

ФЕДЕРАЛЬНАЯ СЛУЖБА ПО
ФИНАНСОВЫМ РЫНКАМ
ЗАРЕГИСТРИРОВАНО

Дата: "18" декабря 2012 г.

в реестре за № 12-3151/пз-ч

Заместитель
руководителя:



УТВЕРЖДЕНЫ

решением Наблюдательного совета
ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр»

от «26» октября 2012 года (Протокол № 8)

Председатель Наблюдательного совета
ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр»



Лыков С.П.

ПРАВИЛА КЛИРИНГА
ЗАО АКБ «НАЦИОНАЛЬНЫЙ КЛИРИНГОВЫЙ ЦЕНТР»
НА СРОЧНОМ И ФОНДОВОМ РЫНКАХ

Москва, 2012г.

ФСФР России УПРАВЛЕНИЕ ДЕЛАМИ И АРХИВА ПРИЛОЖЕНИЕ	
« вх. №	12-02043
от	20.10.2012

СОДЕРЖАНИЕ

РАЗДЕЛ I. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ	5
Статья 1. Термины и определения	5
Статья 2. Классификация порядка осуществления клиринговой деятельности.....	9
Статья 3. Перечень Организаторов торговли, Расчетных депозитариев, Расчетных организаций	10
Статья 4. Общие правила осуществления клиринговой деятельности	11
Статья 5. Договор об оказании клиринговых услуг	12
Статья 6. Документы, предоставляемые Клиринговому центру при заключении договоров	14
Статья 7. Условия клирингового обслуживания. Порядок предоставления и прекращения (приостановления) допуска к клиринговому обслуживанию	15
Статья 8. Регистрация Участников клиринга и клиентов Участников клиринга	17
Статья 9. Порядок присвоения Участникам клиринга кодов Расчетной фирмы	18
Статья 10. Требования к порядку взаимодействия Участников клиринга, клиентов Участников клиринга, иных лиц с Организаторами торговли, Расчетными депозитариями и Расчетными организациями	20
Статья 11. Обеспечение исполнения обязательств и порядок возмещения убытков	20
Статья 12. Конфиденциальность	21
Статья 13. Требования к Участникам клиринга по предоставлению отчетности Клиринговому центру.....	21
Статья 14. Требования к финансовому состоянию Участников клиринга	23
Статья 15. Порядок урегулирования неисполненных обязательств в случае прекращения клирингового обслуживания	23
Статья 16. Порядок разрешения споров	33
РАЗДЕЛ II. ВОЗМОЖНОСТЬ ЗАКЛЮЧЕНИЯ СРОЧНОГО КОНТРАКТА / СДЕЛОК T+N	34
Статья 17. Спецификация Срочного контракта	34
Статья 18. Возможность заключения Срочного контракта	34
Статья 19. Возможность заключения Сделок T+N с ценной бумагой	35
РАЗДЕЛ III. ПОРЯДОК ОСУЩЕСТВЛЕНИЯ КЛИРИНГА	36
Статья 20. Перечень и назначение клиринговых регистров.....	36
Статья 21. Условия открытия клиринговых регистров.....	37
Статья 22. Порядок использования клиринговых регистров	38
Статья 23. Порядок регистрации торговых счетов.....	39
Статья 24. Закрепление торговых счетов за разделами клиринговых регистров.....	40
Статья 25. Коды торговых счетов. Порядок регистрации клиентов Участников клиринга	41
Статья 26. Порядок регистрации клиентов Участников клиринга с целью заключения за счет этих клиентов Срочных контрактов, Сделок T+N	42
Статья 27. Поручения на клиринг	43
Статья 28. Отчеты Клирингового центра	44
Статья 29. Порядок получения Клиринговым центром информации о количестве ценных бумаг и сумме денежных средств на торговых счетах.....	46
Статья 30. Взаимодействие Участников клиринга, которым присвоен код (коды) Расчетной фирмы, и Клирингового центра с Расчетной организацией	46
Статья 31. Взаимодействие Участников клиринга, которым присвоен код (коды) Расчетной фирмы, и Клирингового центра с Расчетным депозитарием	49

Статья 32. Порядок передачи информации Организатору торговли.....	51
Статья 33. Порядок взаимодействия с Организатором торговли в процессе объявления / удаления заявок и заключения сделок	53
Статья 34. Порядок получения информации от Организатора торговли.....	54
Статья 35. Порядок проведения по итогам клиринга расчетов в Расчетных депозитариях и Расчетных организациях.....	55
Статья 36. Порядок проведения клиринговых сессий	57
Статья 37. Порядок определения подлежащих исполнению обязательств Участников клиринга по Срочным контрактам	60
Статья 38. Вариационная маржа и премия	61
Статья 39. Порядок исполнения обязательств по уплате вариационной маржи, премии, Гарантийного перевода, штрафов, пени, неустоек и комиссионных вознаграждений.....	62
Статья 40. Гарантийный перевод	63
Статья 41. Гарантийное обеспечение.....	67
Статья 42. Порядок возникновения и исполнения Маржинальных требований.....	68
Статья 43. Общий порядок формирования клирингового пула	72
Статья 44. Порядок включения в клиринговый пул обязательств по Сделкам с полным обеспечением, Сделкам репо с полным обеспечением и Сделкам с отложенным исполнением	72
Статья 45. Порядок включения в клиринговый пул обязательств по Сделкам без предварительного обеспечения	72
Статья 46. Порядок включения в клиринговый пул обязательств по сделкам продажи акций открытых акционерных обществ, находящихся в государственной или муниципальной собственности	73
Статья 47. Порядок включения в клиринговый пул Обязательств по поставке.....	74
Статья 48. Порядок формирования клирингового пула для исполнения обязательств по Сделкам T+N	77
Статья 49. Процедуры ликвидации позиций по Сделкам T+N	80
Статья 50. Порядок действий Клирингового центра в случае недостаточности ценных бумаг и (или) денежных средств для исполнения обязательств Клирингового центра.....	84
Статья 51. Порядок определения подлежащих исполнению обязательств Участников клиринга по сделкам с ценными бумагами	85
Статья 52. Порядок проверки наличия достаточного количества ценных бумаг и суммы денежных средств для исполнения обязательств, включенных в клиринговый пул.....	85
Статья 53. Порядок действий Клирингового центра в случае недостаточности ценных бумаг и (или) денежных средств для исполнения обязательств, включенных в клиринговый пул	85
Статья 54. Порядок формирования поручений на проведение операций по торговым счетам по итогам клиринга	86
РАЗДЕЛ IV. ПОРЯДОК ИСПОЛНЕНИЯ СРОЧНЫХ КОНТРАКТОВ.....	87
Статья 55. Порядок исполнения опционных контрактов, базовым активом которых является фьючерсный контракт.....	87
Статья 56. Порядок исполнения расчетных фьючерсных контрактов	88
Статья 57. Порядок исполнения поставочных Срочных контрактов	88
Статья 58. Особенности исполнения поставочных Срочных контрактов режима T+4..	88
Статья 59. Особенности исполнения поставочных Срочных контрактов фондового рынка	90

РАЗДЕЛ V. ЗАКЛЮЧЕНИЕ СДЕЛОК РЕПО, СДЕЛОК КУПЛИ-ПРОДАЖИ ЦЕННЫХ БУМАГ И ДОГОВОРОВ ЗАЙМА КЛИРИНГОВОГО ЦЕНТРА.....	92
Статья 60. Заключение сделки репо при наличии Необеспеченной позиции Участника клиринга или Клирингового центра по Сделкам T+N	92
Статья 61. Заключение сделок купли-продажи ценных бумаг при наличии Необеспеченной позиции Участника клиринга или Клирингового центра по Сделкам T+N	93
Статья 62. Участник клиринга, с которым Клиринговым центром заключена сделка репо или сделки купли-продажи ценных бумаг при наличии Необеспеченной позиции Клирингового центра по сделкам T+N	95
Статья 63. Ценные бумаги, в отношении которых Клиринговым центром заключена сделка репо или сделки купли-продажи ценных бумаг	95
Статья 64. Условия Договора займа Клирингового центра, порядок их заключения и исполнения	96
Статья 65. Порядок регистрации Счета для зачисления денежных средств.....	98
РАЗДЕЛ VI. ПОРЯДОК ПЕРЕЧИСЛЕНИЯ ДОХОДОВ ПО СДЕЛКАМ, ЗАКЛЮЧЕННЫМ С КЛИРИНГОВЫМ ЦЕНТРОМ	99
Статья 66. Определения	99
Статья 67. Обязательства сторон.....	99
Статья 68. Гарантии передачи Дохода.....	101
РАЗДЕЛ VII. ПОРЯДОК СВЕРКИ ДОКУМЕНТОВ, ВОЗНАГРАЖДЕНИЕ, РЕЕСТРЫ КЛИРИНГОВОГО ЦЕНТРА.....	103
Статья 69. Порядок сверки документов, полученных Клиринговым центром от Участников клиринга	103
Статья 70. Порядок и сроки оплаты клиринговых услуг, услуг по организации торговли, депозитарному и расчетному обслуживанию, а также порядок списания денежных средств с целью возмещения средств Гарантийных фондов	105
Статья 71. Порядок формирования реестров Клирингового центра	106

РАЗДЕЛ I. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ

Настоящие Правила клиринга ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр» на срочном и фондовом рынках регулируют отношения, связанные с заключением и исполнением договоров, являющихся производными финансовыми инструментами, заключаемых на торгах Открытого акционерного общества «Московская Биржа ММВБ-РТС», Открытого акционерного общества «Санкт-Петербургская биржа», Открытого акционерного общества «Московская энергетическая биржа», в Секции стандартных контрактов на зерновые, зернобобовые и технические культуры Закрытого акционерного общества «Национальная товарная биржа», а также сделок купли-продажи ценных бумаг и сделок репо, заключаемых в Секторе рынка Standard Закрытого акционерного общества «Фондовая биржа ММВБ», и сделок купли-продажи ценных бумаг и сделок репо, заключаемых на торгах Открытого акционерного общества «Санкт-Петербургская биржа».

Статья 1. Термины и определения

«Базовый размер гарантийного обеспечения» - рассчитываемый Клиринговым центром для каждого Срочного контракта / ценной бумаги размер средств в рублях Российской Федерации, необходимых для расчета гарантийного обеспечения по совокупности обязательств по Срочным контрактам, Сделкам T+N;

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

«Верхний/Нижний лимит колебаний цен сделок» - значение, выше (больше) / ниже (меньше) которого не может быть цена заключения фьючерсного контракта / цена Сделки T+N, за исключением случаев, прямо предусмотренных в Правилах клиринга, Правилах торговли Организатора торговли;

«Гарантийное обеспечение» – рассчитываемая в соответствии с Правилами клиринга сумма, выраженная в рублях Российской Федерации, необходимая для оценки достаточности Средств гарантийного обеспечения для обеспечения исполнения обязательств по совокупности обязательств по Срочным контрактам, Сделкам T+N;

«Гарантийный перевод» – переменная часть обеспечения Участника клиринга или Клирингового центра, рассчитываемая в порядке, предусмотренном Правилами клиринга и являющаяся обеспечением исполнения обязательств по Сделкам T+N, заключенным между данным Участником клиринга и Клиринговым центром;

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

«Договор займа Клирингового центра» - договор займа ценных бумаг, заключаемый Клиринговым центром с Участником клиринга в порядке, определенном

Правилами клиринга, с целью исполнения обязательств Клирингового центра по сделкам клирингового пула;

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

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

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

«Клиринговый счет» – счет в российских рублях и/или в иностранной валюте, открытый Расчетной организацией для Клирингового центра, предназначенный для учета операций с денежными средствами Участников клиринга и клиентов Участников клиринга при осуществлении Клиринговым центром клиринга по заключенным сделкам, а также предназначенный для списания и зачисления денежных средств при проведении расчетов в Секторе «Фондовый рынок Standard» в соответствии с Правилами клиринга (в случаях, определенных договором между Клиринговым центром и Расчетной организацией).

«Клиринговый центр» - Акционерный Коммерческий Банк «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое акционерное общество);

«клиринговая сессия» - период времени, в течение которого Клиринговый центр проводит определение взаимных обязательств (сбор, сверку, корректировку информации по сделкам и подготовку бухгалтерских документов по ним) и их зачет и расчеты по ним;

«Коэффициент ликвидности» - используемое при расчете Торгового лимита минимально допустимое значение отношения суммы денежных средств в рублях Российской Федерации, составляющих Средства гарантийного обеспечения по Расчетной фирме, к общей сумме (стоимости) всех Средств гарантийного обеспечения данной Расчетной фирмы, выраженной в рублях Российской Федерации;

«Лимит колебаний цен сделок» - значение, используемое для ограничения цен заключаемых сделок и расчета Базового размера гарантийного обеспечения по фьючерсному контракту / ценной бумаге;

«Маржинальное требование» - требование Клирингового центра к Участнику клиринга об обеспечении обязательств по Срочным контрактам и Сделкам T+N, заключенным Клиринговым центром с Участником клиринга, предъявляемое в порядке и случае, определенных Правилами клиринга

- «Нерезидент»** - лицо, являющееся нерезидентом в соответствии с законодательством Российской Федерации о валютном регулировании и валютном контроле;
- «Организатор торговли»** – организатор торговли на рынке ценных бумаг, фондовая и (или) товарная биржа, указанная в статье 3 Правил клиринга, с которыми (которой) Клиринговым центром заключен договор о порядке взаимодействия при осуществлении клиринга;
- «Сайт Клирингового центра»** – сайт в сети Интернет, расположенный по адресу www.nkcbank.ru. В случае изменения адреса сайта в сети Интернет Клиринговый центр заблаговременно размещает ссылку на новый адрес сайта в сети Интернет на сайте, расположенном по адресу www.nkcbank.ru.
- «Положение о клиринге»** - нормативный правовой акт Федерального органа, регулирующий осуществление клиринговой деятельности;
- «Положение о гарантийных фондах»** - Порядок создания, размещения и использования гарантийных фондов ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр»;
- «Порядок предоставления информации и отчетности»** – внутренний документ Клирингового центра, устанавливающий состав, сроки и форматы предоставления информации и отчетности Участниками клиринга Клиринговому центру.
- «Правила клиринга»** - настоящая часть Правил клиринга ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр»;
- «Правила торговли»** - Правила проведения торгов по ценным бумагам в Закрытом акционерном обществе «Фондовая биржа ММВБ», или Правила совершения срочных сделок на Срочном рынке FORTS ОАО Московская Биржа, или Правила биржевой торговли в Секции срочного рынка Открытого акционерного общества «Московская энергетическая биржа», или Правила совершения срочных сделок Открытого акционерного общества «Санкт – Петербургская биржа», или Правила проведения торгов ценными бумагами Открытого акционерного общества «Санкт-Петербургская биржа», или Правила проведения торгов в Секции стандартных контрактов на зерновые, зернобобовые и технические культуры ЗАО «Национальная товарная биржа»;
- «Расчетная организация»** – кредитная организация, указанная в статье 3 Правил клиринга, с которой Клиринговым центром заключен договор о порядке взаимодействия при осуществлении клиринга;
- «Расчетный день»** – день, в том числе выходной или праздничный нерабочий день по законодательству Российской Федерации, в который Организатор торговли проводит торги, и в который Расчетный депозитарий и Расчетная организация осуществляют расчеты по итогам клиринга.
- «Расчетный депозитарий»** – депозитарий, указанный в статье 3 Правил клиринга, с которым Клиринговым центром заключен договор о порядке взаимодействия при осуществлении клиринга;
- «Резидент»** - лицо, являющееся резидентом в соответствии с законодательством Российской Федерации о валютном регулировании и валютном контроле;
- «Реестр сделок с полным обеспечением»** - информация о Сделках с полным обеспечением и поручениях на клиринг, поданных во исполнение Сделок репо с полным обеспечением и Сделок с отложенным исполнением,

передаваемая Организатором торговли Клиринговому центру и содержащая сведения, предусмотренные приложением № С9 к Правилам клиринга;

«Реестр срочных сделок» - информация о Срочных контрактах, передаваемая Организатором торговли Клиринговому центру и содержащая сведения, предусмотренные приложением № Ф1 к Правилам клиринга;

«Реестр сделок T+N» - информация о Сделках T+N, заключенных на торгах Организатора торговли и передаваемая Организатором торговли Клиринговому центру и содержащая сведения, предусмотренные приложением № Ф1 к Правилам клиринга;

«Сделка без предварительного обеспечения» - сделка купли-продажи ценных бумаг, заключенная на внебиржевом рынке на условиях расчетов «поставка против платежа» в рублях Российской Федерации;

«Сделка репо с полным обеспечением» - сделка репо, заключенная на торгах Открытого акционерного общества «Санкт-Петербургская биржа»;

«Сделка с отложенным исполнением» - сделка с отложенным исполнением, заключенная на торгах Открытого акционерного общества «Санкт-Петербургская биржа»;

«Сделка с полным обеспечением» - сделка купли-продажи ценных бумаг, заключенная на торгах Открытого акционерного общества «Санкт-Петербургская биржа», за исключением Сделок с отложенным исполнением и Сделок репо с полным обеспечением;

«Сделка T+N» - сделка купли-продажи ценных бумаг или Сделка репо, заключенная с Клиринговым центром в Секторе рынка Standard Закрытого акционерного общества «Фондовая биржа ММВБ», а также сделка репо или сделка купли-продажи, заключенная в соответствии с Правилами клиринга при включении обязательств по указанным сделкам в клиринговый пул, или при осуществлении процедуры ликвидации позиций, или при осуществлении процедуры принудительного закрытия позиций;

«Система ЭДО» – система электронного документооборота, представляющая собой совокупность программного, информационного и аппаратного обеспечения, предназначенная для передачи зашифрованных и подписанных ЭП электронных документов. Использование конкретной Системы ЭДО определяется договорами, заключаемыми Клиринговым центром с лицами, указанными в Правилах клиринга, в частности, Организаторами торговли, Расчетными организациями, Расчетными депозитариями, Участниками клиринга;

«Средства гарантийного обеспечения» - денежные средства, включая иностранную валюту, и (или) ценные бумаги, предназначенные для обеспечения исполнения обязательств Участника клиринга по заключенным Срочным контрактам, Сделкам T+N;

«Срочный контракт» - договор, являющийся производным финансовым инструментом, заключенный в соответствии с Правилами торговли Организатора торговли или в соответствии с Правилами клиринга;

«Страховой фонд» – фонд, состоящий из взносов Участников клиринга, формируемый в соответствии с Положением о страховом фонде, являющимся приложением № Ф8 к Правилам клиринга;

«Счет ФОРТС» - счет депо (либо раздел счета депо) в Расчетном депозитарии, предназначенный для учета ценных бумаг, внесенных в качестве Средств гарантийного обеспечения;

«Торговый лимит» - сумма, выраженная в рублях Российской Федерации, определяемая Клиринговым центром в соответствии с Правилами клиринга на основании стоимости Средств гарантийного обеспечения, в пределах которой Участник клиринга вправе заключать Срочные контракты, Сделки T+N;

«Торговый счет депо» - раздел счета депо Участника клиринга, клиента Участника клиринга, иного лица или Клирингового центра, открытый в Расчетном депозитарии и предназначенный для осуществления списания и зачисления ценных бумаг при проведении расчетов по ценным бумагам по итогам клиринга в соответствии с Правилами клиринга;

«Денежный торговый счет» - счет, открытый Расчетной организацией для учета в соответствии с Положениями Банка России денежных средств Участника клиринга, клиента Участника клиринга, иного лица или Клирингового центра в российских рублях, предназначенный для осуществления списания и зачисления на него денежных средств в российских рублях при проведении расчетов по денежным средствам в Секторе «Фондовый рынок Standard» по итогам клиринга в соответствии с Правилами клиринга;

Торговый счет депо и денежный торговый счет далее вместе именуются торговыми счетами.

«уполномоченный банк» - уполномоченный банк в соответствии с законодательством Российской Федерации о валютном регулировании и валютном контроле;

«Участник клиринга» - юридическое лицо, заключившее с Клиринговым центром договор об оказании клиринговых услуг;

«Федеральный орган» - федеральный орган исполнительной власти по рынку ценных бумаг или федеральный орган исполнительной власти в области финансовых рынков;

«ЭП» – электронная подпись.

Иные термины используются Правилами клиринга в значениях, определенных Правилами торговли Организаторов торговли, Спецификациями Срочных контрактов, Положением о гарантийных фондах, иными внутренними документами Клирингового центра, законами, нормативными правовыми актами Федерального органа.

Статья 2. Классификация порядка осуществления клиринговой деятельности

2.1. Настоящей статьей определен порядок осуществления клиринговой деятельности Клиринговым центром в соответствии с классификацией, установленной Положением о клиринге.

2.2. Клиринговый центр осуществляет многосторонний клиринг.

2.3. Клиринговый центр осуществляет централизованный клиринг по:

- а) Сделкам с полным обеспечением, за исключением сделок в отношении ценных бумаг, предназначенных для квалифицированных инвесторов;
- б) Сделкам T+N;

- в) Срочным контрактам.
- 2.4. Клиринговый центр осуществляет:
- а) клиринг без предварительного обеспечения по Сделкам без предварительного обеспечения, Сделкам репо с полным обеспечением и Сделкам с отложенным исполнением;
 - б) клиринг с полным обеспечением по Сделкам с полным обеспечением;
 - в) клиринг с частичным обеспечением по Срочным контрактам, Сделкам T+N.
- 2.5. Клиринговый центр осуществляет клиринг по:
- а) спот-сделкам;
 - б) сделкам репо;
 - в) Срочным контрактам;
 - г) иным сделкам с ценными бумагами.
- 2.6. Клиринговый центр контролирует наличие на торговых счетах ценных бумаг и денежных средств, необходимых для расчетов, по всем сделкам клирингового пула.
- 2.7. Клиринговый центр осуществляет клиринг на условиях «поставка против платежа» при осуществлении клиринга с полным обеспечением, с частичным обеспечением и клиринга без предварительного обеспечения.

Статья 3. Перечень Организаторов торговли, Расчетных депозитариев, Расчетных организаций

- 3.1. Организаторы торговли:
- Открытое акционерное общество «Московская Биржа ММВБ-РТС» (далее – Московская Биржа);
 - Закрытое акционерное общество «Фондовая биржа ММВБ» (далее – ФБ ММВБ);
 - Открытое акционерное общество «Санкт-Петербургская биржа» (далее – ОАО «СПБ»);
 - Открытое акционерное общество «Московская энергетическая биржа» (далее – ОАО «Мосэнергобиржа»);
 - Закрытое акционерное общество «Национальная товарная биржа» (далее – ЗАО НТБ).
- 3.2. Расчетные депозитарии:
- Небанковская кредитная организация закрытое акционерное общество «Национальный расчетный депозитарий» (далее - НКО ЗАО НРД);
 - Закрытое акционерное общество «Расчетно-Депозитарная Компания».
- 3.3. Расчетные организации:
- НКО ЗАО НРД.

Статья 4. Общие правила осуществления клиринговой деятельности

- 4.1. Порядок и сроки обмена документами в ходе осуществления клиринга устанавливаются Правилами клиринга, а также договорами, заключаемыми Клиринговым центром с Участниками клиринга, Организаторами торговли, Расчетными депозитариями и Расчетной организацией.
- 4.1.1. Особенности взаимодействия Клирингового центра с конкретными Расчетными депозитариями и Расчетной организацией определяются приложением № С10 и приложением № Ф1 к Правилам клиринга и соответствующими договорами, заключенными Расчетными депозитариями и Расчетной организацией с Клиринговым центром.
- 4.2. Клиринг по Сделкам с полным обеспечением, Срочным контрактам и Сделкам Т+N, которые включены в реестры сделок, полученные Клиринговым центром от Организаторов торговли, осуществляется на основании таких реестров сделок без получения от Участников клиринга подтверждений совершенных в ходе торгов сделок.
- 4.2.1. Клиринг по Сделкам репо с полным обеспечением, а также по Сделкам с отложенным исполнением осуществляется на основании поручений на клиринг в порядке, установленном Правилами клиринга.
- 4.3. Обмен информацией в процессе осуществления клиринга производится в электронном виде при помощи Системы ЭДО или средств, используемых соответствующей организацией, если это предусмотрено заключенным между такой организацией и Клиринговым центром договором. Передача информации и документов между Клиринговым центром, Организатором торговли и Участниками клиринга может также осуществляться с использованием торговой системы Организатора торговли, при этом указанные документы подписываются аналогом собственноручной подписи
- 4.3.1. Время начала и окончания дневных и вечерних клиринговых сессий определяется Регламентом (приложение № Ф1 к Правилам клиринга, далее - Регламент).
- 4.4. Все приложения к Правилам клиринга являются их неотъемлемой частью.
- 4.5. Учет на клиринговых регистрах информации о количестве ценных бумаг или об обязательствах по перерегистрации ценных бумаг ведется Клиринговым центром с использованием двух кодов ценных бумаг:
 - кодов ценных бумаг, присвоенных Расчетным депозитарием;
 - кодов ценных бумаг, присвоенных Организатором торговли.
- 4.6. Клиринговый центр устанавливает однозначное соответствие кодов ценных бумаг, присвоенных Расчетным депозитарием, и кодов ценных бумаг, присвоенных Организатором торговли.
- 4.6.1. Клиринговый центр осуществляет клиринг только по ценным бумагам, имеющим код, присвоенный Расчетным депозитарием, и код, присвоенный Организатором торговли, и по которым Клиринговым центром установлено однозначное соответствие указанных кодов.

- 4.6.2. При взаимодействии с Расчетным депозитарием в соответствии с Правилами клиринга Клиринговый центр использует код ценной бумаги, присвоенный Расчетным депозитарием.
- 4.6.3. При взаимодействии с Организатором торговли в соответствии с Правилами клиринга Клиринговый центр использует код ценной бумаги, присвоенный Организатором торговли.
- 4.7. Для исполнения обязательств по Срочным контрактам и обеспечения исполнения обязательств по Сделкам T+N используются отдельные банковские счета Клирингового центра: в рублях Российской Федерации и в иностранной валюте, открытые в Расчетной организации (далее – Счета Клирингового центра).
- 4.7.1. Реквизиты Счетов Клирингового центра публикуются на Сайте Клирингового центра.
- 4.8. Клиринговый центр осуществляет определение обязательств по Срочным контрактам и их учет в соответствии со Спецификациями Срочных контрактов и Правилами клиринга.
- 4.8.1. Определение обязательств по Срочным контрактам осуществляется Клиринговым центром в следующем порядке:
- в соответствии с порядком, изложенном в Спецификации Срочного контракта, - при наличии в такой Спецификации прямого указания на порядок определения обязательств;
 - в соответствии с Правилами клиринга - при отсутствии в Спецификации Срочного контракта прямого указания на порядок определения обязательств или при наличии в такой Спецификации ссылки на порядок, изложенный в Правилах клиринга.
- 4.9. Предоставление информации и документов Клиринговому центру осуществляется по форме, установленной Клиринговым центром, за подписью уполномоченных лиц.
- Формы документов, предоставляемых Участниками клиринга в Клиринговый центр, публикуются на Сайте Клирингового центра.
- В случае предоставления Участником клиринга информации и документов без использования Системы ЭДО или торговой системы Организатора торговли соответствующие документы должны быть подписаны уполномоченным лицом Участника клиринга при условии подтверждения полномочий соответствующего лица и наличия у Клирингового центра заверенного в установленном порядке образца его подписи (либо при условии, что такой образец может быть получен Клиринговым центром в установленном порядке).
- В случае нарушения указанных требований Клиринговый центр не принимает полученную информацию и/или документы.

Статья 5. Договор об оказании клиринговых услуг

- 5.1. Образец Договора об оказании клиринговых услуг, заключаемого Клиринговым центром с Участниками клиринга, приведен в приложении №С11 к Правилам клиринга.

- 5.2. Заключение Договора об оказании клиринговых услуг осуществляется путем присоединения к указанному договору, условия которого определены Правилами клиринга.
- 5.3. Размер оплаты клиринговых и иных связанных с клирингом услуг Клирингового центра предусмотрен приложениями №№С1, Ф6 к Правилам клиринга.
- 5.4. Порядок оплаты клиринговых и иных связанных с клирингом услуг Клирингового центра определен в статье 70 Правил клиринга.
- 5.5. Клиринговые и иные связанные с клирингом услуги Клирингового центра считаются оказанными надлежащим образом, если в течение 5 (пяти) рабочих дней после окончания месяца, в течение которого оказывались услуги, Участник клиринга письменно не заявит об обратном.
- 5.6. В случае нарушения Клиринговым центром своих обязательств, установленных Правилами клиринга, Клиринговый центр обязан возместить Участнику клиринга понесенные им убытки.
- 5.7. Участник клиринга вправе отказаться от исполнения Договора об оказании клиринговых услуг только при отсутствии у него имущественных обязательств по указанному договору, а также неисполненных им обязательств, допущенных к клирингу, письменно уведомив об этом Клиринговый центр не позднее, чем за 7 (семь) дней до даты расторжения Договора об оказании клиринговых услуг.
- 5.8. Клиринговый центр вправе отказаться от исполнения Договора об оказании клиринговых услуг с Участником клиринга в случае нарушения им требований, предъявляемых Правилами клиринга к Участнику клиринга.
- 5.9. Действие Договора об оказании клиринговых услуг прекращается в случае прекращения допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию, ликвидации Участника клиринга, а также в случае реорганизации Участника клиринга при условии, что деятельность Участника клиринга в результате реорганизации прекращается. В случае если Клиринговым центром утверждены различные правила клиринга, регламентирующие различные направления клиринговой деятельности, Договор об оказании услуг прекращается после прекращения оказания услуг в соответствии со всеми такими правилами клиринга.
- 5.10. Прекращение действия Договора об оказании клиринговых услуг не освобождает Участника клиринга и Клиринговый центр от исполнения обязательств, возникших до прекращения действия Договора об оказании клиринговых услуг.
- 5.11. Договор об оказании клиринговых услуг и связанные с ним отношения Сторон регулируются законодательством Российской Федерации.
- 5.12. Все права и обязанности, вытекающие из Договора об оказании клиринговых услуг и Правил клиринга, регулируются и толкуются в соответствии с законодательством Российской Федерации.
- 5.13. Клиринговый центр вправе в одностороннем порядке вносить изменения в Правила клиринга.

Клиринговый центр размещает на Сайте Клирингового центра изменения в Правила клиринга (новую редакцию Правил клиринга) не позднее, чем за 5 (пять) дней до даты вступления в силу указанных изменений (новой редакции), в случае если иные сроки раскрытия информации об изменении отдельных положений Правил клиринга не установлены Законом о клиринге.

Статья 6. Документы, предоставляемые Клиринговому центру при заключении договоров

- 6.1. Участниками клиринга могут быть юридические лица, заключившие с Клиринговым центром Договор об оказании клиринговых услуг.
- 6.1.1. В случае если между юридическим лицом и Клиринговым центром заключен Договор об оказании клиринговых услуг по форме, установленной приложением № С11 к Правилам клиринга, для осуществления клирингового обслуживания на других рынках, то заключение нового Договора об оказании клиринговых услуг в соответствии с настоящими Правилами клиринга не требуется.
- 6.2. Для заключения Договора об оказании клиринговых услуг юридическое лицо предоставляет Клиринговому центру:
- Договор об оказании клиринговых услуг по форме, предусмотренной приложением № С11 к Правилам клиринга, в 2 (двух) экземплярах, подписанный уполномоченным лицом юридического лица и скрепленный печатью юридического лица;
 - комплект документов в соответствии со статьей 1 приложения № С13 к Правилам клиринга (в случае подписания Договора об оказании клиринговых услуг между Клиринговым центром и юридическим лицом – резидентом);
 - комплект документов в соответствии со статьей 2 приложения № С13 к Правилам клиринга (в случае подписания Договора об оказании клиринговых услуг между Клиринговым центром и юридическим лицом – нерезидентом);
- 6.3. В случае если какой-либо из документов, указанных в пункте 6.1.1 Правил клиринга, ранее уже предоставлялся Клиринговому центру и имеется в наличии у Клирингового центра, то юридическое лицо по предварительному согласованию с Клиринговым центром может быть освобождено от обязанности повторного предоставления этого документа.
- 6.4. Для заключения с Клиринговым центром Договора об оказании клиринговых услуг юридическое лицо помимо документов, перечисленных в пункте 6.1.1 Правил клиринга, предоставляет Клиринговому центру следующие документы:
- а) Анкету Участника клиринга (Регистрационную карточку), форма которой предусмотрена приложением С12 к Правилам клиринга, на бумажном носителе и в электронном виде;
 - б) отчетность в соответствии со статьей 13 Правил клиринга: для кредитных организаций - за три последних отчетных месяца, для некредитных организаций - за два последних отчетных квартала.
- 6.5. Участник клиринга обязан ежегодно предоставлять Клиринговому центру Анкету Участника клиринга (клиента) (Регистрационную карточку) в форме электронного документа.

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

- 6.6. Форматы предоставления Участником клиринга Анкеты Участника клиринга (клиента) (Регистрационной карточки) определены Порядком предоставления информации и отчетности.
- 6.7. Участник клиринга обязан предоставить иные документы, которые могут быть запрошены Клиринговым центром в необходимых случаях в целях, не противоречащих действующему законодательству Российской Федерации.
- 6.8. Участник клиринга несет риск отрицательных последствий, вызванных непредоставлением или несвоевременным предоставлением Клиринговому центру информации (документов) в соответствии с требованиями Правил клиринга.
- 6.9. Клиринговый центр не несет ответственности за причиненные убытки в случае:
- наличия неполной либо недостоверной информации в документах, предоставленных в соответствии с требованиями настоящей статьи;
 - непредоставления документов в соответствии с требованиями пункта 6.5 настоящей статьи.

Статья 7. Условия клирингового обслуживания. Порядок предоставления и прекращения (приостановления) допуска к клиринговому обслуживанию

- 7.1. Для получения (сохранения) допуска к клиринговому обслуживанию Участнику клиринга необходимо:
- иметь действующий Договор об оказании клиринговых услуг, заключенный с Клиринговым центром;
 - иметь действующую лицензию на осуществление банковских операций, выданную Банком России (для кредитных организаций);
 - являться участником Подсистемы ЭДО НКЦ и Системы ЭДО РТС;
 - внести средства в Страховой фонд в соответствии с Положением о страховом фонде (для срочного рынка и Сектора рынка Standard ФБ ММВБ)
 - выполнить требования Клирингового центра по предоставлению отчетности, предусмотренные статьей 27 Правил клиринга.
- 7.2. О факте предоставления Участнику клиринга допуска к клиринговому обслуживанию Клиринговый центр извещает Организатора торговли не позднее дня, следующего за днем предоставления допуска, направляя соответствующее уведомление с использованием Подсистемы ЭДО НКЦ.
- 7.3. Приостановление / прекращение или возобновление приостановленного клирингового обслуживания Участника клиринга может осуществляться на

основании соответствующего уведомления Организатора торговли, в случае приостановления / прекращения или возобновления приостановленного допуска к торгам Участника клиринга, как Участника торгов, по решению Организатора торговли.

О факте приостановления / прекращения или возобновления допуска к клиринговому обслуживанию Клиринговый центр извещает Участника клиринга и Организатора торговли в день приостановления / прекращения или возобновления допуска к клиринговому обслуживанию, направляя соответствующие уведомления с использованием Подсистемы ЭДО НКЦ.

7.4. Клиринговый центр имеет право приостановить клиринговое обслуживание Участника клиринга в следующих случаях:

- при нарушении Участником клиринга установленных Правилами клиринга требований;
- при применении к Участнику клиринга санкций надзорных органов за нарушение законодательства Российской Федерации, в том числе: наложение административных взысканий, ограничений и введение запрета на проведение Участником клиринга отдельных операций;
- наличие в деятельности Участника клиринга оснований для осуществления мер по предупреждению банкротства в соответствии с законодательством Российской Федерации о несостоятельности (банкротстве), а также основания для отзыва уполномоченным органом исполнительной власти лицензии на осуществление соответствующего вида деятельности в соответствии с законодательством Российской Федерации;
- по результатам рассмотрения Клиринговым центром предоставленных Участником клиринга в соответствии со статьей 13 Правил клиринга информации и документов, а также в случае их непредставления в сроки, установленные статьей 13 Правил клиринга;
- при получении Клиринговым центром письменного сообщения от компетентного органа государства учреждения Участника клиринга-нерезидента в отношении Участника клиринга-нерезидента, из которого следует невозможность дальнейшего осуществления клирингового обслуживания Участника клиринга-нерезидента;
- при наличии фактов ухудшения финансового состояния Участника клиринга и/или информации, дающей основания считать возможными ухудшение финансового состояния Участника клиринга и/или неспособность Участника клиринга своевременно и в полном объеме исполнять свои обязательства Участника клиринга, возникающие из Правил клиринга;
- при наличии фактов неисполнения или ненадлежащего исполнения Участником клиринга обязательств перед Клиринговым центром, возникших из Договора об оказании клиринговых услуг при оказании Клиринговым центром услуг в соответствии с иными правилами клиринга, утвержденными Клиринговым центром и регламентирующими различные направления клиринговой деятельности;
- при получении Клиринговым центром от Участника клиринга письма о приостановлении клирингового обслуживания.

7.5. При приостановлении клирингового обслуживания Клиринговый центр с использованием Торговой системы Организатора торговли направляет

Организатору торговли уведомление о необходимости установления для Участника клиринга запрета на объявление заявок и заключение Срочных контрактов и Сделок T+N, приводящих к открытию позиций Участника клиринга по Срочным контрактам и Сделкам T+N, а также имеет право применить к Участнику клиринга процедуру принудительного закрытия позиций в соответствии с приложением Ф5 к Правилам клиринга.

7.6. Клиринговый центр имеет право прекратить допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию по любому из следующих оснований:

- в случае расторжения Договора об оказании клиринговых услуг при условии отсутствия неисполненных обязательств, возникших до прекращения его действия;
- в случае отзыва (аннулирования) Банком России лицензии на осуществление банковских операций у Участника клиринга – кредитной организации;
- в случае назначения временной администрации или принятия арбитражным судом решения о введении в отношении Участника клиринга, не являющегося кредитной организацией, одной из процедур банкротства.

7.7. Порядок прекращения клирингового обслуживания в случае отзыва (аннулирования) Банком России лицензии на осуществление банковских операций у Участника клиринга – кредитной организации, а также в случае назначения временной администрации или принятия арбитражным судом решения о введении в отношении Участника клиринга, не являющегося кредитной организацией, одной из процедур банкротства, определен в статье 15 Правил клиринга.

Статья 8. Регистрация Участников клиринга и клиентов Участников клиринга

8.1. Одновременно с предоставлением допуска к клиринговому обслуживанию Участнику клиринга Клиринговый центр регистрирует Участника клиринга:

- присваивает Участнику клиринга код (коды) в порядке, установленном нормативными правовыми актами Федерального органа;
- заносит информацию об Участнике клиринга в Реестр Участников клиринга.

8.2. Участник клиринга обязан зарегистрировать в Клиринговом центре своих клиентов, за счет которых будут осуществляться расчеты по сделкам, клиринг по которым проводит Клиринговый центр.

8.2.1. Порядок регистрации клиентов Участников клиринга определен в статьях 25, 26 Правил клиринга.

8.3. При регистрации клиентам Участников клиринга присваивается код (коды) в порядке, установленном нормативными правовыми актами Федерального органа.

8.4. В случае изменения сведений, используемых в составе кода (кодов), присвоенного Участнику клиринга и/или его клиенту, Участник клиринга обязан предоставить Клиринговому центру измененные сведения.

8.5. Клиринговый центр не несет ответственности за причиненные убытки в случае:

- наличия неполной либо недостоверной информации в документах, предоставленных Клиринговому центру для регистрации клиентов Участников клиринга;
 - непредоставления документов в соответствии с требованиями пункта 8.4 настоящей статьи.
- 8.6. Информация о зарегистрированных клиентах Участников клиринга заносится в Реестр клиентов Участников клиринга.
- 8.7. Для регистрации Участников клиринга или клиентов Участников клиринга Клиринговый центр вправе получать от Организатора торговли имеющуюся у него информацию, в том числе, указываемую в заявлениях, на основании которых осуществляется регистрация. При этом Клиринговый центр вправе осуществлять регистрацию клиента Участника клиринга без получения от Участника клиринга заявления на регистрацию, если данный Участник клиринга является Участником торгов Организатора торговли и данный клиент Участника клиринга является клиентом данного Участника торгов.
- 8.8. Для регистрации Организатором торговли Участника клиринга или клиента Участника клиринга в качестве участника торгов или клиента участника торгов Клиринговый центр вправе передавать имеющуюся у него информацию Организатору торговли.
- 8.9. В информации, которой обмениваются в процессе взаимодействия Клиринговый центр и Организатор торговли, может использоваться либо код участника торгов, либо код Участника клиринга, либо внутренний код, присваиваемый Клиринговым центром или Организатором торговли, который позволяет однозначно идентифицировать код Участника клиринга и код участника торгов.
- 8.10. Аннулирование регистрации клиента Участника клиринга осуществляется в порядке, установленном Правилами клиринга:
- по заявлению Участника клиринга;
 - в случае несоответствия регистрации клиента Участника клиринга требованиям российского законодательства, а также правилам и порядку регистрации клиентов Участника клиринга, установленных Клиринговым центром;
 - по иным основаниям, указанным в разделах Правил клиринга, описывающих порядок осуществления клиринга.

Статья 9. Порядок присвоения Участникам клиринга кодов Расчетной фирмы

- 9.1. Для возможности заключения Срочных контрактов и Сделок T+N и осуществления клиринга по ним Участнику клиринга должен быть присвоен Клиринговым центром код Расчетной фирмы.
- 9.2. Участнику клиринга, внесшему взнос в Страховой фонд в порядке и размере, установленном Положением о страховом фонде, являющимся приложением № Ф8 к Правилам клиринга, Клиринговым центром присваивается код Расчетной фирмы, и открываются клиринговые регистры в порядке, установленном приложением № Ф3 к Правилам клиринга.

- 9.2.1. Одному Участнику клиринга может быть присвоено несколько кодов Расчетной фирмы.
- 9.2.2. Информация о присвоенном Участнику клиринга коде (кодах) Расчетной фирмы доводится до сведения Участника клиринга.
- 9.3. Возврат Участнику клиринга его взносов в Страховой фонд, внесенных по Расчетной фирме при аннулировании кода (кодов) данной Расчетной фирмы осуществляется Клиринговым центром на основании заявления Участника клиринга на возврат взноса в Страховой фонд в порядке, установленном Положением о Страховом фонде (приложение № Ф8 к Правилам клиринга), и/или в соответствии с пунктом 9.7 настоящей статьи.
- 9.4. При аннулировании кода (кодов) Расчетной фирмы Клиринговый центр прекращает учет Средств гарантийного обеспечения, учитываемых на разделах клиринговых регистров с кодом данной Расчетной фирмы, и закрывает все разделы клиринговых регистров с кодом данной Расчетной фирмы и клиринговые регистры, открываемые при присвоении Участнику клиринга кода Расчетной фирмы.
- 9.5. Аннулирование кода (кодов) Расчетной фирмы не влечет прекращение обязательств Клирингового центра по возврату Средств гарантийного обеспечения и взноса в Страховой фонд. Указанные обязательства исполняются в порядке, установленном Правилами клиринга и Положением о Страховом фонде, являющимся приложением № Ф8 к Правилам клиринга.
- 9.6. Аннулирование кода (кодов) Расчетной фирмы не влечет прекращение обязательств Участника клиринга по погашению задолженности перед Клиринговым центром и возмещению средств Страхового фонда.
- 9.7. Если после принятия Клиринговым центром решения об аннулировании кода (кодов) Расчетной фирмы, на банковских счетах Клирингового центра учитываются денежные средства, составляющие Средства гарантийного обеспечения и/или взносы Участника клиринга в Страховой фонд по данной Расчетной фирме, Клиринговый центр в целях исполнения обязательства по их возврату вправе:
- перевести денежные средства, учитываемые на банковских счетах Клирингового центра, в размере денежных средств, учитываемых по разделам денежного регистра, имеющих коды Обычных и Выделенных Брокерских фирм, открытых в рамках данной Расчетной фирмы, и по разделу регистра учета средств Страхового фонда данной Расчетной фирмы, на банковские счета Участника клиринга, зарегистрированные в Клиринговом центре в соответствии с пунктом 30.5 Правил клиринга;
 - перевести денежные средства, учитываемые на банковских счетах Клирингового центра, в размере денежных средств, учитываемых по разделам денежного регистра, имеющих коды Обособленных Брокерских фирм, открытых в рамках данной Расчетной фирмы, на банковские счета Доверенных владельцев счетов, зарегистрированных в Клиринговом центре в соответствии с пунктом 30.5 Правил клиринга для разделов денежного регистра, имеющих коды данных Обособленных Брокерских фирм, зарегистрированные, или

указанные в договорах, заключенных Клиринговым центром с Доверенными владельцами счетов;

- в случае невозможности указанных переводов денежных средств, внести указанные денежные средства в депозит нотариуса.

Статья 10. Требования к порядку взаимодействия Участников клиринга, клиентов Участников клиринга, иных лиц с Организаторами торговли, Расчетными депозитариями и Расчетными организациями

- 10.1. Порядок взаимодействия Участника клиринга с Организатором торговли определяется Правилами торговли соответствующего Организатора торговли и договором, заключенным Участником клиринга, как Участником торгов, с данным Организатором торговли в случае, если Участник клиринга является участником торгов Организатора торговли.
- 10.2. Порядок взаимодействия Участника клиринга, клиента Участника клиринга, иного лица, являющихся владельцами счетов депо, с Расчетным депозитарием определяется условиями осуществления депозитарной деятельности Расчетного депозитария и договором, заключенным владельцем счета депо с Расчетным депозитарием.
- 10.3. Порядок взаимодействия Участника клиринга, клиента Участника клиринга, иного лица, являющихся владельцами банковских счетов, с Расчетной организацией определяется документами Расчетной организации и/или договором, заключенным владельцем банковского счета с Расчетной организацией.
- 10.4. Договоры, заключенные в соответствии с пунктами 10.1-10.3 настоящей статьи, должны быть заключены на условиях, не противоречащих Правилам клиринга.

Статья 11. Обеспечение исполнения обязательств и порядок возмещения убытков

- 11.1. Обеспечением исполнения обязательств по Сделкам с полным обеспечением является:
- определение лимитов Участников клиринга;
 - объявление Заявок, заключение сделок и исполнение обязательств по сделкам в пределах лимитов.
- 11.1.1. Определение и изменение лимитов Участников клиринга осуществляется Клиринговым центром в соответствии с приложением № С14 к Правилам клиринга.
- 11.1.2. При изменении в ходе торгов Организатора торговли лимитов, а также параметров, используемых при их расчете, Клиринговый центр немедленно уведомляет об этом Организатора торговли.
- 11.2. Для обеспечения исполнения сделок с ценными бумагами и Срочных контрактов, в отношении которых осуществляется клиринг, Клиринговым центром также создаются Гарантийные фонды. Порядок формирования и использования средств Гарантийных фондов определяется Положением о гарантийных фондах.

- 11.3. В рамках системы мер снижения рисков осуществления клиринговой деятельности Клиринговый центр создает Страховой фонд. Порядок формирования и использования Страхового фонда определяется Положением о Страховом фонде, являющимся приложением № Ф8 к Правилам клиринга.
- 11.4. Исполнение обязательств Участников клиринга по Срочным контрактам, Сделкам T+N также обеспечивается путем:
- депонирования ценных бумаг, составляющих Средства гарантийного обеспечения на Счетах ФОРТС в порядке, определенном Правилами клиринга;
 - внесения денежных средств, составляющих Средства гарантийного обеспечения, на Счета Клирингового центра в порядке, определенном Правилами клиринга;
 - установки Лимитов колебаний цен сделок;
 - установки минимальных Базовых размеров гарантийного обеспечения.
- 11.5. Возмещение убытков в случае неисполнения (ненадлежащего исполнения) обязательств по сделкам в части, не урегулированной условиями таких сделок, осуществляется в соответствии с законодательством Российской Федерации.

Статья 12. Конфиденциальность

- 12.1. Информация, полученная Клиринговым центром в связи с осуществлением клиринга, является конфиденциальной, за исключением общедоступной информации, информации, раскрытой в соответствии с законами и иными нормативными правовыми актами Российской Федерации.
- 12.2. Клиринговый центр вправе распространять / предоставлять третьим лицам указанную в пункте 12.1 настоящей статьи информацию:
- а) если это требуется для заключения и исполнения договоров страхования, связанных с осуществлением клиринговой деятельности, или получения страховых выплат;
 - б) в иных случаях, установленных законодательством Российской Федерации, нормативными правовыми актами Федерального органа, Правилами клиринга и договорами с Участником клиринга, Организатором торговли, Расчетной организацией, Расчетным депозитарием.

Статья 13. Требования к Участникам клиринга по предоставлению отчетности Клиринговому центру

- 13.1. Участники клиринга – кредитные организации обязаны предоставлять Клиринговому центру следующую отчетность:
- оборотную ведомость по счетам бухгалтерского учета кредитной организации (форма 0409101) – ежемесячно;
 - информацию об обязательных нормативах и о других показателях деятельности кредитной организации (форма 0409135) – ежемесячно;
 - расчет собственных средств (капитала) (форма 0409134) – ежемесячно;
 - отчет о прибылях и убытках кредитной организации (форма 0409102) – ежеквартально;

- справку о численном значении норматива максимального размера риска на одного заемщика или группу связанных заемщиков (Н6) (по данным формы 0409118) – ежемесячно;
 - квартальный отчет профессионального участника рынка ценных бумаг (форма №1100) – ежеквартально.
- 13.2. Участники клиринга – некредитные организации обязаны предоставлять Клиринговому центру следующую отчетность:
- бухгалтерский баланс (форма 0710001) – ежеквартально;
 - отчет о прибылях и убытках (форма 0710002) – ежеквартально;
 - расчет размера собственных средств (капитала) для профессиональных участников рынка ценных бумаг – ежемесячно¹;
 - квартальный отчет профессионального участника рынка ценных бумаг (форма №1100) – ежеквартально².
- 13.3. Участники клиринга обязаны предоставлять отчетность, указанную в пунктах 13.1-13.2 Правил клиринга, в следующие сроки:
- расчет размера собственных средств:
 - не позднее 15 рабочего дня месяца, следующего за отчетным месяцем (кредитными организациями);
 - не позднее одного календарного месяца, следующего за отчетным месяцем (некредитными организациями);
 - оборотную ведомость по счетам бухгалтерского учета кредитной организации (форма 0409101) - не позднее 15 рабочего дня месяца, следующего за отчетным месяцем;
 - отчет о прибылях и убытках кредитной организации (форма 0409102) - не позднее 15 рабочего дня месяца, следующего за отчетным кварталом;
 - бухгалтерский баланс некредитной организации (форма 0710001), отчет о прибылях и убытках некредитной организации (форма 0710002) - не позднее 45 (сорока пяти) календарных дней, следующих за отчетным кварталом, за исключением отчетности по состоянию на 1 января, которая предоставляется не позднее 15 апреля года, следующего за отчетным;
 - информацию об обязательных нормативах и о других показателях деятельности кредитной организации (форма 0409135), справку о численном значении норматива максимального размера риска на одного заемщика или группу связанных заемщиков (Н6) кредитной организации (по данным формы 0409118) - не позднее 15 рабочего дня месяца, следующего за отчетным месяцем;
 - квартальный отчет профессионального участника рынка ценных бумаг (форма №1100) - не позднее 45 (сорока пяти) календарных дней, следующих за

¹ Участники клиринга, имеющие только лицензию на заключение биржевым посредником в биржевой торговле договоров, являющихся производными финансовыми инструментами, базисным активом которых является биржевой товар, расчет размера собственных средств предоставляют ежеквартально.

² за исключением Участников клиринга, имеющих только лицензию на заключение биржевым посредником в биржевой торговле договоров, являющихся производными финансовыми инструментами, базисным активом которых является биржевой товар.

отчетным кварталом, за исключением отчетности по состоянию на 01 января, которая предоставляется не позднее 15 апреля года, следующего за отчетным.

- 13.4. Форматы предоставления отчетности, указанной в пунктах 13.1-13.2 Правил клиринга, определены Порядком предоставления информации и отчетности.
- 13.5. Клиринговый центр вправе потребовать от Участника клиринга другие документы, необходимые для оценки финансового состояния Участника клиринга.

Статья 14. Требования к финансовому состоянию Участников клиринга

- 14.1. Участники клиринга - кредитные организации должны соответствовать следующим требованиям:
- соблюдать обязательные нормативы Банка России, установленные для кредитных организаций;
 - иметь по балансу на последнюю отчетную дату положительный финансовый результат текущего года, определяемый как разница между суммой остатков, числящихся на балансовых счетах по учету доходов текущего года, и суммой остатков, числящихся на балансовых счетах по учету расходов текущего года;
 - в деятельности Участников клиринга - кредитных организаций должны отсутствовать основания для осуществления мер по предупреждению банкротства в соответствии с законодательством Российской Федерации о несостоятельности (банкротстве) кредитных организаций, а также основания для отзыва Банком России лицензии на осуществление банковских операций в соответствии с законодательством Российской Федерации о банковской деятельности.
- 14.2. Участники клиринга - некредитные организации должны соответствовать следующим требованиям:
- иметь по балансу на последнюю отчетную дату положительный финансовый результат, определяемый как остаток по строке "Нераспределенная прибыль (непокрытый убыток)" бухгалтерского баланса (формы 0710001).

Статья 15. Порядок урегулирования неисполненных обязательств в случае прекращения клирингового обслуживания

- 15.1. В случае отзыва (аннулирования) Банком России у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций, клиринговое обслуживание Участника клиринга - кредитной организации прекращается с даты отзыва (аннулирования) Банком России у такого Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций.
- 15.1.1. Подтверждением факта отзыва (аннулирования) лицензии на осуществление банковских операций у Участника клиринга - кредитной организации является письменное уведомление Банка России, направленное Клиринговому центру (в том числе, посредством факсимильной связи) и/или размещенная Пресс-центром Банка России на сайте Банка России в сети Интернет информация о решении Банка России об отзыве (аннулировании) выданной Участнику клиринга - кредитной организации лицензии на осуществление банковских операций и/или направленное Пресс-центром Банка России по электронному адресу

Клирингового центра электронное сообщение, содержащее информацию об отзыве (аннулировании) у Участника клиринга - кредитной организации лицензии на осуществление банковских операций.

- 15.1.2. В случае отзыва лицензии на осуществление банковских операций у Участника клиринга – кредитной организации, обязательства по Срочным контрактам, Сделкам Т+N, Сделкам репо с полным обеспечением и Сделкам с отложенным исполнением, заключенным до даты отзыва такой лицензии, прекращаются полностью на дату, предшествующую дате отзыва лицензии на осуществление банковских операций у Участника клиринга – кредитной организации.

Указанные обязательства по Срочным контрактам и Сделкам Т+N прекращаются возникновением нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга – кредитной организации, рассчитанного в соответствии с пунктом 15.3 Правил клиринга, если Участник клиринга решением суда признан несостоятельным (банкротом), или рассчитанного в соответствии с пунктом 15.4 Правил клиринга, если в отношении Участника клиринга принято решение суда о его ликвидации. Такое нетто-обязательство / нетто-требование Участника клиринга – кредитной организации подлежит исполнению после вступления в силу соответствующего решения арбитражного суда.

Указанные обязательства по Сделкам репо с полным обеспечением и Сделкам с отложенным исполнением прекращаются возникновением нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга – кредитной организации в отношении других Участников клиринга – его контрагентов по Сделкам репо с полным обеспечением и Сделкам с отложенным исполнением. Размер указанных нетто-обязательств / нетто-требований рассчитывается в соответствии с пунктом 15.5 Правил клиринга.

- 15.1.3. В случае отзыва (аннулирования) лицензии на осуществление банковских операций у Участника клиринга – кредитной организации, Срочные контракты, Сделки Т+N, Сделки репо с полным обеспечением и Сделки с отложенным исполнением, заключенные в дату отзыва (аннулирования) такой лицензии и (или) после нее, являются недействительными.

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

- 15.1.4. Клиринговый центр направляет Участнику клиринга - кредитной организации, у которого отозвана (аннулирована) лицензия на осуществление банковских операций, в форме электронного документа уведомление о прекращении обязательств по Срочным контрактам, Сделкам Т+N, Сделкам репо с полным обеспечением и Сделкам с отложенным исполнением не позднее Рабочего дня, следующего за датой прекращения обязательств по этим Сделкам. Указанное уведомление также содержит информацию о рассчитанных в соответствии с пунктом 15.5 Правил клиринга нетто-обязательствах / нетто-требованиях Участника клиринга – кредитной организации в отношении его контрагентов по Сделкам репо с полным обеспечением и Сделкам с отложенным исполнением. Уведомления о прекращении обязательств по Сделкам репо с полным обеспечением и Сделкам с отложенным исполнением, содержащие информацию о рассчитанных в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга нетто-

обязательствах / нетто-требованиях Участников клиринга - контрагентов Участника клиринга – кредитной организации, у которого отозвана (аннулирована) лицензия на осуществление банковских операций, по Сделкам репо с полным обеспечением и Сделкам с отложенным исполнением, направляются указанным Участникам клиринга – контрагентам в том же порядке и в те же сроки.

- 15.1.5. Клиринговый центр в порядке, предусмотренном пунктом 15.3 или 15.4 Правил клиринга, рассчитывает сумму нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга – кредитной организации и направляет такому Участнику клиринга в форме электронного документа уведомление о рассчитанной в соответствии с пунктом 15.3 или 15.4 Правил клиринга сумме нетто-обязательства или нетто-требования Участника клиринга.

Клиринговый центр направляет Доверенному владельцу счетов в форме электронного документа уведомление о рассчитанной в соответствии с пунктом 15.3 или 15.4 Правил клиринга сумме нетто-обязательства или нетто-требования Участника клиринга, учитываемого по Доверенному владельцу счетов.

Доверенный владелец счетов вправе подать в Клиринговый центр Заявление на возврат денежных средств, составляющих Средства гарантийного обеспечения, обязательства по возврату которых учитываются на разделах денежного регистра, имеющих код Обособленной Брокерской фирмы, за которой закреплен указанный Доверенный владелец счетов, в сумме, оставшейся после погашения нетто-обязательства Участника клиринга, учитываемого по Доверенному владельцу счетов. Возврат указанных денежных средств осуществляется в порядке, установленном статьей 30 Правил клиринга.

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

Возврат денежных средств Участнику клиринга – кредитной организации осуществляется Клиринговым центром в сумме нетто-требования Участника клиринга, рассчитанного соответственно в порядке, предусмотренном пунктом 15.3 или 15.4 Правил клиринга.

- 15.1.7. Клиринговый центр вправе предъявить к Участнику клиринга требование о взыскании нетто-обязательства Участника клиринга, рассчитанного соответственно в порядке, предусмотренном пунктом 15.3 или 15.4 Правил клиринга, в общем порядке, предусмотренном законодательством о несостоятельности (банкротстве).

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

- 15.2. В случае назначения временной администрации или принятия арбитражным судом решения о введении в отношении Участника клиринга одной из процедур банкротства, клиринговое обслуживание Участника клиринга, не являющегося кредитной организацией, прекращается с даты назначения временной администрации или даты принятия арбитражным судом решения о введении в отношении Участника клиринга одной из процедур банкротства, в зависимости от того, какая дата наступила ранее.
- 15.2.1. В случае назначения временной администрации или принятия арбитражным судом решения о введении в отношении Участника клиринга одной из процедур банкротства, обязательства по Срочным контрактам, Сделкам T+N, Сделкам репо с полным обеспечением и Сделкам с отложенным исполнением прекращаются полностью в дату прекращения клирингового обслуживания.
- Указанные обязательства по Срочным контрактам и Сделкам T+N прекращаются возникновением нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга, не являющегося кредитной организацией, рассчитанных в соответствии с пунктом 15.4 Правил клиринга.
- Указанные обязательства по Сделкам репо с полным обеспечением и Сделкам с отложенным исполнением прекращаются возникновением нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга, не являющегося кредитной организацией, в отношении других Участников клиринга – его контрагентов по Сделкам репо с полным обеспечением и Сделкам с отложенным исполнением. Размер указанных нетто-обязательств / нетто-требований рассчитывается в соответствии с пунктом 15.5 Правил клиринга.
- 15.2.2. Клиринговый центр направляет такому Участнику клиринга, не являющемуся кредитной организацией, в форме электронного документа уведомление о прекращении обязательств по Срочным контрактам, Сделкам T+N, Сделкам репо с полным обеспечением и Сделкам с отложенным исполнением не позднее Рабочего дня, следующего за датой прекращения обязательств по указанным сделкам. Указанное уведомление также содержит информацию о рассчитанных в соответствии с пунктом 15.5 Правил клиринга нетто-обязательствах / нетто-требованиях Участника клиринга, не являющегося кредитной организацией, в отношении его контрагентов по Сделкам репо с полным обеспечением и Сделкам с отложенным исполнением. Уведомления о прекращении обязательств по Сделкам репо с полным обеспечением и Сделкам с отложенным исполнением, содержащие информацию о рассчитанных в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга нетто-обязательствах / нетто-требованиях Участников клиринга - контрагентов Участника клиринга, не являющегося кредитной организацией, в отношении которого назначена временная администрация или введена одна из процедур банкротства, по Сделкам репо с полным обеспечением и Сделкам с отложенным исполнением, направляются указанным Участникам клиринга – контрагентам в том же порядке и в те же сроки.
- 15.2.3. Клиринговый центр в порядке, предусмотренном пунктом 15.4 Правил клиринга, рассчитывает сумму нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга, не являющегося кредитной организацией, и направляет такому Участнику клиринга в форме электронного документа уведомление о рассчитанной в соответствии с пунктом 15.4 Правил клиринга сумме нетто-обязательства или нетто-требования Участника клиринга.
- Клиринговый центр направляет Доверенному владельцу счетов в форме электронного документа уведомление о рассчитанной в соответствии с

пунктом 15.4 Правил клиринга сумме нетто-обязательства или нетто-требования Участника клиринга, учитываемого по Доверенному владельцу счетов.

Доверенный владелец счетов вправе подать в Клиринговый центр Заявление на возврат денежных средств, составляющих Средства гарантийного обеспечения, обязательства по возврату которых учитываются на разделах денежного регистра, имеющих код Обособленной Брокерской фирмы, за которой закреплен указанный Доверенный владелец счетов, в сумме, оставшейся после погашения нетто-обязательства Участника клиринга, учитываемого по Доверенному владельцу счетов. Возврат указанных денежных средств осуществляется в порядке, установленном статьей 30 Правил клиринга.

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

Возврат денежных средств Участнику клиринга, не являющемуся кредитной организацией, осуществляется Клиринговым центром в сумме нетто-требования Участника клиринга, рассчитанного в порядке, предусмотренном пунктом 15.4 Правил клиринга.

- 15.2.5. Клиринговый центр вправе предъявить к Участнику клиринга требование о взыскании нетто-обязательства Участника клиринга, рассчитанного в порядке, предусмотренном пунктом 15.4 Правил клиринга, а также неустоек (штрафов, пеней), и комиссионных вознаграждений, подлежащих уплате в соответствии с Правилами клиринга, в общем порядке, предусмотренном законодательством о несостоятельности (банкротстве).

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

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

- 1) для каждого Доверенного владельца счетов и Срочного контракта / ценной бумаги, допущенной к торгам в Секторе рынка Standard ФБ ММВБ, рассчитывает нетто-позицию Участника клиринга по Срочному контракту / ценной бумаге по разделам регистра учета позиций, имеющим коды Обособленных Брокерских фирм, за которыми закреплен данный Доверенный владелец счетов (далее – нетто-позиция по Срочному контракту / ценной бумаге Доверенного владельца счетов), как сумму (с учетом знака) позиций по Срочным контрактам / ценным бумагам, учитываемых на всех разделах регистра учета позиций Участника клиринга, имеющих коды указанных Обособленных Брокерских фирм, на конец дня,

предшествующего дате отзыва (аннулирования) у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций;

- 2) если нетто-позиция по Срочному контракту / ценной бумаге Доверенного владельца счетов является позицией на продажу, Клиринговый центр рассчитывает произведение абсолютной величины нетто-позиции по Срочному контракту / ценной бумаге Доверенного владельца счетов и разности Расчетной цены Срочного контракта / ценной бумаги, определенной в ходе последней дневной или вечерней клиринговой сессии, и цены сделки, заключенной Клиринговым центром в соответствии с пунктом 33.8 Правил клиринга в объеме, равном нетто-позиции по Срочному контракту / ценной бумаге Доверенного владельца счетов, с направленностью, противоположной направленности нетто-позиции по Срочному контракту / ценной бумаге Доверенного владельца счетов (на покупку);
- 3) если нетто-позиция по Срочному контракту / ценной бумаге Доверенного владельца счетов является позицией на покупку, Клиринговый центр рассчитывает произведение нетто-позиции по Срочному контракту / ценной бумаге Доверенного владельца счетов и разности цены сделки, заключенной Клиринговым центром в соответствии с пунктом 33.8 Правил клиринга в объеме, равном нетто-позиции по Срочному контракту / ценной бумаге Доверенного владельца счетов, с направленностью, противоположной направленности нетто-позиции по Срочному контракту / ценной бумаге Доверенного владельца счетов (на продажу) и Расчетной цены Срочного контракта / ценной бумаги, определенной в ходе последней дневной или вечерней клиринговой сессии;
- 4) по каждому Доверенному владельцу счетов рассчитывает сумму с учетом знака:
 - по всем Срочным контрактам и ценным бумагам, допущенным к торгам в Секторе рынка Standard ФБ ММВБ, произведений, рассчитанных в соответствии с подпунктами 2, 3 настоящего пункта Правил клиринга;
 - обязательств Участников клиринга по уплате вариационной маржи, премии, Гарантийных переводов, учитываемых по разделам регистра учета позиций, имеющим код Обособленной Брокерской фирмы, за которой закреплен данный Доверенный владелец счетов, исполненных в дату отзыва (аннулирования) у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций (учитываются со знаком «плюс»);
 - требований Участников клиринга по получению вариационной маржи, премии, Гарантийных переводов, учитываемых по разделам регистра учета позиций, имеющим код Обособленной Брокерской фирмы, за которой закреплен данный Доверенный владелец счетов, исполненных в дату отзыва (аннулирования) у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций (учитываются со знаком «минус»).

Если указанная сумма отрицательная, это означает наличие нетто-обязательства Участника клиринга, учитываемого по Доверенному владельцу счетов, если положительная – наличие нетто-требования Участника клиринга, учитываемого по Доверенному владельцу счетов.

При этом нетто-обязательство Участника клиринга, учитываемое по Доверенному владельцу счетов, погашается за счет Средств гарантийного обеспечения, обязательства по возврату которых учитываются на разделах денежного регистра, за которыми закреплён указанный Доверенный владелец счетов, в российских рублях, а при их недостаточности также за счет Средств гарантийного обеспечения в иностранной валюте, обязательства по возврату которых учитываются на разделах денежного регистра, за которыми закреплён указанный Доверенный владелец счетов, пересчитанных в российские рубли по курсу, установленному Банком России на день отзыва (аннулирования) у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций;

- 5) по каждому коду Срочного контракта и по каждой ценной бумаге, допущенной к торгам в Секторе рынка Standard ФБ ММВБ, рассчитывает нетто-позицию Участника клиринга по Срочному контракту / ценной бумаге как сумму (с учетом знака) позиций по Срочному контракту / ценной бумаге, учитываемых на всех разделах регистра учета позиций Участника клиринга, имеющих код обычной и Выделенной Брокерской фирмы, на конец дня, предшествующего дате отзыва (аннулирования) у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций;
- 6) если нетто-позиция по Срочному контракту / ценной бумаге Участника клиринга является позицией на продажу, Клиринговый центр рассчитывает произведение абсолютной величины нетто-позиции по Срочному контракту / ценной бумаге Участника клиринга и разности Расчетной цены Срочного контракта / ценной бумаги, определенной в ходе последней дневной или вечерней клиринговой сессии, и цены сделки, заключенной Клиринговым центром в соответствии с пунктом 33.8 Правил клиринга в объеме, равном нетто-позиции по Срочному контракту / ценной бумаге Участника клиринга, с направленностью, противоположной направленности нетто-позиции по Срочному контракту / ценной бумаге Участника клиринга (на покупку);
- 7) если нетто-позиция по Срочному контракту / ценной бумаге Участника клиринга является позицией на покупку, Клиринговый центр рассчитывает произведение нетто-позиции по Срочному контракту / ценной бумаге Участника клиринга и разности цены сделки, заключенной Клиринговым центром в соответствии с пунктом 33.8 Правил клиринга в объеме, равном нетто-позиции по Срочному контракту / ценной бумаге Участника клиринга, с направленностью, противоположной направленности нетто-позиции по Срочному контракту / ценной бумаге Участника клиринга (на продажу) и Расчетной цены Срочного контракта / ценной бумаги, определенной в ходе последней дневной или вечерней клиринговой сессии;
- 8) для каждого Участника клиринга рассчитывает сумму с учетом знака:
 - по всем Срочным контрактам и ценным бумагам, допущенным к торгам в Секторе рынка Standard ФБ ММВБ, произведений, рассчитанных в соответствии с подпунктами 6, 7 настоящего пункта Правил клиринга;
 - Средств гарантийного обеспечения в российских рублях, обязательства по возврату которых учитываются на разделах денежного регистра Участника клиринга, имеющих коды обычных и Выделенных Брокерских фирм (учитываются со знаком «плюс»);

- Средств гарантийного обеспечения в иностранной валюте, обязательства по возврату которых учитываются на разделах денежного регистра Участника клиринга, имеющих коды обычных и Выделенных Брокерских фирм, пересчитанных в российские рубли по курсу, установленному Банком России на день отзыва у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций (учитываются со знаком «плюс»);
- вноса Участника клиринга в Страховой фонд (учитывается со знаком «плюс»);
- обязательств Участников клиринга по уплате вариационной маржи, премии, Гарантийных переводов, исполненных в дату отзыва (аннулирования) у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций, не учтенных при расчете нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга, учитываемых по Доверенному владельцу счетов (учитываются со знаком «плюс»);
- требований Участников клиринга по получению вариационной маржи, премии, Гарантийных переводов, исполненных в дату отзыва (аннулирования) у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций, не учтенных при расчете нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга, учитываемых по Доверенному владельцу счетов (учитываются со знаком «минус»);
- нетто-требований Участника клиринга, учитываемых по Доверенному владельцу счетов (учитываются со знаком «плюс»);
- нетто-обязательств Участника клиринга, учитываемых по Доверенному владельцу счетов и непогашенных за счет Средств гарантийного обеспечения, обязательства по возврату которых учитываются на разделах денежного регистра, за которыми закреплён Доверенный владелец счетов, в российских рублях и в иностранной валюте (учитываются со знаком «минус»).

Если указанная сумма отрицательная, это означает наличие нетто-обязательства Участника клиринга по отношению к Клиринговому центру, если положительная – наличие нетто-требования Участника клиринга по отношению к Клиринговому центру.

- 15.4. В случае принятия арбитражным судом решения о ликвидации Участника клиринга – кредитной организации или в случае назначения временной администрации или принятия арбитражным судом решения о введении в отношении Участника клиринга, не являющегося кредитной организацией, одной из процедур банкротства (за исключением конкурсного управления), Клиринговый центр рассчитывает размер нетто-обязательства Участника клиринга в российских рублях в порядке, предусмотренном пунктом 15.3 Правил клиринга, но с учетом параметров Срочных контрактов и Сделок T+N, заключенных Участником клиринга до момента отзыва (аннулирования) у него лицензии на осуществление банковских операций в день отзыва (аннулирования) указанной лицензии, а также неустоек (штрафов, пеней) и комиссионных вознаграждений, подлежащих уплате Участником клиринга в соответствии с Правилами клиринга.
- 15.5. Клиринговый центр рассчитывает размер нетто-обязательств / нетто-требований в российских рублях Участника клиринга (далее – Ликвидант) в отношении других

Участников клиринга – его контрагентов по Сделкам репо с полным обеспечением и Сделкам с отложенным исполнением следующим образом.

- 15.5.1. Нетто-обязательство (нетто-требование) Ликвиданта по денежным средствам в отношении каждого Участника клиринга – контрагента по Сделкам репо с полным обеспечением и Сделкам с отложенным исполнением, рассчитывается по указанным сделкам, заключенным с данным Участником клиринга, по формуле:

$НОД = СТ - СО$, где:

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

СТ - сумма требований, а СО – сумма обязательств Ликвиданта по денежным средствам по Сделкам репо с полным обеспечением и Сделкам с отложенным исполнением.

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

- 15.5.2. Нетто-обязательство (нетто-требование) Ликвиданта по ценным бумагам в отношении каждого Участника клиринга – контрагента по Сделкам репо с полным обеспечением и Сделкам с отложенным исполнением, рассчитывается по указанным сделкам, заключенным с данным Участником клиринга, по формуле:

$НОЦ = СТЦ - СОЦ$, где:

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

СТЦ - сумма требований, а СОЦ – сумма обязательств Ликвиданта по соответствующей ценной бумаге по Сделкам репо с полным обеспечением и Сделкам с отложенным исполнением.

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

- 15.5.3. Определенное в соответствии с подпунктом 15.5.1 Правил клиринга нетто-обязательство (нетто-требование) Ликвиданта по денежным средствам в российских рублях в отношении каждого Участника клиринга – контрагента по сделкам складывается с учетом знака с определенным в соответствии с подпунктом 15.5.2 Правил клиринга нетто-обязательством (нетто-требованием) Ликвиданта по ценным бумагам в отношении того же Участника клиринга – контрагента по сделкам, пересчитанным в российские рубли по рыночной цене ценной бумаги, определенной на дату прекращения обязательств по сделкам.

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

- 15.6. В случае отзыва (аннулирования) лицензии на осуществление банковских операций у Клирингового центра, обязательства по Срочным контрактам и Сделкам T+N, заключенным до даты отзыва (аннулирования) такой лицензии, прекращаются полностью на дату, предшествующую дате отзыва (аннулирования) лицензии на осуществление банковских операций у Клирингового центра.

Указанные обязательства прекращаются возникновением нетто-обязательства / нетто-требования Клирингового центра, рассчитанного в соответствии с пунктом 15.7 Правил клиринга, если Клиринговый центр решением суда признан несостоятельным (банкротом), или рассчитанного в соответствии с пунктом 15.8 Правил клиринга, если в отношении Клирингового центра принято решение суда о его ликвидации. Такое нетто-обязательство Клирингового центра подлежит исполнению после вступления в силу соответствующего решения арбитражного суда.

- 15.6.1. В случае отзыва (аннулирования) лицензии на осуществление банковских операций у Клирингового центра, обязательства по Срочным контрактам и Сделкам T+N, заключенным в дату отзыва (аннулирования) такой лицензии, являются недействительными.

Участник клиринга вправе предъявить к Клиринговому центру требование о взыскании убытков, связанных с недействительностью указанных сделок, а также неустоек (штрафов, пеней), подлежащих уплате в соответствии с Правилами клиринга, в общем порядке, предусмотренном законодательством о несостоятельности (банкротстве).

- 15.7. В случае принятия арбитражным судом решения о признании Клирингового центра несостоятельным (банкротом) размер нетто-обязательства / нетто-требования Клирингового центра в российских рублях в отношении Участника клиринга рассчитывается как сумма учитываемых на всех разделах денежного регистра Участника клиринга Средств гарантийного обеспечения в российских рублях и Средств гарантийного обеспечения в иностранной валюте, пересчитанных в российские рубли по курсу, установленному Банком России на дату отзыва у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций, уменьшенная на сумму неисполненных обязательств и на сумму исполненных в дату отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций требований Участника клиринга перед Клиринговым центром по уплате (получению) Вариационной маржи, премии, Гарантийных переводов, а также неисполненных Маржинальных требований, возникших до даты отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций, и увеличенная на сумму исполненных в дату отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций обязательств Участника клиринга перед Клиринговым центром по уплате Вариационной маржи, премии, Гарантийных переводов.

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

- 15.8. В случае принятия арбитражным судом решения о ликвидации Клирингового центра размер нетто-обязательства / нетто-требования Клирингового центра в российских рублях в отношении Участника клиринга рассчитывается в порядке, предусмотренном пунктом 15.7 Правил клиринга, но с учетом неустоек (штрафов, пеней), комиссионных вознаграждений, подлежащих уплате в соответствии с Правилами клиринга.

- 15.9. Информация о размере нетто-обязательства / нетто-требования Клирингового центра в российских рублях в отношении Участника клиринга, определенных в

соответствии с пунктами 15.7, 15.8 Правил клиринга направляется Клиринговым центром Участнику клиринга в форме электронного документа.

Статья 16. Порядок разрешения споров

- 16.1. Все гражданско-правовые споры и разногласия, возникшие между Участниками клиринга, Участником клиринга и Клиринговым центром в связи с проведением клиринга (оказанием клиринговых и иных связанных с клирингом услуг) и/или с исполнением обязательств по итогам клиринга в соответствии с Правилами клиринга, подлежат рассмотрению и разрешению в Арбитражной комиссии при ОАО ММВБ-РТС в соответствии с документами, определяющими ее правовой статус и порядок разрешения споров, действующими на момент подачи искового заявления.
- 16.2. Решения Арбитражной комиссии при ОАО ММВБ-РТС являются окончательными и обязательными для сторон. Неисполненное добровольно решение Арбитражной комиссии при ОАО ММВБ-РТС подлежит принудительному исполнению в соответствии с законодательством Российской Федерации или законодательством иной страны места принудительного исполнения и/или международными соглашениями.

РАЗДЕЛ II. ВОЗМОЖНОСТЬ ЗАКЛЮЧЕНИЯ СРОЧНОГО КОНТРАКТА / СДЕЛОК T+N

Статья 17. Спецификация Срочного контракта

- 17.1. Копия утвержденной Организатором торговли Спецификации Срочного контракта направляется Организатором торговли в Клиринговый центр. При этом Организатор торговли Московская Биржа дополнительно указывает, к какому рынку Срочного рынка FORTS относится Срочный контракт, а Организатор торговли ОАО «СПБ» дополнительно указывает, к какому рынку Секции срочного рынка относится Срочный контракт.
- 17.2. На основании полученной от Организатора торговли Спецификации Срочного контракта Клиринговый центр устанавливает минимальный Базовый размер гарантийного обеспечения для всех Срочных контрактов, возможность заключения которых будет предоставляться на условиях данной Спецификации Срочного контракта, и уведомляет об этом Организатора торговли.
- 17.3. Клиринговый центр вправе изменить в порядке, установленном приложением № Ф5 к Правилам клиринга, минимальный Базовый размер гарантийного обеспечения для Срочного контракта с определенным кодом.
- 17.4. Организатор торговли вправе по согласованию с Клиринговым центром внести изменения и/или дополнения в Спецификацию Срочного контракта, изменяющие условия заключения Срочного контракта и/или условия ранее заключенных Срочных контрактов.
- 17.4.1. Последствия внесения изменений и/или дополнений в Спецификацию Срочного контракта устанавливаются этой Спецификацией.
- 17.4.2. Уведомление Участников клиринга о внесении изменений и/или дополнений в Спецификацию Срочного контракта осуществляется Клиринговым центром не позднее, чем за 1 (один) Расчетный день до введения в действие Спецификации Срочного контракта с внесенными в нее изменениями и дополнениями путем ее опубликования на Сайте Клирингового центра.

Статья 18. Возможность заключения Срочного контракта

- 18.1. Возможность заключения Срочного контракта на торгах Организатора торговли на условиях Спецификации Срочного контракта устанавливается решением Организатора торговли.
- Организатор торговли уведомляет Клиринговый центр о принятом решении о возможности заключения Срочного контракта на торгах.
- 18.2. Спецификацией Срочного контракта или решением Организатора торговли должны быть установлены:
- обозначение Срочного контракта;
 - первый и последний торговые дни, в которые может быть заключен Срочный контракт.
- 18.2.1. Если в соответствии с условиями фьючерсного контракта или опционного контракта, установленными соответствующей Спецификацией Срочного контракта, Правилами клиринга, Правилами торговли соответствующего

Организатора торговли необходимо определение расчетной цены и/или Лимитов колебаний цен сделок, то решением Организатора торговли должны быть также установлены:

- начальная расчетная цена в первый день заключения Срочного контракта; и/или
- начальный Лимит колебаний цен сделок в первый день заключения Срочного контракта.

Статья 19. Возможность заключения Сделок T+N с ценной бумагой

19.1. При получении от Организатора торговли информации о включении ценной бумаги в список ценных бумаг, в отношении которых могут заключаться Сделки T+N, с указанием лота, Клиринговый центр устанавливает:

- минимальный Базовый размер гарантийного обеспечения для ценной бумаги, в отношении которой могут заключаться Сделки T+N;
- начальную расчетную цену в первый день заключения сделок с указанной ценной бумагой;
- начальный Лимит колебаний цен сделок в первый день заключения сделок с указанной ценной бумагой.

Клиринговый центр устанавливает начальную расчетную цену в первый день заключения сделок с ценной бумагой и начальный Лимит колебаний цен сделок в первый день заключения сделок с ценной бумагой постольку, поскольку указанные параметры не устанавливаются решением Организатора торговли.

19.2. Клиринговый центр вправе изменить в порядке, установленном приложением № Ф5 к Правилам клиринга, минимальный Базовый размер гарантийного обеспечения для ценной бумаги, в отношении которой могут заключаться Сделки T+N.

РАЗДЕЛ III. ПОРЯДОК ОСУЩЕСТВЛЕНИЯ КЛИРИНГА

ПОДРАЗДЕЛ III-1. КЛИРИНГОВЫЕ РЕГИСТРЫ

Статья 20. Перечень и назначение клиринговых регистров

- 20.1. Клиринговый центр осуществляет учет обязательств Участников клиринга, а также учет информации о ценных бумагах и денежных средствах, предназначенных для исполнения обязательств Участников клиринга, на клиринговых регистрах.
- 20.2. Клиринговый центр использует следующие категории клиринговых регистров:
- торговый депо регистр;
 - торговый денежный регистр;
 - позиционный депо регистр;
 - позиционный денежный регистр;
 - расчетный депо регистр;
 - расчетный денежный регистр (в рублях Российской Федерации);
 - денежный регистр (в рублях Российской Федерации и в иностранной валюте);
 - депо регистр поставки;
 - денежный регистр поставки (в рублях Российской Федерации);
 - депо регистр обеспечения;
 - денежный регистр обеспечения;
 - регистр учета позиций;
 - регистр учета средств Страхового фонда.
- 20.3. Торговый депо регистр - клиринговый регистр, на котором учитываются значения Лимитов по ценным бумагам Участника клиринга или клиентов Участника клиринга.
- Торговый денежный регистр - клиринговый регистр, на котором учитываются значения Лимита по денежным средствам Участника клиринга или клиентов Участников клиринга.
- Торговый депо регистр и торговый денежный регистр далее вместе именуются торговыми регистрами.
- 20.4. Позиционный депо регистр - клиринговый регистр, предназначенный для учета объема обязательств или требований Участника клиринга по перерегистрации ценных бумаг.
- Позиционный денежный регистр - клиринговый регистр, предназначенный для учета объема обязательств или требований Участника клиринга в рублях Российской Федерации по оплате ценных бумаг.
- Позиционный депо регистр и позиционный денежный регистр далее вместе именуются позиционными регистрами.
- 20.5. Расчетный депо регистр – клиринговый регистр, на котором учитывается подтвержденное Расчетным депозитарием (известное Клиринговому центру) значение остатка ценных бумаг на торговом счете депо.

Расчетный денежный регистр – клиринговый регистр, на котором учитывается подтвержденное Расчетной организацией (известное Клиринговому центру) значение остатка денежных средств на денежном торговом счете.

Расчетный депо регистр и расчетный денежный регистр далее вместе именуются расчетными регистрами.

20.6. Денежный регистр - клиринговый регистр, на котором учитывается обязательство Клирингового центра по возврату Средств гарантийного обеспечения в сумме денежных средств, перечисленных на Счет Клирингового центра.

20.7. Депо регистр поставки - клиринговый регистр, на котором учитывается обязательство по возврату ценных бумаг в количестве, зарезервированном Клиринговым центром для исполнения обязательств по сделкам с использованием торгового счета депо, в случаях, предусмотренных Правилами клиринга.

Денежный регистр поставки - клиринговый регистр, на котором учитывается обязательство по возврату денежных средств в сумме, зарезервированной Клиринговым центром для исполнения обязательств по сделкам с использованием денежного торгового счета, в случаях, предусмотренных Правилами клиринга.

Депо регистр поставки и денежный регистр поставки далее вместе именуются регистрами поставки.

20.8. Депо регистр обеспечения – клиринговый регистр, на котором учитывается подтвержденное (известное Клиринговому центру) значение остатка ценных бумаг на Счете ФОРТС.

Депо регистр обеспечения далее также именуется регистром обеспечения.

20.9. Регистр учета позиций - клиринговый регистр, на котором учитываются заключенные Срочные контракты и Сделки Т+N.

20.10. Регистр учета средств Страхового фонда - клиринговый регистр для учета средств Страхового фонда (взносов в Страховой фонд).

Статья 21. Условия открытия клиринговых регистров

21.1. Для каждого торгового счета депо в момент его регистрации Клиринговым центром открываются расчетный депо регистр, позиционный депо регистр, торговый депо регистр.

21.2. Для каждого денежного торгового счета в момент его регистрации Клиринговым центром открываются расчетный денежный регистр, позиционный денежный регистр, торговый денежный регистр.

21.3. Для каждого Счета ФОРТС в момент его регистрации Клиринговым центром открывается депо регистр обеспечения.

21.4. Порядок открытия и ведения денежных регистров, депо регистров обеспечения, регистров учета позиций, регистров учета средств Страхового фонда для Участников клиринга, которым присвоен код (коды) Расчетной фирмы определен в приложении № ФЗ к Правилам клиринга.

Статья 22. Порядок использования клиринговых регистров

- 22.1. Значения клиринговых регистров изменяются Клиринговым центром в процессе взаимодействия с Расчетными депозитариями, Расчетными организациями, и Организаторами торговли и при осуществлении клиринга.
- 22.1.1. Порядок изменения значений клиринговых регистров определяется их категорией и приводится в соответствующих статьях Правил клиринга.

ПОДРАЗДЕЛ III-II. ПОРЯДОК ВЗАИМОДЕЙСТВИЯ УЧАСТНИКОВ КЛИРИНГА И ИХ КЛИЕНТОВ С КЛИРИНГОВЫМ ЦЕНТРОМ

Статья 23. Порядок регистрации торговых счетов

- 23.1. Торговые счета должны быть предварительно зарегистрированы в Клиринговом центре.
- 23.2. Основанием для регистрации денежных торговых счетов в Клиринговом центре является полученное Клиринговым центром от Расчетной организации Уведомление об открытии торгового счета.
- 23.3. Основанием для регистрации торгового счета депо в Клиринговом центре является получение Клиринговым центром от Расчетного депозитария в процессе взаимодействия, описанного в статье 29 Правил клиринга, Реестра остатков на торговых счетах депо, в который внесена запись об указанном торговом счете депо.
- 23.4. Клиринговый центр регистрирует торговые счета в срок не позднее следующего Расчетного дня с даты получения Уведомления об открытии торгового счета от Расчетной организации или Реестра остатков на торговых счетах депо, в который внесена запись о торговом счете депо.
- 23.5. Клиринговый центр для торгового счета осуществляет учет следующих параметров:
- лицо, указанное в качестве Участника клиринга / Клирингового центра;
 - лицо, указанное в качестве Доверенного владельца счетов (при наличии);
 - назначение (возможность или невозможность использования торгового счета для клиринга с полным обеспечением).
- 23.6. Если иное не указано владельцем торгового счета, при регистрации торгового счета Клиринговый центр устанавливает следующие значения параметров:
- лицом, указанным в качестве Участника клиринга, является владелец торгового счета;
 - лицо, указанное в качестве Доверенного владельца счетов, отсутствует;
 - торговый счет предназначен для клиринга с полным обеспечением.
- 23.7. Изменение параметров, учитываемых Клиринговым центром для торгового счета, осуществляется Клиринговым центром на основании заявления по установленной Клиринговым центром форме, подаваемого владельцем торгового счета, не позднее 3 (трех) Расчетных дней со дня получения данного заявления, за исключением:
- режима торгов Организатора торговли. Изменение данного параметра осуществляется Клиринговым центром на основании информации, получаемой от Расчетной организации / Расчетного депозитария, не позднее 3 (трех) Расчетных дней со дня получения данной информации.
- Для возможности подачи указанного заявления владелец торгового счета, не являющийся Участником клиринга или Доверенным владельцем счетов, - резидент, должен предоставить Клиринговому центру документы, перечисленные

в статье 1 приложения С13 к Правилам клиринга, нерезидент - документы, перечисленные в статье 2 приложения С13 к Правилам клиринга.

- 23.8. Передача Клиринговому центру полномочий на право получения информации об остатках ценных бумаг на торговом счете или денежных средств на торговом счете и на право подавать в Расчетный депозитарий / Расчетную организацию поручения на списание с торгового счета ценных бумаг / с торгового счета денежных средств и / или поручения на зачисление на торговый счет ценных бумаг / на торговый счет денежных средств осуществляется в соответствии с законодательством Российской Федерации.
- 23.9. Расчеты по Сделкам с полным обеспечением, Сделкам репо с полным обеспечением, Сделкам T+N и Сделкам с отложенным исполнением не могут проводиться с использованием торгового счета, не предназначенного для клиринга с полным обеспечением.
- 23.10. Клиринговый центр вправе аннулировать регистрацию торгового счета:
- а) в случае исключения торгового счета Расчетным депозитарием / Расчетной организацией из Реестра остатков;
 - б) в случае прекращения полномочий Клирингового центра, указанных в пункте 23.8 настоящей статьи, по торговому счету;
 - в) в случае расторжения договора об оказании клиринговых услуг с Участником клиринга, учитываемого Клиринговым центром для данного торгового счета как лицо, указанное в качестве Участника клиринга;
 - г) на основании заявления владельца торгового счета.
- 23.10.1. Торговый счет, регистрация которого в Клиринговом центре аннулирована, не может использоваться при осуществлении клиринга Клиринговым центром.

Статья 24. Закрепление торговых счетов за разделами клиринговых регистров

- 24.1. За разделом регистра учета позиций могут быть закреплены торговые счета, предназначенные для исполнения обязательств по Срочным контрактам, Сделкам T+N, учитываемых на данном разделе регистра учета позиций.
- 24.2. За одним разделом регистра учета позиций могут быть закреплены по одному торговому денежному счету в каждой Расчетной организации, по одному торговому счету депо в каждом Расчетном депозитарии.
- 24.3. Один торговый счет может быть закреплен либо за разделами клиринговых регистров, имеющих коды обычных и / или Выделенных Брокерских фирм, одного Участника клиринга, либо за разделами клиринговых регистров, имеющих коды Обособленных Брокерских фирм, открытых одному Участнику клиринга, и за которыми закреплен один Доверенный владелец счетов.
- 24.4. Закрепление зарегистрированных торговых счетов осуществляется Клиринговым центром на основании заявления установленной Клиринговым центром формы, подаваемого Участником клиринга или Доверенным владельцем счетов, в соответствии со следующими условиями:
- 24.4.1. Заявление на закрепление торгового счета за разделом регистра учета позиций, имеющим код обычной или Выделенной Брокерской фирмы, вправе подавать

Участник клиринга, зарегистрировавший указанную Брокерскую фирму, учитываемый Клиринговым центром для данного торгового счета как лицо, указанное в качестве Участника клиринга.

Заявление на закрепление торгового счета за разделом регистра учета позиций, имеющим код Обособленной Брокерской фирмы, вправе подавать Доверенный владелец счетов, закрепленный за данной Обособленной Брокерской фирмой и учитываемый Клиринговым центром для данного торгового счета как лицо, указанное в качестве Доверенного владельца счетов.

24.4.2. Закрепление за разделом регистра учета позиций торговых счетов аннулирует закрепление торговых счетов за данным разделом регистра учета позиций осуществленное ранее.

24.5. Аннулирование закрепления торгового счета за разделом регистра учета позиций осуществляется Клиринговым центром на основании заявления установленной Клиринговым центром формы, подаваемого в Клиринговый центр Участником клиринга или Доверенным владельцем счетов, имеющим право подавать заявление на закрепление за данным разделом регистра учета позиций данного торгового счета.

24.5.1. Аннулирование закрепления торгового счета за разделом регистра учета позиций осуществляется Клиринговым центром:

- при аннулировании регистрации данного торгового счета;
- при закрытии данного раздела регистра учета позиций.

24.6. Торговый счет, закрепленный за разделом регистра учета позиций, имеющим код обычной, Выделенной или Обособленной Брокерской фирмы, не используется для исполнения обязательств Участника клиринга, не являющегося Участником клиринга, зарегистрированным Клиринговым центром для данного торгового счета.

Торговый счет, закрепленный за разделом регистра учета позиций, имеющим код Обособленной Брокерской фирмы, не используется для исполнения обязательств Участника клиринга, учитываемым на данном разделе регистра учета позиций, если Доверенный владелец счетов, закрепленный за данной Обособленной Брокерской фирмой, не совпадает с Доверенным владельцем счетов, зарегистрированным для данного торгового счета.

Статья 25. Коды торговых счетов. Порядок регистрации клиентов Участников клиринга

25.1. Настоящая статья определяет порядок регистрации Кодов торговых счетов и клиентов Участников клиринга с целью заключения с указанием этих Кодов торговых счетов Сделок с полным обеспечением, Сделок репо с полным обеспечением, Сделок с отложенным исполнением.

25.2. Код торговых счетов устанавливает соответствие между торговым счетом депо и денежным торговым счетом.

По каждому Коду торговых счетов учитывается Участник клиринга или его клиент, в интересах которого будут заключаться сделки с указанием такого Кода торговых счетов.

Коды торговых счетов должны быть предварительно зарегистрированы в Клиринговом центре.

- 25.3. Регистрация Кодов торговых счетов осуществляется на основании Заявления на регистрацию клиентов и Кодов торговых счетов, предоставляемого в Клиринговый центр Участником клиринга по форме, установленной Клиринговым центром.
- 25.4. Торговые счета, указанные в Заявлении на регистрацию клиентов и Кодов торговых счетов, должны быть предварительно зарегистрированы в Клиринговом центре в порядке, определенном статьей 23 Правил клиринга.
- 25.5. На основании Заявления на регистрацию клиентов и Кодов торговых счетов одновременно с регистрацией Кодов торговых счетов Клиринговый центр осуществляет регистрацию клиентов Участника клиринга, в случае если указанные клиенты не были зарегистрированы Клиринговым центром ранее на основании Заявлений на регистрацию клиентов и Кодов торговых счетов или заявлений, подаваемых в соответствии с пунктом 26.2 Правил клиринга,.
- 25.6. Клиринговый центр вправе отказать в регистрации Кода торговых счетов в случае, если использование данного Кода торговых счетов при заключении сделок и/или расчетам по сделкам приведет к нарушению требований законодательства Российской Федерации и/или в случае выявления нарушений требований, предусмотренных статьей 69 Правил клиринга.
- 25.7. Клиринговый центр в срок не позднее 3 (трех) Расчетных дней с даты получения Заявления на регистрацию клиентов и Кодов торговых счетов регистрирует Код торговых счетов либо направляет Участнику клиринга, предоставившему Заявление, уведомление об отказе в регистрации Кода торговых счетов с указанием причины.
- 25.8. Клиринговый центр аннулирует регистрацию Кода торговых счетов:
- на основании заявления Участника клиринга, на основании заявления которого была осуществлена регистрация;
 - в случае аннулирования регистрации хотя бы одного из торговых счетов, входящего в состав данного Кода торговых счетов;
 - при изменении хотя бы для одного торгового счета, входящего в состав данного Кода торговых счетов, лица, указанного в качестве Участника клиринга для данного торгового счета.

Статья 26. Порядок регистрации клиентов Участников клиринга с целью заключения за счет этих клиентов Срочных контрактов, Сделок T+N

- 26.1. Настоящая статья определяет порядок регистрации клиентов Участников клиринга с целью заключения за счет этих клиентов Срочных контрактов, Сделок T+N.
- 26.2. Регистрация клиента Участника клиринга осуществляется на основании заявления установленной Клиринговым центром формы, поданного Участником клиринга в Клиринговый центр для открытия раздела клиринговых регистров, в случае если указанный клиент не был зарегистрирован Клиринговым центром ранее на

основании заявления, подаваемого в соответствии с настоящим пунктом, или на основании Заявления на регистрацию клиентов и Кодов торговых счетов, подаваемого в соответствии с пунктом 25.5 Правил клиринга. В заявлении должны быть указаны сведения, необходимые для регистрации данного клиента в соответствии с нормативными правовыми актами Федерального органа. При регистрации клиента Участника клиринга ему открываются разделы клиринговых регистров, указанные в заявлении.

Информация о присвоенном клиенту регистрационном коде (кодах) доводится до сведения Участника клиринга в отчетах, предоставляемых Клиринговым центром.

Статья 27. Поручения на клиринг

- 27.1. Для осуществления клиринга на условиях «поставки против платежа» без предварительного обеспечения Участники клиринга подают в Клиринговый центр Поручения на клиринг по форме, установленной Клиринговым центром.
- 27.2. Поручения на клиринг по Сделкам без предварительного обеспечения должны соответствовать следующим требованиям:
- а) указанные в Поручении на клиринг счет списания и счет зачисления ценных бумаг должны находиться в одном и том же Расчетном депозитарии;
 - в) иным требованиям, установленным Правилами клиринга.
- 27.3. В случае если валюта сделки отличается от валюты платежа, Поручение на клиринг должно содержать правило определения курса пересчета валюты сделки в валюту платежа:
- по курсу Банка России на дату расчетов;
 - по курсу Банка России на дату, предшествующую расчетам;
- или непосредственно значение курса.
- 27.4. Поручения на клиринг могут подаваться на бумажном носителе или в электронном виде.
- 27.4.1. Поручение на клиринг в электронном виде, поданное для исполнения обязательств по Сделке без предварительного обеспечения, формируется как один электронный документ, подписанный ЭП обоих Участников клиринга.
- 27.4.2. Поручение на клиринг в бумажном виде, поданное для исполнения обязательств по Сделке без предварительного обеспечения, оформляется в виде бумажного документа, подписанного уполномоченными лицами обоих Участников клиринга.
- 27.5. Поручение на клиринг для исполнения обязательств по Сделке с отложенным исполнением, Первой или Второй части Сделки репо с полным обеспечением подается только в электронном виде с использованием торговой системы Организатора торговли как единый электронный документ, подтвержденный обоими Участниками клиринга.
- 27.6. Клиринговый центр вправе отказать в приеме Поручения на клиринг в случае, если его исполнение приведет к нарушению требований законодательства Российской Федерации и/или в случае выявления нарушения требований, предусмотренных статьей 69 Правил клиринга или Правилами торговли Организаторов торговли.

- 27.7. В случае подачи Поручения на клиринг для исполнения обязательств по Сделке без предварительного обеспечения Клиринговый центр осуществляет в соответствии со статьей 45 Правил клиринга проверку достаточности ценных бумаг и денежных средств для исполнения обязательств по такой Сделке без предварительного обеспечения, информация о которой содержится в неисполненном Поручении на клиринг с наступившей датой исполнения, каждый Расчетный день в течение 30 дней с даты исполнения, указанной в Поручении на клиринг. По истечении этого срока неисполненное Поручение на клиринг аннулируется. В этом случае для исполнения обязательств по Сделке без предварительного обеспечения Участникам клиринга необходимо предоставить в Клиринговый центр новое Поручение на клиринг в порядке, предусмотренном настоящей статьей.
- 27.8. Поручение на клиринг для исполнения обязательств по Сделке с отложенным исполнением, Первой и Второй части Сделки репо с полным обеспечением исполняются только в дату подачи соответствующего поручения.
- 27.9. Поручение на клиринг, поданное для исполнения обязательств по Сделке без предварительного обеспечения, может быть отменено любым из Участников клиринга, подавших такое Поручение, в одностороннем порядке.
Поручение на отмену Поручения на клиринг составляется по форме, установленной Клиринговым центром.
При отмене Поручения на клиринг Сделка без предварительного обеспечения, по которой было подано Поручение на клиринг, исключается из клирингового пула.
- 27.10. В период проведения расчетной клиринговой сессии отмена Поручений на клиринг запрещается. Полученные Клиринговым центром в ходе расчетной клиринговой сессии поручения на отмену Поручений на клиринг исполняются до начала следующей расчетной клиринговой сессии. Исполненные Поручения на клиринг отмене не подлежат.
- 27.11. Поручения на клиринг по Сделкам с отложенным исполнением и Поручения на клиринг во исполнение Первых и Вторых частей Сделок репо с полным обеспечением отмене не подлежат.

Статья 28. Отчеты Клирингового центра

- 28.1. В сроки, установленные нормативными правовыми актами Федерального органа, Клиринговый центр формирует и направляет каждому Участнику клиринга отчеты, содержащие информацию о заключенных этим Участником клиринга сделках, по которым осуществлен клиринг, и об исполненных за счет этого Участника клиринга либо клиентов этого Участника клиринга Поручениях на клиринг.
- 28.2. По итогам каждого Расчетного дня Клиринговый центр формирует и направляет Участникам клиринга Отчеты о состоянии торговых счетов, и денежных регистров, содержащие информацию об изменении остатков по указанным счетам и денежным регистрам по итогам операций, выполненных в течение Расчетного дня по поручениям Клирингового центра / с согласия Клирингового центра.

- 28.2.1. Отчеты клиентам Участников клиринга - владельцам торговых счетов предоставляются Участникам клиринга для последующей передачи клиенту Участника клиринга - владельцу торгового счета.
- 28.3. Реквизиты отчетов, предоставляемых Клиринговым центром Участникам клиринга, и порядок их заполнения указаны в приложении № С2 к Правилам клиринга.
- 28.4. В случае обнаружения ошибок Клиринговый центр имеет право сформировать и направить Участникам клиринга исправленные отчеты. При этом правильным отчетом считается отчет, имеющий более позднюю дату и время формирования отчета.
- 28.5. По итогам дневной и вечерней клиринговой сессии Клиринговый центр в сроки, установленные Регламентом, формирует отчеты для Участников клиринга, которым присвоены код (коды) Расчетной фирмы, и/или для их клиентов и предоставляет их Участникам клиринга.
Реквизиты отчетов, предоставляемых Клиринговым центром Участникам клиринга, которым присвоены код (коды) Расчетной фирмы, и порядок их заполнения указаны в приложении № Ф4 к Правилам клиринга.
- 28.6. Помимо предоставления отчетов Клирингового центра в порядке, предусмотренном в пунктах 28.2 и 28.5 настоящей статьи, Клиринговый центр предоставляет отчеты по запросу Участника клиринга в бумажной форме и/или электронном виде с использованием Системы ЭДО РТС. Указанные отчеты предоставляются Клиринговым центром в течение 3 (трех) Расчетных дней после получения запроса. За предоставление указанных отчетов с Участника клиринга взимается плата в соответствии с Тарифами (приложение № С1 и приложение № Ф6 к Правилам клиринга).
- 28.7. Клиринговый центр вправе предоставлять отчеты Доверенному владельцу счетов, закрепленному за Обособленной Брокерской фирмой, по клиентам Участника клиринга, для которых открыты разделы клиринговых регистров, имеющие коды данной Обособленной Брокерской фирмы, в разрезе указанных разделов.
- 28.8. На основании заявления, поданного Участником клиринга / Доверенным владельцем счетов, Клиринговый центр может предоставлять отчеты по электронной почте на адрес, указанный в заявлении. Заявление подается по форме, установленной Клиринговым центром.

ПОДРАЗДЕЛ III-III. ПОРЯДОК ВЗАИМОДЕЙСТВИЯ КЛИРИНГОВОГО ЦЕНТРА С РАСЧЕТНЫМИ ДЕПОЗИТАРИЯМИ, РАСЧЕТНЫМИ ОРГАНИЗАЦИЯМИ, ОРГАНИЗАТОРАМИ ТОРГОВЛИ

Статья 29. Порядок получения Клиринговым центром информации о количестве ценных бумаг и сумме денежных средств на торговых счетах

29.1. Клиринговый центр получает от Расчетного депозитария информацию о количестве ценных бумаг, учитываемых на торговых счетах депо, в виде:

- а) Реестра остатков на торговых счетах депо;
- б) Реестра пополнений торговых счетов депо.

Реквизиты Реестра остатков на торговых счетах депо и Реестра пополнений торговых счетов депо приведены в приложении № С5 к Правилам клиринга.

29.2. Клиринговый центр устанавливает значения расчетных депо регистров, открытых для соответствующих торговых счетов депо, равными количеству ценных бумаг, учитываемых на соответствующем торговом счете депо в соответствии с информацией, полученной от Расчетного депозитария в Реестре остатков на торговых счетах депо.

29.3. Клиринговый центр получает от Расчетной организации информацию о суммах денежных средств, учитываемых на денежных торговых счетах, в виде:

- а) Сведения о денежных средствах, зарезервированных на торговых счетах;
- б) Уведомление об увеличении денежных средств на торговых счетах.

Реквизиты Сведений о денежных средствах, зарезервированных на торговых счетах, и Уведомления об увеличении денежных средств на торговых счетах приведены в приложении № С7 к Правилам клиринга.

29.4. Клиринговый центр устанавливает значения расчетных денежных регистров, открытых для соответствующих денежных торговых счетов, равными суммам денежных средств, зарезервированных на соответствующих денежных торговых счетах в соответствии с информацией, полученной от Расчетной организации в Сведениях о денежных средствах, зарезервированных на торговых счетах.

29.5. При получении Реестра пополнений торговых счетов депо или Уведомления об увеличении денежных средств на Торговых счетах Клиринговый центр увеличивает значение расчетного регистра на величину пополнения торгового счета депо / Торгового счета, указанного в Реестре пополнений торговых счетов депо или Уведомления об увеличении денежных средств на Торговых счетах (приложение № С5, № С7 к Правилам клиринга).

Статья 30. Взаимодействие Участников клиринга, которым присвоен код (коды) Расчетной фирмы, и Клирингового центра с Расчетной организацией

30.1. Для заключения Срочных контрактов, Сделок T+N, обеспечения исполнения обязательств Участника клиринга по Срочным контрактам, Сделкам T+N и осуществления расчетов по итогам клиринга на Счета Клирингового центра зачисляются денежные средства.

- 30.2. При зачислении денежных средств на Счет Клирингового центра указывается назначение платежа, однозначно определяющее данные средства как Средства гарантийного обеспечения и содержащее код раздела клиринговых регистров для учета обязательств в сумме зачисляемых денежных средств и номер договора между Участником клиринга и Клиринговым центром, если код указанного раздела клиринговых регистров имеет код обычной или Выделенной Брокерской фирмы, или номер договора между Доверенным владельцем счетов, закрепленным за Обособленной Брокерской фирмой, и Клиринговым центром, если код указанного раздела клиринговых регистров имеет код данной Обособленной Брокерской фирмы.

Пример назначения платежа для зачисления денежных средств в рублях Российской Федерации: «Перечисление средств гарантийного обеспечения по договору №5-К от 15.10.2001. Код раздела клирингового регистра 1900001. НДС не облагается».

Пример назначения платежа для зачисления денежных средств в иностранной валюте: «FORTS1900001 UNDER AGR5-K FROM 011015».

- 30.3. В установленный Регламентом срок Расчетная организация представляет в Клиринговый центр информацию о зачислении денежных средств, составляющих Средства гарантийного обеспечения, на Счета Клирингового центра. Данная информация включает назначение платежа, указанное плательщиком при зачислении денежных средств на Счет Клирингового центра.

- 30.4. После идентификации раздела денежного регистра в соответствии с приложением № Ф2 к Правилам клиринга, Клиринговый центр начинает учитывать свое обязательство по возврату Средств гарантийного обеспечения на соответствующем разделе денежного регистра.

- 30.4.1. Клиринговый центр обязан по требованию Участника клиринга перечислить со Счета Клирингового центра денежные средства, обязательства по возврату которых учитываются на разделах денежного регистра, имеющих код обычной или Выделенной Брокерской фирмы.

- 30.4.2. Клиринговый центр обязан по требованию Доверенного владельца счетов перечислить со Счета Клирингового центра денежные средства, обязательства по возврату которых учитываются на разделах денежного регистра, имеющих код Обособленной Брокерской фирмы.

- 30.4.3. Исполнение обязательства Клирингового центра по возврату денежных средств в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга осуществляется в порядке, установленном пунктами 30.5-30.9 настоящей статьи Правил клиринга, в сроки, установленные Регламентом.

- 30.5. Заявление на возврат денежных средств, составляющих Средства гарантийного обеспечения, может быть подано при условии регистрации Клиринговым центром банковских счетов, на которые перечисляются денежные средства со Счетов Клирингового центра (далее – Счета зачисления). Регистрация Счетов зачисления осуществляется Клиринговым центром в соответствии со следующими условиями.

- 30.5.1. Счет зачисления, на который возможно перечисление (возврат) денежных средств, составляющих Средства гарантийного обеспечения, обязательства по возврату которых учитываются на разделах денежного регистра, имеющих коды

обычной или Выделенной Брокерской фирмы, открытых в рамках одной Расчетной фирмы, регистрируется Клиринговым центром на основании заявления на регистрацию, подаваемого Участником клиринга, к которому относится данная Расчетная фирма, при условии, что владельцем такого счета является указанный Участник клиринга.

30.5.2. Счет зачисления, на который возможно перечисление (возврат) денежных средств, составляющих Средства гарантийного обеспечения, обязательства по возврату которых учитываются на разделах денежного регистра, имеющих код Обособленной Брокерской фирмы, регистрируется Клиринговым центром:

- 1) на основании заявления на регистрацию, подаваемого Доверенным владельцем счетов, закрепленным за данной Обособленной Брокерской фирмой, при условии, что владельцем такого счета является указанный Доверенный владелец счетов;
- 2) на основании заявления на регистрацию, подаваемого совместно Доверенным владельцем счетов, закрепленным за данной Обособленной Брокерской фирмой и Участником клиринга, зарегистрировавшим данную Обособленную Брокерскую фирму, при условии, что владельцем такого счета является указанный Участник клиринга. Указанное заявление может быть подано в Клиринговый центр как единый документ в бумажном виде, подписанное указанными лицами, или как два идентичных документа в бумажном и/или электронном виде, подписанных каждым из указанных лиц.

30.5.3. В случае если владельцем Счета зачисления является не Участник клиринга и не Доверенный владелец счетов, Участник клиринга обязан предоставить Клиринговому центру Письмо об идентификации клиента по форме, установленной приложением СЗ к Правилам клиринга.

30.6. Заявление на возврат денежных средств подается в соответствии со следующими условиями:

30.6.1. Участник клиринга вправе подавать заявление на возврат денежных средств, составляющих Средства гарантийного обеспечения, с указанием разделов денежного регистра, имеющих коды обычной или Выделенной Брокерской фирмы, зарегистрированной данным Участником клиринга, с указанием Счета зачисления, зарегистрированного в соответствии с подпунктом 30.5.1 Правил клиринга.

30.6.2. Доверенный владелец счетов, закрепленный за Обособленной Брокерской фирмой, вправе подавать заявление на возврат денежных средств, составляющих Средства гарантийного обеспечения, с указанием разделов денежного регистра, имеющих код данной Обособленной Брокерской фирмы, с указанием Счета зачисления, зарегистрированного в соответствии с подпунктом 1) или подпунктом 2) подпункта 30.5.2 настоящей статьи. При этом, если возврат денежных средств, составляющих Средства гарантийного обеспечения, обязательства по возврату которых учитываются на разделе денежного регистра, имеющем код Обособленной Брокерской фирмы, зарегистрированной Участником клиринга, осуществляется на Счет зачисления, зарегистрированный в соответствии с подпунктом 2) пункта 30.5.2 настоящей статьи, заявление на возврат денежных средств должно быть согласовано с указанным Участником клиринга. Такое согласование осуществляется путем проставления подписи Участника клиринга на заявлении на возврат денежных средств или путем представления идентичного заявления, подписанного Участником клиринга.

- 30.7. В случаях и порядке, установленных приложением № Ф2 к Правилам клиринга, Клиринговый центр на основании принятых документов на возврат денежных средств, составляющих Средства гарантийного обеспечения, формирует и передает в Расчетную организацию поручения на перевод указанных денежных средств с соответствующего Счета Клирингового центра.
- 30.8. В установленный Регламентом срок Расчетная организация на основании поручений на перевод денежных средств, полученных от Клирингового центра, осуществляет списание денежных средств со Счета Клирингового центра и уведомляет об этом Клиринговый центр.
- 30.9. В срок, установленный Регламентом, Расчетная организация передает в Клиринговый центр информацию об операциях по Счетам Клирингового центра, на основании которой Клиринговый центр осуществляет сверку выполненных операций и остатков на Счетах Клирингового центра.
- 30.10. Аннулирование регистрации Счета зачисления осуществляется Клиринговым центром:
- на основании заявления Участника клиринга и/или Доверенного владельца счетов, имеющих право подавать заявление на регистрацию Счета зачисления, подаваемого в Клиринговый центр в том же порядке, что и заявление на регистрацию Счета зачисления;
 - для Счета зачисления, владельцем которого является Доверенный владелец счетов, закрепленный за Обособленной Брокерской фирмой, при прекращении выполнения им функций Доверенного владельца счетов по данной Обособленной Брокерской фирме.

Статья 31. Взаимодействие Участников клиринга, которым присвоен код (коды) Расчетной фирмы, и Клирингового центра с Расчетным депозитарием

- 31.1. Для заключения Срочных контрактов, Сделок T+N, обеспечения исполнения обязательств по Срочным контрактам, Сделкам T+N, и исполнения обязательств по указанным сделкам ценные бумаги зачисляются на Счета ФОРТС. Перечень ценных бумаг, которые могут составлять Средства гарантийного обеспечения, устанавливается в соответствии с приложением № Ф2 к Правилам клиринга.
- 31.2. Информация о Счете ФОРТС передается Расчетным депозитарием в Клиринговый центр в реестрах, предоставляемых в соответствии с договором между Расчетным депозитарием и Клиринговым центром.
- 31.3. Ценные бумаги, учитываемые на Счете ФОРТС, владельцем которого не является Участник клиринга или Доверенный владелец счетов, учитываются Клиринговым центром в качестве Средств гарантийного обеспечения при наличии между Клиринговым центром и владельцем указанного Счета ФОРТС заключенного договора по установленной Клиринговым центром форме, определяющего порядок распоряжения такими ценными бумагами в соответствии с Правилами клиринга (далее в настоящей статье - Договор).
- 31.3.1. Для заключения Договора владелец Счета ФОРТС, являющийся резидентом, представляет в Клиринговый центр документы, предусмотренные статьей 1 приложения № С13 к Правилам клиринга.

- 31.3.2. Для заключения Договора владелец Счета ФОРТС, являющийся нерезидентом, представляет в Клиринговый центр документы, предусмотренные статьей 2 приложения № С13 к Правилам клиринга.
- 31.4. Ценные бумаги, учитываемые на Счете ФОРТС, учитываются Клиринговым центром на разделе депо регистра обеспечения, за которым закреплен данный Счет ФОРТС.
- 31.5. Владелец Счета ФОРТС должен, а Участник клиринга или Доверенный владелец счетов вправе направить в Клиринговый центр указание на Участника клиринга / Доверенного владельца счетов, определяющее, за каким разделом депо регистра обеспечения может быть закреплен данный Счет ФОРТС в соответствии со следующими условиями:
- указание Участника клиринга означает, что Счет ФОРТС может быть закреплен за разделом депо регистра обеспечения, имеющего код обычной или Выделенной Брокерской фирмы, зарегистрированной данным Участником клиринга.
 - указание Доверенного владельца счетов означает, что Счет ФОРТС может быть закреплен за разделом депо регистра обеспечения, имеющего код Обособленной Брокерской фирмы, за которой закреплен данный Доверенный владелец счетов.
 - указание Участника клиринга / Доверенного владельца счетов осуществляется путем подачи в Клиринговый центр заявления установленной Клиринговым центром формы.
- 31.6. Счет ФОРТС, владельцем которого является Участник клиринга, и для которого отсутствует указание Участника клиринга или Доверенного владельца счетов, может быть закреплен за разделом депо регистра обеспечения, имеющего код обычной или Выделенной Брокерской фирмы, зарегистрированной данным Участником клиринга.
- Счет ФОРТС, владельцем которого является Доверенный владелец счетов, и для которого отсутствует указание Участника клиринга или Доверенного владельца счетов, может быть закреплен за разделом депо регистра обеспечения, имеющего код Обособленной Брокерской фирмы, за которой закреплен данный Доверенный владелец счетов.
- 31.7. Закрепление Счета ФОРТС осуществляется Клиринговым центром на основании заявления установленной Клиринговым центром формы, подаваемого Участником клиринга или Доверенным владельцем счетов в соответствии со следующими условиями:
- 31.7.1. Заявление на закрепление Счета ФОРТС за разделом депо регистра обеспечения с кодом обычной или Выделенной Брокерской фирмы вправе подавать Участник клиринга, зарегистрировавший указанные Брокерские фирмы. Заявление на закрепление Счета ФОРТС за разделом депо регистра обеспечения с кодом Обособленной Брокерской фирмы вправе подавать Доверенный владелец счетов, закрепленный за данной Обособленной Брокерской фирмой.
- 31.7.2. Счет ФОРТС может быть закреплен только за одним разделом депо регистра обеспечения.

- 31.8. Клиринговый центр для каждого Счета ФОРТС осуществляет учет Участника клиринга или Доверенного владельца счетов, имеющего право подавать заявление на закрепление данного Счета ФОРТС за разделом депо регистра обеспечения.
- 31.9. Аннулирование закрепления Счета ФОРТС за разделом депо регистра обеспечения осуществляется Клиринговым центром на основании заявления установленной Клиринговым центром формы, подаваемого лицом, имеющим право подавать заявление на закрепление данного Счета ФОРТС, при отсутствии на Счете ФОРТС ценных бумаг, учитываемых Клиринговым центром в качестве Средств гарантийного обеспечения. Клиринговый центр вправе аннулировать закрепление Счета ФОРТС за разделом депо регистра обеспечения при отсутствии на данном Счете ФОРТС ценных бумаг, учитываемых Клиринговым центром в качестве Средств гарантийного обеспечения, без указанного заявления.
- 31.10. Расчетный депозитарий в установленные Регламентом сроки предоставляет в Клиринговый центр информацию о состоянии Счетов ФОРТС и об остатках ценных бумаг на Счетах ФОРТС.
- 31.11. Учет ценных бумаг в качестве Средств гарантийного обеспечения и операций с ними осуществляется Клиринговым центром в порядке, установленном приложением № Ф2 к Правилам клиринга.
- 31.12. При получении информации об обстоятельствах, которые могут привести к ограничению или изменению порядка проведения операций с ценными бумагами, являющимися Средствами гарантийного обеспечения, в соответствии с Правилами клиринга, Клиринговый центр вправе потребовать от данного Участника клиринга замены ценных бумаг денежными средствами в порядке, установленном приложением Ф2 к Правилам клиринга.

Статья 32. Порядок передачи информации Организатору торговли

- 32.1. Ежедневно, перед началом Торгового дня Клиринговый центр передает Организатору торговли:
- а) список клиентов, зарегистрированных на момент передачи указанного списка;
 - б) значения лимитов;
 - в) дополнительные параметры.
- 32.1.1. Порядок установления и изменения значений лимитов определен в приложении № С14 к Правилам клиринга.
- 32.1.2. Значения Торговых лимитов для каждого Участника клиринга, которому присвоен код (коды) Расчетной фирмы, передаются Организатору торговли по каждому присвоенному ему коду Расчетной фирмы и каждому коду Брокерской фирмы.
- 32.2. Дополнительными параметрами, передаваемыми Организатору торговли, оказывающему услуги, способствующие заключению Срочных контрактов и/или Сделок T+N, являются:
- перечень разделов клиринговых регистров по каждой Расчетной фирмы;
 - объем обязательств, учитываемых на каждом разделе регистра учета позиций;

- Гарантийное обеспечение, рассчитанное по каждому разделу регистра учета позиций, по каждой Брокерской фирме и по каждой Расчетной фирме;
- сумма денежных средств в рублях Российской Федерации, учитываемых в качестве Средств гарантийного обеспечения, по группе разделов денежного регистра, имеющих одинаковый код Брокерской фирмы ($\sum_i M_i$) (далее – Брокерский лимит);
- сумма оценочной стоимости ценных бумаг, учитываемых в качестве Средств гарантийного обеспечения, суммарно по группе разделов депо регистра обеспечения, имеющих одинаковый код Брокерской фирмы, и сумма оценочной стоимости иностранной валюты, учитываемой в качестве Средств гарантийного обеспечения, суммарно по группе разделов денежных регистров, имеющих одинаковый код Брокерской фирмы ($\sum_i S_i$);

где

M_i – денежные средства, учитываемые на i -м разделе денежного регистра,

S_i – оценочная стоимость ценных бумаг, учитываемых в качестве Средств гарантийного обеспечения на i -м разделе депо регистра обеспечения и оценочная стоимость иностранной валюты, учитываемой в качестве Средств гарантийного обеспечения на i -м разделе денежного регистра (суммирование осуществляется по всем разделам, входящим в группу);

- Лимит колебаний цен сделок в ходе одного Расчетного периода для каждого фьючерсного контракта / ценной бумаги,
- Базовый размер гарантийного обеспечения для каждого фьючерсного контракта / ценной бумаги,
- Нижний и Верхний лимиты колебаний цен каждого фьючерсного контракта / ценной бумаги;
- Расчетная цена каждой ценной бумаги, если Организатор торговли не осуществляет определение Расчетных цен ценных бумаг.

32.2.1. По итогам дневной клиринговой сессии Клиринговый центр передает Организатору торговли:

- объем обязательств, учитываемых на каждом разделе регистра учета позиций;
- Гарантийное обеспечение, рассчитанное по каждому разделу регистра учета позиций, по каждой Брокерской фирме и по каждой Расчетной фирме;
- изменение суммы денежных средств в рублях Российской Федерации, учитываемых в качестве Средств гарантийного обеспечения, по группе разделов денежного регистра, имеющих одинаковый код Брокерской фирмы;
- изменение размера оценочной стоимости ценных бумаг, учитываемых в качестве Средств гарантийного обеспечения, суммарно по группе разделов депо регистра обеспечения, имеющих одинаковый код Брокерской фирмы, и оценочной стоимости иностранной валюты, учитываемой в качестве Средств гарантийного обеспечения, суммарно по группе разделов денежных регистров, имеющих одинаковый код Брокерской фирмы;
- Лимит колебаний цен сделок в ходе одного Расчетного периода для каждого фьючерсного контракта / ценной бумаги,

- Базовый размер гарантийного обеспечения для каждого фьючерсного контракта / ценной бумаги,
- Нижний и Верхний лимиты колебаний цен каждого фьючерсного контракта / ценной бумаги;
- изменение значения Торговых лимитов для каждой Расчетной фирмы и Брокерской фирмы;
- Расчетную цену каждой ценной бумаги, если Организатор торговли не осуществляет определение Расчетных цен ценных бумаг.

32.2.2. В случае изменения значений Торгового лимита или дополнительных параметров Клиринговый центр незамедлительно передает Организатору торговли указанные измененные значения.

32.3. Реквизиты документов, передаваемых Организатору торговли, и порядок их заполнения указаны в приложении № С8 и в приложении № Ф1 к Правилам клиринга.

Статья 33. Порядок взаимодействия с Организатором торговли в процессе объявления / удаления заявок и заключения сделок

33.1. Предусмотренный настоящей статьей порядок взаимодействия Клирингового центра с Организатором торговли применяется при объявлении Заявок с целью заключения Сделок с полным обеспечением, Срочных контрактов, Сделок T+N, .

33.2. При подаче участником торгов Заявки Организатор торговли направляет Клиринговому центру информацию о поданной Заявке.

33.3. Клиринговый центр направляет Организатору торговли отказ в объявлении поданной Заявки в случаях, установленных Правилами клиринга.

33.4. При получении информации о поданной Заявке с целью заключения Сделки с полным обеспечением Клиринговый центр немедленно в порядке, определенном в приложении № С14 к Правилам клиринга, проверяет, что объявление Заявки не приведет к превышению лимитов. При получении информации о поданной Заявке с целью заключения Срочной сделки, Сделки T+N Клиринговый центр немедленно проверяет, что объявление Заявки не приведет к нарушению условий, определенных в приложении № С14 к Правилам клиринга.

33.5. В случае положительного результата проверки, указанной в пункте 33.4 настоящей статьи, Клиринговый центр направляет Организатору торговли подтверждение возможности объявления Заявки, в случае отрицательного результата - отказ в объявлении Заявки.

33.6. В ходе вечерней клиринговой сессии, после выполнения всех операций, изменяющих регистры учета позиций, денежные регистры, депо регистр обеспечения, Клиринговый центр проверяет для каждой Активной заявки, поданной от имени Участника клиринга с указанием кода Расчетной фирмы, соблюдение условий возможности объявления Заявок, предусмотренных приложением № С14 к Правилам клиринга. При отрицательном результате проверки Клиринговый центр направляет Организатору торговли уведомление о необходимости удаления данной Активной заявки.

- 33.6.1. Клиринговый центр направляет Организатору торговли уведомление о необходимости удаления Активной заявки в иных случаях, установленных Правилами клиринга.
- 33.7. Организатор торговли незамедлительно сообщает Клиринговому центру об отзыве / удалении Активной заявки.
- 33.8. По лучшей Активной заявке Участника торгов, в отношении которой отсутствует встречная Заявка, Клиринговый центр вправе направить участнику торгов, подавшему данную Заявку, сообщение о принятии адресованных ему оферт, сделанных посредством объявления такой Заявки, с указанием количества ценных бумаг / количества Срочных контрактов.
- 33.9. По встречным Активным заявкам, для которых выполняются условия, установленные Правилами торговли Организатора торговли, Клиринговый центр направляет участникам торгов, подавшим данные Заявки, сообщение о принятии адресованных ему оферт, сделанных посредством объявления таких Заявок (заключает сделку).
- 33.10. Цена сделки купли-продажи ценных бумаг / заключенных Срочных контрактов и количество ценных бумаг / Срочных контрактов определяются в соответствии с Правилами торговли соответствующего Организатора торговли.
- 33.11. Реквизиты документов, получаемых от Организаторов торговли, указаны в приложении № С9 и в приложении № Ф1 к Правилам клиринга.

Статья 34. Порядок получения информации от Организатора торговли

- 34.1. При осуществлении клиринга с полным обеспечением и клиринга с частичным обеспечением Клиринговый центр использует информацию о сделках, получаемую от Организаторов торговли.
Данная информация передается Организаторами торговли в виде Реестра сделок с полным обеспечением, Реестра сделок T+N или Реестра срочных сделок.
- 34.1.1. Реестры сделок с полным обеспечением передаются Организаторами торговли по запросам Клирингового центра перед началом каждой расчетной клиринговой сессии и содержат информацию о сделках, заключенных с момента начала торгов (начала предыдущей расчетной клиринговой сессии) и до момента начала текущей расчетной клиринговой сессии (до момента окончания торгов).
- 34.2. Реестры срочных сделок и Реестр сделок T+N передаются Организаторами торговли Клиринговому центру перед началом каждой дневной и вечерней клиринговой сессии.
- 34.3. Перед началом каждой дневной и вечерней клиринговой сессии Организаторы торговли передают Клиринговому центру для каждого Срочного контракта / ценной бумаги расчетную цену без учета ограничений на отклонение от предыдущей расчетной цены и расчетную цену. Расчетная цена ценной бумаги передается Организатором торговли, если Организатор торговли осуществляет определение Расчетной цены ценной бумаги.

Статья 35. Порядок проведения по итогам клиринга расчетов в Расчетных депозитариях и Расчетных организациях

- 35.1. Для проведения расчетов по итогам клиринга Клиринговый центр направляет Сводную ведомость по обязательствам и требованиям по денежным средствам, реквизиты которой приведены в приложении № С6 к Правилам клиринга, Расчетной организации и Реестр поручений по итогам клиринга, реквизиты которого приведены в приложении № С4 к Правилам клиринга, Расчетному депозитарию.
- 35.2. Расчетная организация осуществляет исполнение полученной от Клирингового центра Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по денежным средствам (списание и зачисление денежных средств в размере и по торговым счетам, указанным Клиринговым центром).
- 35.2.1. Исполнение Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по денежным средствам может осуществляться Расчетной организацией с использованием Клирингового счета (если это предусмотрено режимом использования этого счета и договором между Клиринговым центром и Расчетной организацией).
- 35.2.2. После исполнения Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по денежным средствам Расчетная организация направляет Клиринговому центру Отчет об исполнении Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по денежным средствам, реквизиты которого приведены в приложении № С7 к Правилам клиринга.
- 35.3. Расчетный депозитарий осуществляет исполнение полученного от Клирингового центра Реестра поручений по итогам клиринга (списание и зачисление ценных бумаг в размере и по торговым счетам депо, указанным Клиринговым центром).
- 35.3.1. После исполнения Реестра поручений по итогам клиринга Расчетный депозитарий направляет Клиринговому центру Подтверждение исполнения расчетов, реквизиты которого приведены в приложении № С5 к Правилам клиринга.
- 35.4. После получения от Расчетной организации Отчета об исполнении Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по денежным средствам и от Расчетного депозитария Подтверждение исполнения расчетов:
- расчеты по обязательствам по сделкам клирингового пула считаются окончательными, а обязательства по сделкам клирингового пула - прекращенными зачетом встречных однородных требований, а в оставшейся части - надлежащим исполнением;
 - Клиринговый центр изменяет значения расчетных регистров на величину значения соответствующих им позиционных регистров;
 - Клиринговый центр устанавливает значения всех позиционных регистров равными нулю.
- 35.5. В случае невозможности исполнения полученной от Клирингового центра Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по денежным средствам, Расчетная организация направляет Клиринговому центру Отчет о неисполнении Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по денежным средствам, реквизиты которого приведены в приложении № С7 к Правилам клиринга. При этом Клиринговый центр вправе повторно сформировать и направить Расчетной

организации новую Сводную ведомость по обязательствам и требованиям по денежным средствам.

- 35.5.1. В случае невозможности исполнения Реестра поручений по итогам клиринга, Расчетный депозитарий направляет Клиринговому центру Сообщение о невозможности исполнения Реестра поручений по итогам клиринга, реквизиты которого приведены в приложении № С5 к Правилам клиринга. При этом Клиринговый центр вправе повторно сформировать и направить Расчетному депозитарию новый Реестр поручений по итогам клиринга.
- 35.6. До момента завершения расчетов по сделкам, в случае получения от Расчетной организации Отчета о неисполнении Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по денежным средствам и/или в случае получения от Расчетного депозитария Сообщение о невозможности исполнения Реестра поручений по итогам клиринга, Клиринговый центр направляет Расчетной организации Распоряжение на отмену Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по денежным средствам, реквизиты которого приведены в приложении № С6 к Правилам клиринга, и/или Расчетному депозитарию Реестр поручений по итогам клиринга, реквизиты которого приведены в приложении № С4 к Правилам клиринга, содержащий поручения, обратные поручениям из ранее направленного Реестра поручений по итогам клиринга.
- 35.6.1. В случае отправки Реестра поручений по итогам клиринга и/или Распоряжения на отмену Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по денежным средствам в соответствии с пунктом 35.6 Правил клиринга, Клиринговый центр совместно с Расчетными депозитариями и Расчетной организацией предпринимает меры по скорейшему выяснению причин возникновения ошибки и устранению ее последствий.
- 35.6.2. Если невозможность исполнения расчетов обусловлена ошибкой, допущенной Клиринговым центром, и это привело к недостаточности средств на торговых счетах Участников клиринга для исполнения обязательств по сделкам клирингового пула, то для исправления последствий этой ошибки могут использоваться собственные средства Клирингового центра и средства Гарантийного фонда рынка ценных бумаг или средства Гарантийного фонда срочного рынка в случаях и порядке, установленных Положением о гарантийных фондах.
- 35.6.3. Если ошибка допущена одним из Расчетных депозитариев или Расчетной организацией, то Клиринговый центр повторно проводит расчетную клиринговую сессию по сделкам, ранее включенным в клиринговый пул, но не исполненным по причине возникшей ошибки.

ПОДРАЗДЕЛ III-IV. КЛИРИНГОВЫЕ СЕССИИ

Статья 36. Порядок проведения клиринговых сессий

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

- дневную клиринговую сессию;
- вечернюю клиринговую сессию;
- одну или несколько расчетных клиринговых сессий.

Обязательства, включенные в клиринговый пул расчетной клиринговой сессии, прекращаются (исполнением, зачетом или отступным) в ходе проведения данной расчетной клиринговой сессии.

36.1.1. Расчетные клиринговые сессии могут проводиться Клиринговым центром несколько раз в течение Расчетного дня. Каждая последующая расчетная клиринговая сессия может начинаться только после окончания предыдущей расчетной клиринговой сессии. Временной регламент проведения расчетных клиринговых сессий установлен Регламентом.

36.2. В ходе расчетной клиринговой сессии Клиринговый центр:

- 1) определяет подлежащие исполнению обязательства на основании обязательств / сделок, включенных в клиринговый пул;
- 2) проверяет наличие количества ценных бумаг и суммы денежных средств, достаточных для исполнения обязательств по сделкам клирингового пула;
- 3) формирует поручения на проведение операций по торговым счетам с целью расчетов по исполняемым в ходе расчетной клиринговой сессии обязательствам и передает сформированные поручения в Расчетные депозитарии и Расчетные организации в соответствии со статьей 35;
- 4) на основании документов, полученных от Расчетных депозитариев и Расчетных организаций, выполняет действия, предусмотренные статьей 35 Правил клиринга.

36.3. По окончании расчетной клиринговой сессии значения всех позиционных регистров устанавливаются равными нулю.

36.4. Дневная и вечерняя клиринговые сессии проводятся Клиринговым центром в дни, когда хотя бы одним Организатором торговли в соответствии с Правилами торговли проводится Основная торговая сессия.

36.5. Дневная и вечерняя клиринговые сессии проводятся Клиринговым центром в сроки, установленные Регламентом.

36.6. В ходе дневной клиринговой сессии Клиринговый центр:

- 1) проводит исполнение опционных контрактов, в случаях, установленных Правилами клиринга;
- 2) изменяет учет обязательств по Срочным контрактам, Сделкам T+N на разделах регистра учета позиций при выполнении процедуры принудительного закрытия позиций;

- 3) определяет объем обязательств по Срочным контрактам, Сделкам T+N, подлежащих учету на каждом разделе регистра учета позиций Участника клиринга;
 - 4) определяет оценочную стоимость ценных бумаг и иностранных валют, составляющих Средства гарантийного обеспечения;
 - 5) для каждого Срочного контракта, Спецификацией которого предусмотрена уплата вариационной маржи, рассчитывает и перечисляет вариационную маржу;
 - 6) определяет расчетные цены ценных бумаг, в отношении которых могут заключаться Сделки T+N постольку, поскольку указанные расчетные цены не определяются Организатором торговли в соответствии с утвержденными им правилами;
 - 7) рассчитывает сумму Гарантийного перевода по Сделкам T+N и учитывает ее значение на разделе денежного регистра;
 - 8) по опционным контрактам, Спецификацией которых предусмотрена уплата премии, изменяет (увеличивает или уменьшает) значения денежных регистров Участников клиринга на суммы премий;
 - 9) осуществляет учет расторжения (прекращения) Срочных контрактов в соответствии с Правилами клиринга;
 - 10) изменяет (увеличивает или уменьшает) значения денежных регистров на суммы платежей, предусмотренных Правилами клиринга, Правилами торговли Организаторов торговли, и заключенными Клиринговым центром с Участниками клиринга, Организаторами торговли и иными лицами договорами, в случае если условиями таких договоров предусмотрено взимание Клиринговым центром с Участника клиринга сборов, комиссионных вознаграждений и иных платежей в пользу указанных лиц;
 - 11) изменяет учет обязательств по Срочным контрактам, Сделкам T+N на разделах регистра учета позиций на основании заявления Участника клиринга;
 - 12) устанавливает Лимит колебания цен сделок для каждого фьючерсного контракта / ценной бумаги в порядке, установленном приложением № Ф5 к Правилам клиринга;
 - 13) рассчитывает Гарантийное обеспечение;
 - 14) рассчитывает Торговый лимит;
 - 15) формирует отчеты для Участников клиринга, которым присвоен код (коды) Расчетной фирмы, и их клиентов.
- 36.7. В ходе вечерней клиринговой сессии Клиринговый центр кроме действий, перечисленных в пункте 36.6 настоящей статьи:
- 1) прекращает учет обязательств по опционным контрактам, дата исполнения которых наступила, и право требования по которым не осуществлено их Держателями;
 - 2) проводит исполнение расчетных Срочных контрактов с текущей датой исполнения;
 - 3) выполняет операции, предусмотренные Спецификациями поставочных Срочных контрактов, при их исполнении;

- 4) осуществляет перевод денежных средств, составляющих Средства гарантийного обеспечения, в Страховой фонд;
- 5) присваивает Участникам клиринга коды Расчетной фирмы и осуществляет регистрацию клиентов Участников клиринга с целью заключения за счет этих клиентов Срочных контрактов, Сделок T+N;
- 6) осуществляет открытие и закрытие разделов клиринговых регистров для Участников клиринга, которым присвоен код (коды) Расчетной фирмы.

ПОДРАЗДЕЛ III-V. ПОРЯДОК ОПРЕДЕЛЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ, ПОДЛЕЖАЩИХ ИСПОЛНЕНИЮ В ДНЕВНУЮ И ВЕЧЕРНЮЮ КЛИРИНГОВЫЕ СЕССИИ

Статья 37. Порядок определения подлежащих исполнению обязательств Участников клиринга по Срочным контрактам

37.1. Определение подлежащих исполнению Участником клиринга обязательств по Срочным контрактам осуществляется Клиринговым центром, исходя из заключенных Участником клиринга Срочных контрактов и объема обязательств по Срочным контрактам, заключенным ранее, учитываемых на разделах регистра учета позиций, открытых для Участника клиринга.

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

Каждая позиция по Срочным контрактам определяется:

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

Положение стороны и количество Срочных контрактов, учитываемых в составе позиции, определяются в предположении, что обязательства по указанным Срочным контрактам были расторгнуты (прекращены) как это определено далее в настоящем пункте Правил клиринга.

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

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

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

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

происходит также в результате прекращения обязательств по Срочным контрактам в порядке, установленном Правилами клиринга.

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

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

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

Статья 38. Вариационная маржа и премия

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

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

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

38.2. Для исполнения обязательства по уплате вариационной маржи Клиринговый центр изменяет (увеличивает или уменьшает) значение раздела денежного регистра, код которого совпадает с кодом раздела регистра учета позиций, на котором учтены обязательства по Срочному контракту.

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

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

38.4. Для исполнения обязательства Участника клиринга по уплате вариационной маржи и/или премии используются Средства гарантийного обеспечения.

38.5. Порядок исполнения обязательства / требования Участника клиринга по уплате / получению вариационной маржи / премии определен в статье 39 Правил клиринга.

Статья 39. Порядок исполнения обязательств по уплате вариационной маржи, премии, Гарантийного перевода, штрафов, пени, неустоек и комиссионных вознаграждений

39.1. Клиринговый центр зачитывает обязательство по уплате вариационной маржи, премии, Гарантийного перевода, штрафа, пени, неустойки, биржевого сбора, комиссионного вознаграждения, иного сбора или платежа, а также обязательство по оплате клиринговых услуг (далее – денежное обязательство) Участника клиринга, которому присвоен код (коды) Расчетной фирмы, возникшие по разделу регистра учета позиций, имеющему код обычной или Выделенной Брокерской фирмы, с требованием Участника клиринга по возврату Средств гарантийного обеспечения, учитываемым по разделу денежного регистра, код которого совпадает с кодом раздела регистра учета позиций, на котором учтена позиция по Срочным контрактам / Сделкам T+N, по которым возникло денежное обязательство.

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

39.2. Требование по получению вариационной маржи, премии, Гарантийного перевода, штрафов, пени, неустоек и комиссионного вознаграждения (далее – денежное требование) Участника клиринга, которому присвоен код (коды) Расчетной фирмы, возникшие по разделу регистра учета позиций, имеющему код обычной или Выделенной Брокерской фирмы, прекращается возникновением обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга Средств гарантийного обеспечения, учитываемого по разделу денежного регистра, код которого совпадает с кодом раздела регистра учета позиций, на котором учтена позиция по Срочным контрактам / Сделкам T+N, по которым возникло денежное требование.

При этом значение указанного раздела денежного регистра увеличивается на сумму денежного требования.

39.3. Денежное обязательство Участника клиринга, которому присвоен код Расчетной фирмы, возникшие по разделу регистра учета позиций, имеющему код Обособленной Брокерской фирмы, исполняются за счет Средств гарантийного обеспечения, внесенного Доверенным владельцем счетов, обязательства по возврату которых учитываются на разделе денежного регистра, код которого совпадает с кодом раздела регистра учета позиций, на котором учтена позиция по Срочным контрактам / Сделкам T+N, по которым возникло денежное обязательство.

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

39.4. Денежное обязательство Участника клиринга считается исполненным полностью или частично в момент изменения Клиринговым центром значения раздела денежного регистра, код которого совпадает с кодом раздела регистра учета позиций, на котором учтено указанное денежное обязательство, при условии, что в результате такого изменения не становится отрицательной:

- для раздела денежного регистра, имеющего код обычной Брокерской фирмы, - сумма денежных средств в рублях Российской Федерации, обязательства по возврату которых учитываются на всех разделах денежного регистра, имеющих

код обычных Брокерских фирм, имеющих код Расчетной фирмы, совпадающий с кодом Расчетной фирмы указанного раздела денежного регистра, уменьшенная на сумму неисполненных денежных обязательств, учитываемых по разделам регистра учета позиций, имеющих коды Выделенных или Обособленных Брокерских фирм, имеющих код указанной Расчетной фирмы;

- для раздела денежного регистра, имеющего код Выделенной Брокерской фирмы, - сумма денежных средств в рублях Российской Федерации, обязательства по возврату которых учитываются на всех разделах денежного регистра, имеющих код обычных Брокерских фирм и данной Выделенной Брокерской фирмы, имеющих код Расчетной фирмы, совпадающий с кодом Расчетной фирмы указанного раздела денежного регистра, уменьшенная на сумму неисполненных денежных обязательств, учитываемых по разделам регистра учета позиций, имеющих коды Выделенных или Обособленных Брокерских фирм, имеющих код указанной Расчетной фирмы;
- для раздела денежного регистра, имеющего код Обособленной Брокерской фирмы, - сумма денежных средств в рублях Российской Федерации, обязательства по возврату которых учитываются на всех разделах денежного регистра, имеющих код обычных Брокерских фирм и данной Обособленной Брокерской фирмы, имеющих код Расчетной фирмы, совпадающий с кодом Расчетной фирмы указанного раздела денежного регистра, уменьшенная на сумму неисполненных денежных обязательств, учитываемых по разделам регистра учета позиций, имеющих коды Выделенных или Обособленных Брокерских фирм, имеющих код указанной Расчетной фирмы.

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

При этом значение указанного раздела денежного регистра увеличивается на сумму денежного требования.

Статья 40. Гарантийный перевод

40.1. Сделки T+N учитываются Клиринговым центром в составе позиций после первого определения обязательства по перечислению Гарантийного перевода по данной позиции по Сделкам T+N в ходе дневной или вечерней клиринговой сессии.

Каждая позиция по Сделкам T+N определяется:

- ценной бумагой, являющейся предметом указанных Сделок T+N, датой исполнения обязательств по указанным сделкам, и кодом раздела регистра учета позиций, с указанием которого заключены указанные сделки (далее указанные Сделки T+N именуются Сделками T+N, составляющими позицию, указанный раздел регистра учета позиций именуется разделом регистра учета позиций, на котором учитывается позиция по Сделкам T+N);
- положением стороны (Покупатель или Продавец), которой является Участник клиринга и Клиринговый центр по обязательствам по передаче ценных бумаг по

Сделкам T+N, составляющим позицию (далее – сторона позиции по Сделкам T+N);

- количеством ценных бумаг, обязательства по передаче которых учитываются в составе позиции (далее – размер позиции по Сделкам T+N);
- суммой денежных средств в рублях Российской Федерации, соответствующей размеру обязательства по оплате ценных бумаг по Сделкам T+N, составляющим позицию.

Положение стороны, количество ценных бумаг и сумма денежных средств, учитываемых в составе позиции по Сделкам T+N, определяются с учетом закрытия позиций по Сделкам T+N, определенного далее в настоящем пункте Правил клиринга.

Сделка T+N является встречной сделкой по отношению к учитываемой позиции по Сделкам T+N, если в результате ее заключения размер позиции уменьшается и не изменяются стороны позиции (далее – закрытие позиции по Сделкам T+N). Закрытие позиции происходит также в результате прекращения обязательств по Сделкам T+N, составляющим позицию, в порядке, установленном Правилами клиринга.

Увеличение размера позиции в результате заключения Сделок T+N именуется открытием позиции по Сделкам T+N.

Две позиции по Сделкам T+N с одной ценной бумагой с одной датой исполнения обязательств являются противоположными, если по одной из них Участник клиринга является Покупателем, а по другой этот или иной Участник клиринга – Продавцом.

Обязательства по заключенной Сделке T+N и обязательства по позиции по Сделкам T+N с той же ценной бумагой с тем же сроком исполнения обязательств являются противоположными, если сторона, которой является Клиринговый центр в указанной Сделке T+N, и сторона, которой является Клиринговый центр в указанной позиции, являются противоположными. Обязательства по заключенной Сделке T+N и позиция по Сделкам T+N с той же ценной бумагой с тем же сроком исполнения обязательств являются однонаправленными, если сторона, которой является Клиринговый центр в указанной Сделке T+N, и сторона, которой является Клиринговый центр в указанной позиции, совпадают.

40.2. Клиринговым центром ведется также учет обязательств по возврату перечисленных Гарантийных переводов (в рублях Российской Федерации) между Участником клиринга и Клиринговым центром.

40.3. В ходе дневной и вечерней клиринговых сессий Клиринговый центр по каждой позиции по Сделкам T+N и по Сделкам T+N, подлежащим включению в состав позиции, определяет обязательства по уплате Гарантийного перевода следующим образом.

Клиринговый центр рассчитывает величину G по формуле:

$G = G_{\text{поз}} + \sum_i (S_i - S_{\text{пок}_i}) + \sum_i (S_{\text{прод}_i} - S_i), \text{ где:}$ $G_{\text{поз}} = (SP_i - SP_p), \text{ если Участник клиринга является Покупателем по позиции}$ $G_{\text{поз}} = (SP_p - SP_i), \text{ если Участник клиринга является Продавцом по позиции}$

$G_{\text{поз}}$	сумма Гарантийного перевода по позиции по Сделкам T+N
SP_t	Сумма позиции по текущей расчетной цене ценной бумаги
SP_p	Сумма позиции по предыдущей расчетной цене ценной бумаги
$S_{\text{покуп}_i}$	Сумма Сделки T+N (части Сделки T+N для сделки репо), в которой Участник клиринга является Покупателем, по цене заключения Сделки T+N
$S_{\text{прод}_i}$	Сумма Сделки T+N (части Сделки T+N для сделки репо), в которой Участник клиринга является Продавцом, по цене заключения Сделки T+N
S_t	Сумма Сделки T+N (части Сделки T+N для сделки репо) / по текущей расчетной цене ценной бумаги
Σ	Суммирование осуществляется по всем Сделкам T+N, заключенным в период, от окончания предшествующей дневной или вечерней клиринговой сессии до окончания текущей дневной или вечерней клиринговой сессии
Формула расчета суммы позиции: $SP_{t/p} = C_{t/p} * L * PL$, где $SP_{t/p}$ – сумма позиции по текущей / предыдущей расчетной цене; $C_{t/p}$ – текущая / предыдущая расчетная цена; L – размер лота; PL – количество лотов, составляющих позицию. Формула расчета суммы сделки (части сделки репо), за исключением второй части сделки репо, заключенной в Секторе рынка Standard ФБ ММВБ (далее в настоящем пункте – Сделка репо, заключенная на торгах): $S_{t/i} = C_{t/i} * L * SL$, где $S_{t/i}$ - суммы сделки (части сделки репо) по текущей расчетной цене / по цене заключения; $C_{t/i}$ – текущая расчетная цена / цена заключения; L – размер лота; SL – количество лотов, составляющих сделку (часть сделки репо). Формула расчета суммы второй части Сделки репо, заключенной на торгах: $S_2 = S_1 * (1 + R / 36500 * D)$, где S_2 - сумма второй части Сделки репо, заключенной на торгах; S_1 - сумма первой части Сделки репо, заключенной на торгах; R – ставка Сделки репо, заключенной на торгах; D – количество дней между днями исполнения обязательств по первой и второй частям Сделки репо, заключенной на торгах; Суммы сделок (частей сделок репо) и позиций, рассчитанные по указанным формулам, округляются с точностью до копеек по правилам математического округления	

Расчетная цена ценной бумаги определяется Клиринговым центром в порядке, установленном приложением № Ф7 к Правилам клиринга.

Если рассчитанная в соответствии с настоящим пунктом величина G отрицательная, у Участника клиринга возникает обязательство по уплате Гарантийного перевода Клиринговому центру в размере, равном абсолютному значению рассчитанной величины G . В этом случае значение раздела денежного регистра, код которого совпадает с кодом раздела регистра учета позиций, на котором учтены Сделки T+N, составляющие позицию, уменьшается на размер обязательства по уплате Гарантийного перевода.

Если рассчитанная в соответствии с настоящим пунктом величина G положительная, у Клирингового центра возникает обязательство по уплате Гарантийного перевода Участнику клиринга в размере, равном значению рассчитанной величины G. В этом случае значение указанного раздела денежного регистра увеличивается на размер обязательства по уплате Гарантийного перевода.

40.4. Для исполнения обязательства Участника клиринга по уплате Гарантийного перевода используются Средства гарантийного обеспечения.

40.5. Порядок исполнения обязательства / требования Участника клиринга по уплате / получению Гарантийного перевода определен в статье 39 Правил клиринга.

40.5.1. Обязательство Участника клиринга по уплате Гарантийного перевода считается исполненным, если размер указанного обязательства не больше, чем:

- сумма денежных средств в рублях Российской Федерации, обязательства по возврату которых учитываются на всех разделах денежного регистра, имеющих код обычных Брокерских фирм, имеющих код Расчетной фирмы, совпадающий с кодом Расчетной фирмы указанного раздела денежного регистра, если указанный раздел денежного регистра является разделом, имеющим код обычной Брокерской фирмы;
- сумма денежных средств в рублях Российской Федерации, обязательства по возврату которых учитываются на всех разделах денежного регистра, имеющих код обычных и Выделенных Брокерских фирм, имеющих код Расчетной фирмы, совпадающий с кодом Расчетной фирмы указанного раздела денежного регистра, если указанный раздел денежного регистра является разделом, имеющим код Выделенной Брокерской фирмы;
- сумма денежных средств в рублях Российской Федерации, обязательства по возврату которых учитываются на всех разделах денежного регистра, имеющих код обычных Брокерских фирм и Обособленной Брокерской фирмы, имеющих код Расчетной фирмы, совпадающий с кодом Расчетной фирмы указанного раздела денежного регистра, если указанный раздел денежного регистра является разделом, имеющим код Обособленной Брокерской фирмы.

40.6. Если после заключения Сделки T+N до момента исполнения по ней обязательств по поставке / оплате ценных бумаг Клиринговым центром не проводится дневной или вечерней клиринговой сессии, Клиринговый центр рассчитывает и учитывает обязательство по уплате Гарантийного перевода по указанной отдельной сделке в порядке, определенном пунктами 40.3 настоящей статьи.

При этом в качестве расчетной цены ценной бумаги используется расчетная цена, определенная в ходе ближайшей предыдущей дневной или вечерней клиринговой сессии.

Обязательства по уплате Гарантийного перевода, определенные в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга исполняются в ходе ближайшей дневной или вечерней клиринговой сессии.

40.7. Обязательства по возврату уплаченных Гарантийных переводов возникают в момент исполнения обязательств по уплате Гарантийных переводов в порядке, определенном настоящей статьей, в ходе дневной и вечерней клиринговых сессий.

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

Статья 41. Гарантийное обеспечение

- 41.1. Размер Гарантийного обеспечения (G) определяется на основании:

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

- 41.1.1. Гарантийное обеспечение по совокупности обязательств по Срочным контрактам, Сделкам T+N не может быть больше суммы Базовых размеров гарантийного обеспечения, установленных по каждому Срочному контракту / ценной бумаге из данной совокупности обязательств.

- 41.1.2. Клиринговый центр осуществляет расчет Гарантийного обеспечения:

- по совокупности обязательств по Срочным контрактам, Сделкам T+N, учитываемых на одном разделе регистра учета позиций (далее – Гарантийное обеспечение по разделу, G_R);
- по совокупности обязательств по Срочным контрактам, Сделкам T+N, учитываемых на группе разделов, имеющих одинаковый код Брокерской фирмы (далее – Гарантийное обеспечение по Брокерской фирме, G_B);
- по совокупности обязательств по Срочным контрактам, Сделкам T+N, учитываемых на группе разделов, имеющих одинаковый код Расчетной фирмы, как сумму Гарантийного обеспечения всех Брокерских фирм (далее – Гарантийное обеспечение по Расчетной фирме, $G = \sum_B G_B$).

- 41.1.3. Информация о Гарантийном обеспечении отражается Клиринговым центром в отчетах, предоставляемых по итогам дневной и вечерней клиринговой сессии в соответствии со статьей 28 Правил клиринга.

- 41.1.4. Базовый размер гарантийного обеспечения по Срочному контракту / ценной бумаге, за исключением опционных контрактов, рассчитывается на основании Лимита колебаний цен сделок, установленного для этого Срочного контракта / ценной бумаги.

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

- 41.1.5. Информация о Базовом размере гарантийного обеспечения по каждому Срочному контракту / ценной бумаге указывается Клиринговым центром в отчетах, предоставляемых Участникам клиринга, которым присвоены код (коды) Расчетной фирмы в соответствии со статьей 28 Правил клиринга, и публикуется на Сайте Клирингового центра .

- 41.2. Клиринговый центр осуществляет расчет Базового размера гарантийного обеспечения по каждому Срочному контракту / ценной бумаге, а также Гарантийного обеспечения по совокупности обязательств по Срочным

контрактам, Сделкам T+N в соответствии с принципами, утвержденными Клиринговым центром.

- 41.3. Участникам клиринга и их клиентам может быть предоставлена возможность самостоятельного расчета Гарантийного обеспечения с помощью специального программного обеспечения.
- 41.3.1. Принципы расчета Базового размера гарантийного обеспечения и Гарантийного обеспечения по совокупности обязательств по Срочным контрактам, Сделкам T+N указываются в описании к указанному специальному программному обеспечению.

Статья 42. Порядок возникновения и исполнения Маржинальных требований

- 42.1. Наличие у Участника клиринга Маржинального требования определяется следующим образом:

Рассчитывается величина SZ:

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

$\sum_B$ - суммирование по обычным Брокерским фирмам, зарегистрированным в рамках данной Расчетной фирмы;

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

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

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

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

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

Величины TL_R , TL_{OB} , TL_B , TL_{BA} являются величинами Торгового лимита, рассчитываемыми в соответствии с приложением № С14 к Правилам клиринга.

- 42.1.1. Величина SZ, рассчитываемая в целях определения наличия у Участника клиринга Маржинального требования, учитываемого по Расчетной фирме, рассчитывается на основании:
- в ходе дневной клиринговой сессии – на основании обязательств по Срочным контрактам, Сделкам T+N, учитываемых по Расчетной фирме, относящейся к Участнику клиринга, и Активных заявок, поданных от имени Участника клиринга с указанием кода Расчетной фирмы по состоянию на момент начала дневной клиринговой сессии;

- в ходе вечерней клиринговой сессии - на основании обязательств по Срочным контрактам, Сделкам T+N, учитываемых по Расчетной фирме.
- 42.2. Клиринговый центр вправе направлять информацию о возникновении Маржинального требования, учитываемого по Расчетной фирме, Доверенным владельцам счетов, закрепленным за Обособленными Брокерскими фирмами, открытыми в рамках Расчетной фирмы.
- 42.3. Маржинальное требование, учитываемое по Расчетной фирме и возникшее у Участника клиринга по итогам дневной или вечерней клиринговой сессии, должно быть исполнено Участником клиринга не позднее, чем за 45 (сорок пять) минут до начала ближайшей следующей дневной или вечерней клиринговой сессии.
- Клиринговый центр вправе продлить указанный срок исполнения Маржинального требования до начала ближайшей следующей дневной или вечерней клиринговой сессии, в случае невозможности предоставления Расчетной организацией / Расчетным депозитарием в Клиринговый центр информации о зачислении денежных средств на Счета Клирингового центра / Счета ФОРТС в соответствии с порядком, установленным Регламентом и договором между Клиринговым центром и Расчетной организацией / Расчетным депозитарием.
- 42.4. Маржинальное требование, учитываемое по Расчетной фирме, должно быть исполнено Участником клиринга путем перечисления денежных средств в российских рублях на Счет Клирингового центра в порядке, определенном статьей 30 Правил клиринга.
- 42.5. Маржинальное требование, учитываемое по Расчетной фирме, может быть также прекращено полностью или в части в случаях:
- внесения иностранной валюты и/или ценных бумаг в качестве Средств гарантийного обеспечения, приводящего к увеличению Торгового лимита;
 - изменения обязательств по Срочным контрактам, Сделкам T+N, приводящего к уменьшению Гарантийного обеспечения;
 - удаления Активных заявок, поданных от имени Участника клиринга с использованием кода Расчетной фирмы, приводящих к уменьшению Гарантийного обеспечения.
- 42.6. Маржинальное требование, учитываемое по Расчетной фирме и возникшее у Участника клиринга, считается прекращенным в момент времени, когда величина SZ, рассчитанная в соответствии с пунктом 42.1 Правил клиринга, станет неотрицательной ($SZ \geq 0$). При этом, для расчета Базового размера гарантийного обеспечения каждого Срочного контракта / ценной бумаги, на основании которого определяется размер Гарантийного обеспечения (G), используется значение Лимита колебания цен сделок (L), установленное в последнюю проведенную дневную или вечернюю клиринговую сессию.
- 42.7. В случае неисполнения Участником клиринга Маржинального требования, учитываемого по Расчетной фирме, в срок, установленный пунктом 42.3 Правил клиринга, Клиринговый центр:
- направляет Организатору торговли уведомление о необходимости приостановить возможность заключения Срочных контрактов, Сделок T+N от

имени такого Участника клиринга с указанием кодов обычных и Выделенных Брокерских фирм, а также Обособленных Брокерских фирм, по которым учитывается неисполненное Маржинальное требование, открытых в рамках Расчетной фирмы, по которой учитывается неисполненное Маржинальное требование;

- при наличии в торговой системе Организатора торговли Активных заявок, поданных от имени такого Участника клиринга с указанием кода обычной, или Выделенной, или Обособленной Брокерской фирмы, по которой учитывается неисполненное Маржинальное требование, открытых в рамках Расчетной фирмы, по которой учитывается неисполненное Маржинальное требование, Клиринговый центр направляет Организатору торговли поручение на их удаление.

Начиная с момента направления уведомления и при наличии позиций, учитываемых на разделах регистра учета позиций обычных, или Выделенных, или Обособленных Брокерских фирм, по которым учитывается неисполненное Маржинальное требование, открытых в рамках Расчетной фирмы, по которой учитывается неисполненное Маржинальное требование, Клиринговый центр применяет к Участнику клиринга, неисполнившему Маржинальное требование, процедуру принудительного закрытия позиций по коду Расчетной фирмы, по которой учитывается неисполненное Маржинальное требование, в порядке, установленном приложением № Ф5 к Правилам клиринга.

- 42.7.1. За применение к Участнику клиринга процедуры принудительного закрытия позиций при открытии / закрытии позиций по Срочным контрактам, Сделкам T+N с Участника клиринга взимается плата в размере, установленном приложением № Ф6 к Правилам клиринга.

Порядок исполнения обязательства Участника клиринга по уплате платы за применение к Участнику клиринга процедуры принудительного закрытия определен в статье 39 Правил клиринга.

- 42.8. В случае если у Участника клиринга, не исполнившего Маржинальное требование, учитываемое по Расчетной фирме, отсутствовали учитываемые Клиринговым центром позиции, указанные в пункте 42.7 Правил клиринга, или все указанные позиции были закрыты в результате процедуры принудительного закрытия, примененной Клиринговым центром к Участнику клиринга и при этом у Участника клиринга осталось неисполненное Маржинальное требование, учитываемое по Расчетной фирме, Клиринговый центр принимает решение:

- об использовании иностранной валюты, учитываемой в качестве Средств гарантийного обеспечения по данной Расчетной фирмы, и/или
- о переводе ценных бумаг, учитываемых в качестве Средств гарантийного обеспечения по данной Расчетной фирмы, на счет депо Клирингового центра в Расчетном депозитарии с целью исполнения Маржинального требования Участника клиринга, учитываемого по Расчетной фирме.

Порядок использования иностранной валюты и ценных бумаг для исполнения Маржинального требования Участника клиринга, учитываемого по Расчетной фирме, в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга определен приложением № Ф2 к Правилам клиринга.

- 42.9. Если в результате действий, указанных в пунктах 42.7, 42.8 Правил клиринга, Маржинальное требование Участника клиринга, учитываемое по Расчетной

фирме, будет исполнено (прекращено), Клиринговый центр направляет Организатору торговли уведомление о предоставлении возможности заключения Срочных контрактов, Сделок T+N от имени такого Участника клиринга с указанием кода такой Расчетной фирмы.

- 42.9.1. Если в результате действий, указанных в пунктах 42.7, 42.8 Правил клиринга, Маржинальное требование Участника клиринга, учитываемое по Обособленной Брокерской фирме, открытой в рамках Расчетной фирмы, по которой учитывалось неисполненное Маржинальное требование, будет исполнено (прекращено), а Маржинальное требование Участника клиринга, учитываемое по такой Расчетной фирме, не исполнено, Клиринговый центр направляет Организатору торговли уведомление о предоставлении возможности заключения Срочных контрактов, Сделок T+N от имени такого Участника клиринга с указанием кода такой Обособленной Брокерской фирмы.
- 42.10. Если после выполнения действий, указанных в пунктах 42.7, 42.8 настоящей статьи, у Участника клиринга осталось неисполненное Маржинальное требование, учитываемое по Расчетной фирме, то по решению Клирингового центра в ходе ближайшей следующей дневной или вечерней клиринговой сессии используются средства Страхового фонда в порядке, предусмотренном Положением о страховом фонде, являющимся приложением № Ф8 к Правилам клиринга.
- 42.11. При наличии позиций по Срочным контрактам, Сделкам T+N, учитываемых на разделах регистра учета позиций Обособленных Брокерских фирм, открытых в рамках Расчетной фирмы, по которой учитывается неисполненное Маржинальное требование Участника клиринга, указанные позиции должны быть закрыты Участником клиринга в течение двух Расчетных периодов, следующих за дневной или вечерней клиринговой сессией, в ходе которой были использованы средства Страхового фонда, за исключением обязательств по Срочным контрактам и Сделкам T+N, срок исполнения которых наступил.
- 42.12. В случае невыполнения требования, установленного пунктом 42.11 Правил клиринга, Клиринговый центр направляет Организатору торговли уведомление о необходимости приостановить возможность заключения Срочных контрактов, Сделок T+N от имени Участника клиринга с указанием кода Расчетной фирмы, по которой учитывается неисполненное Маржинальное требование.
- С момента направления указанного уведомления, Клиринговый центр осуществляет закрытие всех позиций по Срочным контрактам, Сделкам T+N, учитываемым на разделах регистра учета позиций Обособленных Брокерских фирм, открытых в рамках Расчетной фирмы, по которой учитывается неисполненное Маржинальное требование Участника клиринга, в порядке, установленном процедурой принудительного закрытия позиций, приведенной в приложении № Ф5 к Правилам клиринга.

ПОДРАЗДЕЛ III-VI. ПОРЯДОК ФОРМИРОВАНИЯ КЛИРИНГОВОГО ПУЛА

Статья 43. Общий порядок формирования клирингового пула

- 43.1. Для каждой расчетной клиринговой сессии формируется один клиринговый пул.
- 43.2. Порядок определения обязательств, подлежащих включению в клиринговый пул, и порядок их включения в клиринговый пул определяется в соответствующих статьях настоящего подраздела.

Статья 44. Порядок включения в клиринговый пул обязательств по Сделкам с полным обеспечением, Сделкам репо с полным обеспечением и Сделкам с отложенным исполнением

- 44.1. Сделками с полным обеспечением, Сделками репо с полным обеспечением и Сделками с отложенным исполнением, обязательства по которым подлежат включению в клиринговый пул расчетной клиринговой сессии, являются:
- Сделки с полным обеспечением, информация о которых содержится в Реестре сделок с полным обеспечением, полученном от Организатора торговли перед началом указанной расчетной клиринговой сессии;
 - Первые и Вторые части Сделок репо с полным обеспечением и Сделки с отложенным исполнением, поручения на клиринг во исполнение которых были поданы до момента начала указанной расчетной клиринговой сессии.

Статья 45. Порядок включения в клиринговый пул обязательств по Сделкам без предварительного обеспечения

- 45.1. Обязательствами по Сделкам без предварительного обеспечения, подлежащими включению в клиринговый пул, являются обязательства по Сделкам без предварительного обеспечения, информация о которых содержится в неисполненных поручениях на клиринг с наступившей датой исполнения.
- 45.2. Клиринговый центр для каждого обязательства по Сделкам без предварительного обеспечения, подлежащего включению в клиринговый пул, изменяет в соответствии с приложением № С14 к Правилам клиринга значения регистров поставки, соответствующих торговым счетам, указанным в поручении на клиринг, и Лимитов по таким торговым счетам на количество ценных бумаг / сумму денежных средств, необходимую для исполнения обязательств по Сделке без предварительного обеспечения, если такое изменение не приведет к превышению Лимитов по торговым счетам.
- 45.2.1. При этом сумма платежа по поручению на клиринг принимается равной сумме сделки, указанной в поручении на клиринг, если валюта сделки совпадает с валютой платежа, или рассчитывается, как сумма сделки, указанная в поручении на клиринг, умноженная на курс пересчета валюты сделки в валюту платежа, взятый по правилу определения курса пересчета валют, указанному в поручении на клиринг, в случае если валюта сделки отличается от валюты платежа.
- 45.3. Клиринговый центр проверяет достаточность ценных бумаг и денежных средств, учитываемых на регистрах поставки, для исполнения обязательств по Сделке без предварительного обеспечения, подлежащей включению в клиринговый пул.

- 45.4. При отрицательном результате проверки, указанной в пункте 45.3 настоящей статьи, хотя бы для одного из торговых счетов, Клиринговый центр не включает обязательства по Сделке без предварительного обеспечения в клиринговой пул.
- 45.5. В случае положительного результата проверки, указанной в пункте 45.3 настоящей статьи, Клиринговый центр включает в клиринговый пул ближайшей расчетной клиринговой сессии обязательства по Сделке без предварительного обеспечения, подлежащие включению в клиринговый пул.
- 45.6. Клиринговый центр по каждому обязательству по Сделкам без предварительного обеспечения, включенному и не включенному в клиринговый пул, изменяет значения регистров поставки, и Лимиты в порядке, определенном приложением № С14 к Правилам клиринга для завершения формирования клирингового пула.

Статья 46. Порядок включения в клиринговый пул обязательств по сделкам продажи акций открытых акционерных обществ, находящихся в государственной или муниципальной собственности

- 46.1. Данной статьей определяется порядок обмена документами и информацией между Клиринговым центром и ОАО «СПБ» с целью включения в клиринговый пул обязательств по сделкам продажи акций открытых акционерных обществ, находящихся в государственной или муниципальной собственности, заключенных на торгах указанного Организатора торговли.
- 46.2. Торговые счета, используемые для расчетов по сделкам продажи акций открытых акционерных обществ, находящихся в государственной и муниципальной собственности, должны быть зарегистрированы в Клиринговом центре в качестве торговых счетов, а их владельцы - в качестве Участников клиринга или их клиентов в соответствии с требованиями Правил клиринга.
- 46.3. ОАО «СПБ» направляет Клиринговому центру информацию о количестве ценных бумаг / суммах денежных средств, необходимых для заключения сделок продажи акций открытых акционерных обществ, находящихся в государственной или муниципальной собственности, в виде Реестра поручений на блокировку активов (приложение № С9 к Правилам клиринга).
- 46.4. Клиринговый центр изменяет в соответствии с приложением № С14 к Правилам клиринга значения регистров поставки, соответствующих торговым счетам, указанным в Реестре поручений на блокировку активов, и Лимитов по таким торговым счетам на количество ценных бумаг (сумму денежных средств), указанную в Реестре поручений на блокировку активов, если такое изменение не приведет к превышению Лимитов по торговым счетам, либо на максимально возможное количество ценных бумаг (сумму денежных средств), не приводящую к превышению Лимитов по торговым счетам.
- 46.5. Клиринговый центр направляет ОАО «СПБ» информацию о количестве ценных бумаг / суммах денежных средств, учитываемых на регистрах поставки, в виде Реестра зарезервированных активов (приложение № С8 к Правилам клиринга).
- 46.6. ОАО «СПБ» в порядке, определенном Правилами проведения торгов ценными бумагами ОАО «СПБ», регистрирует сделки с акциями открытых акционерных

обществ, находящихся в государственной или муниципальной собственности, и направляет Клиринговому центру Реестр сделок по итогам аукциона (приложение № С9 к Правилам клиринга).

46.7. После получения Реестра сделок по итогам аукциона в соответствии с пунктом 46.6 настоящей статьи Клиринговый центр проверяет полученный реестр:

- на предмет соответствия требованиям, предъявляемым Клиринговым центром к форме и содержанию Реестра сделок по итогам аукциона;
- на заключение сделок в пределах количества ценных бумаг / сумм денежных средств, полученных от Клирингового центра в соответствии с пунктом 46.5 настоящей статьи,

и направляет ОАО «СПБ» Ведомость выявленных ошибок в Реестре сделок по итогам аукциона (приложение № С9 к Правилам клиринга).

46.7.1. В случае наличия хотя бы одной ошибки в Реестре сделок по итогам аукциона, Клиринговый центр не принимает весь Реестр сделок по итогам аукциона.

46.8. При наличии ошибок в Реестре сделок по итогам аукциона ОАО «СПБ» вправе повторно сформировать и направить в Клиринговый центр Реестр сделок по итогам аукциона.

46.9. В случае отправки ОАО «СПБ» Ведомости выявленных ошибок в Реестре сделок по итогам аукциона в соответствии с пунктом 46.7 настоящей статьи, не содержащей информации об ошибках, Клиринговый центр включает в клиринговый пул ближайшей расчетной клиринговой сессии обязательства по сделкам, информация о которых содержится в Реестре сделок по итогам аукциона, а также изменяет значения регистров поставки, и Лимиты в порядке, определенном приложением № С14 к Правилам клиринга для завершения формирования клирингового пула.

Статья 47. Порядок включения в клиринговый пул Обязательств по поставке

47.1. Настоящей статьей определяется порядок включения в клиринговый пул Обязательств по поставке по поставочным Срочным контрактам, базовым активом которых являются ценные бумаги, с которыми в день исполнения невозможно заключение сделок в Секторе рынка Standard ФБ ММВБ и перевод которых при исполнении указанных контрактов в соответствии с их Спецификацией осуществляется по указанию Клирингового центра (далее - поставочные Срочные контракты фондового рынка).

47.2. Определение Обязательств по поставке, подлежащих включению в клиринговый пул, осуществляется Клиринговым центром в соответствии со статьей 59 Правил клиринга.

47.3. Включение в клиринговый пул Обязательств по поставке, подлежащих включению в клиринговый пул, осуществляется в сроки, установленные Регламентом (приложение № Ф1 к Правилам клиринга).

47.4. Необходимыми условиями включения в клиринговый пул Обязательства по поставке, подлежащего включению в клиринговый пул, за исключением случаев, предусмотренных пунктом 47.5 настоящей статьи, являются:

- 1) Наличие у Клирингового центра по каждому разделу регистра учета позиций, на котором учитываются Обязательства по поставке, информации о номере торгового счета депо и номере денежного торгового счета (далее – торговые счета, закрепленные за разделом), через которые будет осуществляться исполнение указанных обязательств. Данная информация предоставляется Участником клиринга либо при открытии раздела клиринговых регистров, либо в дальнейшем, путем подачи соответствующего заявления в порядке и сроки, установленные Регламентом.
- 2) Соответствие торговых счетов, закрепленных за разделом, на котором учитываются Обязательства по поставке, требованиям, установленным статьями 23, 24 Правил клиринга.

Указанные условия должны выполняться на момент начала соответствующего этапа формирования клирингового пула.

Обязательства по поставке, не удовлетворяющие указанным условиям, за исключением случаев, предусмотренных пунктом 47.5 настоящей статьи, исключаются из Обязательств по поставке, подлежащих включению в клиринговый пул.

47.5. Если для позиции Продавца (Подписчика) и позиции Покупателя (Держателя) по поставочному Срочному контракту с одним кодом, учитываемых по одной Расчетной фирме на разных разделах регистра учета позиций, выполняются одновременно следующие условия:

- оба раздела регистра учета позиций являются либо собственными, открытыми одному и тому же Участнику клиринга, либо клиентскими, открытыми одному и тому же клиенту Участника клиринга;
- у Клирингового центра отсутствует информация о торговых счетах, закрепленных за разделами, или торговые счета, закрепленные за разделами, совпадают;

то такие Обязательства по поставке включаются в клиринговый пул.

47.6. Обязательства по поставке, подлежащие включению в клиринговый пул и не включенные в клиринговый пул в соответствии с пунктом 47.5 настоящей статьи, включаются в клиринговый пул в порядке, определенном в пунктах 47.7-47.14 настоящей статьи.

47.7. Клиринговый центр для каждого торгового счета, закрепленного за разделом, на котором учитываются Обязательства по поставке, подлежащие включению в клиринговый пул, изменяет в соответствии с приложением № С14 к Правилам клиринга значения регистра поставки, открытого для торгового счета, и Лимита по такому торговому счету на количество ценных бумаг / сумму денежных средств, необходимую для исполнения указанных обязательств, если такое изменение не приведет к превышению Лимита по торговому счету, либо на максимально возможное количество ценных бумаг / сумму денежных средств, не приводящую к превышению Лимита по торговому счету.

47.8. По всем Обязательствам по поставке, подлежащим включению в клиринговый пул, Клиринговый центр для каждого торгового счета депо и денежного торгового счета, закрепленного за разделом, на котором учитываются Обязательства по поставке, рассчитывает итоговое количество ценных бумаг или итоговую сумму

денежных средств, которые должны быть списаны с торгового счета или зачислены на торговый счет.

- 47.9. Для всех торговых счетов, закрепленных за разделами, на которых учитываются Обязательства по поставке, подлежащие включению в клиринговый пул, Клиринговый центр проверяет соблюдение следующего условия: итоговое количество ценных бумаг или итоговая сумма денежных средств, которые должны быть списаны с торгового счета, рассчитанные в соответствии с пунктом 47.8 настоящей статьи, не должны превышать количества ценных бумаг / суммы денежных средств, учитываемых на регистре поставки, открытом для такого торгового счета.
- 47.10. В случае если условие, указанное в пункте 47.9 настоящей статьи, не соблюдается хотя бы для одного торгового счета, Клиринговый центр определяет необеспеченные активами на торговом счете Обязательства по поставке, расчеты по которым должны быть проведены с использованием этого торгового счета, и исключает данные обязательства из Обязательств по поставке, подлежащих включению в клиринговый пул.
- 47.10.1. После выполнения действий, указанных в пункте 47.10 настоящей статьи, Клиринговый центр последовательно повторяет действия, описанные в пунктах 47.8-47.10 настоящей статьи.
- 47.11. В случае если условие, указанное в пункте 47.9 настоящей статьи, соблюдается для всех торговых счетов, Клиринговый центр по всем Обязательствам по поставке, подлежащим включению в клиринговый пул, рассчитывает итоговое количество ценных бумаг и итоговую сумму денежных средств, которые должны быть зачислены на торговые счета.
- 47.12. Клиринговый центр проверяет соблюдение следующего условия: итоговое количество ценных бумаг и итоговая сумма денежных средств, которые должны быть зачислены на торговые счета, рассчитанные в соответствии с пунктом 47.11 настоящей статьи, не должны превышать суммы количества ценных бумаг / суммы денежных средств, которые должны быть списаны с торговых счетов, рассчитанных в соответствии с пунктом 47.8 Правил клиринга, и количества ценных бумаг / суммы денежных средств, учитываемых на торговых счетах Клирингового центра.
- 47.13. В случае если условие, указанное в пункте 47.12 настоящей статьи, не соблюдается, Клиринговый центр:
- определяет необеспеченные активами на торговых счетах Клирингового центра Обязательства по поставке, подлежащие включению в клиринговый пул, и исключает данные обязательства из Обязательств по поставке, подлежащих включению в клиринговый пул;
 - последовательно повторяет действия, указанные в пунктах 47.8-47.13 настоящей статьи.
- 47.14. В случае если условие, указанное в пункте 47.12 настоящей статьи, соблюдается, Клиринговый центр включает в клиринговый пул ближайшей расчетной клиринговой сессии Обязательства по поставке, подлежащие включению в клиринговый пул, а также изменяет значения, учитываемые на регистрах

поставки, и Лимиты в порядке, определенном приложением № С14 к Правилам клиринга для завершения формирования клирингового пула.

Статья 48. Порядок формирования клирингового пула для исполнения обязательств по Сделкам T+N

48.1. Подлежащими включению в клиринговый пул являются:

- обязательства по Сделкам T+N с наступившей датой исполнения,
- обязательства по возврату перечисленных Гарантийных переводов по Сделкам T+N, определенные в статье 39 Правил клиринга с наступившей датой исполнения,

далее указанные обязательства вместе именуются Обязательства по Сделкам T+N, подлежащие включению в клиринговый пул.

Указанный клиринговый пул именуется клиринговым пулом по Сделкам T+N.

Формирование клирингового пула по Сделкам T+N осуществляется в срок, установленный Регламентом.

48.2. Клиринговый центр для каждого раздела регистра учета позиций, на котором учитываются Обязательства по Сделкам T+N, подлежащие включению в клиринговый пул, проверяет на момент начала формирования клирингового пула:

- 1) наличие информации о номере торгового счета депо и номере денежного торгового счета (далее – торговые счета, закрепленные за разделом), через которые будет осуществляться исполнение указанных обязательств. Данная информация предоставляется Участником клиринга либо при открытии раздела клиринговых регистров, либо в дальнейшем, путем подачи соответствующего заявления в порядке и сроки, установленные Регламентом;
- 2) соответствие торговых счетов, закрепленных за разделом, требованиям, установленным статьями 23, 24 Правил клиринга.

Разделы регистра учета позиций, прошедшие указанную проверку, именуются разделами с торговыми счетами. Разделы регистра учета позиций, не прошедшие указанную проверку, именуются разделами без торговых счетов.

48.3. По каждой Расчетной фирме Клиринговый центр рассчитывает итоговое количество ценных бумаг или итоговую сумму денежных средств, подлежащую списанию или зачислению по Обязательствам по Сделкам T+N, подлежащим включению в клиринговый пул, учитываемым на разделах без торговых счетов.

48.4. По всем Обязательствам по Сделкам T+N, подлежащим включению в клиринговый пул, учитываемым на разделах с торговыми счетами, Клиринговый центр для каждого торгового счета депо и денежного торгового счета, закрепленных за разделом, на котором учитываются указанные обязательства, рассчитывает итоговое количество ценных бумаг, итоговую сумму денежных средств в рублях Российской Федерации, которые должны быть списаны с торгового счета или зачислены на торговый счет.

48.5. Клиринговый центр для каждого торгового счета, закрепленного за разделом и удовлетворяющего требованиям статей 23, 24 Правил клиринга, на котором учитываются Обязательства по Сделкам T+N, подлежащие включению в клиринговый пул, изменяет в соответствии с приложением № С14 к Правилам

клиринга значения регистра поставки, открытого для торгового счета, и Лимита по такому торговому счету.

48.5.1. Участник клиринга вправе изменять значение регистра поставки для торгового счета. Увеличение значения регистра поставки для торгового счета осуществляется Участником клиринга через клиринговую систему. Уменьшение значения регистра поставки для торгового счета осуществляется Клиринговым центром на основании заявления установленной Клиринговым центром формы, подаваемого Участником клиринга в Клиринговый центр.

48.6. Клиринговый центр проверяет соблюдение следующих условий:

- 1) Итоговое количество ценных бумаг или итоговая сумма денежных средств в рублях Российской Федерации, которые должны быть списаны с торгового счета, рассчитанные в соответствии с пунктом 48.4 настоящей статьи, не должны превышать количества ценных бумаг / суммы денежных средств в рублях Российской Федерации, учитываемых на регистре поставки, открытом для такого торгового счета;
- 2) по каждой Расчетной фирме итоговое количество ценных бумаг и/или итоговая сумма денежных средств в рублях Российской Федерации, подлежащие списанию и/или зачислению, рассчитанные в соответствии с пунктом 48.3 настоящей статьи, должны быть равны нулю.

48.7. В случае если хотя бы одно из условий, указанных в пункте 48.6 настоящей статьи, не соблюдается, Клиринговый центр определяет не обеспеченные активами на торговом счете Обязательства по Сделкам T+N, подлежащие включению в клиринговый пул, и Обязательства по Сделкам T+N, подлежащие включению в клиринговый пул, учитываемые на разделах без торговых счетов (далее - Необеспеченные позиции Участников клиринга по сделкам T+N).

48.8. После выполнения действий, указанных в пункте 48.7 настоящей статьи, Клиринговый центр последовательно повторяет действия, описанные в пунктах 48.4-48.7 настоящей статьи, без учета Необеспеченных позиций Участников клиринга по сделкам T+N, ранее определенных в соответствии с пунктом 48.7 настоящей статьи.

48.9. В случае если условия, указанные в пункте 48.6 настоящей статьи, соблюдаются, Клиринговый центр:

- при наличии Необеспеченных позиций Участников клиринга по сделкам T+N заключает сделки репо и/или сделки купли-продажи ценных бумаг в соответствии с разделом V Правил клиринга;
- по каждой Необеспеченной позиции Участника клиринга по Сделкам T+N Участник клиринга обязан уплатить Клиринговому центру штраф в размере, установленном Клиринговым центром. Порядок исполнения обязательства Участника клиринга по уплате штрафа определен в статье 39 Правил клиринга;
- по всем Обязательствам по Сделкам T+N, подлежащим включению в клиринговый пул, рассчитывает итоговое количество ценных бумаг и итоговую сумму денежных средств, которые должны быть зачислены на торговые счета для исполнения указанных обязательств.

48.10. Клиринговый центр проверяет соблюдение следующего условия: итоговое количество ценных бумаг и итоговая сумма денежных средств, которые должны

быть зачислены на торговые счета, рассчитанные в соответствии с пунктом 48.9 настоящей статьи, не должны превышать суммы количества ценных бумаг / суммы денежных средств, которые должны быть списаны с торговых счетов, рассчитанных в соответствии с пунктом 48.4 Правил клиринга, и количества ценных бумаг / суммы денежных средств, учитываемых на торговых счетах Клирингового центра.

- 48.11. В случае если условие, указанное в пункте 48.10 настоящей статьи, не соблюдается, Клиринговый центр предпринимает действия в соответствии со статьей 50 Правил клиринга.
- 48.12. Если действия, предпринятые Клиринговым центром в соответствии со статьей 50 Правил клиринга, не приводят к соблюдению условия, указанного в пункте 48.10 настоящей статьи, Клиринговый центр:
- определяет необеспеченные активами на торговых счетах Клирингового центра Обязательства по Сделкам T+N (далее - Необеспеченные позиции Клирингового центра по сделкам T+N);
 - при наличии Необеспеченных позиций Клирингового центра по Сделкам T+N заключает сделки репо и/или сделки купли-продажи ценных бумаг в соответствии с разделом V Правил клиринга;
 - по каждой Необеспеченной позиции Клирингового центра по сделкам T+N начисляет Клиринговый центр обязан уплатить Участнику клиринга штраф в размере, установленном Клиринговым центром. Порядок исполнения требования Участника клиринга по получению штрафа определен в статье 39 Правил клиринга;
 - последовательно повторяет действия, указанные в пунктах 48.4-48.11 настоящей статьи.
- 48.13. В случае если условия, указанные в пунктах 48.10 настоящей статьи, соблюдаются, Клиринговый центр включает в клиринговый пул по Сделкам T+N ближайшей расчетной клиринговой сессии Обязательства по Сделкам T+N, подлежащие включению в клиринговый пул, а также изменяет значения регистров поставки, и Лимиты в порядке, определенном приложением № С14 к Правилам клиринга для завершения формирования клирингового пула. Обязательства по Сделкам T+N, включенные в клиринговый пул, не включаются в совокупность обязательств для расчета Гарантийного обеспечения.
- 48.14. В случае если Необеспеченные позиции Участника клиринга по Сделкам T+N по передаче одной и той же ценной бумаги, учитываемые на разделах регистра учета позиций обычных и Выделенных Брокерских фирм / Обособленной Брокерской фирмы, открытых / открытой в рамках одной Расчетной фирмы, возникают ежедневно в течение 6 (шести) Расчетных дней для ликвидной ценной бумаги или 10 (десяти) Расчетных дней для неликвидной ценной бумаги, то к Участникам клиринга, зарегистрировавшим указанные обычные и Выделенные Брокерские фирмы / Обособленную Брокерскую фирму, Клиринговым центром применяется процедура ликвидации позиций на продажу по Сделкам T+N с данной ценной бумагой по указанным обычным и Выделенным Брокерским фирмам / по указанной Обособленной Брокерской фирме в порядке, установленном статьей 49 Правил клиринга. Отнесение ценных бумаг к ликвидным или неликвидным осуществляется на основании решения ФБ ММВБ. В случае если по ценной

бумаги указанное решение не принято, то такая ценная бумага считается ликвидной.

- 48.14.1. Клиринговый центр вправе уменьшить срок, в течение которого могут возникать Необеспеченные позиции по Сделкам T+N, указанный в пункте 48.14 настоящей статьи, в случае, если ценная бумага исключена из списка ценных бумаг, по которым возможно заключение Сделок T+N.
- 48.15. В случае если Необеспеченные позиции Участника клиринга по Сделкам T+N по оплате ценных бумаг, учитываемые на разделах регистра учета позиций обычных и Выделенных Брокерских фирм / на разделах регистра учета позиций Обособленной Брокерской фирмы в рамках одной Расчетной фирмы, возникают ежедневно в течение 6 (шести) Расчетных дней, то к Участникам клиринга, зарегистрировавшим указанные обычные и Выделенные Брокерские фирмы / Обособленную Брокерскую фирму, Клиринговым центром применяется процедура ликвидации позиций на покупку по Сделкам T+N со всеми ценными бумагами по указанным обычным и Выделенным Брокерским фирмам / по указанной Обособленной Брокерской фирме в порядке, установленном статьей 49 Правил клиринга.

Статья 49. Процедуры ликвидации позиций по Сделкам T+N

- 49.1. Процедура ликвидации позиций на продажу / процедура ликвидации позиций на покупку по Сделкам T+N с ценной бумагой по обычным и Выделенным Брокерским фирмам / по Обособленной Брокерской фирме, открытым / открытой в рамках одной Расчетной фирмы (далее в настоящей статье - обычные и Выделенные Брокерские фирмы / Обособленная Брокерская фирма), осуществляется Клиринговым центром с момента окончания формирования клирингового пула по Сделкам T+N (далее в настоящей статье – момент начала процедуры). Участник клиринга, зарегистрировавший указанные обычные и Выделенные Брокерские фирмы / Обособленную Брокерскую фирму, именуется Участником клиринга - должником. В дальнейшем в настоящей статье под Сделками T+N понимаются Сделки T+N с указанной ценной бумагой.
- 49.2. С момента начала процедуры Клиринговый центр устанавливает запрет на объявление поданных Участником клиринга Заявок на заключение Сделок T+N с указанием кодов обычных и Выделенных Брокерских фирм / кода Обособленной Брокерской фирмы. При наличии в торговой системе Организатора торговли Активных заявок, поданных с указанием кодов обычных и Выделенных Брокерских фирм / кода Обособленной Брокерской фирмы, Клиринговый центр направляет Организатору торговли поручение на их удаление.
- 49.3. Моментом окончания процедуры ликвидации позиций на продажу является момент прекращения всех обязательств по передаче ценных бумаг по Сделкам T+N, учитываемых на разделах регистра учета позиций обычных и Выделенных Брокерских фирм / Обособленной Брокерской фирмы. Процедура ликвидации позиций на покупку заканчивается после прекращения всех обязательств по оплате ценных бумаг по Сделкам T+N, учитываемых на разделах регистра учета позиций обычных и Выделенных Брокерских фирм / Обособленной Брокерской фирмы. С момента окончания процедур ликвидации позиций на продажу / ликвидации позиций на покупку Клиринговый центр отменяет запрет на объявление поданных Участником клиринга Заявок на заключение Сделок T+N с

указанием кодов обычных и Выделенных Брокерских фирм / кода Обособленной Брокерской фирмы.

- 49.4. Под нетто-позицией по обычным и Выделенным Брокерским фирмам / Обособленной Брокерской фирме по Сделкам Т+N понимается учет обязательств по Сделкам Т+N со всеми сроками исполнения указанных обязательств, учитываемых на разделах регистра учета позиций обычных и Выделенных Брокерских фирм / Обособленной Брокерской фирмы.

При этом положение стороны (Продавец или Покупатель) и количество ценных бумаг, учитываемых в составе нетто-позиции по обычным и Выделенным Брокерским фирмам / Обособленной Брокерской фирме по Сделкам Т+N, определяются в предположении, что к указанным нетто-позициям была применена процедура прекращения встречных обязательств и требований. Одна нетто-позиция является противоположной к другой нетто-позиции / позиции, если сторона, которой является Клиринговый центр в одной нетто-позиции, является противоположной стороне, которой является Клиринговый центр в другой нетто-позиции / позиции.

- 49.5. В ходе процедуры ликвидации позиций на продажу Клиринговый центр осуществляет следующие действия:

- 49.5.1. Если Участник клиринга - должник является (становится) Продавцом по нетто-позиции по Сделкам Т+N по обычным и Выделенным Брокерским фирмам / Обособленной Брокерской фирме (далее в настоящем пункте – нетто-позиция должника по Сделкам Т+N), то в ходе текущего Расчетного периода между Клиринговым центром и Участниками клиринга на основании заявок, поданных Участниками клиринга в торговую систему Организатора торговли, заключаются Сделки Т+N на следующих условиях:

- обязательства по указанным сделкам являются односторонними к обязательствам, составляющим нетто-позицию должника по Сделкам Т+N;
- количество ценных бумаг в указанных Сделках Т+N не превышает размера нетто-позиции должника по Сделкам Т+N.

- 49.5.2. Если количество ценных бумаг в Сделках Т+N, заключенных в соответствии с подпунктом 49.5.1 Правил клиринга, меньше размера нетто-позиции должника по Сделкам Т+N, то по окончании указанного Расчетного периода (далее в настоящем пункте – Расчетный период ликвидации позиций) между Клиринговым центром и Участниками клиринга без подачи заявок заключаются Сделки Т+N на следующих условиях:

- количество ценных бумаг равно разности между размером нетто-позиции должника по Сделкам Т+N и количеством ценных бумаг в Сделках Т+N, заключенных в соответствии с подпунктом 49.5.1 Правил клиринга;
- стороной Сделок Т+N является Участник клиринга, для которого зарегистрирован код Расчетной фирмы, в рамках которой открыты обычные и Выделенные Брокерские фирмы / Обособленная Брокерская фирмы, нетто-позиция по которым / по которой по Сделкам Т+N является противоположной нетто-позиции должника по Сделкам Т+N (далее в настоящем пункте указанный Участник клиринга именуется Участником клиринга, задействованный в ликвидации позиции, а указанная Расчетная фирма - Расчетной фирмой, задействованной в ликвидации позиции);

- если указанная нетто-позиция по Сделкам T+N определена по обязательствам, учитываемым на разделах регистра учета позиций обычных и Выделенных Брокерских фирм, открытых в рамках Расчетной фирмы, задействованной в ликвидации позиции, то Сделки T+N заключаются с использованием ликвидационного раздела регистра учета позиций, открытого в рамках Расчетной фирмы, задействованной в ликвидации позиции. Если указанная нетто-позиция по Сделкам T+N определена по обязательствам, учитываемым на разделах регистра учета позиций Обособленной Брокерской фирмы, открытой в рамках Расчетной фирмы, задействованной в ликвидации позиции, то Сделки T+N считаются заключенными с использованием ликвидационного раздела регистра учета позиций, открытого в рамках данной Обособленной Брокерской фирмы;
 - цена Сделок T+N, в которых Участник клиринга, задействованный в ликвидации позиции, является Покупателем, равна Нижнему лимиту колебаний цен сделок по указанным ценным бумагам, являющимся предметом указанных Сделок T+N, установленному на момент окончания Расчетного периода ликвидации позиций;
 - цена Сделок T+N, в которых Участник клиринга, задействованный в ликвидации позиции, является Продавцом, равна Верхнему лимиту колебаний цен сделок по указанным ценным бумагам, являющимся предметом указанных Сделок T+N, установленному на момент окончания Расчетного периода ликвидации позиций.
- 49.5.3. Клиринговый центр вправе на основании заявок, поданных Участниками клиринга в торговую систему Организатора торговли, заключать с указанными Участниками клиринга Сделки T+N, являющиеся сделками репо и/или двумя сделками купли-продажи, в одной из которых Клиринговый центр, является Покупателем, а в другой – Продавцом, с целью приведения позиций по Сделкам T+N, образовавшихся в результате заключения сделок в соответствии с подпунктами 49.5.1, 49.5.2 Правил клиринга, к одной дате исполнения, а в случае невозможности приведения их к одной дате исполнения – с целью минимизации количества Расчетных дней между датами исполнения указанных позиций.
- 49.5.4. В случае заключения Сделки T+N в соответствии с подпунктами 49.5.1-49.5.3 Правил клиринга, между Клиринговым центром и Участником клиринга - должником без подачи заявок заключается Сделка T+N на следующих условиях:
- количество ценных бумаг и цена ценных бумаг совпадает с количеством ценных бумаг и ценой ценных бумаг в Сделке T+N, заключенной в соответствии с подпунктами 49.5.1-49.5.3 Правил клиринга;
 - Клиринговый центр является стороной, противоположной стороне, которой является Клиринговый центр в Сделке T+N, заключенной в соответствии с подпунктами 49.5.1-49.5.3 Правил клиринга;
 - на разделе регистра учета позиций обычных и Выделенных Брокерских фирм / Обособленной Брокерской фирмы, с указанием которого заключается Сделка T+N, учитывается позиция по Сделкам T+N.
- 49.6. В ходе процедуры ликвидации позиций на покупку Клиринговый центр осуществляет следующие действия:
- 49.6.1. Если Участник клиринга - должник является (становится) Покупателем по нетто-позиции по Сделкам T+N по обычным и Выделенным Брокерским фирмам /

Обособленной Брокерской фирмы (далее в настоящем пункте – нетто-позиция должника по Сделкам T+N), то в ходе текущего Расчетного периода между Клиринговым центром и Участниками клиринга на основании заявок, поданных Участниками клиринга в торговую систему Организатора торговли, заключаются Сделки T+N на следующих условиях:

- обязательства по указанным сделкам являются однонаправленными к обязательствам, составляющим нетто-позицию должника;
- количество ценных бумаг в указанных Сделках T+N сделок не превышает размера нетто-позиции должника.

49.6.2. Если количество ценных бумаг в Сделках T+N, заключенных в соответствии с подпунктом 49.6.1 Правил клиринга, меньше размера нетто-позиции должника по Сделкам T+N, то по окончании указанного Расчетного периода (далее в настоящем пункте – Расчетный период ликвидации позиций) между Клиринговым центром и Участниками клиринга без подачи заявок заключаются Сделки T+N на следующих условиях:

- количество ценных бумаг равно разности между размером нетто-позиции должника по Сделкам T+N и количеством ценных бумаг в Сделках T+N, заключенных в соответствии с подпунктом 49.6.1 Правил клиринга;
- стороной Сделок T+N является Участник клиринга, для которого зарегистрирован код Расчетной фирмы, в рамках которой открыты обычные и Выделенные Брокерские фирмы / Обособленная Брокерская фирмы, нетто-позиция по которым / по которой по Сделкам T+N является противоположной нетто-позиции должника по Сделкам T+N (далее в настоящем пункте указанный Участник клиринга именуется Участником клиринга, задействованным в ликвидации позиции, указанная Расчетная фирма - Расчетной фирмой, задействованной в ликвидации позиции);
- если указанная нетто-позиция по Сделкам T+N определена по обязательствам, учитываемым на разделах регистра учета позиций обычных и Выделенных Брокерских фирм, открытых в рамках Расчетной фирмы, задействованной в ликвидации позиции, то Сделки T+N заключаются с использованием ликвидационного раздела регистра учета позиций, открытого в рамках Расчетной фирмы, задействованной в ликвидации позиции. Если указанная нетто-позиция по Сделкам T+N определена по обязательствам, учитываемым на разделах регистра учета позиций Обособленной Брокерской фирмы, открытой в рамках Расчетной фирмы, задействованной в ликвидации позиции, то Сделки T+N считаются заключенными с использованием ликвидационного раздела регистра учета позиций, открытого в рамках данной Обособленной Брокерской фирмы;
- цена Сделок T+N, в которых Участник клиринга, задействованный в ликвидации позиции, является Покупателем, равна Нижнему лимиту колебаний цен сделок по указанным ценным бумагам, являющимся предметом указанных Сделок T+N, установленному на момент окончания Расчетного периода ликвидации позиций;
- цена Сделок T+N, в которых Участник клиринга, задействованный в ликвидации позиции, является Продавцом, равна Верхнему лимиту колебаний цен сделок по указанным ценным бумагам, являющимся предметом указанных Сделок T+N, установленному на момент окончания Расчетного периода ликвидации позиций.

- 49.6.3. Сделки Т+N, заключаемые Клиринговым центром с Участниками клиринга в соответствии с подпунктами 49.6.1, 49.6.2 Правил клиринга, являются сделками репо и/или двумя сделками купли-продажи, в одной из которых Клиринговый центр, является Покупателем, а в другой – Продавцом.
- 49.6.4. В случае заключения Сделки Т+N в соответствии с пунктами 49.6.1-49.6.3 Правил клиринга, между Клиринговым центром и Участником клиринга - должником без подачи заявок заключается Сделка Т+N на следующих условиях:
- количество ценных бумаг и цена ценных бумаг совпадает с количеством ценных бумаг и ценой ценных бумаг в Сделке Т+N, заключенной в соответствии с подпунктами 49.6.1-49.6.3 Правил клиринга;
 - Клиринговый центр является стороной, противоположной стороне, которой является Клиринговый центр в Сделке Т+N, заключенной в соответствии с подпунктами 49.6.1-49.6.3 Правил клиринга;
 - на разделе регистра учета позиций обычных и Выделенных Брокерских фирм / Обособленной Брокерской фирмы, с указанием которого заключается Сделка Т+N, учитывается позиция по Сделкам Т+N.

Статья 50. Порядок действий Клирингового центра в случае недостаточности ценных бумаг и (или) денежных средств для исполнения обязательств Клирингового центра

- 50.1. В случае недостаточности ценных бумаг или денежных средств на торговых счетах Клирингового центра для исполнения обязательств, подлежащих включению в клиринговый пул, Клиринговый центр предпринимает следующие действия:
- переводит на торговые счета Клирингового центра собственные денежные средства;
 - заключает Договоры займа Клирингового центра в порядке, определенном статьей 64 Правил клиринга.

ПОДРАЗДЕЛ III-VII. ПОРЯДОК ПРОВЕДЕНИЯ РАСЧЕТОВ ПО ОБЯЗАТЕЛЬСТВАМ, ВКЛЮЧЕННЫМ В КЛИРИНГОВЫЙ ПУЛ

Статья 51. Порядок определения подлежащих исполнению обязательств Участников клиринга по сделкам с ценными бумагами

51.1. По каждому обязательству, включенному в клиринговый пул, Клиринговый центр в ходе расчетной клиринговой сессии изменяет значения позиционных регистров, открытых для торговых счетов, с использованием которых должны исполняться обязательства, включенные в клиринговый пул, следующим образом:

- значение позиционного депо регистра, открытого для торгового счета депо, по которому учитывается обязательство по перерегистрации ценных бумаг, уменьшается, значение позиционного депо регистра, открытого для торгового счета депо, по которому учитывается требование по перерегистрации ценных бумаг, увеличивается на количество ценных бумаг в обязательстве / требовании;
- значение позиционного денежного регистра, открытого для денежного торгового счета, по которому учитывается обязательство по оплате ценных бумаг, уменьшается, значение позиционного денежного регистра, открытого для денежного торгового счета, по которому учитывается требование по оплате ценных бумаг, увеличивается на сумму обязательства / требования.

Статья 52. Порядок проверки наличия достаточного количества ценных бумаг и суммы денежных средств для исполнения обязательств, включенных в клиринговый пул

52.1. В случае если сформированное в соответствии со статьей 51 Правил клиринга значение позиционного регистра, соответствующего торговому счету отрицательное, то это означает, что у Участника клиринга / Клирингового центра имеется обязательство по перерегистрации или оплате ценных бумаг, и по итогам клиринга ценные бумаги или денежные средства должны быть списаны с торгового счета.

52.2. Количество ценных бумаг или сумма денежных средств на торговом счете являются достаточными для исполнения обязательств Участника клиринга / Клирингового центра по перерегистрации или оплате ценных бумаг, если абсолютное значение позиционного регистра, открытого для торгового счета, не превышает значения расчетного регистра, открытого для этого же торгового счета.

Статья 53. Порядок действий Клирингового центра в случае недостаточности ценных бумаг и (или) денежных средств для исполнения обязательств, включенных в клиринговый пул

53.1. В случае если условие достаточности ценных бумаг или денежных средств, указанное в пункте 52.2 Правил клиринга, не соблюдается хотя бы для одного торгового счета, Клиринговый центр совместно с Организатором торговли предпринимает меры по скорейшему выяснению причин возникновения ошибки и устранению ее последствий.

В частности, Клиринговый центр вправе:

- а) запросить у Организатора торговли новый Реестр сделок с полным обеспечением;
- б) использовать средства Гарантийных фондов в порядке, определенном в Положении о гарантийных фондах;
- в) исключить обязательства, для исполнения которых не достаточно ценных бумаг или денежных средств, из клирингового пула;
- г) на основании заявления Участника клиринга – стороны по сделке изменить Код клиента (Код торговых счетов) Участника клиринга, за счет средств которого осуществляются расчеты по сделке, и (или) код выпуска ценных бумаг, поставляемых по сделке.

Статья 54. Порядок формирования поручений на проведение операций по торговым счетам по итогам клиринга

- 54.1. В случае если условие достаточности ценных бумаг или денежных средств, указанное в пункте 52.2 Правил клиринга, соблюдаются для всех торговых счетов, Клиринговый центр формирует Сводную ведомость по обязательствам и требованиям по денежным средствам, реквизиты которой приведены в приложении № С6 к Правилам клиринга, и Реестр поручений по итогам клиринга, реквизиты которого приведены в приложении № С4 к Правилам клиринга.
- 54.2. Сумма, указываемая в Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по денежным средствам по каждому денежному торговому счету, соответствует значению позиционного денежного регистра, сформированному в порядке, описанном в статье 52 Правил клиринга.
- 54.3. Количество ценных бумаг, указываемое в Реестре поручений по итогам клиринга по каждому торговому счету депо, соответствует значению позиционного депо регистра, сформированному в порядке, описанном в статье 52 Правил клиринга.

РАЗДЕЛ IV. ПОРЯДОК ИСПОЛНЕНИЯ СРОЧНЫХ КОНТРАКТОВ

Статья 55. Порядок исполнения опционных контрактов, базовым активом которых является фьючерсный контракт

- 55.1. Исполнение опционного контракта осуществляется при заявлении Держателем требования об исполнении опционного контракта путем заключения без подачи заявок между Клиринговым центром и Участником клиринга – Держателем фьючерсного контракта, являющегося базовым активом опционного контракта (далее в настоящей статье – фьючерсный контракт исполнения).
- 55.2. Требование Держателя об исполнении опционного контракта считается заявленным в следующих случаях:
- если Держателем является Участник клиринга:
 - в случаях, предусмотренных Спецификацией опционного контракта;
 - в случае применения в отношении данного Участника клиринга процедуры принудительного закрытия позиций - в отношении опционного контракта, определенного Клиринговым центром в соответствии с Правилами клиринга;
 - если Держателем является Клиринговый центр - при исполнении Клиринговым центром опционного контракта с тем же кодом, по которому он являлся Подписчиком (далее в настоящей статье - связанный опционный контракт).
- 55.3. Фьючерсный контракт исполнения между Клиринговым центром и Участником клиринга – Держателем заключается в случае заявления Участником клиринга – Держателем требования об исполнении опционного контракта, за исключением случая, указанного в пункте 55.3.2 Правил клиринга.
- 55.3.1. Цена заключения фьючерсного контракта исполнения может быть выше / ниже Верхнего лимита колебаний цен сделок / Нижнего лимита колебаний цен сделок для фьючерсного контракта исполнения.
- 55.3.2. Фьючерсный контракт исполнения между Клиринговым центром и Участником клиринга – Держателем не заключается, в случае если заключение такого фьючерсного контракта приведет к возникновению или увеличению у данного Участника клиринга Маржинального требования, учитываемого по Расчетной фирме.
- 55.4. Заключение фьючерсного контракта исполнения между Клиринговым центром и Участником клиринга – Подписчиком осуществляется без подачи заявок, в случае заявления Клиринговым центром требования об исполнении опционного контракта, направляемого Участнику клиринга – Подписчику. При этом Участник клиринга – Подписчик и опционный контракт, подлежащий исполнению, выбираются по времени заключения данных опционных контрактов, начиная с самого раннего.
- 55.5. Исполнение опционного контракта, заключенного Клиринговым центром с Участником клиринга – Держателем, осуществляется Клиринговым центром:
- в ходе ближайшей следующей дневной или вечерней клиринговой сессии - на основании заявления, поданного Участником клиринга – Держателем;

- в ходе вечерней клиринговой сессии последнего дня заключения опционного контракта – при заявлении требования об исполнении опционного контракта в случаях, предусмотренных Спецификацией опционного контракта, за исключением требования, заявленного путем подачи Заявления;
- в сроки, установленные Приложением Ф5 к Правилам клиринга - при осуществлении процедуры принудительного закрытия позиций.

Исполнение опционного контракта, заключенного Клиринговым центром с Участником клиринга – Подписчиком, осуществляется Клиринговым центром в ходе той же дневной или вечерней клиринговой сессии, в которой Клиринговым центром осуществлено исполнение связанного опционного контракта.

Статья 56. Порядок исполнения расчетных фьючерсных контрактов

- 56.1. Исполнение расчетных фьючерсных контрактов осуществляется в ходе вечерней клиринговой сессии в соответствии с условиями, установленными в Спецификации соответствующего контракта.

Статья 57. Порядок исполнения поставочных Срочных контрактов

- 57.1. Под поставочными Срочными контрактами в целях Правил клиринга понимаются поставочные фьючерсные контракты или поставочные опционные контракты, базовым активом которых не являются фьючерсные контракты.
- 57.2. За две недели до последнего дня заключения поставочного фьючерсного контракта Клиринговый центр направляет Участникам клиринга отчет, содержащий уведомление о приближении срока исполнения.
- 57.3. Спецификацией Срочного контракта может быть установлен штраф (пеня) за ненадлежащее исполнение или неисполнение поставочного Срочного контракта.
- 57.4. Порядок исполнения обязательства / требования Участника клиринга по уплате / получению штрафа (пени) определен в статье 39 Правил клиринга.
- 57.5. Исполнение поставочного Срочного контракта осуществляется в соответствии с требованиями и в порядке, установленном Спецификацией данного поставочного Срочного контракта. Если Спецификацией поставочного Срочного контракта не установлен порядок исполнения, указанный поставочный Срочный контракт исполняется в порядке, установленном Правилами клиринга.
- 57.6. Особенности исполнения поставочных Срочных контрактов, базовым активом которых являются ценные бумаги, с которыми в День исполнения возможно заключение сделок в Секторе рынка Standard ФБ ММВБ (далее – поставочные Срочные контракты режима T+4), определяются статьей 58 Правил клиринга.
- 57.7. Особенности исполнения поставочных Срочных контрактов фондового рынка определяются статьей 59 Правил клиринга.

Статья 58. Особенности исполнения поставочных Срочных контрактов режима T+4

- 58.1. Исполнение поставочных Срочных контрактов режима T+4 осуществляется в вечерней клиринговой сессии дня исполнения данных Срочных контрактов.

- 58.2. Исполнению подлежат одновременно все поставочные Срочные контракты режима T+4 с одним кодом, Обязательства по поставке по которым учитываются Клиринговым центром на одном разделе регистра учета позиций Участника клиринга в вечерней клиринговой сессии дня исполнения данных Срочных контрактов после выполнения Клиринговым центром всех операций, изменяющих денежные регистры и регистры учета позиций Участников клиринга. Указанные Срочные контракты далее в настоящей статье именуются поставочными Срочными контрактами по разделу.
- 58.3. Исполнением поставочных Срочных контрактов по разделу (исполнением Обязательств по поставке по поставочным Срочным контрактам по разделу) является заключение Участником клиринга сделки купли-продажи ценных бумаг в Секторе рынка Standard ФБ ММВБ на следующих условиях (далее в настоящей статье – Сделка поставки для Срочных контрактов по разделу):
- сделка заключается в отношении ценных бумаг, являющихся базовым активом поставочных Срочных контрактов по разделу;
 - количество ценных бумаг по сделке равно произведению Лота поставочных Срочных контрактов по разделу и количества поставочных Срочных контрактов по разделу, Обязательства по поставке по которым учитывается Клиринговым центром;
 - цена одной ценной бумаги по сделке определяется в порядке, установленном Спецификацией поставочных Срочных контрактов по разделу;
 - срок исполнения обязательств по сделке определяется в соответствии с Правилами торговли ФБ ММВБ;
 - Участник клиринга является Покупателем по сделке, если он является Покупателем по поставочным Срочным контрактам по разделу. Участник клиринга является Продавцом по сделке, если он является Продавцом по поставочным Срочным контрактам по разделу.
- 58.4. Сделки поставки для Срочных контрактов по разделу заключаются без подачи заявок.
- Обязательства по Сделке поставки для Срочных контрактов по разделу учитываются на разделе регистра учета позиций, на котором учитывались Обязательства по поставке по поставочным Срочным контрактам по разделу.
- 58.5. Сделку поставки по разделу может заключить только Участник клиринга, допущенный к заключению сделок в Секторе рынка Standard ФБ ММВБ.
- Если Участник клиринга не допущен к заключению сделок в Секторе рынка Standard ФБ ММВБ, то данный Участник клиринга признается неисполнившей стороной по Срочным контрактам по разделу и обязан уплатить Клиринговому центру неустойку, а Обязательства по поставке по поставочным Срочным контрактам по разделу прекращаются уплатой неустойки. Размер неустойки по каждому такому Срочному контракту равен базовому размеру гарантийного обеспечения, установленному в дневной клиринговой сессии дня исполнения такого Срочного контракта.
- 58.6. Порядок исполнения обязательства / требования Участника клиринга по уплате неустойки определен в статье 39 Правил клиринга.

Статья 59. Особенности исполнения поставочных Срочных контрактов фондового рынка

- 59.1. В день исполнения Клиринговый центр для поставочных Срочных контрактов фондового рынка определяет в соответствии со Спецификацией данного Срочного контракта обязательства по оплате и перерегистрации ценных бумаг, составляющие Обязательства по поставке, подлежащие включению в клиринговый пул в эту дату.
- 59.2. Включение в клиринговый пул Обязательств по поставке по поставочным Срочным контрактам фондового рынка, подлежащих включению в клиринговый пул, осуществляется в ходе первого и/или второго этапа формирования клирингового пула в порядке, определенном в статье 47 Правил клиринга, в сроки, установленные Регламентом.
- 59.3. По каждому Обязательству по поставке, не включенному в клиринговый пул в ходе первого этапа формирования клирингового пула в соответствии с пунктами 47.4, 47.10 Правил клиринга, Участник клиринга обязан уплатить Клиринговому центру пеню.
- По каждому Обязательству по поставке, не включенному в клиринговый пул в ходе первого этапа формирования клирингового пула в соответствии с пунктом 47.13 Правил клиринга, Клиринговый центр обязан уплатить Участнику клиринга пеню.
- Размер пени устанавливается Клиринговым центром. Информация о размере пени публикуется на Сайте Клирингового центра.
- 59.4. Порядок исполнения обязательства / требования Участника клиринга по уплате / получению пени определен в статье 39 Правил клиринга.
- 59.5. Обязательства по поставке, не включенные в клиринговый пул по итогам первого этапа формирования клирингового пула, являются подлежащими включению в клиринговый пул в ходе второго этапа формирования клирингового пула.
- 59.6. После окончания первого этапа формирования клирингового пула Клиринговый центр по каждому Обязательству по поставке, не включенному в клиринговый пул, изменяет в соответствии с приложением № С14 Правил клиринга значения регистра поставки, открытого для денежного торгового счета / торгового счета депо, закрепленного за разделом, на котором учитывается Обязательство по поставке, и Лимита по такому торговому счету на сумму денежных средств / количество ценных бумаг, необходимое для исполнения Обязательства по поставке, в порядке, указанном в пункте 47.7 Правил клиринга.
- Обязательства по Срочному контракту, входящие в состав Обязательства по поставке, для исполнения которого достаточно денежных средств / ценных бумаг, учитываемых на регистре поставки, не включаются в совокупность обязательств по Срочному контракту для расчета Гарантийного обеспечения. Выбор указанных обязательств осуществляется Клиринговым центром.
- 59.7. Каждое Обязательство по поставке, не включенное в клиринговый пул по итогам второго этапа формирования клирингового пула, является неисполненным и прекращается.

По каждому Обязательству по поставке, не включенному в клиринговый пул в ходе второго этапа формирования клирингового пула в соответствии с пунктами 47.4, 47.10 Правил клиринга, Участник клиринга является неисполнившей стороной и обязан уплатить Клиринговому центру неустойку.

По каждому Обязательству по поставке, не включенному в клиринговый пул в ходе второго этапа формирования клирингового пула в соответствии с пунктом 47.13 Правил клиринга, Клиринговый центр является неисполнившей стороной и обязан уплатить Участнику клиринга неустойку.

Размер неустойки равен базовому размеру гарантийного обеспечения, установленному в вечерней клиринговой сессии последнего дня заключения поставочного Срочного контракта фондового рынка, Обязательство по поставке по которому не включено в клиринговый пул.

- 59.8. Порядок исполнения обязательства / требования Участника клиринга по уплате / получению штрафа определен в статье 39 Правил клиринга.

РАЗДЕЛ V. ЗАКЛЮЧЕНИЕ СДЕЛОК РЕПО, СДЕЛОК КУПЛИ-ПРОДАЖИ ЦЕННЫХ БУМАГ И ДОГОВОРОВ ЗАЙМА КЛИРИНГОВОГО ЦЕНТРА

Статья 60. Заключение сделки репо при наличии Необеспеченной позиции Участника клиринга или Клирингового центра по Сделкам T+N

60.1. В случае возникновения Необеспеченной позиции Участника клиринга по Сделкам T+N между этим Участником клиринга и Клиринговым центром заключается сделка репо, в соответствии с которой:

- во исполнение первой части репо Клиринговый центр обязан передать Участнику клиринга недостающие для исполнения Необеспеченной позиции Участника клиринга по Сделкам T+N ценные бумаги (денежные средства), а Участник клиринга обязан оплатить (передать) ценные бумаги;
- во исполнение второй части репо Участник клиринга обязан передать Клиринговому центру недостающие для исполнения Необеспеченной позиции Участника клиринга по Сделкам T+N ценные бумаги (денежные средства), а Клиринговый центр обязан оплатить (передать) ценные бумаги.

60.2. В случае возникновения Необеспеченной позиции Клирингового центра по Сделкам T+N между Клиринговым центром и Участником клиринга, определенным в соответствии со статьей 62 Правил клиринга, заключается сделка репо, в соответствии с которой:

- во исполнение первой части репо Участник клиринга обязан передать Клиринговому центру недостающие для исполнения Необеспеченной позиции Клирингового центра по Сделкам T+N ценные бумаги (денежные средства), а Клиринговый центр обязан оплатить (передать) ценные бумаги;
- во исполнение второй части репо Клиринговый центр обязан передать Участнику клиринга недостающие для исполнения Необеспеченной позиции Клирингового центра по Сделкам T+N ценные бумаги (денежные средства), а Участник клиринга обязан оплатить (передать) ценные бумаги.

60.3. Сделка репо в соответствии с пунктом 60.1 или 60.2 настоящей статьи заключается без подачи заявок. Условия указанной сделки репо соответствуют Условиям сделок РЕПО, заключаемых с Центральным контрагентом в Секторе рынка Standard, являющимся приложением к Правилам торговли ФБ ММВБ, действующим на момент заключения сделки репо. При этом:

- количество и вид, категория (тип) ценных бумаг, в отношении которых заключена сделка репо, определяется в соответствии со статьей 63 Правил клиринга;
- первая часть сделки репо исполняется в день ее заключения;
- вторая часть сделки репо исполняется в Расчетный день, следующий за днем ее заключения;
- сумма первой части сделки репо определяется как произведение количества ценных бумаг в сделке репо и расчетной цены ценной бумаги, определенной Организатором торговли, а в случае, если Организатор торговли не осуществляет определение расчетной цены, определенной в соответствии с приложением № Ф7 к Правилам клиринга;

- сумма второй части сделки репо равна сумме первой части сделки репо (ставка репо равна нулю).
- 60.4. При включении обязательства по первой части сделки репо в список (перечень) Обязательств по Сделкам T+N, подлежащих включению в клиринговый пул, Клиринговый центр осуществляет учет обязательств по второй части сделки репо в составе обязательств по сделкам T+N по разделу регистра учета позиций, код которого совпадает с кодом раздела регистра учета позиций, на котором учитывается Необеспеченная позиция Участника клиринга по сделкам T+N или Необеспеченная позиция Клирингового центра по сделкам T+N, по ценной бумаге, соответствующей ценным бумагам, в отношении которых заключена сделка репо, с датой исполнения, соответствующей дате исполнения второй части сделки репо.
- 60.5. Настоящая статья применяется, если ценная бумага входит в список бумаг, по которым возможно заключение Сделок T+N, или исключена из указанного списка, и с момента исключения ценной бумаги из данного списка прошло менее пяти Расчетных дней, за исключением случаев применения в отношении Участника клиринга любой из процедур банкротства, обращения взыскания на имущество Участника клиринга, применения к Участнику клиринга процедуры принудительного закрытия позиций в порядке, определенном приложением № Ф5 к Правилам клиринга, аннулирования кода (кодов) Расчетной фирмы у Участника клиринга, получения от Участника клиринга заявления, в соответствии с которым при наличии Необеспеченных позиций по сделкам T+N должны заключаться сделки купли-продажи ценных бумаг.

Статья 61. Заключение сделок купли-продажи ценных бумаг при наличии Необеспеченной позиции Участника клиринга или Клирингового центра по Сделкам T+N

- 61.1. В случае возникновения Необеспеченной позиции Участника клиринга по Сделкам T+N между этим Участником клиринга и Клиринговым центром заключаются две сделки купли-продажи ценных бумаг, в соответствии с которыми:
- во исполнение первой сделки купли-продажи Клиринговый центр обязан передать Участнику клиринга недостающие для исполнения Необеспеченной позиции Участника клиринга по Сделкам T+N ценные бумаги (денежные средства), а Участника клиринга обязан оплатить (передать) ценные бумаги;
 - во исполнение второй сделки купли-продажи Участник клиринга обязан передать Клиринговому центру недостающие для исполнения Необеспеченной позиции Участника клиринга по Сделкам T+N ценные бумаги (денежные средства), а Клиринговый центр обязан оплатить (передать) ценные бумаги.
- 61.2. В случае возникновения Необеспеченной позиции Клирингового центра по Сделкам T+N между Клиринговым центром и Участником клиринга, определенным в соответствии со статьей 62 Правил клиринга, заключаются две сделки купли-продажи ценных бумаг, в соответствии с которыми:
- во исполнение первой сделки купли-продажи Участник клиринга обязан передать Клиринговому центру недостающие для исполнения Необеспеченной

позиции Клирингового центра по Сделкам T+N ценные бумаги (денежные средства), а Клиринговый центр обязан оплатить (передать) ценные бумаги;

- во исполнение второй сделки купли-продажи Клиринговый центр обязан передать Участнику клиринга недостающие для исполнения Необеспеченной позиции Клирингового центра по Сделкам T+N ценные бумаги (денежные средства), а Участник клиринга обязан оплатить (передать) ценные бумаги.

61.3. Сделки купли-продажи ценных бумаг в соответствии с пунктом 61.1 или 61.2 настоящей статьи заключаются без подачи заявок. Условия указанных сделок соответствуют Условиям сделок, заключаемых с Центральным контрагентом в Секторе рынка Standard, действующим на момент заключения сделок купли-продажи. При этом:

- количество и вид, категория (тип) ценных бумаг, в отношении которых заключены сделки купли-продажи, определяется в соответствии со статьей 63 Правил клиринга;
- первая сделка купли-продажи исполняется в день ее заключения;
- вторая сделка купли-продажи исполняется в Расчетный день, следующий за днем ее заключения;
- сумма первой сделки купли-продажи определяется как произведение количества ценных бумаг в сделке сделки купли-продажи и расчетной цены ценной бумаги, определенной Организатором торговли, а в случае, если Организатор торговли не осуществляет определение расчетной цены, определенной в соответствии с приложением № Ф7 к Правилам клиринга;
- сумма второй сделки купли-продажи равна сумме первой сделки купли-продажи.

61.4. При включении обязательства по первой сделке купли-продажи в список (перечень) Обязательств по Сделкам T+N, подлежащих включению в клиринговый пул, Клиринговый центр осуществляет учет обязательств по второй сделке купли-продажи в составе обязательств по Сделкам T+N по разделу регистра учета позиций, код которого совпадает с кодом раздела регистра учета позиций, на котором учитывается Необеспеченная позиция Участника клиринга по Сделкам T+N или Необеспеченная позиция Клирингового центра по Сделкам T+N, по ценной бумаге, соответствующей ценным бумагам, в отношении которых заключены сделки купли-продажи, с датой исполнения, соответствующей дате исполнения второй сделки купли-продажи.

61.5. Настоящая статья применяется, если ценная бумага входит в список бумаг, по которым возможно заключение Сделок T+N, или исключена из указанного списка, и с момента исключения ценной бумаги из данного списка прошло менее пяти Расчетных дней, и от Участника клиринга Клиринговым центром получено заявление, в соответствии с которым при наличии Необеспеченных позиций по сделкам T+N должны заключаться сделки купли-продажи ценных бумаг, за исключением случаев применения в отношении Участника клиринга любой из процедур банкротства, обращения взыскания на имущество Участника клиринга, применения к Участнику клиринга процедуры принудительного закрытия позиций в порядке, определенном приложением № Ф5 к Правилам клиринга, аннулирования кода (кодов) Расчетной фирмы у Участников клиринга.

61.6. Клиринговый центр предоставляет информацию о сделках купли-продажи ценных бумаг, заключенных в соответствии с настоящей статьей, Организатору торговли в соответствии с нормативными правовыми актами Федерального органа, регулирующими представление фондовым биржам информации о внебиржевых сделках, и документами ФБ ММВБ. Комиссионное вознаграждение Клирингового центра, взимаемое с Участника клиринга по указанным сделкам, включает в себя вознаграждение за исполнение Клиринговым центром поручения Участника клиринга на представление ФБ ММВБ информации об указанных сделках, и возмещение расходов, связанных с его исполнением. Отчетами об исполнении Клиринговым центром указанного поручения считаются клиринговые отчеты, представляемые Участнику клиринга в соответствии с Правилами клиринга и содержащие сведения о заключении сделок, информация о которых представлена ФБ ММВБ в соответствии с настоящим пунктом, иные документы при этом Участнику клиринга не представляются. Возражения по указанным отчетам могут быть представлены Клиринговому центру в сроки, установленные Правилами клиринга для заявления об оказании клиринговых услуг ненадлежащим образом.

Статья 62. Участник клиринга, с которым Клиринговым центром заключена сделка репо или сделки купли-продажи ценных бумаг при наличии Необеспеченной позиции Клирингового центра по сделкам T+N

62.1. В случае возникновения Необеспеченной позиции Клирингового центра по Сделкам T+N по оплате ценных бумаг сделки, предусмотренные статьями 60, 61 Правил клиринга, заключаются Клиринговым центром с Участником клиринга, у которого в составе Необеспеченной позиции по сделкам T+N учитывается требование по оплате ценных бумаг.

62.2. В случае возникновения Необеспеченной позиции Клирингового центра по сделкам T+N по перерегистрации ценных бумаг сделки, предусмотренные статьями 60, 61 Правил клиринга, заключаются Клиринговым центром с Участником клиринга, у которого в составе Необеспеченной позиции Клирингового центра по сделкам T+N учитывается требование по перерегистрации ценных бумаг, недостающих Клиринговому центру.

Статья 63. Ценные бумаги, в отношении которых Клиринговым центром заключена сделка репо или сделки купли-продажи ценных бумаг

63.1. При наличии Необеспеченной позиции Участника клиринга по сделкам T+N по перерегистрации ценных бумаг, сделка репо или сделки купли-продажи ценных бумаг, предусмотренные статьями 60, 61 Правил клиринга, заключаются в отношении ценных бумаг, недостающих для исполнения обязательства Участника клиринга, в количестве, кратном лоту и не превышающем количества ценных бумаг, недостающих для исполнения обязательства Участника клиринга.

63.2. При наличии Необеспеченной позиции Участника клиринга по сделкам T+N по оплате ценных бумаг, сделка репо или сделки купли-продажи ценных бумаг, предусмотренные статьями 60, 61 Правил клиринга, заключаются в отношении ценных бумаг, по которым в составе Необеспеченной позиции Участника клиринга по сделкам T+N учитывается обязательство по оплате ценных бумаг, в количестве, кратном лоту и не превышающем количества ценных бумаг, на

которое в составе данной позиции учитывается требование по перерегистрации указанных ценных бумаг.

- 63.3. При наличии Необеспеченной позиции Клирингового центра по сделкам T+N по оплате ценных бумаг, сделка репо или сделки купли-продажи ценных бумаг, предусмотренные статьями 60, 61 Правил клиринга, заключаются в отношении ценных бумаг, по которым в составе Необеспеченной позиции по сделкам T+N учитывается требование Участника клиринга по оплате ценных бумаг, в количестве, кратном лоту и не превышающем абсолютного значения обязательства по перерегистрации ценных бумаг, учитываемого в составе данных обязательств.
- 63.4. При наличии Необеспеченной позиции Клирингового центра по сделкам T+N по перерегистрации ценных бумаг, сделка репо или сделки купли-продажи ценных бумаг, предусмотренные статьями 60, 61 Правил клиринга, заключаются в отношении ценных бумаг, по которым в составе Необеспеченной позиции по сделкам T+N учитывается требование Участника клиринга по перерегистрации ценных бумаг, недостающих Клиринговому центру, в количестве, кратном лоту и не превышающем количества ценных бумаг, на которое в составе данной позиции учитывается требование по перерегистрации указанных ценных бумаг.

Статья 64. Условия Договора займа Клирингового центра, порядок их заключения и исполнения

- 64.1. Предметом Договора займа Клирингового центра могут являться ценные бумаги, допущенные к торгам ФБ ММВБ в Секторе рынка Standard (далее в настоящем разделе – Ценные бумаги).
- 64.2. Займодавцем по Договору займа Клирингового центра является Участник клиринга, заемщиком - Клиринговый центр.
- 64.3. Необходимыми условиями для заключения Договора займа Клирингового центра является:
- а) регистрация Участником клиринга в Клиринговом центре:
 - торгового счета депо, открытого в Расчетном депозитарии, по которому будут проводиться операции, связанные с заключением и исполнением Договоров займа Клирингового центра;
 - счета для зачисления денежных средств, на который будут зачисляться проценты по Договорам займа Клирингового центра. Регистрация такого счета осуществляется в порядке, предусмотренном статьей 65 Правил клиринга;
 - б) регистрация в Клиринговом центре:
 - Кода торговых счетов, в состав которого входят указанные в подпункте «а» настоящего пункта торговый счет депо и счет для зачисления денежных средств.
- 64.4. Участник клиринга, заключая Договор займа Клирингового центра в отношении Ценных бумаг, гарантирует, что он обладает всеми необходимыми поручениями и полномочиями на заключение указанного договора.
- 64.5. Условия Договора займа Клирингового центра:

- 1) в дату заключения Договора займа Участник клиринга (займодавец) обязан передать Клиринговому центру (заемщику) Ценные бумаги;
 - 2) в Расчетный день, следующий за датой заключения Договора займа Клирингового центра, Клиринговый центр обязан вернуть Участнику клиринга Ценные бумаги, полученные по Договору займа Клирингового центра, и уплатить проценты по Договору займа Клирингового центра, рассчитанные как произведение Ставки по Договорам займа Клирингового центра, установленной Клиринговым центром на дату заключения Договора займа Клирингового центра, количества Ценных бумаг, переданных по Договору займа Клирингового центра, количества календарных дней с даты заключения Договора займа Клирингового центра до следующего Расчетного дня, и последней Расчетной цены Ценных бумаг, определенной в соответствии с приложением № Ф7 к Правилам клиринга;
 - 3) Ставка по Договорам займа Клирингового центра устанавливается в процентах годовых, с базой равной 365 дням. Информация о Ставке по Договорам займа Клирингового центра публикуется на Сайте Клирингового центра. Ставка по заключенным Договорам займа Клирингового центра не может быть изменена;
 - 4) передача Ценных бумаг во исполнение Договора займа Клирингового центра осуществляется в порядке, установленном Правилами клиринга, путем проведения операций по торговому счету депо Участника клиринга (или его клиента) и по торговому счету депо Клирингового центра, открытым в Расчетном депозитарии;
 - 5) в случае если на дату заключения Договора займа Клирингового центра приходится дата составления списка лиц, имеющих право на получение дивидендов, процентов и иного распределения по Ценным бумагам (далее – Доход), Клиринговый центр обязан передать Доход Участнику клиринга. Порядок и сроки передачи Дохода в форме денежных средств, а также сумма Дохода, подлежащая передаче, определяются в соответствии с разделом VI Правил клиринга. Иной Доход Клиринговый центр передает Участнику клиринга в течение десяти операционных дней, следующих за днем получения Клиринговым центром такого Дохода.
- 64.6. Клиринговый центр заключает Договоры займа Клирингового центра в случае недостаточности ценных бумаг на торговых счетах Клирингового центра для исполнения обязательств, подлежащих включению в клиринговый пул, с Участниками клиринга, зарегистрировавшими в Клиринговом центре в соответствии с пунктом 64.3 Коды торговых счетов, в состав которых входит торговый счет депо, на котором учитываются недостающие у Клирингового центра ценные бумаги. Договоры займа Клирингового центра заключаются без подачи заявок.
- 64.7. Клиринговый центр включает в клиринговый пул обязательства по передаче и возврату ценных бумаг по Договорам займа Клирингового центра и учитывает указанные обязательства при определении итогового количества ценных бумаг, которые должны быть списаны / зачислены на торговый счет депо.
- 64.8. Для исполнения обязанности Клирингового центра по уплате Участнику клиринга процентов по Договору займа Клиринговый центр направляет Расчетной организации поручения на перечисление денежных средств со Счета

Клирингового центра на Счет для зачисления денежных средств в форме Реестра платежных поручений, реквизиты которого приведены в приложении № С6 к Правилам клиринга.

- 64.9. В дату заключения Договора займа Клирингового центра, Клиринговый центр в порядке, установленном статьей 28 Правил клиринга, направляет Участнику клиринга Отчет о Договорах займа Клирингового центра, спецификация которого приведена в приложении № С2 к Правилам клиринга. Указанный отчет является документом, удостоверяющим передачу Участником клиринга Клиринговому центру Ценных бумаг.

Статья 65. Порядок регистрации Счета для зачисления денежных средств

- 65.1. Лицо, от имени которого будут заключаться Договоры займа Клирингового центра, должно быть зарегистрировано в Клиринговом центре в качестве Участника клиринга.
- 65.2. Счет для зачисления денежных средств должен быть предварительно зарегистрирован в Клиринговом центре.
- 65.2.1. Регистрация счета для зачисления денежных средств осуществляется Клиринговым центром на основании Заявления на регистрацию счета для зачисления денежных средств по форме, установленной Клиринговым центром.
- 65.2.2. В случае если владельцем Счета для зачисления денежных средств, является Клиент Участника клиринга, Участник клиринга вместе с Заявлением на регистрацию счета для зачисления денежных средств обязан предоставить в Клиринговый центр письмо по форме, установленной приложением № С3 к Правилам клиринга.
- 65.2.3. Клиринговый центр регистрирует Счет для зачисления денежных средств в течение 1 (одного) Расчетного дня с даты получения всех необходимых документов.
- 65.3. Клиринговый центр вправе аннулировать регистрацию Счета для зачисления денежных средств:
- а) на основании заявления Участника клиринга, зарегистрировавшего Счет для зачисления денежных средств;
 - б) в случае прекращения Договора об оказании клиринговых услуг с Участником клиринга, зарегистрировавшим Счет для зачисления денежных средств.

РАЗДЕЛ VI. ПОРЯДОК ПЕРЕЧИСЛЕНИЯ ДОХОДОВ ПО СДЕЛКАМ, ЗАКЛЮЧЕННЫМ С КЛИРИНГОВЫМ ЦЕНТРОМ

Статья 66. Определения

В целях настоящего раздела используются следующие термины и определения:

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

«Список» - список лиц, имеющих право на получение Дохода;

«Объем нетто-позиции на продажу» - объем неисполненных по состоянию на дату составления Списка обязательств Участника клиринга по передаче Клиринговому центру ценных бумаг, по которым принято решение о выплате Дохода, определенных с учетом зачета встречных однородных требований по всем сделкам с такими ценными бумагами, заключенным Участником клиринга или от имени Участника клиринга с Клиринговым центром, в том числе по сделкам репо;

«Участник клиринга – нетто-продавец» - Участник клиринга, имеющий нетто-позицию на продажу;

«Объем нетто-позиции на покупку» - объем неисполненных по состоянию на дату составления Списка обязательств Клирингового центра по передаче Участнику клиринга ценных бумаг, по которым принято решение о выплате Дохода, определенных с учетом зачета встречных однородных требований по всем сделкам с ценной бумагой, заключенным Участником клиринга или от имени Участника клиринга с Клиринговым центром, в том числе по сделкам репо и по Договорам займа Клирингового центра;

«Участник клиринга – нетто-покупатель» - Участник клиринга, имеющий нетто-позицию на покупку.

Иные термины используются в значениях, определенных Условиями сделок, заключаемых с Центральным контрагентом в Секторе рынка Standard, и Условиями сделок РЕПО, заключаемых с Центральным контрагентом в Секторе рынка Standard, являющимися приложением к Правилам торговли ФБ ММВБ.

Статья 67. Обязательства сторон

67.1. В случае если в соответствии с Условиями сделок, заключаемых с Центральным контрагентом в Секторе рынка Standard, или Условиями сделок РЕПО, заключаемых с Центральным контрагентом в Секторе рынка Standard, являющимися приложением к Правилам торговли ФБ ММВБ, Доход подлежит передаче Продавцом ценных бумаг Покупателю (по сделкам репо - Первоначальным покупателем Первоначальному продавцу), Участник клиринга – нетто-продавец обязан перечислить Доход Клиринговому центру в течение 5 (пяти) Расчетных дней после раскрытия эмитентом ценных бумаг информации о факте исполнения своих обязательств по выплате Дохода.

67.1.1. Сумма Дохода, подлежащая перечислению Участником клиринга – нетто-продавцом Клиринговому центру, рассчитывается по формулам:

$Inc_S_i = N S_i \times (d - n), \text{ где}$
--

Inc_s_i	Сумма Дохода, которая должна быть перечислена Клиринговому центру i-м Участником клиринга – нетто-продавцом (в рублях Российской Федерации)
Ns_i	Объем нетто-позиции на продажу i-го Участника клиринга (в штуках)
d	Величина, равная сумме Дохода в расчете на одну ценную бумагу, подлежащая выплате эмитентом ценных бумаг, без учета налогов (в рублях Российской Федерации)
n	Меньшая из следующих величин: 1) величина, равная сумме Дохода в расчете на одну ценную бумагу, подлежащей выплате эмитентом ценных бумаг, без учета налогов, умноженной на коэффициент 0,09; 2) величина, равная размеру налога в расчете на одну ценную бумагу, рассчитанного эмитентом ценных бумаг в соответствии с законодательством Российской Федерации в отношении налогоплательщиков, являющихся российскими организациями.*

* - в случае если эмитент ценных бумаг не предоставляет Клиринговому центру указанную величину, Клиринговый центр вправе использовать величину, определенную Расчетным депозитарием на основании запроса Клирингового центра, или использовать величину, рассчитанную в соответствии с предыдущим пунктом.

67.1.2. Назначение платежа, которое должно быть указано Участником клиринга в платежном поручении на перечисление Дохода по сделкам купли-продажи: «Доход по сделкам купли-продажи ценных бумаг (код <код ценной бумаги, присвоенный ФБ ММВБ>) в соответствии с Условиями сделок, заключаемых с Центральным контрагентом в Секторе рынка Standard, неисполненным по состоянию на <дата составления Списка>. НДС не облагается».

67.1.3. Назначение платежа, которое должно быть указано Участником клиринга в платежном поручении на перечисление Дохода по сделкам репо: «Доход по сделкам репо с ц.б.(код <код ценной бумаги, присвоенный ФБ ММВБ >) в соотв. с Условиями сделок репо, заключаемых с Центральным контрагентом в Секторе рынка Standard, Дата обратного выкупа которых позднее <дата составления Списка>. НДС не облагается».

67.2. В случае если в соответствии с Условиями сделок, заключаемых с Центральным контрагентом в Секторе рынка Standard, или Условиями сделок РЕПО, заключаемых с Центральным контрагентом в Секторе рынка Standard, являющимися приложением к Правилам торговли ФБ ММВБ, или в соответствии с условиями Договоров займа Клирингового центра, определенных Правилами клиринга, Доход подлежит передаче Продавцом ценных бумаг Покупателю, или Первоначальным покупателем Первоначальному продавцу, или Клиринговым центром Участнику клиринга - займодавцу, Клиринговый центр обязан перечислить Доход Участнику клиринга – нетто-покупателю в течение 10 (десяти) Расчетных дней после раскрытия эмитентом ценных бумаг информации о факте исполнения своих обязательств по выплате Дохода.

67.2.1. Сумма Дохода, подлежащая перечислению Клиринговым центром Участнику клиринга – нетто-покупателю, рассчитывается по формулам:

$$Inc_s_i = Ns_i \times (d - n), \text{ где}$$

Inc_s_i	Сумма Дохода, которая должна быть перечислена Клиринговым центром i -му Участнику клиринга – нетто-покупателю (в рублях Российской Федерации)
Ns_i	Объем нетто-позиции на покупку i -го Участника клиринга (в штуках)
d	Величина, равная сумме Дохода в расчете на одну ценную бумагу, подлежащая выплате эмитентом ценных бумаг, без учета налогов (в рублях Российской Федерации)
n	Меньшая из следующих величин: 1) величина, равная сумме Дохода в расчете на одну ценную бумагу, подлежащей выплате эмитентом ценных бумаг, без учета налогов, умноженной на коэффициент 0,09; 2) величина, равная размеру налога в расчете на одну ценную бумагу, рассчитанного эмитентом ценных бумаг в соответствии с законодательством Российской Федерации в отношении налогоплательщиков, являющихся российскими организациями.*

* - в случае если эмитент ценных бумаг не предоставляет Клиринговому центру указанную величину, Клиринговый центр вправе использовать величину, определенную Расчетным депозитарием на основании запроса Клирингового центра, или использовать величину, рассчитанную в соответствии с предыдущим пунктом.

- 67.2.2. Суммы Дохода, подлежащие перечислению Участникам клиринга – нетто-покупателям, зачисляются Клиринговым центром на счета, предварительно зарегистрированные Участником клиринга в Клиринговом центре.
- 67.2.3. Регистрация счета для перечисления Дохода осуществляется на основании заявления Участника клиринга по форме, установленной Клиринговым центром, предоставленного в Клиринговый центр.
- 67.2.4. В случае изменения реквизитов счета для перечисления Дохода Участник клиринга обязан предоставить Клиринговому центру новое заявление на регистрацию счета для перечисления Дохода, содержащего информацию о новых реквизитах счета.
- 67.2.5. Участник клиринга несет риск последствий, вызванных непредоставлением (несвоевременным представлением) в Клиринговый центр заявлений, указанных в пунктах 67.2.3 и 67.2.4 настоящей статьи.
- 67.2.6. В случае если в соответствии с законодательством Российской Федерации Клиринговый центр обязан удержать налог на прибыль организаций с суммы Дохода, передаваемого Участнику клиринга, являющемуся нерезидентом, сумма Дохода, определенная в соответствии с пунктом 67.2.1 настоящей статьи, уменьшается на величину удерживаемого налога.

Статья 68. Гарантии передачи Дохода

- 68.1. В случае неперечисления Участником клиринга – нетто-продавцом Клиринговому центру суммы Дохода в срок, установленный в пункте 67.1 Правил клиринга, Участник клиринга – нетто-продавец обязан заплатить штраф в пользу Клирингового центра в размере, установленном в приложении № С1 к Правилам клиринга.

- 68.2. В случае неперечисления Участником клиринга – нетто-продавцом Клиринговому центру Дохода в срок, установленный в пункте 67.1 Правил клиринга, и/или неуплаты штрафа, указанного в пункте 68.1 настоящей статьи, Клиринговый центр передает информацию об этом нарушении Организатору торговли с целью применения к участнику торгов, являющемуся Участником клиринга, не исполнившему обязательство по перечислению Дохода Клиринговому центру, мер дисциплинарного воздействия.
- 68.3. В случае неперечисления Участником клиринга – нетто-продавцом Клиринговому центру суммы Дохода в срок, установленный в пункте 67.1 Правил клиринга, Клиринговый центр вправе удержать сумму Дохода и сумму штрафа, установленного в соответствии с пунктом 68.1 Правил клиринга, из Средств гарантийного обеспечения Участника клиринга, а в случае их недостаточности - из взноса в Страховой фонд такого Участника клиринга.
- 68.4. Порядок исполнения обязательства Участника клиринга по уплате Дохода и обязательства Участника клиринга по уплате штрафа определен в статье 39 Правил клиринга.

РАЗДЕЛ VII. ПОРЯДОК СВЕРКИ ДОКУМЕНТОВ, ВОЗНАГРАЖДЕНИЕ, РЕЕСТРЫ КЛИРИНГОВОГО ЦЕНТРА

Статья 69. Порядок сверки документов, полученных Клиринговым центром от Участников клиринга

69.1. Документами, получаемыми Клиринговым центром от Участников клиринга и (или) от уполномоченных ими лиц, являются:

- Анкета Участника клиринга;
- подписанный Участником клиринга Договор об оказании клиринговых услуг;
- Заявление на регистрацию торгового счета;
- Доверенности;
- Заявление на регистрацию клиентов и Кодов торговых счетов;
- Поручение на клиринг;
- Поручение на отмену поручения на клиринг;
- Заявление на регистрацию клиента и Кодов торговых счетов для Договоров займа Клирингового центра;
- Заявление на регистрацию Счета для зачисления денежных средств;
- иные документы, предоставляемые в соответствии с Правилами клиринга.

69.2. Все документы, перечисленные в пункте 69.1 настоящей статьи, должны соответствовать следующим требованиям:

- документы на бумажном носителе:
 - должны быть предоставлены по форме, установленной Клиринговым центром;
 - должны быть заполнены в соответствии с утвержденным Клиринговым центром порядком заполнения документов;
 - полномочия лица, подписавшего документ, должны быть подтверждены документом, подтверждающим избрание (назначение) лица, осуществляющего функции единоличного исполнительного органа, или доверенностью;
 - подпись лица, подписавшего документ, должна совпадать с образцом подписи в карточке с образцами подписей и оттиском печати или в доверенности;
 - печать на документе должна совпадать с оттиском печати в карточке с образцами подписей и оттиском печати.
- документы, полученные в электронной форме по Системе ЭДО:
 - документы должны соответствовать форматам, утвержденным Клиринговым центром;
 - ЭП, которой подписан документ, должна соответствовать ЭП Участника клиринга либо уполномоченного им лица, указанного в документе.

69.3. Дополнительно к требованиям, указанным в пункте 69.2 Правил клиринга, Заявление на регистрацию клиентов и Кодов торговых счетов должно соответствовать следующим требованиям:

- лицо, подавшее Заявление, должно быть зарегистрировано в Клиринговом центре в качестве Участника клиринга;
 - торговые счета (торговый счет и денежный регистр), указанные в Заявлении, должны быть зарегистрированы в Клиринговом центре, и Участник клиринга, предоставивший Заявление, должен иметь право указывать данные счета (денежный регистр) при регистрации Кодов торговых счетов;
 - информация о клиенте Участника клиринга, указанная в заявлении, должна соответствовать требованиям, установленным Правилами клиринга к правилам и порядку регистрации клиентов;
 - регистрация торгового счета депо и денежного торгового счета, указанных в Заявлении, совместно в составе Кода торговых счетов должна быть разрешена (не запрещена) в соответствии с заявлениями, на основании которых Клиринговым центром была осуществлена регистрация данных торговых счетов;
 - использование торгового счета депо и денежного торгового счета, зарегистрированных совместно в составе Кода торговых счетов, при заключении сделок и/или расчетов по сделкам не должно привести к нарушению требований российского законодательства, а также не должно противоречить установленным Правилами клиринга требованиям Клирингового центра к правилам и порядку регистрации Кодов торговых счетов.
- 69.4. Дополнительно к требованиям, указанным в пункте 69.2 Правил клиринга, Поручение на клиринг, должно соответствовать следующим требованиям:
- Поручение на клиринг должно быть подано в соответствии с порядком, установленным Правилами клиринга;
 - лицо, подавшее Поручение на клиринг, должно быть зарегистрировано в Клиринговом центре в качестве Участника клиринга;
 - торговые счета, указанные в поручении на клиринг, должны быть зарегистрированы в Клиринговом центре и Участники клиринга, подавшие поручение на клиринг, должны иметь право использовать данные счета при проведении расчетов;
 - при исполнении Поручения на клиринг использование торгового счета депо и денежного торгового счета, указанных в Поручении на клиринг, не должно привести к нарушению требований российского законодательства.
- 69.5. Дополнительно к требованиям, указанным в пункте 69.2 Правил клиринга, Поручение на отмену поручения на клиринг, должно быть подано одним из Участников клиринга, подавших отменяемое Поручение на клиринг.
- 69.6. При получении документов, указанных в пункте 69.1 Правил клиринга, Клиринговый центр осуществляет проверку полученных документов на соответствие требованиям, перечисленным в пунктах 69.2-69.5 настоящей статьи.
- 69.6.1. Документ, удовлетворяющий требованиям, перечисленным в пунктах 69.2-69.5 настоящей статьи, принимается Клиринговым центром.
- 69.6.2. Документ, не удовлетворяющий требованиям, перечисленным в пунктах 69.2-69.5 настоящей статьи, не принимается Клиринговым центром и возвращается предоставившему его лицу с указанием причины возврата.

Статья 70. Порядок и сроки оплаты клиринговых услуг, услуг по организации торговли, депозитарному и расчетному обслуживанию, а также порядок списания денежных средств с целью возмещения средств Гарантийных фондов

- 70.1. Ежедневно, по итогам клиринга, Клиринговый центр подает в Расчетную организацию документы³ с целью списания вознаграждения, причитающегося ему за оказание клиринговых услуг по сделкам в соответствии с Тарифами Клирингового центра, являющимися приложением № С1 к Правилам клиринга, возмещения средств Гарантийных фондов, а также с целью списания вознаграждения за оказание услуг по организации торговли (за исключением случая, установленного пунктом 70.5.1 настоящей статьи), депозитарному и расчетному обслуживанию и перечисления указанного вознаграждения в пользу организации, оказавшей соответствующие услуги. Списание вознаграждения за оказание услуг по организации торговли, депозитарному и расчетному обслуживанию осуществляется только при наличии соответствующих договоров Клирингового центра с организациями, оказывающими соответствующие услуги Участникам клиринга и/или их клиентам.
- 70.1.1. Клиринговый центр самостоятельно рассчитывает сумму вознаграждения за услуги по организации торговли, депозитарному и расчетному обслуживанию в соответствии с действующими тарифами соответствующей организации.
- 70.1.2. В случае если тарифы и/или рассчитанные в соответствии с подпунктом 70.1.1 настоящей статьи суммы комиссионного вознаграждения выражены в долларах США, оплата клиринговых услуг, услуг по организации торговли, депозитарному и расчетному обслуживанию осуществляется в рублях Российской Федерации по курсу, установленному Банком России на день заключения сделки.
- 70.2. По итогам каждого Расчетного дня списываются предусмотренные пунктом 70.1 настоящей статьи суммы вознаграждений, рассчитанные по итогам данного Расчетного дня, а также суммы задолженностей по выплате рассчитанных за предыдущие дни сумм вознаграждений.
- 70.3. Списание сумм вознаграждений, предусмотренных пунктом 70.1 настоящей статьи, осуществляется:
- 70.3.1. со счета в Расчетной организации, указанного Участником клиринга в Заявлении на регистрацию счета для списания комиссионных вознаграждений по форме, установленной Клиринговым центром, в случае предоставления такого Заявления, или
- 70.3.2. с денежного торгового счета, использованного при осуществлении клиринга.
- 70.4. Оплата клиринговых услуг по сделкам и иных услуг Клирингового центра в соответствии с Тарифами Клирингового центра, являющимися приложением № С1 к Правилам клиринга, в случае непредоставления Заявления на регистрацию счета для списания комиссионных вознаграждений и неиспользования денежных торговых счетов при осуществлении клиринга, производится на основании счетов, выставляемых Клиринговым центром по итогам каждого календарного месяца.

³Таковыми документами, в том числе, могут являться платежные требования, исполняемые без акцепта Участника клиринга.

Счета выставляются не позднее 10 (десятого) числа следующего календарного месяца. Услуги должны быть оплачены до конца месяца, следующего за оплачиваемым.

- 70.4.1. Если тарифы Клирингового центра и/или рассчитанные суммы комиссионного вознаграждения / суммы штрафов выражены в долларах США, оплата услуг Клирингового центра / штрафов Участником клиринга – резидентом осуществляется в рублях Российской Федерации по курсу Банка России на день платежа - в случаях, когда услуги подлежат оплате в авансовом порядке, а при оплате за оказанные услуги за очередной отчетный период - по курсу, установленному Банком России на последний день отчетного месяца.
- 70.4.2. Если тарифы Клирингового центра и/или рассчитанные суммы комиссионного вознаграждения / суммы штрафов выражены в долларах США, оплата услуг Клирингового центра / штрафов Участником клиринга – нерезидентом осуществляется в долларах США.
- 70.5. Размер платы за услуги, оказываемые Клиринговым центром Участникам клиринга, которым присвоен код (коды) Расчетной фирмы, устанавливаются решением Клирингового центра и являются приложением к Правилам клиринга (приложение № Ф6 к Правилам клиринга).
- 70.5.1. Клиринговый центр на основании договоров с Организаторами торговли и в соответствии с их тарифами удерживает с Участников клиринга, являющихся участниками торгов Организатора торговли, биржевые сборы Организаторов торговли за регистрацию Срочных контрактов и сделок, заключенных в Секторе рынка Standard ФБ ММВБ.
- 70.5.2. Порядок исполнения обязательства Участника клиринга по оплате клиринговых услуг, по уплате биржевого сбора, а также иных сборов, комиссионных вознаграждений и иных платежей в пользу лиц, с которыми Клиринговым центром заключены соответствующие договоры, определен в статье 39 Правил клиринга.

Статья 71. Порядок формирования реестров Клирингового центра

- 71.1. Клиринговый центр ведет специализированную базу данных, в которую ежедневно, после окончания Расчетного дня, заносится информация, необходимая для ведения реестров Клирингового центра.
- 71.2. Реестр Участников клиринга содержит:
- полное фирменное наименование Участника клиринга – заполняется на основании информации, полученной от Участника клиринга в Анкете Участника клиринга;
 - код (коды) Участника клиринга, присвоенные Клиринговым центром в соответствии с Положением о клиринге;
 - место нахождения, номер телефона, факса, адрес электронной почты Участника клиринга – заполняется на основании информации, полученной от Участника клиринга в Анкете Участника клиринга;
 - ИНН Участника клиринга – заполняется на основании информации, полученной от Участника клиринга в Анкете Участника клиринга;

- реквизиты денежных торговых счетов Участников клиринга и их клиентов, через которые осуществляются расчеты по итогам клиринга, – заполняются на основании информации, полученной от Расчетной организации;
- фамилию, имя, отчество и должность лица, осуществляющего функции единоличного исполнительного органа Участника клиринга, и контролера – заполняются на основании информации, полученной от Участника клиринга в Анкете Участника клиринга;
- сведения о лицензии профессионального участника рынка ценных бумаг, включая: вид (виды) деятельности, на который выдана лицензия, наименование органа, выдавшего лицензию, номер лицензии, дату выдачи и дату окончания срока действия лицензии – заполняются на основании информации, полученной от Участника клиринга в Анкете Участника клиринга;
- дату аккредитации в качестве Участника клиринга – дата заключения Договора об оказании клиринговых услуг, заключенного с Участником клиринга;
- информацию о принятых Клиринговым центром дисциплинарных мерах по приостановлению проведения клиринга по сделкам Участника клиринга или об исключении из списка Участников клиринга – заполняется на основании решения руководителя Клирингового центра о применении дисциплинарных мер к Участнику клиринга или соглашения (уведомления) о расторжении Договора об оказании клиринговых услуг.

71.3. Реестр клиентов Участников клиринга содержит:

- код Участника клиринга, присвоенный Клиринговым центром в соответствии с Положением о клиринге;
- ИНН клиента Участника клиринга (или номер бланка паспорта для физических лиц, или код, присвоенный Участником клиринга) – заполняется на основании информации, полученной от Участника клиринга.

71.4. Реестр остатков ценных бумаг и денежных средств, размещенных на торговых счетах Участников клиринга и их клиентов, формируется на основании информации, полученной в Реестре остатков на торговых счетах депо и Сведениях о денежных средствах, зарезервированных на торговых счетах (приложения №№ С5, С7 к Правилам клиринга), и содержит:

- дату документа – дату получения Реестра остатков на торговых счетах депо и Сведений о денежных средствах, зарезервированных на торговых счетах;
- номер документа – номер Реестра остатков на торговых счетах депо и Сведений о денежных средствах, зарезервированных на торговых счетах;
- счет депо / денежный счет – поле «Номер торгового счета» из Реестра остатков на торговых счетах депо и Сведений о денежных средствах, зарезервированных на торговых счетах;
- код ценной бумаги – поле «Код ценной бумаги, присвоенный Клиринговым центром» из Реестра остатков на торговых счетах депо;
- количество ценных бумаг / сумма денежных средств - поле «Количество ценных бумаг, учитываемых на торговом счете» из Реестра остатков на торговых счетах депо / «Сумма зарезервированных денежных средств» из Сведений о денежных средствах, зарезервированных на торговых счетах.

- 71.5. Реестр принятых поручений формируется по всем поручениям, принятым Клиринговым центром, и содержит:
- идентификационный номер поручения – номер поручения на клиринг / поручения на отмену поручения на клиринг / реестра сделок;
 - дату составления поручения – дату получения поручения Клиринговым центром;
 - код Участника клиринга или Организатора торговли, представившего поручение.
- 71.6. Реестр сделок, по которым осуществлен клиринг, формируется ежедневно на основании информации о сделках, рассчитанных в течение данного Расчетного дня, и содержит:
- идентификационный номер сделки;
 - дату и время клиринга по сделке;
 - вид сделки (спот-сделка, Сделка репо, иная сделка с ценными бумагами, Срочная сделка, Конверсионная сделка);
 - дату и номер поручения, на основании которого осуществляется клиринг по сделке;
 - коды участников торгов, совершивших сделку, или код участника торгов и код Клирингового центра, если сделка заключена с Клиринговым центром;
 - коды Участников клиринга, на которых возложены обязательства по исполнению сделки, или код Участника клиринга и код Клирингового центра, если сделка заключена с Клиринговым центром;
 - коды клиентов Участников клиринга, по поручению и за счет которых должна быть исполнена сделка, или код клиента Участника клиринга и код Клирингового центра, если сделка заключена с Клиринговым центром;
 - наименование эмитента (наименование паевого инвестиционного фонда и его управляющей компании, индивидуальное обозначение, идентифицирующее ипотечные сертификаты участия, и наименование управляющего ипотечным покрытием), вид, категорию (тип), серию ценной бумаги;
 - цену (стоимость) одной ценной бумаги, Срочного контракта;
 - сумму сделки;
 - количество ценных бумаг, Срочных контрактов;
 - результат клиринга;
 - дату и время проведения расчетов по сделке.
- 71.7. Реестр поручений, направленных Расчетной организации и Расчетному депозитарию, формируется на основании информации из Реестров поручений по итогам клиринга, Сводных ведомостей по обязательствам и требованиям по денежным средствам (приложения №№ С4,С6 к Правилам клиринга), Подтверждений исполнения расчетов и Отчетов об исполнении Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по денежным средствам (приложения №№ С5,С7 к Правилам клиринга) и содержит:
- номер поручения – номер Реестра поручений по итогам клиринга или Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по денежным средствам;

- дату поручения – дату формирования и отправки Реестра поручений по итогам клиринга или Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по денежным средствам;
- коды счетов или лиц, по обязательствам которых должна быть проведена операция – «Номер торгового счета списания», «Номер торгового счета зачисления» из Реестра поручений по итогам клиринга или Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по денежным средствам;
- код валюты / код ценной бумаги - поле «Код валюты» из Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по денежным средствам / поле «Код ценной бумаги» из Реестра поручений по итогам клиринга;
- сумму денежных средств / количество ценных бумаг - поле «Сумма» из Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по денежным средствам / поле «Количество ценных бумаг для перечисления» из Реестра поручений по итогам клиринга;
- итоги исполнения операции («исполнено» / «не исполнено»).

71.8. Реестр Клиринговых отчетов, направленных Участникам клиринга, содержит:

- код Участника клиринга, которому направлен отчет, - поле «Код» из Клирингового отчета;
- дату отправления отчета;
- способ направления отчета (по Системе ЭДО / в бумажной форме);
- общую сумму обязательств (по каждому виду ценных бумаг и валюты) по сделкам участника клиринга и / или его клиентов.