клирингового центра при неисполнении Участником клиринга Задолженности в срок, установленный в пункте 16.9 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, определен в статье 18 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.
- 16.11. Требование Участника клиринга по получению вариационной маржи, учитываемое

по Расчетному коду Участника клиринга, прекращается возникновением обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга Обеспечения в российских рублях, учитываемого по тому же Расчетному коду. При этом размер Обеспечения Участника клиринга в российских рублях, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, увеличивается на размер исполненного требования Участника клиринга.

- 16.12. Клиринговый центр также учитывает информацию об исполнении обязательств по уплате / получению вариационной маржи по Расчетным кодам 2-го и/или 3-го уровня без учета проверки достаточности Обеспечения, учитываемого по Расчетному коду 2-го или 3-го уровня.

При этом размер Обеспечения в российских рублях, информация о котором учитывается по Расчетному коду 2-го / 3-го уровня, уменьшается на размер обязательства по уплате вариационной маржи / увеличивается на размер требования по получению вариационной маржи.

- 16.13. Проценты на сумму уплаченной и/или полученной вариационной маржи Клиринговым центром не начисляются и не уплачиваются.

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

Статья 17. Порядок исполнения / прекращения обязательств по Сделкам

- 17.1. 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.
- 17.1.1. 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 Клиринговый центр:
- включает в клиринговый пул непрекращенные 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 направляет Участникам клиринга предварительные Биржевые свидетельства и Клиринговые отчеты.
- 17.1.2. Исполнение / прекращение Итоговых нетто-обязательств и Итоговых нетто-требований, определенных в соответствии с подпунктом 17.1.1 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, осуществляется в общем порядке, установленном настоящей статьей Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.
- 17.2. По окончании всех торгов, на которых заключаются Сделки с исполнением обязательств в дату их заключения, Клиринговый центр:
- 17.2.1. включает в клиринговый пул непрекращенные 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 16.6.1, 16.6.2 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов;
- 17.2.2. 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.
- 17.3. Процедуры, указанные в пункте 17.2 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.

- 17.3.1. Запрос на проведение ранних расчетов действует в день его предоставления.
- 17.3.2. 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.
- 17.3.3. 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.
- 17.4. После определения Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований Участников клиринга в соответствии с пунктом 17.2.2 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, Клиринговый центр формирует и направляет Участникам клиринга Биржевые свидетельства и Клиринговые отчеты.
- 17.5. 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.
- 17.6. Клиринговый центр исполняет Итоговые нетто-требования Участника клиринга, учитываемые по Расчетному коду, при условии исполнения Участником клиринга своих Итоговых нетто-обязательств, учитываемых по тому же Расчетному коду.
- 17.7. Для исполнения Итоговых нетто-обязательств Участника клиринга в соответствующей валюте / соответствующем драгоценном металле, учитываемых по Расчетному коду Участника клиринга, используется Обеспечение Участника клиринга в соответствующей валюте / соответствующем драгоценном металле, учитываемое по тому же Расчетному коду Участника клиринга. Обеспечение, учитываемое по другим Расчетным кодам Участника клиринга, не используется.
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 Расчетных организациях.
Датой и временем внесения Участником клиринга драгоценных металлов в Обеспечение являются дата и время зачисления драгоценных металлов на Счет

обеспечения в драгоценном металле Участника клиринга.

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

- 17.8. Итоговое нетто-обязательство Участника клиринга в соответствующей валюте, учитываемое по Расчетному коду Участника клиринга, является обеспеченным средствами под исполнение, если размер Обеспечения Участника клиринга в соответствующей валюте, учитываемого по тому же Расчетному коду Участника клиринга, больше или равен величине указанного Итогового нетто-обязательства Участника клиринга в соответствующей валюте, и является необеспеченным средствами под исполнение – если размер Обеспечения Участника клиринга в соответствующей валюте, учитываемого по тому же Расчетному коду Участника клиринга, меньше величины указанного Итогового нетто-обязательства Участника клиринга в соответствующей валюте.
- 17.9. Участник клиринга, имеющий Итоговое нетто-обязательство, не обеспеченное средствами под исполнение, признается Недобросовестным участником клиринга, и в отношении него Клиринговый центр выполняет действия, предусмотренные статьей 18 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.
- 17.10. В срок, установленный Временным регламентом на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, Клиринговый центр осуществляет исполнение / прекращение Итоговых нетто-обязательств Участников клиринга, обеспеченных средствами под исполнение, и соответствующих им Итоговых нетто-требований Участников клиринга, в том числе определенных по итогам выполнения действий, предусмотренных статьей 18 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.
- 17.11. Клиринговый центр зачитывает Итоговое нетто-обязательство Участника клиринга в соответствующей валюте, учитываемое по Расчетному коду Участника клиринга, с требованием Участника клиринга по возврату денежных средств в соответствующей валюте, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга по тому же Расчетному коду 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, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, уменьшается на сумму исполненного Итогового нетто-обязательства в этой валюте.
- 17.12. Итоговое нетто-обязательство Участника клиринга в соответствующем драгоценном металле, учитываемое по Расчетному коду Участника клиринга, исполняется за счет Обеспечения Участника клиринга в этом драгоценном металле, учитываемого по тому же Расчетному коду Участника клиринга.
- 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 в драгоценном металле, соответствующего Расчетному коду Участника клиринга, в счет исполнения Итогового нетто-обязательства Участника клиринга в этом драгоценном металле.

При этом размер Обеспечения Участника клиринга в соответствующем драгоценном металле, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, уменьшается на сумму исполненного Итогового нетто-обязательства в этом драгоценном металле.

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

При этом размер Обеспечения Участника клиринга в соответствующей валюте, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, увеличивается на сумму прекращенного Итогового нетто-требования Участника клиринга в этой валюте.

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

При этом размер Обеспечения Участника клиринга в соответствующем драгоценном металле, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, увеличивается на сумму исполненного Итогового нетто-требования Участника клиринга в этом драгоценном металле.

- 17.15. Клиринговый центр также учитывает информацию о прекращении обязательств по Сделкам с наступившей Датой исполнения, заключенным с указанием Торгово-клирингового счета 2-го уровня, по Расчетному коду 2-го уровня, входящему в состав Торгово-клирингового счета 2-го уровня, указанного в заявке на заключение такой Сделки, без учета проверки достаточности Обеспечения, учитываемого по Расчетному коду 2-го уровня.

Клиринговый центр также учитывает информацию о прекращении обязательств по Сделкам с наступившей Датой исполнения, заключенным с указанием Торгово-клирингового счета 3-го уровня, по Расчетному коду 3-го уровня, входящему в состав Торгово-клирингового счета 3-го уровня, указанного в заявке на заключение такой Сделки, и по Расчетному коду 2-го уровня, соответствующему Торгово-клиринговому счету 3-го уровня, указанного в заявке на заключение такой Сделки, без учета проверки достаточности Обеспечения, учитываемого по Расчетному коду 2-го и/или 3-го уровня.

При этом размер Обеспечения в соответствующей валюте / соответствующем драгоценном металле, информация о котором учитывается по Расчетному коду 2-го

/ 3-го уровня, уменьшается / увеличивается на сумму Нетто-обязательства / Нетто-требования в такой иностранной валюте / таком драгоценном металле с наступившей Датой исполнения, информация о котором учитывается по соответствующему Расчетному коду 2-го / 3-го уровня.

Статья 18. Порядок действий в случае наличия Задолженности и/или обязательств по Сделкам, не обеспеченных средствами под исполнение

18.1. В случаях:

- если Итоговое нетто-обязательство Участника клиринга в соответствующей валюте / соответствующем драгоценном металле, не обеспечено средствами под исполнение (полностью или частично);
- 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;

Клиринговый центр без подачи заявок заключает с Недобросовестным участником клиринга сделку своп или сделку купли-продажи с иностранной валютой / драгоценным металлом в соответствии со статьей 19 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.

18.2. При превышении установленного в подпункте 19.1.5 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов количества Расчетных дней, в течение которых у Участника клиринга может возникать Итоговое нетто-обязательство, не обеспеченное средствами под исполнение, по Торгово-клиринговому счету Участника клиринга, имеющего необеспеченное средствами под исполнение Итоговое нетто-обязательство в иностранной валюте / драгоценных металлах / российских рублях, с Участника клиринга взимается штраф, рассчитываемый по формуле:

$Penalty = ROUND (VAL_OBL \times C \times K \times R / 365; 2)$, 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 Участника клиринга.

- 18.3. Клиринговый центр зачитывает обязательство Участника клиринга по уплате штрафа, учитываемое по основному Расчетному коду Участника клиринга, сумма которого рассчитана в соответствии с пунктом 18.2 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, с требованием Участника клиринга по возврату Обеспечения в российских рублях, учитываемого по основному Расчетному коду 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.
- 18.4. При наличии Недобросовестных участников клиринга, имеющих не обеспеченные полностью или частично средствами под исполнение Итоговые нетто-обязательства в соответствующей валюте / драгоценном металле, для исполнения Итоговых нетто-требований в соответствующей валюте / драгоценном металле Добросовестных участников клиринга Клиринговый центр выполняет действия в следующей последовательности:
- использует свободные собственные денежные средства / драгоценные металлы по усмотрению Клирингового центра;
 - заключает с Уполномоченными участниками клиринга (за исключением Банка России) сделки своп;
 - в случае невозможности заключения сделок своп с Уполномоченными участниками клиринга (за исключением Банка России), заключает сделки своп с иностранной валютой с Банком России в соответствии с Договором о взаимодействии;
 - в случае невозможности заключения сделок своп с Уполномоченными участниками клиринга, включая Банк России, заключает сделку своп / сделку купли-продажи с иностранной валютой / драгоценным металлом с Добросовестными участниками клиринга в соответствии со статьей 20 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.
- 18.4.1. 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.
- 18.4.2. Условия сделок своп, заключаемых Клиринговым центром с Банком России, и порядок их исполнения определены Договором о взаимодействии.
- 18.5. После заключения сделок своп / сделок купли-продажи иностранной валюты в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов Клиринговый центр:
- 18.5.1. включает обязательства с наступившей Датой исполнения по указанным Сделкам в клиринговый пул;
- 18.5.2. зачитывает встречные однородные Итоговые нетто-обязательства / Итоговые нетто-требования в соответствующей валюте / соответствующем драгоценном металле и/или Задолженности в российских рублях Участника клиринга с обязательствами и требованиями в соответствующих валютах / соответствующих драгоценных металлах с наступившей Датой исполнения по указанным

заключенным Сделкам;

- 18.5.3. 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;

- 18.5.4. осуществляет исполнение / прекращение Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований Участников клиринга, определенных в соответствии с подпунктом 18.5.2 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, в порядке, установленном статьей 17 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.

- 18.6. 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.

- 18.7. Итоговое нетто-обязательство в российских рублях, учитываемое по Расчетному коду Участника клиринга, не прекращенное по итогам действий, выполненных в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, учитывается как Задолженность Участника клиринга перед Клиринговым центром по этому Расчетному коду Участника клиринга.

- 18.8. Задолженность Участника клиринга должна быть погашена Участником клиринга не позднее времени, установленного Временным регламентом на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.

Информация о наличии у Участника клиринга Задолженности и ее размере предоставляется Участнику клиринга в составе отчета «Требование о погашении Задолженности», направляемом Участнику клиринга в соответствии с пунктом 16.9 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, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, по которому учитывалась Задолженность, является неотрицательным.

- 18.9. В случае непогашения Участником клиринга до времени, установленного Временным регламентом на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, Задолженности:

- 18.9.1. Участник клиринга обязан уплатить Клиринговому центру пени, 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 Расчетным днем.

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

Обязательство по уплате пени, рассчитанное в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, учитывается по тому же Расчетному коду Участника клиринга, что и Задолженность.

18.9.2. Указанная Задолженность урегулируется в соответствии с пунктом 18.1 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.

18.10. Если Задолженность Участника клиринга не погашена полностью по итогам действий, выполненных в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, и/или Участником клиринга в срок, установленный Временным регламентом на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, 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.

Статья 19. Порядок заключения и условия сделок своп / сделки купли-продажи с иностранной валютой / драгоценным металлом, заключаемых с Недобросовестными участниками клиринга

19.1. Сделки своп с иностранной валютой / драгоценным металлом, указанные в пункте 18.1 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, заключаются при соблюдении следующих условий:

19.1.1. у Участника клиринга – кредитной организации не отозвана (не аннулирована) лицензия Банка России на осуществление банковских операций;

19.1.2. 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;

19.1.3. допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию не приостановлен;

19.1.4. 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;

19.1.5. количество Расчетных дней, в которые у Участника клиринга возникает Итоговое нетто-обязательство в соответствующей валюте / соответствующем драгоценном металле, не обеспеченное средствами под исполнение, и/или Задолженность, учитываемые по одному Расчетному коду Участника клиринга, не превышает 2 (двух) Расчетных дней подряд;

19.1.6. у Участника клиринга – кредитной организацией не отозвана (не аннулирована)

лицензия Банка России на привлечение во вклады и размещение драгоценных металлов (для сделок своп с драгоценным металлом).

- 19.2. Условие, указанное в подпункте 19.1.5 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, не применяется, если причиной необеспеченности Итогового нетто-обязательства Участника клиринга в соответствующей валюте средствами под исполнение / причиной непогашения Задолженности является несвоевременное зачисление денежных средств на клиринговые / корреспондентские счета Клирингового центра в Расчетных организациях / Расчетных банках, вызванное проведением процедур комплаенс-контроля в банках-корреспондентах, сбоями в работе платежных систем, а также обстоятельствами непреодолимой силы, определенными в пункте 19.5 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.
- 19.3. Условия сделок своп, заключаемых Клиринговым центром от имени Недобросовестного участника клиринга в отношении себя лично в случае, установленном пунктом 18.1 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, соответствуют определенным Правилами торгов на валютном рынке условиям сделок своп с учетом следующих особенностей:
- 19.3.1. в случае наличия у Участника клиринга не обеспеченного полностью или частично средствами под исполнение Итогового нетто-обязательства в российских рублях, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, по первой части сделки своп у Участника клиринга возникают требования в российских рублях и обязательства в иностранной валюте / драгоценном металле, в объеме, соответствующем не обеспеченному средствами под исполнение Итоговому нетто-обязательству в российских рублях и не превышающем суммы Итогового нетто-требования Участника клиринга в иностранной валюте / драгоценном металле и Обеспечения Участника клиринга в такой иностранной валюте / таком драгоценном металле, учитываемого по тому же Расчетному коду Участника клиринга;
- 19.3.2. в случае наличия у Участника клиринга не обеспеченного полностью или частично средствами под исполнение Итогового нетто-обязательства в иностранной валюте / драгоценном металле, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, по первой части сделки своп у Участника клиринга возникают требования в иностранной валюте / драгоценном металле в объеме, равном не обеспеченному средствами под исполнение Итоговому нетто-обязательству в иностранной валюте / драгоценном металле, и обязательства в другой валюте, в том числе в российских рублях, в объеме, соответствующем не обеспеченному средствами под исполнение Итоговому нетто-обязательству в иностранной валюте / драгоценном металле и не превышающем суммы Итогового нетто-требования Участника клиринга в такой другой валюте и Обеспечения Участника клиринга в такой другой валюте, учитываемого по тому же Расчетному коду Участника клиринга;
- 19.3.3. в случае наличия у Участника клиринга Задолженности, учитываемой по Расчетному коду Участника клиринга, по первой части сделки своп у Участника клиринга возникают требования в российских рублях и обязательства в

иностранной валюте / драгоценном металле в объеме, соответствующем размеру Задолженности и не превышающем суммы Итогового нетто-требования Участника клиринга в иностранной валюте / драгоценном металле и Обеспечения Участника клиринга в такой иностранной валюте / таком драгоценном металле, учитываемого по тому же Расчетному коду Участника клиринга;

19.3.4. Датой исполнения обязательств по первой части сделки своп является день ее заключения;

19.3.5. Датой исполнения обязательств по второй части сделки своп является Расчетный день, следующий за днем ее заключения и являющийся одновременно Расчетным днем по валюте лота и сопряженной валюте заключенной сделки своп;

19.3.6. Базовый курс сделки своп устанавливается равным Центральному курсу, определенному в 19:00 по московскому времени текущего Расчетного дня;

19.3.7. Цена сделки своп рассчитывается по следующей формуле:

$$\text{Swap_Price} = R_{c_VAL1_VAL2} \times S \times n / 365, \text{ где}$$

Swap_Price – цена сделки своп,

$R_{c_VAL1_VAL2}$ – Центральный курс сделок купли-продажи иностранной валюты / драгоценного металла VAL1 за валюту VAL2, рассчитанный в 19:00 по московскому времени текущего Расчетного дня,

VAL1 – валюта лота сделки своп,

VAL2 – сопряженная валюта 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.

19.4. При несоблюдении любого из условий, указанных в подпунктах 19.1.3-19.1.5 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, Клиринговый центр без подачи заявок заключает с Недобросовестным участником клиринга закрывающую сделку купли-продажи иностранной валюты / драгоценного металла, условия которой соответствуют определенным Правилами торгов на валютном рынке условиям сделок спот с учетом следующих особенностей:

19.4.1. в случае наличия у Участника клиринга не обеспеченного полностью или частично средствами под исполнение Итогового нетто-обязательства в российских рублях, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, у Участника клиринга возникают требования в российских рублях и обязательства в иностранной валюте / драгоценном металле, в объеме, соответствующем не обеспеченному средствами под исполнение Итоговому нетто-обязательству в российских рублях и не превышающем суммы Итогового нетто-требования Участника клиринга в иностранной валюте / драгоценном металле и Обеспечения Участника клиринга в такой иностранной валюте / таком драгоценном металле, учитываемого по тому же Расчетному коду Участника клиринга;

19.4.2. в случае наличия у Участника клиринга не обеспеченного полностью или частично средствами под исполнение Итогового нетто-обязательства в иностранной валюте / драгоценном металле, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, у

Участника клиринга возникают требования в иностранной валюте / драгоценном металле в объеме, равном не обеспеченному средствами под исполнение Итоговому нетто-обязательству в иностранной валюте / драгоценном металле, и обязательства в другой валюте, в том числе в российских рублях, в объеме, соответствующем не обеспеченному средствами под исполнение Итоговому нетто-обязательству в иностранной валюте / драгоценном металле и не превышающем суммы Итогового нетто-требования Участника клиринга в такой другой валюте, в том числе в российских рублях, и Обеспечения Участника клиринга в такой другой валюте, в том числе в российских рублях, учитываемого по тому же Расчетному коду Участника клиринга;

- 19.4.3. в случае наличия у Участника клиринга Задолженности, учитываемой по Расчетному коду Участника клиринга, у Участника клиринга возникают требования в российских рублях и обязательства в иностранной валюте / драгоценном металле в объеме, соответствующем размеру Задолженности и не превышающем суммы Итогового нетто-требования Участника клиринга в иностранной валюте / драгоценном металле и Обеспечения Участника клиринга в такой иностранной валюте / таком драгоценном металле, учитываемого по тому же Расчетному коду Участника клиринга;
- 19.4.4. Датой исполнения обязательств по сделке является день ее заключения;
- 19.4.5. цена сделки устанавливается равной цене балансирующей сделки с соответствующей иностранной валютой / драгоценным металлом, порядок заключения которой определен общей частью Правил клиринга.
- 19.5. 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 подпунктом 19.3.7 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.

- 19.6. Клиринговый центр вправе принять решение о заключении от имени Недобросовестного участника клиринга сделок своп с иностранной валютой в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов с ценой сделки своп, равной нулю, при наличии обстоятельств, не указанных в пункте 19.5 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов и свидетельствующих об отсутствии вины такого Участника клиринга.
- 19.7. 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.
- 19.7.1. Обязательства по Сделкам, в отношении которых Клиринговым центром принято решение в соответствии с пунктом 19.7 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 17 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, при этом при наличии неисполненного Итогового нетто-обязательства Участника клиринга в иностранной валюте / драгоценном металле Клиринговый центр заключает от имени Недобросовестного участника клиринга закрывающую сделку купли-продажи иностранной валюты / драгоценного металла, с условиями, определенными подпунктами 19.4.1-19.4.5 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.
- 19.8. 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.

Статья 20. Порядок заключения и условия сделок своп / сделки купли-продажи с иностранной валютой / драгоценным металлом, заключаемых с Добросовестным участником клиринга

- 20.1. В случае, указанном в пункте 18.4 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, Клиринговый центр без подачи заявок заключает с Добросовестным участником клиринга сделку своп, условия которой соответствуют определенным Правилами торгов на валютном рынке условиям сделок спот с учетом следующих особенностей:
- 20.1.1. в случае недостаточности у Клирингового центра иностранной валюты / драгоценного металла для исполнения Итоговых нетто-требований Добросовестного участника клиринга, по первой части сделки своп у такого Участника клиринга возникают требования в российских рублях и обязательства по соответствующей иностранной валюте / соответствующему драгоценному металлу, в объеме, не превышающем Итогового нетто-требования Добросовестного участника клиринга в такой иностранной валюте / таком драгоценном металле;
- 20.1.2. Датой исполнения обязательств по первой части сделки своп является день ее заключения;
- 20.1.3. Датой исполнения обязательств по второй части сделки своп является Расчетный день, следующий за днем ее заключения и являющийся одновременно Расчетным днем по валюте лота и сопряженной валюте заключенной сделки своп;
- 20.1.4. Базовый курс сделки своп устанавливается равным Центральному курсу, определенному в 19:00 по московскому времени текущего Расчетного дня;
- 20.1.5. Цена сделки своп определяется по формуле, указанной в подпункте 19.3.7 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.
- 20.2. Сделки своп могут заключаться Клиринговым центром с одним Добросовестным участником клиринга не более, чем 2 (два) Расчетных дня подряд, при наличии у Добросовестного участника клиринга Итогового нетто-требования в иностранной валюте / драгоценном металле.
- 20.2.1. В случае отсутствия у Клирингового центра возможности в течение 2 (двух) Расчетных дней подряд исполнить Итоговые нетто-требования в иностранной валюте / драгоценном металле одного или нескольких Добросовестных участников клиринга:
- Клиринговый центр устанавливает по такой иностранной валюте / такому драгоценному металлу признак «запрет коротких продаж»;
 - Клиринговый центр без подачи заявок заключает с Добросовестным участником клиринга сделку купли-продажи иностранной валюты / драгоценного металла, условия которой соответствуют условиям первой части сделки своп, определенным в пункте 20.1 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, за исключением цены покупки/продажи, которая устанавливается решением Клирингового центра исходя из рыночной ситуации на дату заключения указанной Сделки.
- 20.3. Клиринговый центр, действуя от имени Участника клиринга в отношении себя лично, осуществляет все юридические и фактические действия, необходимые для

заклучения 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.

РАЗДЕЛ VI. ПОРЯДОК ОПЛАТЫ УСЛУГ. ОТЧЕТЫ ПО ИТОГАМ КЛИРИНГА

Статья 21. Порядок оплаты услуг Клирингового центра, Биржи и Технического центра

- 21.1. 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 Клирингового центра за оказание Участнику торгов услуг по договору о ведении клиринговых регистров;
 - 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).
- 21.2. Участник клиринга исполняет обязательства по уплате комиссионных вознаграждений Биржи, Клирингового центра и Технического центра за Участника торгов, не совпадающего в одном лице с Участником клиринга и имеющего право подавать заявки с указанием Торгово-клиринговых счетов 2-го уровня, соответствующих Расчетным кодам данного Участника клиринга.
- 21.3. Размер оборотной и постоянной частей комиссионного вознаграждения Биржи за организацию торгов и вознаграждения Технического центра за предоставление ИТС по сделкам с иностранной валютой рассчитывается с учетом действующего для Участника торгов тарифного плана.
- Размер оборотной и постоянной частей комиссионного вознаграждения Клирингового центра за клиринговое обслуживание по сделкам с иностранной валютой рассчитывается с учетом действующего для Участника клиринга тарифного плана.
- 21.3.1. Тарифный план действует для Регистрационного кода (идентификатора) Участника торгов / для Идентификатора Участника клиринга. Тарифный план применяется для всех соответствующих Сделок, заключенных на основании заявок, поданных с указанием Торгово-клирингового счета Участника клиринга, а также с указанием Торгово-клиринговых счетов 2-го и 3-го уровней, открытых в рамках Регистрационного кода (идентификатора) Участника торгов / Идентификатора Участника клиринга.
- 21.3.2. Тарифный план по сделкам своп применяется к сделкам своп, своп контрактам и фьючерсным контрактам с иностранной валютой.
- 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.

21.3.3. 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.

21.4. 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.

21.5. 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 Расчетный день календарного месяца, за который взимается постоянная часть комиссионного вознаграждения, 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.

- 21.5.1. 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, Дополнительного комиссионного сбора, а также комиссионного вознаграждения Клирингового центра за оказание Участнику торгов услуг по договору о ведении клиринговых регистров.
- 21.5.2. Заявление о выборе Расчетного кода для списания комиссионных вознаграждений действует, начиная с дня, следующего за днем его предоставления.
- 21.6. 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.
- 21.7. 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 рассчитывает 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 подлежит уплате 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, и удерживается Клиринговым центром с Участника клиринга в последний Расчетный день месяца по Расчетному коду, указанному Участником клиринга в Заявлении о выборе Расчетного кода для списания комиссионных вознаграждений, предоставленном в соответствии с пунктом 21.5 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 Расчетный день, когда Участник клиринга / Участник торгов был допущен к клиринговому обслуживанию / торгам, за исключением случаев, предусмотренных Тарифами Клирингового центра / Тарифами Биржи / Тарифами Технического центра.

- 21.8. Фиксированная часть вознаграждения за предоставление ИТС и комиссионное вознаграждение Клирингового центра за оказание Участнику торгов услуг по договору о ведении клиринговых регистров удерживаются Клиринговым центром с Участника клиринга в первый Расчетный день календарного месяца, следующего за месяцем фактического оказания соответствующих услуг, по Расчетному коду, указанному Участником клиринга в Заявлении о выборе Расчетного кода для списания комиссионных вознаграждений, предоставленном в соответствии с пунктом 21.5 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 и комиссионное вознаграждение Клирингового центра за оказание Участнику торгов услуг по договору о ведении клиринговых регистров удерживаются в последний Расчетный день, когда Участник торгов был допущен к торгам, за исключением случаев, предусмотренных Тарифами Технического центра / решением Клирингового центра.
- 21.9. Подлежащий уплате в соответствии с Тарифами Технического центра Дополнительный комиссионный сбор, рассчитанный в отношении Участника торгов / клиента Участника торгов, удерживается Клиринговым центром с Участника клиринга в Расчетный день, по итогам которого указанное дополнительное вознаграждение рассчитано, по Расчетному коду, входящему в состав / соответствующему Торгово-клиринговому счету соответствующего уровня, с указанием которого Участником торгов в течение данного Расчетного дня

были поданы заявки на заключение Сделок за свой счет или за счет указанного клиента Участника торгов (в случае если такой Торгово-клиринговый счет соответствующего уровня – единственный) либо по Расчетному коду, указанному Участником клиринга в Заявлении о выборе Расчетного кода для списания комиссионных вознаграждений, предоставленном в соответствии с пунктом 21.5 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 Участника торгов с указанием нескольких Торгово-клиринговых счетов соответствующего уровня.

- 21.10. Комиссионное вознаграждение Клирингового центра за учет клирингового обеспечения учитывается Клиринговым центром 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.
- 21.11. Комиссионное вознаграждение Клирингового центра за регистрацию и ведение Торгово-клирингового счета 3-го уровня, подлежащее уплате Участником торгов по договору о ведении клиринговых регистров, удерживается Клиринговым центром с Участника клиринга, зарегистрировавшего Торгово-клиринговый счет 2-го уровня для такого Участника торгов, по Расчетному коду, указанному таким Участником клиринга в Заявлении о выборе Расчетного кода для списания комиссионных вознаграждений, предоставленном в соответствии с пунктом 21.5 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов (в случае предоставления указанного заявления), либо по основному Расчетному коду такого Участника клиринга.
- 21.12. 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.
- 21.13. Клиринговый центр зачитывает обязательства Участника клиринга по уплате комиссионных вознаграждений, учитываемые по Расчетному коду Участника клиринга, с требованием Участника клиринга по возврату денежных средств в российских рублях, учитываемых в качестве Обеспечения по тому же Расчетному коду Участника клиринга.
- Обязательства Участника клиринга по уплате комиссионных вознаграждений считаются исполненными, если размер указанных обязательств меньше или равен размеру Обеспечения Участника клиринга в российских рублях.
- При этом размер Обеспечения Участника клиринга в российских рублях, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, уменьшается на сумму исполненных обязательств Участника клиринга по уплате комиссионных вознаграждений, а обязательства Участника клиринга по уплате комиссионных вознаграждений, не исполненные в срок, установленный Временным регламентом на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, учитываются как

Задолженность Участника клиринга перед Клиринговым центром по этому Расчетному коду Участника клиринга.

Указанная Задолженность Участника клиринга должна быть урегулирована в порядке, установленном пунктом 18.8 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.

- 21.14. Клиринговый центр также учитывает информацию об исполнении обязательств по уплате оборотных частей комиссионных вознаграждений по Сделкам, заключенным с указанием Торгово-клирингового счета 2-го уровня, по Расчетному коду 2-го уровня, входящему в состав Торгово-клирингового счета 2-го уровня, указанного в заявке на заключение такой Сделки, без учета проверки достаточности Обеспечения, учитываемого по Расчетному коду 2-го уровня.

Клиринговый центр также учитывает информацию об исполнении обязательств по уплате оборотных частей комиссионных вознаграждений по Сделкам, заключенным с указанием Торгово-клирингового счета 3-го уровня, по Расчетному коду 3-го уровня, входящему в состав Торгово-клирингового счета 3-го уровня, указанного в заявке на заключение такой Сделки, и по Расчетному коду 2-го уровня, соответствующему Торгово-клиринговому счету 3-го уровня, указанного в заявке на заключение такой Сделки, без учета проверки достаточности Обеспечения, учитываемого по Расчетному коду 2-го и/или 3-го уровня.

При этом размер Обеспечения в российских рублях, информация о котором учитывается по Расчетному коду 2-го / 3-го уровня, уменьшается / увеличивается на сумму обязательств по уплате оборотных частей комиссионных вознаграждений по Сделкам, информация о которых учитывается по соответствующему Расчетному коду 2-го / 3-го уровня.

- 21.15. 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.

- 21.15.1. Участник клиринга, не совпадающий в одном лице с Участником торгов, вправе поручить Клиринговому центру не предоставлять Участникам торгов информацию об оборотных частях комиссионных вознаграждений по Сделкам, заключенным с указанием Торгово-клиринговых счетов 2-го уровня, путем предоставления Клиринговому центру Заявления о порядке предоставления информации о комиссионных вознаграждениях.

- 21.15.2. Участник торгов, заключивший с Клиринговым центром договор о ведении клиринговых регистров, предусмотренный общей частью Правил клиринга, вправе поручить Клиринговому центру не предоставлять клиентам Участников торгов информацию об оборотных частях комиссионных вознаграждений по Сделкам, заключенным с указанием Торгово-клиринговых счетов 3-го уровня, путем предоставления Клиринговому центру Заявления о порядке предоставления информации о комиссионных вознаграждениях.

- 21.15.3. В случае предоставления Клиринговому центру Заявления о порядке предоставления информации о комиссионных вознаграждениях в соответствии с

подпунктом 21.15.1 / 21.15.2 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов Клиринговый центр не предоставляет Участникам торгов / клиентам Участника торгов информацию об оборотных частях комиссионных вознаграждений по Сделкам, заключенным с указанием соответствующих Торгово-клиринговых счетов 2-го и 3-го уровней, и соответствующая информация об уплате указанных комиссионных вознаграждений не учитывается Клиринговым центром в соответствии с пунктом 21.14 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.

Статья 22. Порядок предоставления информации и отчетов по итогам клиринга

22.1. Клиринговый центр обеспечивает Участнику клиринга возможность получения следующей информации из Клиринговой системы:

- о Сделках, стороной по которым является Участник клиринга;
- о Поручениях на управление риском, поданных Участником клиринга;
- о размере Обеспечения, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, в каждой валюте / каждом драгоценном металле (по каждому Расчетному коду Участника клиринга);
- о размере Единого лимита по Расчетному коду;
- о минимальном допустимом значении оценки в российских рублях Обеспечения Участника клиринга, учитываемого при расчете Единого лимита по Расчетному коду, установленном Участником клиринга (по каждому Расчетному коду Участника клиринга) (в случае, если такое значение установлено);
- о значении Нетто-обязательства и/или Нетто-требования, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, в каждой валюте / каждом драгоценном металле и с каждой Датой исполнения (по каждому Расчетному коду Участника клиринга);
- об обязательствах по уплате вариационной маржи (суммарно по каждому Расчетному коду Участника клиринга);
- о размере Обеспечения, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, в каждой валюте / каждом драгоценном металле, недостающего для исполнения Нетто-обязательства Участника клиринга в соответствующей валюте / соответствующем драгоценном металле, учитываемого по тому же Расчетному коду Участника клиринга, с наступившей Датой исполнения (по каждому Расчетному коду Участника клиринга);
- о наличии / отсутствии Маржинального требования Участника клиринга, о сумме Маржинального требования в российских рублях (в случае наличия) (по каждому Расчетному коду Участника клиринга);
- о наличии / отсутствии Задолженности Участника клиринга перед Клиринговым центром, о сумме Задолженности Участника клиринга (в случае наличия) (по каждому Расчетному коду Участника клиринга).

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

- Выписка из реестра сделок, принятых в клиринг, содержащая информацию об обязательствах по Сделкам, допущенных к клирингу, стороной по которым является Участник клиринга;
- 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 в денежных средствах / драгоценных металлах, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, об изменении размера такого Обеспечения, включая информацию об использовании Обеспечения, в том числе для исполнения обязательств, определенных по итогам клиринга;
- Отчет об Обеспечении, содержащий информацию о размере Обеспечения в денежных средствах / драгоценных металлах, учитываемую по Расчетному коду 2-го уровня, и об изменении размера такого Обеспечения;
- Отчет о комиссионных вознаграждениях;
- Отчет о торгово-клиринговых счетах, содержащий информацию о зарегистрированных Торгово-клиринговых счетах 1-го и 2-го уровня;
- Отчет о Клиринговых идентификаторах;
- Требование о погашении Задолженности;
- Отчет о Маржинальном требовании;
- Отчет о Поручениях на управление риском;
- Отчет об оценке обеспечения, содержащий информацию о российских рублях и об оценочной стоимости (в российских рублях) иностранной валюты и драгоценных металлов, составляющих индивидуальное и иное обеспечение, свободных от обязательств Участников клиринга и обремененных обязательствами Участника клиринга.

22.3. Отчеты, указанные в пункте 22.2 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.

22.4. Формы и форматы отчетов по итогам клиринга, предоставляемых Клиринговым

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

22.5. 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.

22.6. Клиринговый центр обеспечивает Участнику клиринга, для которого зарегистрирован Торгово-клиринговый счет 2-го уровня, возможность получения следующей информации из Клиринговой системы:

- о Сделках, заключенных Участником торгов с указанием Торгово-клирингового счета 2-го уровня, стороной по которым является Участник клиринга (по каждому Участнику торгов);
- о размере Обеспечения, информация о котором учитывается по Расчетному коду 2-го уровня, в каждой валюте / каждом драгоценном металле (по каждому Расчетному коду 2-го уровня);
- о размере Единого лимита по Расчетному коду 2-го уровня;
- о минимальном допустимом значении оценки в российских рублях Обеспечения, учитываемого при расчете Единого лимита по Расчетному коду 2-го уровня, установленном Участником клиринга (по каждому Расчетному коду 2-го уровня) (в случае, если такое значение установлено);
- о значении Нетто-обязательства и/или Нетто-требования, информация о котором учитывается по Расчетному коду 2-го уровня, в каждой валюте / каждом драгоценном металле и с каждой Датой исполнения (по каждому Расчетному коду 2-го уровня);
- об обязательствах по уплате вариационной маржи, информация о которых учитывается по Расчетному коду 2-го уровня (суммарно по каждому Расчетному коду 2-го уровня);
- о размере Обеспечения, информация о котором учитывается по Расчетному коду 2-го уровня, в каждой валюте / каждом драгоценном металле, недостающего для исполнения Нетто-обязательства в соответствующей валюте / соответствующем драгоценном металле, учитываемого по тому же Расчетному коду 2-го уровня, с наступившей Датой исполнения (по каждому Расчетному коду 2-го уровня).

22.7. Клиринговый центр обеспечивает Участнику торгов, заключившему с Клиринговым центром договор о ведении клиринговых регистров,

предусмотренный общей частью Правил клиринга, и для которого зарегистрирован Торгово-клиринговый счет 3-го уровня, возможность получения следующей информации из Клиринговой системы:

- о размере Обеспечения, информация о котором учитывается по Расчетному коду 2-го и 3-го уровня, в каждой валюте / каждом драгоценном металле (по каждому Расчетному коду 2-го и 3-го уровня);
- о размере Единого лимита по Расчетному коду 2-го и 3-го уровня;
- о минимальном допустимом значении оценки в российских рублях Обеспечения, учитываемого при расчете Единого лимита по Расчетному коду 2-го уровня, установленном Участником клиринга (по каждому Расчетному коду 2-го уровня) (в случае, если такое значение установлено);
- о минимальном допустимом значении оценки в российских рублях Обеспечения, учитываемого при расчете Единого лимита по Расчетному коду 3-го уровня, установленном Участником торгов (по каждому Расчетному коду 3-го уровня) (в случае, если такое значение установлено);
- о значении Нетто-обязательства и/или Нетто-требования, информация о котором учитывается по Расчетному коду 2-го и 3-го уровня, в каждой валюте / каждом драгоценном металле и с каждой Датой исполнения (по каждому Расчетному коду 2-го и 3-го уровня);
- об обязательствах по уплате вариационной маржи, информация о которых учитывается по Расчетному коду 2-го и 3-го уровня (суммарно по каждому Расчетному коду 2-го и 3-го уровня);
- о размере Обеспечения, информация о котором учитывается по Расчетному коду 2-го уровня и 3-го уровня, в каждой валюте / каждом драгоценном металле, недостающего для исполнения Нетто-обязательства в соответствующей валюте / соответствующем драгоценном металле, учитываемого по тому же Расчетному коду 2-го или 3-го уровня, с наступившей Датой исполнения (по каждому Расчетному коду 2-го и 3-го уровня).

22.8. Клиринговый центр формирует следующие отчеты для Участников торгов, заключивших с Клиринговым центром договор о ведении клиринговых регистров, предусмотренный общей частью Правил клиринга:

- Выписка из реестра сделок, принятых в клиринг, содержащая информацию об обязательствах по Сделкам, допущенных к клирингу, заключенным с указанием Торгово-клиринговых счетов 2-го и 3-го уровня;
- Отчет об обязательствах по ПФИ, содержащий информацию о допущенных к клирингу обязательствах по своп контрактам и фьючерсным контрактам и обязательствах по уплате вариационной маржи, учитываемую по Расчетным кодам 2-го и 3-го уровня;
- Отчет о сделках, дата исполнения которых перенесена, содержащий информацию об обязательствах, исключенных из клирингового пула, по сделкам, заключенным с указанием Торгово-клиринговых счетов 2-го и 3-го уровня;

- Отчет об Обеспечении, содержащий информацию о размере Обеспечения в денежных средствах / драгоценных металлах, учитываемую по Расчетному коду 2-го и 3-го уровня, и об изменении размера такого Обеспечения;
- Отчет о торгово-клиринговых счетах, содержащий информацию о зарегистрированных Торгово-клиринговых счетах 2-го и 3-го уровня;
- Отчет о Клиринговых идентификаторах.

22.9. Отчеты, указанные в пункте 22.8 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, направляются Участнику торгов в форме электронных документов в соответствии с Порядком ЭДО.

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

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

РАЗДЕЛ VII. ПРОЧИЕ УСЛОВИЯ

Статья 23. Особенности перевода обязательств и Обеспечения одного Участника клиринга другому Участнику клиринга

23.1. 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.

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

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

№ п/п	Наименование операции	Время (московское)
1.	Зачисление денежных средств на клиринговый банковский или корреспондентский счет Клирингового центра для учета в текущем Расчетном дне.	до 21:00
2.	Передача Участником клиринга в Клиринговый центр Запроса на проведение ранних расчетов.	до 16:30 Расчетного дня
3.	Определение Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований в юанях, белорусских рублях, тенге, гонконгских долларах, сомони, швейцарских франках.	11:00 Даты исполнения
4.	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
5.	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
6.	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

№ п/п	Наименование операции	Время (московское)
7.	Передача Клиринговым центром предварительных Биржевых свидетельств, содержащих обязательства в юанях, белорусских рублях, тенге и гонконгских долларах, сомони, швейцарских франках и Клиринговых отчетов.	с 11:00 до 11:15 Даты исполнения
8.	Передача Клиринговым центром предварительных Биржевых свидетельств, содержащих обязательства в евро, фунтах стерлингов, гривнах, и Клиринговых отчетов Участникам клиринга, не предоставившим Запрос на проведение ранних расчетов или Постоянное поручение на проведение ранних расчетов.	с 15:15 до 15:30 Даты исполнения
9.	Передача Клиринговым центром Клиринговых отчетов, Биржевых свидетельств и Клиринговых отчетов:	
	- 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
10.	Проведение клиринговой сессии.	до 10:00 Расчетного дня
11.	Передача Клиринговым центром Участникам клиринга Отчетов об обязательствах, Отчетов об обязательствах по ПФИ, Требований о погашении задолженности.	до 09:30 Расчетного дня
12.	Формирование и передача Клиринговым центром Участникам клиринга Отчетов о Маржинальном требовании.	с 09:30 до 10:00 Расчетного дня
13.	Передача Клиринговым центром Участникам клиринга Отчетов о движении денежных средств.	до 11:00 Расчетного дня, следующего за днем, за который формируется отчет
14.	Исполнение Маржинальных требований.	до 17:30 дня возникновения Маржинального требования
15.	Заключение сделок с иностранной валютой / драгоценными металлами в случае неисполнения Участником клиринга Маржинального требования.	с 17:30 дня возникновения Маржинального требования
16.	Погашение Задолженности, возникшей в связи с неисполнением обязательства по уплате вариационной маржи.	до 20:00 дня возникновения Задолженности

№ п/п	Наименование операции	Время (московское)
17.	Погашение Задолженности, возникшей в связи с неисполнением Итогового нетто-обязательства по денежным средствам и обязательств по уплате комиссионных вознаграждений.	до 20:00 Расчетного дня, следующего за днем возникновения Задолженности
18.	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
19.	Перечисление Участниками клиринга денежных средств / драгоценных металлов в целях исполнения Итоговых нетто-обязательств перед Клиринговым центром:	
	- в тенге;	до 11:00 Даты исполнения
	- в юанях, белорусских рублях, гонконгских долларах, сомони, швейцарских франках;	до 12:00 ¹ Даты исполнения
	- в гривнах;	до 15:15 Даты исполнения
	- в евро, фунтах стерлингов;	до 17:00 ¹ Даты исполнения
	- в долларах США, российских рублях и драгоценных металлах.	до 20:00 ¹ Даты исполнения
20.	Перечисление Участниками клиринга денежных средств / драгоценных металлов в целях исполнения Итоговых нетто-обязательств Участниками клиринга, которыми превышено количество Расчетных дней, в течение которых у Участника клиринга может возникать Итоговое нетто-обязательство, не обеспеченное средствами под исполнение.	до 10:00
21.	Перечисление Участниками клиринга денежных средств в целях исполнения обязательств по уплате комиссионных вознаграждений.	до 20:00 ¹ дня взимания соответствующего комиссионного вознаграждения
22.	Исполнение / прекращение Итоговых нетто-обязательств, обеспеченных средствами под исполнение, и соответствующих им Итоговых нетто-требований Участников клиринга.	20:00
23.	Заключение сделок своп в случае наличия Задолженности и/или обязательств по Сделкам, не обеспеченных средствами под исполнение.	с 20:00 ¹ до 20:30 ¹ Расчетного дня

№ п/п	Наименование операции	Время (московское)
24.	Передача Клиринговым центром Участникам клиринга Клиринговых отчетов и Биржевых свидетельств и Клиринговых отчетов по итогам заключения сделок своп в случае наличия Задолженности и/или обязательств по Сделкам, не обеспеченных средствами под исполнение.	до 20:45 ¹ Расчетного дня
25.	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
	- швейцарских франков;	до 14:00 Расчетного дня
	- евро, фунтов стерлингов;	до 17:00 Расчетного дня
	- долларов США, российских рублей, драгоценных металлов.	до 20:00 Расчетного дня
26.	Возврат Клиринговым центром Участникам клиринга денежных средств, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга, на основании Запроса о возврате ² .	в являющийся Расчетным днем день получения Запроса о возврате

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

² - 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.