



УТВЕРЖДЕНЫ

решением Наблюдательного совета

Банка НКЦ (АО)

от «22» сентября 2016 года (Протокол № 6)

Председатель Наблюдательного совета

Банка НКЦ (АО)



 Денисов Ю.О.

**ПРАВИЛА КЛИРИНГА
БАНКА «НАЦИОНАЛЬНЫЙ КЛИРИНГОВЫЙ ЦЕНТР»
(АКЦИОНЕРНОЕ ОБЩЕСТВО).
ЧАСТЬ VII. ПРАВИЛА КЛИРИНГА НА РЫНКЕ
СТАНДАРТИЗИРОВАННЫХ ПФИ**

Москва, 2016 г.

СОДЕРЖАНИЕ

РАЗДЕЛ I. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ	4
Статья 1. Термины и определения	4
Статья 2. Общие положения	5
Статья 3. Особенности использования Аналога собственноручной подписи	6
Статья 4. Клиринговые регистры	6
РАЗДЕЛ II. ТРЕБОВАНИЯ К УЧАСТНИКАМ КЛИРИНГА	8
Статья 5. Условия клирингового обслуживания. Порядок предоставления допуска к клиринговому обслуживанию	8
Статья 6. Особенности приостановления и прекращения допуска к клиринговому обслуживанию	9
Статья 7. Особенности регистрации Участников клиринга, особенности использования, открытия и закрытия Расчетных кодов Участника клиринга	10
Статья 8. Порядок открытия и закрытия регистров учета позиций	10
Статья 9. Особенности регистрации Обособленных клиентов	12
РАЗДЕЛ III. МЕРЫ, НАПРАВЛЕННЫЕ НА УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ ПРИ ОСУЩЕСТВЛЕНИИ КЛИРИНГА	13
Статья 10. Перечень мер, направленных на управление рисками при осуществлении клиринга	13
Статья 11. Контроль достаточности Обеспечения Участника клиринга и риск-параметры	13
Статья 12. Порядок заключения балансирующих сделок в ходе аукциона ликвидации	15
РАЗДЕЛ IV. ПОРЯДОК И УСЛОВИЯ ДОПУСКА ОБЯЗАТЕЛЬСТВ К КЛИРИНГУ	18
Статья 13. Возможность заключения внебиржевых Договоров СПФИ	18
Статья 14. Порядок заключения внебиржевых Договоров СПФИ	18
Статья 15. Особенности заключения внебиржевых Договоров СПФИ с использованием Рабочего места Блумберг / Рабочего места Рейтер	22
Статья 16. Порядок взаимодействия с Биржей при подаче Заявок и заключении Договоров СПФИ	23
Статья 17. Изменение условий Договора СПФИ	24
Статья 18. Досрочное прекращение Договора СПФИ	26
Статья 19. Изменение порядка учета Договоров СПФИ	27
РАЗДЕЛ V. ПОРЯДОК ПРОВЕДЕНИЯ КЛИРИНГА	29
ПОДРАЗДЕЛ V-I. ПОРЯДОК ВНЕСЕНИЯ И ВОЗВРАТА ОБЕСПЕЧЕНИЯ	29
Статья 20. Порядок внесения Обеспечения	29
Статья 21. Порядок возврата Обеспечения	31
ПОДРАЗДЕЛ V-II. КЛИРИНГОВЫЕ СЕССИИ	36
Статья 22. Порядок проведения клиринговых сессий	36
ПОДРАЗДЕЛ V-III. ПОРЯДОК ОПРЕДЕЛЕНИЯ И ИСПОЛНЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ, ВКЛЮЧЕННЫХ В КЛИРИНГОВЫЙ ПУЛ КЛИРИНГОВОЙ СЕССИИ	38

Статья 23.	Вариационная маржа	38
Статья 24.	Депозитная маржа	39
Статья 25.	Порядок исполнения (прекращения) обязательств, включенных в клиринговый пул.....	42
Статья 26.	Порядок возникновения и исполнения Маржинальных требований.....	43
Статья 27.	Порядок действий в случае наличия Задолженности и/или обязательств, не обеспеченных средствами под исполнение	46
Статья 28.	Порядок заключения и условия сделок своп / сделки купли-продажи с иностранной валютой, заключаемых с Недобросовестными участниками клиринга	48
Статья 29.	Особенности использования взносов Добросовестных участников клиринга в Гарантйный фонд	52
ПОДРАЗДЕЛ V-IV. ПОРЯДОК ИСПОЛНЕНИЯ ОПЦИОННЫХ ДОГОВОРОВ		53
Статья 30.	Порядок осуществления права на исполнение по внебиржевым опционным Договорам СПФИ.....	53
РАЗДЕЛ VI. ПОРЯДОК ОПЛАТЫ УСЛУГ. ОТЧЕТЫ ПО ИТОГАМ КЛИРИНГА		55
Статья 31.	Особенности оплаты услуг Клирингового центра и Биржи	55
Статья 32.	Порядок предоставления информации и отчетов по итогам клиринга	55
РАЗДЕЛ VII. ПРОЧИЕ УСЛОВИЯ		57
Статья 33.	Особенности перевода обязательств и Обеспечения одного Участника клиринга другому Участнику клиринга	57
Приложение № 1 Временной регламент на рынке Стандартизированных ПФИ.....		58

РАЗДЕЛ I. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ

Настоящие «Правила клиринга Банка «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество). Часть VII. Правила клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ» (далее – Правила клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ) являются неотъемлемой частью Правил клиринга Банка «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество) и совместно с «Правилами клиринга Банка «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество). Часть I. Общая часть» (далее – общая часть Правил клиринга) и «Правилами клиринга Банка «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество). Часть II. Тарифы» (далее – Тарифы Клирингового центра) регулируют отношения, связанные с заключением и исполнением договоров, являющихся производными финансовыми инструментами, заключаемых не на организованных торгах в соответствии с Правилами клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ, а также отношения, связанные с исполнением договоров, являющихся производными финансовыми инструментами, заключаемых на организованных торгах ПАО Московская Биржа на рынке Стандартизированных ПФИ.

Статья 1. Термины и определения

1.1. В Правилах клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ используются термины, определенные в общей части Правил клиринга, а также следующие термины:

Аукционная заявка -	Предложение Участника клиринга, содержащее оферты, направленные на аукционе ликвидации на заключение всех Аукционных договоров, составляющих лот аукциона ликвидации.
Аукционный договор -	Договор СПФИ, заключаемый с Добросовестным участником клиринга в ходе аукциона ликвидации на условиях, идентичных условиям неисполненных обязательств по Договору СПФИ, стороной по которому является Недобросовестный участник клиринга, или Участник клиринга, в отношении которого / клиента которого проводится ликвидационный неттинг в соответствии с общей частью Правил клиринга, или Участник клиринга, в отношении которого Клиринговый центр допустил дефолт в соответствии с общей частью Правил клиринга.
Аукционный портфель -	все Аукционные договоры.
Договор СПФИ -	договор, являющийся в соответствии с Федеральным законом от 22.04.1996 №39-ФЗ «О рынке ценных бумаг» производным финансовым инструментом: заключаемый не на организованных торгах в соответствии с Правилами клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ на условиях Спецификации, утвержденной Клиринговым центром, и Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ (далее – внебиржевой Договор СПФИ), или заключаемый на организованных торгах ПАО Московская Биржа на рынке Стандартизированных ПФИ в соответствии с

	Правилами торгов на рынке Стандартизированных ПФИ на условиях Спецификации, утвержденной Биржей, и Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ (далее – биржевой Договор СПФИ).
Методика расчета рисков на рынке Стандартизированных ПФИ -	внутренний документ Клирингового центра, устанавливающий порядок определения риск-параметров рынка Стандартизированных ПФИ, расчетной стоимости Договора СПФИ и величин, используемых для контроля достаточности Обеспечения Участника клиринга.
Предложение о заключении внебиржевого Договора СПФИ (Предложение) -	оферта, направляемая Участником клиринга или Клиринговым центром на заключение внебиржевого Договора СПФИ, содержащая условия внебиржевого Договора СПФИ и иную информацию, предусмотренную Правилами клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ и Спецификацией.
Предложение «Стратегия» -	оферта, направляемая Участником клиринга или Клиринговым центром на одновременное заключение нескольких внебиржевых Договоров СПФИ, содержащая условия, необходимые для определения условий внебиржевых Договоров СПФИ и иную информацию, предусмотренную Правилами клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ и Спецификацией.
Репозитарий -	Небанковская кредитная организация акционерное общество «Национальный расчетный депозитарий» (НКО АО НРД), выполняющие функции репозитария в соответствии с главой 3.2 Федерального закона от 22.04.1996 № 39-ФЗ «О рынке ценных бумаг».
Спецификация -	документ, совместно с Правилами торгов на рынке Стандартизированных ПФИ и/или Правилами клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ определяющий стандартные условия Договора СПФИ и порядок его исполнения.

Статья 2. Общие положения

- 2.1. Клиринговый центр осуществляет клиринг, выполняя функции центрального контрагента по всем Договорам СПФИ.
- 2.2. Клиринговый центр осуществляет клиринг в отношении следующих производных финансовых инструментов:
 - своп-договоров;
 - фьючерсных договоров;
 - форвардных договоров;
 - опционных договоров,
 а также в отношении сделок своп и сделок купли-продажи с иностранной валютой.
- 2.3. Формы и форматы документов, предоставляемых Участниками клиринга Клиринговому центру в соответствии с Правилами клиринга на рынке

Стандартизированных ПФИ и способ их предоставления установлены документом «Формы и форматы документов, предоставляемых Участниками клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ», если иное не установлено Правилами клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ.

- 2.4. Сроки исполнения обязательств, определенных Правилами клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ, а также сроки проведения клиринговых операций, сроки предоставления документов Клиринговому центру / Клиринговым центром в процессе взаимодействия с Участниками клиринга при проведении клиринга в соответствии с Правилами клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ, установлены Временным регламентом на рынке Стандартизированных ПФИ, являющимся приложением № 1 к Правилам клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ.
- 2.5. Техническим центром на рынке Стандартизированных ПФИ является ООО «МБ Технологии».

Статья 3. Особенности использования Аналога собственноручной подписи

- 3.1. Аналогом собственноручной подписи признается Клиринговый идентификатор, позволяющий однозначно идентифицировать Участника клиринга или Клиринговый центр, направивших электронное сообщение и достоверно установить, что электронное сообщение исходит от Участника клиринга или Клирингового центра, которому присвоен данный Клиринговый идентификатор.
- 3.2. Порядок присвоения Клирингового идентификатора Участнику клиринга / Участнику торгов определен общей частью Правил клиринга.

Статья 4. Клиринговые регистры

- 4.1. Клиринговый центр осуществляет внутренний учет, предусмотренный Законом о клиринге, на клиринговых регистрах. Клиринговые регистры ведутся Клиринговым центром в Клиринговой системе.
- 4.2. При осуществлении клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ Клиринговый центр открывает и ведет клиринговые регистры, предусмотренные общей частью Правил клиринга, а также:
- регистры учета позиций, предназначенные для учета сведений о Договорах СПФИ, сделках своп и сделках купли-продажи с иностранной валютой, обязательства из которых допущены к клирингу, и стороной по которым является Участник клиринга.
- 4.3. При осуществлении клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ на клиринговых регистрах Клиринговый центр кроме учета, предусмотренного общей частью Правил клиринга, также учитывает:
- сведения о Договорах СПФИ, обязательства из которых допущены к клирингу, с учетом Соглашений об изменении условий Договора СПФИ и Соглашений о досрочном прекращении Договора СПФИ, на регистрах учета позиций;

- сведения о сделках своп и сделках купли-продажи с иностранной валютой, заключенных в соответствии с подпунктом 26.6.5 и/или статьей 27 на рынке Стандартизированных ПФИ, на регистрах учета позиций;
- обязательства Участника клиринга и/или Клирингового центра из Договоров СПФИ по уплате денежных сумм, включая, но не ограничиваясь, обязательствами по уплате вариационной маржи, премии, депозитной маржи, накопленной депозитной маржи, процентов на накопленную депозитную маржу, суммы платежа, суммы первоначального платежа, суммы окончательного платежа, суммы промежуточного платежа, дополнительного платежа, плавающей суммы, фиксированной суммы, суммы периода капитализации, номинальной суммы, по Датам исполнения и по Расчетным кодам;
- обязательства Участника клиринга и/или Клирингового центра из сделок своп и сделок купли-продажи с иностранной валютой, заключенных в соответствии с подпунктом 26.6.5 и/или статьей 27 на рынке Стандартизированных ПФИ, по Датам исполнения и по Расчетным кодам;
- Итоговое нетто-обязательство / Итоговое нетто-требование Участника клиринга в каждой валюте по Расчетным кодам;
- Обеспечение Участника клиринга в каждой валюте по Расчетным кодам;
- Задолженность Участника клиринга перед Клиринговым центром (в каждой валюте) по Расчетному коду (в случае наличия);
- Маржинальное требование Участника клиринга по Расчетным кодам (в случае наличия).

4.4. Порядок ведения клиринговых регистров определен в соответствующих статьях разделов IV и V Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ.

РАЗДЕЛ II. ТРЕБОВАНИЯ К УЧАСТНИКАМ КЛИРИНГА

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

- 5.1. На рынке Стандартизированных ПФИ Участникам клиринга может быть присвоена следующая категория Участников клиринга:
- Участники клиринга категории «Б».
- 5.2. Допуск к клиринговому обслуживанию на рынке Стандартизированных ПФИ предоставляется Участнику клиринга, соответствующему требованиям, установленным для Участников клиринга категории «Б» в общей части Правил клиринга, а также требованиям, указанным в пункте 5.3 или 5.4 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ.
- 5.3. Для допуска к клиринговому обслуживанию Участник клиринга - Некредитная организация должен дополнительно соответствовать следующим требованиям:
- 5.3.1. иметь действующую лицензию на осуществление брокерской деятельности и/или дилерской деятельности и/или деятельности по управлению ценными бумагами;
- 5.3.2. иметь собственные средства (капитал) не менее, чем 300 000 000 (триста миллионов) российских рублей.
- 5.4. Для допуска к клиринговому обслуживанию Участник клиринга – Банк-нерезидент должен дополнительно соответствовать следующим требованиям:
- 5.4.1. иметь собственные средства (капитал) не менее, чем 50 000 000 000 (пятьдесят миллиардов) российских рублей, либо
- 5.4.2. иметь собственные средства (капитал) не менее, чем 20 000 000 000 (двадцать миллиардов) российских рублей и рейтинг по международной шкале долгосрочной кредитоспособности по обязательствам в российских рублях или в иностранной валюте не ниже BB- по классификации рейтинговых агентств "Standard & Poor's" или "Fitch Ratings" либо "Ba3" по классификации рейтингового агентства "Moody's Investors Service".
- 5.4.3. Для проверки соответствия собственных средств (капитала) Участника клиринга – Банка-нерезидента требованиям, установленным подпунктами 5.4.1-5.4.2 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ, размер собственных средств (капитала) Участника клиринга – Банка-нерезидента в иностранной валюте пересчитывается в российские рубли по курсу иностранной валюты к российскому рублю, установленному Банком России на первое число календарного квартала предоставления Участником клиринга Заявления о предоставлении допуска к клиринговому обслуживанию.
- 5.5. В случае изменения суверенного рейтинга Российской Федерации, значения рейтингов по международной шкале долгосрочной кредитоспособности по обязательствам в российских рублях или в иностранной валюте, применяемые для предоставления допуска к клиринговому обслуживанию в соответствии с подпунктом 5.4.2 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ, могут быть изменены решением Клирингового центра, раскрываемом на Сайте

Клирингового центра.

Статья 6. Особенности приостановления и прекращения допуска к клиринговому обслуживанию

- 6.1. Клиринговый центр вправе приостановить допуск к клиринговому обслуживанию Участника клиринга - Некредитной организации по любому из оснований, предусмотренных общей частью Правил клиринга в качестве оснований для приостановления допуска к клиринговому обслуживанию, а также по любому из следующих оснований:
- 6.1.1. отзыв (аннулирование) Банком России лицензии на осуществление брокерской деятельности и/или дилерской деятельности и/или деятельности по управлению ценными бумагами у Участника клиринга – Некредитной организации;
- 6.1.2. несоответствие размера собственных средств (капитала) Участника клиринга требованию, установленному подпунктом 5.3.2 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ.
- 6.2. Клиринговый центр вправе приостановить допуск к клиринговому обслуживанию Участника клиринга – Банка-нерезидента по любому из оснований, предусмотренных общей частью Правил клиринга в качестве оснований для приостановления допуска к клиринговому обслуживанию, а также по следующему основанию:
- 6.2.1. несоответствие Участника клиринга требованиям, установленным подпунктом 5.4.1 или подпунктом 5.4.2 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ.
- При этом в целях проверки соответствия собственных средств (капитала) Участника клиринга – Банка-нерезидента требованиям, установленным подпунктами 5.4.1-5.4.2 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ, размер собственных средств (капитала) Участника клиринга – Банка-нерезидента в иностранной валюте пересчитывается в российские рубли по курсу иностранной валюты к российскому рублю, установленному Банком России на первое число каждого календарного квартала.
- 6.3. При наличии оснований, предусмотренных общей частью Правил клиринга в качестве оснований для приостановления допуска к клиринговому обслуживанию, а также оснований, предусмотренных подпунктами 6.1.1, 6.1.2 или 6.2.1 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ, Клиринговый центр вправе установить для Участника клиринга Режим закрытия позиций.
- 6.3.1. После получения информации о прекращении действия оснований для приостановления допуска к клиринговому обслуживанию, предусмотренных общей частью Правил клиринга и Правилами клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ, Клиринговый центр вправе принять решение об отмене Режимы закрытия позиций, установленного для Участника клиринга.
- 6.4. В случае если действие оснований для установления Участнику клиринга Режимы закрытия позиций не прекращено в течение 3-х рабочих дней после установления указанного режима в соответствии с пунктами 6.3 или 10.4 Правил клиринга на

рынке Стандартизированных ПФИ, Клиринговый центр вправе приостановить допуск к клиринговому обслуживанию Участника клиринга, начиная с 4-го рабочего дня с даты установления указанного режима.

- 6.5. Клиринговый центр прекращает допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию по любому из оснований, предусмотренных общей частью Правил клиринга в качестве оснований для прекращения допуска к клиринговому обслуживанию, а также при получении от Участника клиринга, не являющегося Участником торгов, заявления о прекращении допуска к клиринговому обслуживанию на рынке Стандартизированных ПФИ, при условии отсутствия учитываемых Клиринговым центром на регистрах учета позиций и Расчетных кодах Участника клиринга не прекращённых обязательств / требований Участника клиринга.

Статья 7. Особенности регистрации Участников клиринга, особенности использования, открытия и закрытия Расчетных кодов Участника клиринга

- 7.1. Процедура регистрации Участника клиринга Клиринговым центром предусматривает присвоение Участнику клиринга следующего идентификатора, помимо кодов, установленных общей частью Правил клиринга:
- Идентификатор (присваивается Клиринговым центром). Если Участник клиринга является Участником торгов, Идентификатор присваивается на основании данных, полученных от Биржи.
- 7.2. Определение обязательств из Договоров СПФИ, Задолженностей Участника клиринга, контроль достаточности Обеспечения Участника клиринга, перечисление и учет денежных средств Участника клиринга, исполнение (прекращение) обязательств по Договорам СПФИ, возникновение и прекращение Маржинального требования, уплата комиссионных вознаграждений осуществляется по Расчетному коду Участника клиринга.
- 7.3. Открытие Расчетного кода Участника клиринга, за исключением основного Расчетного кода Участника клиринга, осуществляется на основании Заявления на регистрацию Расчетного кода Участника клиринга, предоставленного Участником клиринга Клиринговому центру.
- 7.4. Закрытие Расчетного кода возможно при соблюдении условий, предусмотренных общей частью Правил клиринга, а также следующего условия:
- закрыты все регистры учета позиций, соответствующие Расчетному коду.

Статья 8. Порядок открытия и закрытия регистров учета позиций

- 8.1. Для заключения Договоров СПФИ у Участника клиринга должен быть открыт регистр учета позиций.
- 8.2. При предоставлении Участнику клиринга допуска к клиринговому обслуживанию на рынке Стандартизированных ПФИ Клиринговый центр открывает:
- основной собственный регистр учета позиций Участника клиринга.

- 8.3. Клиринговым центром для Участника клиринга на основании соответствующего заявления Участника клиринга могут быть открыты регистры учета позиций следующих типов:
- дополнительный собственный регистр учета позиций;
 - клиентский регистр учета позиций;
 - регистр учета позиций ДУ.
- 8.3.1. Участник клиринга, совпадающий в одном лице с Участником торгов, вправе подавать Заявки с указанием любых открытых для него регистров учета позиций.
- 8.4. В Заявлении на открытие регистра учета позиций должны быть указаны:
- код регистра учета позиций и тип регистра учета позиций;
 - Расчетный код Участника клиринга.
- 8.4.1. На основании Заявления на открытие регистра учета позиций Клиринговый центр:
- открывает для Участника клиринга регистр учета позиций с кодом и типом, указанными в заявлении;
 - устанавливает соответствие между открытым регистром учета позиций и Расчетным кодом Участника клиринга, указанным в заявлении;
 - устанавливает соответствие между регистром учета позиций и Участником торгов, имеющим право подавать заявки с указанием такого регистра учета позиций Участника клиринга (в случае указания в заявлении идентификатора и наименования Участника торгов).
- 8.4.2. Регистр учета позиций может соответствовать только одному Расчетному коду. Одному Расчетному коду (за исключением Расчетного кода, открытого для Обособленного клиента) могут соответствовать несколько регистров учета позиций. Расчетному коду, открытому для Обособленного клиента, может соответствовать только один клиентский регистр учета позиций, открытый для такого Обособленного клиента.
- 8.4.3. Заявление на открытие регистра учета позиций исполняется Клиринговым центром при условии, что тип регистра учета позиций и тип Расчетного кода совпадают.
- 8.5. Для заключения сделок от имени Участника клиринга на основании заявок Участника торгов, не совпадающего в одном лице с таким Участником клиринга, Участник клиринга обязан открыть для такого Участника торгов отдельный регистр учета позиций и предоставить Клиринговому центру информацию об идентификаторе и наименовании Участника торгов, который будет подавать заявки с указанием такого регистра учета позиций.
- В качестве такого регистра учета позиций не может быть указан регистра учета позиций, открытый для Обособленного клиента в соответствии с пунктом 9.1 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ, если таким Обособленным клиентом является не Участник торгов.
- Указанная информация предоставляется в форме Заявления на регистрацию регистра учета позиций.
- Подача указанного заявления считается согласием Участника клиринга на указание его в качестве стороны по Договорам СПФИ в заявках Участника торгов с соответствующим регистром учета позиций, открытым Участником клиринга для

такого Участника торгов.

- 8.5.1. Один регистр учета позиций может использовать только один Участник торгов.
- 8.5.2. Участник клиринга вправе изменить Участника торгов, который вправе подавать Заявки на заключение Договоров СПФИ с указанием регистра учета позиций Участника клиринга, путем подачи в Клиринговый центр соответствующего заявления.
- 8.5.3. Участник клиринга также вправе аннулировать соответствие между регистром учета позиций и Участником торгов, который вправе подавать Заявки на заключение Договоров СПФИ с указанием такого регистра учета позиций Участника клиринга, путем подачи в Клиринговый центр соответствующего заявления.
- 8.6. Закрытие регистра учета позиций (за исключением основного собственного регистра учета позиций) осуществляется на основании Заявления Участника клиринга на закрытие регистра учета позиций.
- 8.6.1. Закрытие основного собственного регистра учета позиций осуществляется в случае прекращения допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию на рынке Стандартизированных ПФИ.
- 8.6.2. Закрытие регистра учета позиций Участника клиринга осуществляется при условии отсутствия у Участника клиринга Договоров СПФИ, сделок своп и сделок купли-продажи с иностранной валютой, учитываемых по такому регистру учета позиций.
- 8.7. Клиринговый центр уведомляет Участника клиринга об открытии и закрытии регистра учета позиций не позднее рабочего дня, следующего за днем исполнения соответствующей операции, посредством ЭДО.

Статья 9. Особенности регистрации Обособленных клиентов

- 9.1. Помимо отдельного клиентского Расчетного кода Участник клиринга должен открыть для Обособленного клиента отдельный клиентский регистр учета позиций.
- 9.2. В Заявлении на регистрацию Обособленного клиента помимо информации, предусмотренной общей частью Правил клиринга, Участник клиринга обязан указать код раздела регистра учета позиций, открытый для Обособленного клиента.

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

Статья 10. Перечень мер, направленных на управление рисками при осуществлении клиринга

- 10.1. В целях снижения рисков, связанных с осуществлением клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ, Клиринговый центр применяет меры, предусмотренные общей частью Правил клиринга, а также:
- устанавливает лимит колебаний стоимости Договоров СПФИ для каждого Договора СПФИ, за пределы которых не может выходить расчетная стоимость Договора СПФИ при заключении Договора СПФИ и изменении условий Договора СПФИ.
- 10.2. Гарантийный фонд формируется Клиринговым центром за счет взносов в Гарантийный фонд всех Участников клиринга.
Размер взноса в Гарантийный фонд каждого Участника клиринга составляет 1 000 000 (один миллион) российских рублей.
- 10.3. Участники клиринга обязаны вносить Обеспечение под стресс.
Порядок определения размера Обеспечения под стресс Участника клиринга установлен Методикой определения размера Обеспечения под стресс.
- 10.4. При неисполнении Участником клиринга Маржинального требования по фондам и/или Маржинального требования по обеспечению под стресс, порядок выставления и исполнения которых определен общей частью Правил клиринга, Участнику клиринга устанавливается Режим закрытия позиций.
- 10.5. При использовании взноса Недобросовестного участника клиринга в Гарантийный фонд рынка Стандартизированных ПФИ и/или Обеспечения под стресс на рынке Стандартизированных ПФИ, клиринговое обслуживание Участника клиринга приостанавливается.
- 10.6. В случае возмещения Недобросовестным участником клиринга средств Гарантийного фонда рынка Стандартизированных ПФИ и Обеспечения под стресс на рынке Стандартизированных ПФИ в течение 1 (одного) Расчетного дня после направления Клиринговым центром такому Недобросовестному Участнику клиринга Маржинального требования по фонду и/или Маржинального требования по Обеспечению под стресс, клиринговое обслуживание Участника клиринга возобновляется.

Статья 11. Контроль достаточности Обеспечения Участника клиринга и риск-параметры

- 11.1. В целях контроля достаточности Обеспечения Участника клиринга Клиринговый центр рассчитывает Уровень обеспеченности позиций по каждому Расчетному коду Участника клиринга.

- 11.2. Уровень обеспеченности позиций рассчитывается Клиринговым центром как разность оценки Обеспечения, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, и требования к Обеспечению, рассчитанному по тому же Расчетному коду Участника клиринга.
- 11.2.1. Уровень обеспеченности позиций пересчитывается Клиринговым центром при изменении любого значения, которое входит в его расчет.
- 11.3. Оценка Обеспечения рассчитывается как сумма Обеспечения в российских рублях, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, и произведения Обеспечения в соответствующей иностранной валюте, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, на курс российского рубля к такой иностранной валюте, определенный в соответствии с Методикой расчета рисков на рынке Стандартизированных ПФИ, с учетом дополнительных параметров, установленных Методикой расчета рисков на рынке Стандартизированных ПФИ.
- 11.4. Требование к Обеспечению по Расчетному коду представляет собой оценку в российских рублях размера Обеспечения, необходимого для обеспечения исполнения обязательств по Договорам СПФИ и обязательств из Соглашений об изменении условий Договора СПФИ / Соглашений о досрочном прекращении Договора СПФИ, учитываемых по такому Расчетному коду, с учетом Заявки / Предложения / Предложения «Стратегия», поданных с указанием регистров учета позиций с кодами, соответствующими такому Расчетному коду Участника клиринга. Требование к Обеспечению рассчитывается Клиринговым центром в соответствии с Методикой расчета рисков на рынке Стандартизированных ПФИ.
- 11.5. Обеспечение, учитываемое по Расчетному коду Участника клиринга, является достаточным для обеспечения исполнения обязательств Участника клиринга, учитываемых по тому же Расчетному коду, если Уровень обеспеченности позиций по такому Расчетному коду является неотрицательным.
- 11.6. В случае, указанном в пункте 10.4 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ, а также в иных указанных в Правилах клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ случаях, Участнику клиринга устанавливается Режим закрытия позиций, при котором могут заключаться только такие Договоры СПФИ, стороной по которым является указанный Участник клиринга, заключение которых приводит к неувеличению требования к Обеспечению такого Участника клиринга.
- 11.7. Для контроля и управления рисками на рынке Стандартизированных ПФИ используются:
- расчетная стоимость Договора СПФИ;
 - лимит колебаний стоимости Договоров СПФИ.
- Перечень риск-параметров, используемых для расчета указанных величин, а также порядок их установления / определения приведены в Методике расчета рисков на рынке Стандартизированных ПФИ.
- 11.8. Расчет и/или изменение риск-параметров осуществляется Клиринговым центром каждый Торговый день по состоянию на момент времени окончания торгов, установленный Биржей.

Клиринговый центр может принять решение об изменении риск-параметров до начала и в ходе Торгов.

Порядок расчета и изменения риск-параметров установлен Методикой расчета рисков на рынке Стандартизированных ПФИ.

Статья 12. Порядок заключения балансирующих сделок в ходе аукциона ликвидации

12.1. В случае необходимости заключения Договоров СПФИ, являющихся балансирующими сделками, в соответствии с Правилами клиринга и в случае невозможности заключения Клиринговым центром всех или части указанных Договоров СПФИ на биржевом или внебиржевом рынках либо в случае если заключение всех или части указанных Договоров СПФИ в порядке, установленном общей частью Правил клиринга, приводит к нарушению условий ограничения ответственности Клирингового центра за неисполнение или ненадлежащее исполнение обязательств перед Добросовестными участниками клиринга, включенных в клиринговый пул на рынке Стандартизированных ПФИ, предусмотренных общей частью Правил клиринга, Клиринговый центр проводит аукцион ликвидации между Участниками клиринга в отношении Аукционного портфеля Недобросовестного участника клиринга.

При этом Аукционные договоры не заключаются в отношении Договоров СПФИ, стороной по которым является Недобросовестный участник клиринга, или Участник клиринга, в отношении которого / клиента которого проводится ликвидационный неттинг в соответствии с общей частью Правил клиринга, или Участник клиринга, в отношении которого Клиринговый центр допустил дефолт в соответствии с общей частью Правил клиринга, на условиях которых были заключены балансирующие сделки в порядке, установленном общей частью Правил клиринга.

12.2. В аукционе ликвидации могут принимать участие все Участники клиринга за исключением Недобросовестного участника клиринга.

12.3. Аукцион ликвидации проводится в следующем порядке.

12.3.1. Клиринговый центр посредством ЭДО направляет Участникам клиринга приглашение подавать Аукционные заявки, содержащее:

- информацию о дате и времени проведения аукциона ликвидации;
- информацию об условиях Аукционных договоров;
- информацию о стартовой цене аукциона. При этом стартовая цена аукциона определяется Клиринговым центром исходя из оценки справедливой стоимости Аукционного портфеля, рассчитанной с учетом соблюдения правил ограничения размера ответственности Клирингового центра, установленных общей частью Правил клиринга. Отрицательное значение стартовой цены означает обязанность Клирингового центра по внесению платы за заключение Аукционных договоров в размере абсолютного значения стартовой цены, положительное – требование Клирингового центра на получение платы в указанном размере.

12.3.2. В ходе проведения аукциона ликвидации Участники клиринга направляют

Клиринговому центру Аукционные заявки, каждая из которых должна содержать:

- для каждого Аукционного договора - код регистра учета позиций, на котором должен учитываться Аукционный договор;
- цена по каждому Расчетному коду, которому соответствует хотя бы один из указанных кодов регистров учета позиций (цена за заключение Аукционных договоров по Расчетному коду).

Ценой Аукционной заявки (платой за заключение Аукционных договоров) является сумма всех указанных цен за заключение Аукционных договоров по Расчетным кодам.

При этом цена Аукционной заявки не может быть меньше стартовой цены аукциона, указанной Клиринговым центром в соответствии с подпунктом 12.3.1 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ. Отрицательное значение цены Аукционной заявки означает обязанность Клирингового центра по внесению платы за заключение Аукционных договоров в размере абсолютного значения цены Аукционной заявки, положительное – требование Клирингового центра по получению платы в указанном размере.

Каждый Участник клиринга может отправлять Аукционные заявки неограниченное количество раз до окончания аукциона ликвидации. Направление каждой последующей Аукционной заявки рассматривается как отзыв ранее направленной Аукционной заявки и подача новой Аукционной заявки.

- 12.3.3. После сбора Аукционных заявок в отношении каждой Аукционной заявки Клиринговый центр осуществляет проверку Уровней обеспеченности позиций по каждому Расчетному коду, указанному в Аукционной заявке, для заключения указанных Аукционных договоров с учетом внесения платы за заключение Аукционных договоров по Расчетному коду в порядке, установленном Правилами клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ.
- 12.3.4. Клиринговый центр после проведения проверок, предусмотренных подпунктом 12.3.3 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ, определяет лучшую Аукционную заявку среди Аукционных заявок, для которых результат проверки Уровней обеспеченности позиций по Расчетным кодам является положительным.
- 12.3.5. Лучшей Аукционной заявкой признается Аукционная заявка, содержащая максимальную цену Аукционной заявки за заключение всех Аукционных договоров.
- 12.3.6. После определения лучшей Аукционной заявки Клиринговый центр заключает Аукционные договоры с Участником клиринга, направившим лучшую Аукционную заявку. При этом между Участником клиринга и Клиринговым центром в соответствии с условиями лучшей Аукционной заявки возникают обязательства по внесению/получению платы за заключение Аукционных договоров по Расчетному коду, которые учитываются на соответствующих Расчетных кодах. При этом данный Участник клиринга не уплачивает комиссионное вознаграждение Клирингового центра за осуществление клиринга по заключенным Аукционным договорам.
- 12.4. В случае если во время проведения аукциона ликвидации Участники клиринга не направили ни одной Аукционной заявки, либо на основании полученных

Клиринговым центром Аукционных заявок не были заключены Аукционные договоры, аукцион ликвидации признается несостоявшимся, и Клиринговый центр вправе осуществить одно или несколько из следующих действий:

- разделить Аукционный портфель на лоты и провести несколько аукционов ликвидации, на каждом из которых будут заключены Аукционные договоры, составляющие лот, определенный Клиринговым центром.
- заключить Аукционные договоры из Аукционного портфеля с Добросовестными участниками клиринга, являющимися сторонами по Договорам СПФИ, обязательства по которым не прекращены, противоположные Договорам СПФИ, стороной по которым является Недобросовестный участник клиринга, или Участник клиринга, в отношении которого / клиента которого проводится ликвидационный неттинг в соответствии с общей частью Правил клиринга, или Участник клиринга, в отношении которого Клиринговый центр допустил дефолт в соответствии с общей частью Правил клиринга, в объеме, пропорциональном объему Договоров СПФИ, стороной по которым являются Добросовестные участники клиринга,. При этом суммарная плата за заключение Аукционных договоров равна стартовой цене аукциона, указанной Клиринговым центром в соответствии с подпунктом 12.3.1 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ.

- 12.5. Аукционные договоры, заключенные в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ в ходе аукциона ликвидации, являются балансирующими сделками, определенными в общей части Правил клиринга.
- 12.6. В случае проведения аукциона ликвидации с Недобросовестного участника клиринга взимается штраф за неисполнение обязательств, установленный Тарифами.

РАЗДЕЛ IV. ПОРЯДОК И УСЛОВИЯ ДОПУСКА ОБЯЗАТЕЛЬСТВ К КЛИРИНГУ

Статья 13. Возможность заключения внебиржевых Договоров СПФИ

- 13.1. Клиринговый центр составляет и утверждает список предметов обязательств из договоров, заключенных не на организованных торгах (далее - Список).
- 13.2. Список содержит для каждого внебиржевого Договора СПФИ:
- код Договора СПФИ;
 - предмет обязательств по Договору СПФИ;
 - предмет обязательств по заключению Аукционных договоров.
- 13.3. С момента вступления в силу Списка допускается заключение внебиржевых Договоров СПФИ, параметры которых содержатся в Списке, и осуществление клиринга по указанным Договорам СПФИ на основании соответствующих Спецификаций и Правил клиринга.
- 13.4. Список и Спецификации раскрываются на Сайте Клирингового центра.
- 13.5. Клиринговый центр, являясь стороной внебиржевых Договоров СПФИ при выполнении им функций центрального контрагента, осуществляет функции информирующего лица, и передает Репозитарию на основании договора, заключенного с Репозитарием, информацию о заключенных внебиржевых Договорах СПФИ в объеме, порядке и сроки, установленные нормативными актами Банка России.

Статья 14. Порядок заключения внебиржевых Договоров СПФИ

- 14.1. Участники клиринга вправе заключать внебиржевые Договоры СПФИ в соответствии с Правилами клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ:
- от своего имени и за свой счет;
 - от своего имени и за счет своего клиента.
- 14.2. В целях заключения внебиржевого Договора СПФИ Участник клиринга или Клиринговый центр подает в Клиринговую систему Предложение. В целях заключения нескольких внебиржевых Договоров СПФИ Участник клиринга или Клиринговый центр подает в Клиринговую систему Предложение «Стратегия».
- 14.3. Клиринговый центр заключает внебиржевые Договоры СПФИ с Участниками клиринга исключительно для целей осуществления клиринга по Договорам СПФИ.
- 14.4. Предложение или Предложение «Стратегия» формируется как электронный документ, подписанный АСП.
- 14.5. Предложения или Предложения «Стратегия» могут подаваться в срок, установленный Временным регламентом на рынке Стандартизированных ПФИ.
- 14.6. Предложение должно содержать:
- код внебиржевого Договора СПФИ;

- условия, установленные формой Предложения, предусмотренной Спецификацией, за исключением условий, которые в соответствии со Спецификацией могут быть указаны по волеизъявлению сторон, с учетом ограничений, определенных Списком;
- код регистра учета позиций, на котором будет учитываться обязательства по внебиржевому Договору СПФИ, заключенному в соответствии с данным Предложением;
- Идентификатор Участника клиринга – конечного контрагента.

14.7. Предложение «Стратегия» должно содержать:

- код стратегии;
- условия, установленные формой Предложения «Стратегия», предусмотренной Спецификацией для стратегии с указанным кодом;
- код регистра учета позиций, на котором будут учитываться обязательства по всем внебиржевым Договорам СПФИ, заключенным в соответствии с данным Предложением «Стратегия»;
- Идентификатор Участника клиринга – конечного контрагента.

Коды внебиржевых Договоров СПФИ, заключенных в соответствии с Предложением «Стратегия», и их условия определяются на основании информации, указанной в Предложении «Стратегия» в соответствии со Спецификацией.

14.8. Два Предложения являются встречными, если они одновременно удовлетворяют следующим условиям:

- оба Предложения поданы по Договору СПФИ с одним кодом;
- в Предложениях указаны идентичные условия Договора СПФИ;
- при совпадении Идентификатора Участника клиринга, направившего одно Предложение, с Идентификатором Участника клиринга – конечного контрагента.

14.9. Два Предложения «Стратегия» являются встречными, если они одновременно удовлетворяют следующим условиям:

- оба Предложения «Стратегия» поданы с указанием одного кода стратегии;
- в Предложениях «Стратегия» указаны идентичные условия;
- при совпадении Идентификатора Участника клиринга, направившего одно Предложение «Стратегия», с Идентификатором Участника клиринга – конечного контрагента.

14.10. После того, как информация о поданном Участником клиринга Предложении, направленном на заключение внебиржевого Договора СПФИ, стороной по которому будет являться Участник клиринга, стала доступной Клиринговому центру посредством Клиринговой системы, Клиринговый центр осуществляет проверку возможности регистрации такого Предложения следующим образом:

- Клиринговый центр проверяет соответствие условий, указанных в Предложении, ограничениям, установленным Списком для данного внебиржевого Договора СПФИ, и условиям, установленным формой

Предложения, предусмотренной Спецификацией;

- Клиринговый центр выполняет проверки, аналогичные проверкам, установленным пунктом 16.2 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ для Заявок.

14.10.1. При положительном результате проверок первого этапа Клиринговый центр фиксирует в Клиринговой системе полученное Предложение до момента получения встречного Предложения. При отрицательном результате хотя бы одной проверки, указанной в настоящем пункте Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ, Клиринговый центр удаляет Предложение из Клиринговой системы.

14.10.2. Клиринговый центр регистрирует в Клиринговой системе Предложение, поданное Участником клиринга, при положительном результате всех проверок.

14.11. После того, как информация о поданном Участником клиринга Предложении «Стратегия» стала доступной Клиринговому центру посредством Клиринговой системы, Клиринговый центр осуществляет проверку возможности регистрации такого Предложения «Стратегия» в два этапа:

14.11.1. На первом этапе Клиринговый центр проверяет:

- соответствие условий каждого Договора СПФИ, заключаемого на основании данного Предложения «Стратегия», ограничениям, установленным Списком для данного внебиржевого Договора СПФИ, и условиям, установленным формой Предложения, предусмотренной Спецификацией;
- соответствие расчетной стоимости каждого Договора СПФИ, заключаемого на основании данного Предложения «Стратегия», лимиту колебаний стоимости такого Договора СПФИ, в соответствии с Методикой расчета рисков на рынке Стандартизированных ПФИ.

При положительном результате указанных в настоящем подпункте Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ проверок Клиринговый центр фиксирует полученное Предложение «Стратегия» до момента получения встречного Предложения «Стратегия». При отрицательном результате хотя бы одной проверки, указанной в настоящем подпункте Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ, Клиринговый центр удаляет Предложение «Стратегия» из Клиринговой системы.

14.11.2. На втором этапе, после фиксации в Клиринговой системе встречных Предложений «Стратегия», Клиринговый центр осуществляет проверки, аналогичные проверкам, установленным подпунктом 16.2.2 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ для Заявок.

14.11.3. Клиринговый центр регистрирует в Клиринговой системе Предложение «Стратегия», поданное Участником клиринга, при положительном результате всех проверок.

14.12. Предложение или Предложение «Стратегия», поданное Клиринговым центром, регистрируется в Клиринговой системе без осуществления проверок, предусмотренных настоящей статьей Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ.

- 14.13. Предложению, зафиксированному в Клиринговой системе в соответствии с подпунктом 14.10.2 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ, или Предложению «Стратегия», зафиксированному в соответствии с подпунктом 14.11.3 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ, Клиринговой системой присваивается идентификационный номер, информация о котором посредством Клиринговой системы направляется лицу, подавшему Предложение или Предложение «Стратегия».
- 14.14. Предложение или Предложение «Стратегия», действует до момента их удаления Клиринговым центром непосредственно перед началом клиринговой сессии или в порядке, установленном настоящей статьей Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ, до его отзыва или заключения на его основании внебиржевого Договора СПФИ (внебиржевых Договоров СПФИ).
- 14.15. Участник клиринга или Клиринговый центр могут отозвать Предложение или Предложение «Стратегия», поданное им, путем направления сообщения посредством Клиринговой системы.
С момента фиксации в Клиринговой системе встречных Предложений / Предложений «Стратегия» отзыв таких Предложений / Предложений «Стратегия» не допускается.
- 14.16. В случае технической невозможности отзыва Предложений или Предложений «Стратегия» посредством Клиринговой системы, Участник клиринга может предоставить Клиринговому центру заявление на отзыв поданных им Предложений или Предложений «Стратегия» посредством телефонной или факсимильной связи.
- 14.16.1. Для идентификации Участника клиринга Клиринговый центр запрашивает Идентификатор Участника клиринга, Клиринговый идентификатор и Пароль Участника клиринга.
- 14.16.2. Для идентификации Предложений или Предложений «Стратегия» Клиринговый центр запрашивает их идентификационные номера.
- 14.16.3. В случае успешной идентификации Участника клиринга и поданных им Предложений или Предложений «Стратегия», подлежащих отзыву, Клиринговый центр отзывает их из Клиринговой системы при наличии технической возможности.
- 14.16.4. При рассмотрении споров, связанных с отзывом Предложений или Предложений «Стратегия» посредством телефонной связи, Клиринговый центр и Участник клиринга вправе использовать запись телефонных переговоров.
- 14.17. Внебиржевой Договор СПФИ (внебиржевые Договоры СПФИ) заключается (заключаются) на основании зарегистрированных в Клиринговой системе встречных Предложений или Предложений «Стратегия» в момент акцепта Клиринговым центром оферт, условия которых содержатся в Предложениях / Предложениях «Стратегия», путем направления сообщения об акцепте Участникам клиринга-оферентам. Момент отображения указанного сообщения в Клиринговой системе считается моментом получения Участником клиринга-оферентом акцепта Клирингового центра.
- 14.18. Внебиржевые Договоры СПФИ (внебиржевой Договор СПФИ) заключаются

(заключается) Клиринговым центром при наличии двух встречных Предложений или Предложений «Стратегия». Если встречные Предложения / Предложения «Стратегия» поданы Участниками клиринга, то Клиринговый центр заключает внебиржевой Договор СПФИ с каждым из них. Если встречные Предложения / Предложения «Стратегия» поданы Участником клиринга и Клиринговым центром, то Клиринговый центр в целях осуществления клиринга заключает внебиржевой Договор СПФИ с таким Участником клиринга.

14.19. При заключении внебиржевого Договора СПФИ Клиринговый центр:

- присваивает заключенному внебиржевому Договору СПФИ идентификационный номер;
- учитывает заключенный внебиржевой Договор СПФИ на регистре учета позиций с кодом, указанным при подаче Предложения или Предложения «Стратегия», на основании которого заключен внебиржевой Договор СПФИ;
- определяет обязательства из заключенного внебиржевого Договора СПФИ в соответствии со Спецификацией и допускает указанные обязательства к клирингу.

Статья 15. Особенности заключения внебиржевых Договоров СПФИ с использованием Рабочего места Блумберг / Рабочего места Рейтер

15.1. Для Участников клиринга, использующих Рабочее место Блумберг / Рабочее место Рейтер для заключения внебиржевых Договоров СПФИ, подача / прием Предложений / Предложений «Стратегия» осуществляется путем обмена текстовыми сообщениями между Участниками клиринга и Клиринговым центром в соответствии с требованиями Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ, а также требованиями к оформлению сообщений, передаваемых с использованием Системы Блумберг / Системы Рейтер.

15.2. Текстовые сообщения, полученные от Участника клиринга с использованием Рабочего места Блумберг / Рабочего места Рейтер, транслируются в Клиринговую систему в виде Предложений / Предложений «Стратегия».

Участники клиринга несут полную ответственность за подаваемые с использованием Рабочего места Блумберг / Рабочего места Рейтер Предложения / Предложения «Стратегия».

15.3. Подтверждением подачи / приема Предложений / Предложений «Стратегия» с использованием Рабочего места Блумберг / Рабочего места Рейтер является протокол, содержащий текст переговоров между Участником клиринга и Клиринговым центром по Системе Блумберг / Системе Рейтер, который выражает не требующее дополнительного подтверждения согласие Участника клиринга на заключение внебиржевого Договора СПФИ в соответствии с Правилами клиринга, а также иными внутренними документами Клирингового центра.

15.4. При заключении внебиржевых Договоров СПФИ с использованием Рабочего места Блумберг / Рабочего места Рейтер Предложение / Предложение «Стратегия» Участника клиринга считается поданным в Клиринговую систему с момента получения таким Участником клиринга подтверждения от Клирингового центра о

приеме такого Предложения / Предложения «Стратегия».

- 15.5. После подачи Предложения / Предложения «Стратегия» в Клиринговую систему с использованием Рабочего места Блумберг / Рабочего места Рейтер производится обработка такого Предложения / Предложения «Стратегия» в соответствии с пунктами 14.10-14.16 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ.
- 15.6. Заключение внебиржевых Договоров СПФИ по Предложениям / Предложениям «Стратегия», поданным в Клиринговую систему с использованием Рабочего места Блумберг / Рабочего места Рейтер, осуществляется в порядке, предусмотренном пунктами 14.17-14.19 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ.
- 15.7. В случае неработоспособности Рабочего места Участника клиринга по причине сбоя в Системе Блумберг / Системе Рейтер Предложения / Предложения «Стратегия», принятые до возникновения неработоспособности Рабочего места Участника клиринга, не аннулируются.
- Исполнение Участником клиринга своих обязательств по внебиржевым Договорам СПФИ, заключенным на основании Предложений / Предложений «Стратегия», поданных им с использованием Рабочего места Блумберг / Рабочего места Рейтер до возникновения неработоспособности Рабочего места Участника клиринга осуществляется в соответствии с Правилами клиринга.

Статья 16. Порядок взаимодействия с Биржей при подаче Заявок и заключении Договоров СПФИ

- 16.1. Клиринговый центр посредством Системы торгов передает Бирже информацию:
- о зарегистрированных регистрах учета позиций;
 - об Участниках торгов, не совпадающих в одном лице с Участником клиринга, имеющих право подавать заявки с указанием регистра учета позиций Участника клиринга;
 - о зарегистрированных Обособленных клиентах;
 - иную информацию, предусмотренную Правилами торгов на рынке Стандартизированных ПФИ.
- 16.2. После того, как информация о поданной Участником торгов Заявке, направленной на заключение Договора СПФИ, стороной по которому будет являться Участник клиринга, стала доступной Клиринговому центру посредством Системы торгов, Клиринговый центр осуществляет проверку возможности регистрации такой Заявки в два этапа:
- 16.2.1. На первом этапе Клиринговый центр проверяет соответствие расчетной стоимости Договора СПФИ, который может быть заключен на основании поданной Заявки, лимиту колебаний стоимости такого Договора СПФИ в соответствии с Методикой расчета рисков на рынке Стандартизированных ПФИ.
- 16.2.2. На втором этапе, после того, как Клиринговому центру посредством Системы торгов стала доступной информация о подаче Заявки, являющейся в соответствии с Правилами торгов на рынке Стандартизированных ПФИ встречной по отношению к ранее поданной Заявке, Клиринговый центр осуществляет следующие проверки

каждой из встречных Заявок:

- при неотрицательном значении Уровня обеспеченности позиций по Расчетному коду, соответствующему регистру учета позиций, указанному в Заявке, до момента подачи Заявки - проверку того, что Уровень обеспеченности позиций по такому Расчетному коду не станет отрицательным с учетом поданной Заявки;
- при отрицательном значении Уровня обеспеченности позиций по Расчетному коду, соответствующему регистру учета позиций, указанному в Заявке, до момента подачи Заявки - проверку неуменьшения Уровня обеспеченности позиций по такому Расчетному коду с учетом поданной Заявки;
- при неотрицательном значении Уровня обеспеченности позиций по Расчетному коду, соответствующему коду регистра учета позиций, указанному в Заявке, до момента подачи Заявки, и при условии, что на момент подачи Заявки Участнику клиринга установлен Режим закрытия позиций, - проверку неувеличения требования к Обеспечению по такому Расчетному коду с учетом поданной Заявки.

16.3. После проведения Клиринговым центром проверок, предусмотренных настоящей статьей Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ, информация о результате таких проверок становится доступной Бирже посредством Системы торгов: в случае положительного результата всех проверок – информация о возможности регистрации обеих встречных Заявок, в случае отрицательного результата хотя бы одной из проверок – информацию о невозможности регистрации Заявки (Заявок).

16.4. При регистрации Заявок, являющихся в соответствии с Правилами торгов на рынке Стандартизированных ПФИ встречными Заявками, Клиринговый центр заключает Договор СПФИ с каждым из Участников клиринга, указанным в Заявке в качестве стороны по Договору СПФИ.

16.5. После того, как информация о регистрации Договора СПФИ стала доступной Клиринговому центру посредством Системы торгов, Клиринговый центр:

- учитывает заключенный Договор СПФИ на регистре учета позиций с кодом, указанным при подаче Заявки, на основании которой заключен такой Договор СПФИ;
- определяет обязательства из заключенного Договора СПФИ в соответствии со Спецификацией, учитывает их по Расчетному коду, соответствующему регистру учета позиций, указанному при подаче Заявки, на основании которой заключен такой Договор СПФИ, и допускает указанные обязательства к клирингу.

Статья 17. Изменение условий Договора СПФИ

17.1. Участник клиринга вправе изменить условия Договора СПФИ в порядке, установленном настоящей статьей Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ. Условия Договора СПФИ, которые могут быть изменены, устанавливаются Спецификацией Договора СПФИ.

- 17.2. В целях изменения условий Договора СПФИ Участник клиринга направляет Клиринговому центру оферту на изменение условий Договора СПФИ (Заявление об изменении условий Договора СПФИ). Указанное заявление направляется в виде электронного документа.
- 17.3. Заявление об изменении условий Договора СПФИ должно содержать:
- идентификационный номер Договора СПФИ;
 - условия Договора СПФИ, подлежащие изменению.
- 17.4. В ходе клиринговой сессии при наличии двух встречных поданных Заявлений об изменении условий Договора СПФИ или по одному поданному Заявлению об изменении условий Договора СПФИ, в случае если на момент подачи Участником клиринга такого заявления Парный Договор СПФИ прекращен, Клиринговый центр осуществляет проверку каждого указанного Заявления об изменении условий Договора СПФИ аналогично проверкам, установленным пунктом 16.2 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ для Заявки.
- 17.4.1. Встречными являются Заявления об изменении условий Договора СПФИ, удовлетворяющие следующим требованиям:
- Заявления направлены на изменение Парных договоров СПФИ;
 - условия Договоров СПФИ, подлежащие изменению, указанные в таких заявлениях, являются идентичными;
 - для каждого заявления: Идентификатор Участника клиринга, направившего заявление, совпадает с Идентификатором Участника клиринга – конечного контрагента.
- 17.4.2. При положительном результате указанных проверок Клиринговый центр осуществляет регистрацию Соглашения / Соглашений об изменении условий Договора СПФИ в соответствии с условиями Заявления об изменении условий Договора СПФИ / каждого из встречных Заявлений об изменении условий Договора СПФИ.
- 17.5. При наличии нескольких Договоров СПФИ, по которым поданы встречные Заявления об изменении условий Договора СПФИ, Клиринговый центр осуществляет проверки, указанные в пункте 17.4 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ, в порядке времени подачи встречных Заявлений об изменении условий Договора СПФИ, начиная с самого раннего. При этом временем подачи встречных Заявлений об изменении условий Договора СПФИ является время подачи более позднего из двух встречных Заявлений об изменении условий Договора СПФИ.
- 17.6. В случае если на момент подачи Участником клиринга Заявления об изменении условий Договора СПФИ Парный Договор СПФИ прекращен, Клиринговый центр вправе отказать Участнику клиринга в исполнении такого заявления.
- 17.7. В результате заключения Соглашения об изменении условий Договора СПФИ обязательства по Договору СПФИ, допущенные к клирингу, определенные в соответствии с условиями такого Договора СПФИ до его изменения, прекращаются, и возникают и допускаются к клирингу обязательства по такому Договору СПФИ в соответствии с измененными условиями.

- 17.8. Участник клиринга вправе отозвать Заявление об изменении условий Договора СПФИ, поданное им, путем направления в Клиринговый центр электронного документа до начала ближайшей клиринговой сессии.
- 17.9. Поданные Заявления об изменении условий Договора СПФИ аннулируются Клиринговым центром после окончания ближайшей клиринговой сессии.

Статья 18. Досрочное прекращение Договора СПФИ

- 18.1. Участник клиринга вправе направить Клиринговому центру оферту на досрочное прекращение Договора СПФИ (Заявление о досрочном прекращении Договора СПФИ), если с даты заключения указанного Договора СПФИ прошло не менее трех Расчетных дней. Указанное заявление направляется в виде электронного документа.
- 18.2. Заявление о досрочном прекращении Договора СПФИ должно содержать:
- идентификационный номер Договора СПФИ;
 - сумму компенсации, подлежащую уплате, учитывающую все издержки, связанные с досрочным прекращением Договора СПФИ.
- 18.3. В ходе клиринговой сессии при наличии двух встречных принятых Заявлений о досрочном прекращении Договора СПФИ или по одному поданному Заявлению о досрочном прекращении Договора СПФИ, в случае если на момент подачи Участником клиринга такого заявления Парный Договор СПФИ прекращен, Клиринговый центр осуществляет проверку каждого указанного Заявления о досрочном прекращении Договора СПФИ аналогично проверкам, установленным пунктом 16.2 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ для Заявки.
- 18.3.1. Встречными являются Заявления о досрочном прекращении Договора СПФИ, удовлетворяющие следующим условиям:
- заявления направлены на прекращение Парных договоров СПФИ;
 - для каждого заявления: Идентификатор Участника клиринга, направившего заявление, совпадает с Идентификатором Участника клиринга – конечного контрагента.
- 18.3.2. При положительном результате указанных проверок Клиринговый центр осуществляет регистрацию Соглашения / Соглашений о досрочном прекращении Договора СПФИ в соответствии с условиями Заявления о досрочном прекращении Договора СПФИ / каждого из встречных Заявлений о досрочном прекращении Договора СПФИ.
- 18.4. При наличии нескольких Договоров СПФИ, по которым поданы встречные Заявления о досрочном прекращении Договора СПФИ, Клиринговый центр осуществляет проверки, указанные в пункте 18.3 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ, в порядке времени подачи встречных Заявлений о досрочном прекращении Договора СПФИ, начиная с самого раннего. При этом временем подачи встречных Заявлений о досрочном прекращении Договора СПФИ является время подачи более позднего из двух встречных Заявлений о досрочном прекращении Договора СПФИ.

- 18.5. В случае если на момент подачи Участником клиринга Заявления о досрочном прекращении Договора СПФИ Парный Договор СПФИ прекращен, Клиринговый центр вправе отказать Участнику клиринга в исполнении такого заявления.
- 18.6. В результате заключения Соглашения о досрочном прекращении Договора СПФИ обязательства по Договору СПФИ, за исключением обязательств с наступившей Датой исполнения, допущенные к клирингу, определенные в соответствии с условиями такого Договора СПФИ до его прекращения, прекращаются, и возникают и допускаются к клирингу обязательства по такому Договору СПФИ, возникшие в связи с его досрочным прекращением.
- 18.7. При прекращении Договора СПФИ обязательства по такому Договору СПФИ, подлежащие исполнению в дату досрочного прекращения Договора СПФИ в соответствии со статьей 23 или статьей 24 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ, исполняются в ходе ближайшей клиринговой сессии в порядке, установленном статьей 25 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ.
- 18.8. Участник клиринга вправе отозвать Заявление о досрочном прекращении Договора СПФИ, поданное им, путем направления в Клиринговый центр электронного документа до начала ближайшей клиринговой сессии.
- 18.9. Поданные Заявления о досрочном прекращении Договора СПФИ аннулируются Клиринговым центром после окончания ближайшей клиринговой сессии.

Статья 19. Изменение порядка учета Договоров СПФИ

- 19.1. Участник клиринга имеет право потребовать от Клирингового центра изменить порядок учета Договоров СПФИ на регистрах учета позиций при условии, что оба регистра учета позиций открыты для одного лица, т.е. либо оба регистра являются собственными, либо оба регистра являются клиентскими, открытыми для одного и того же клиента.
- 19.2. Изменение учета Договоров СПФИ осуществляется Клиринговым центром на основании заявления, подаваемого Участником клиринга Клиринговому центру.
- 19.3. При изменении учета Договоров СПФИ Договоры СПФИ перестают учитываться Клиринговым центром на регистре учета позиций с одним кодом и начинают учитываться на регистре учета позиций с другим кодом.
- 19.4. Изменение учета Договоров СПФИ на регистрах учета позиций, соответствующих разным Расчетным кодам, осуществляется Клиринговым центром при положительном результате следующих проверок:
- выполняются проверки, предусмотренные пунктом 16.2 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ для Заявки, в предположении, что подана Заявка на заключение Договора СПФИ с указанием регистра учета позиций, на котором должен начать учитываться Договор СПФИ;
 - выполняется проверки, указанные в пункте 18.3 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ, в предположении, что подано Заявление о

досрочном прекращении Договора СПФИ, учитываемого по разделу регистра учета позиций, на котором должен перестать учитываться Договор СПФИ.

- 19.5. Изменение учета Договоров СПФИ осуществляется Клиринговым центром в ходе ближайшей клиринговой сессии после получения Клиринговым центром заявления, указанного в пункте 19.2 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ.

РАЗДЕЛ V. ПОРЯДОК ПРОВЕДЕНИЯ КЛИРИНГА

ПОДРАЗДЕЛ V-I. ПОРЯДОК ВНЕСЕНИЯ И ВОЗВРАТА ОБЕСПЕЧЕНИЯ

Статья 20. Порядок внесения Обеспечения

- 20.1. Обеспечение Участника клиринга в иностранной валюте, являющееся индивидуальным клиринговым обеспечением, и Обеспечение Участника клиринга в российских рублях вносится на клиринговый банковский счет Клирингового центра в Расчетной организации.
- 20.2. Обеспечение Участника клиринга в иностранной валюте, являющееся иным обеспечением, вносится на корреспондентский счет Клирингового центра в Расчетном банке.
- 20.3. Денежные средства в соответствующей валюте, предоставляемые в качестве Обеспечения в российских рублях и/или Обеспечения в иностранной валюте, перечисляются на соответствующий клиринговый банковский или корреспондентский счет Клирингового центра по реквизитам, размещенным на Сайте Клирингового центра, с обязательным указанием в назначении платежа Расчетного кода Участника клиринга.
 - 20.3.1. Клиринговый центр учитывает в Клиринговой системе денежные средства, перечисленные с указанием в назначении платежа Расчетного кода Участника клиринга, в качестве Обеспечения Участника клиринга по такому Расчетному коду.
 - 20.3.2. Если Расчетный код Участника клиринга, указанный в назначении платежа, не найден среди зарегистрированных Клиринговым центром Расчетных кодов Участника клиринга, Клиринговый центр вправе запросить у Участника клиринга уточнение назначения платежа. В случае получения от Участника клиринга или от банка плательщика уточнения назначения платежа, учет денежных средств в качестве Обеспечения Участника клиринга в соответствии с подпунктом 20.3.1 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ осуществляется Клиринговым центром после получения от Участника клиринга / банка плательщика такого уточнения назначения платежа с правильно указанным Расчетным кодом Участника клиринга.
 - 20.3.3. Если в течение 5 (пяти) Расчетных дней по соответствующей валюте с даты, следующей за датой зачисления денежных средств в российских рублях / иностранной валюте на соответствующий клиринговый банковский или корреспондентский счет Клирингового центра с не указанным / неправильно указанным Расчетным кодом Участника клиринга в назначении платежа, Участник клиринга / банк плательщика не предоставит Клиринговому центру уточнение назначения платежа с правильно указанным Расчетным кодом Участника клиринга, Клиринговый центр возвращает указанные денежные средства по реквизитам плательщика.
 - 20.3.4. Денежные средства, зачисленные на соответствующий клиринговый банковский или корреспондентский счет Клирингового центра, позднее времени, установленного Временным регламентом на рынке Стандартизированных ПФИ, учитываются Клиринговым центром в следующем Расчетном дне.

- 20.4. Денежные средства, учитываемые в качестве Обеспечения Участника клиринга, используются для обеспечения исполнения и исполнения обязательств по Договорам СПФИ, учитываемых по регистрам учета позиций, соответствующих Расчетному коду, по которому указанное Обеспечение учитывается, а также для исполнения обязательств по уплате комиссионных вознаграждений по Расчетному коду, по которому указанное Обеспечение учитывается.
- 20.5. Участник клиринга вправе предоставить Клиринговому центру Заявление об изменении статуса Обеспечения в иностранной валюте на рынке Стандартизированных ПФИ.
- 20.5.1. Для исполнения указанного заявления Клиринговый центр после учета всех клиринговых и иных операций текущего Расчетного дня:
- для каждого Расчетного кода Участника клиринга открывает Участнику клиринга Счета обеспечения в иностранных валютах, соответствующие лицевым счетам на балансовом счете № 47405;
 - переводит Обеспечение в иностранной валюте, учитываемое по каждому Расчетному коду, со Счета обеспечения, соответствующего такому Расчетному коду и лицевому счету, открытому на балансовом счете № 30420 (30421), на Счет обеспечения, соответствующий такому Расчетному коду и лицевому счету, открытому на балансовом счете № 47405;
 - закрывает Счета обеспечения в иностранных валютах, соответствующие лицевым счетам, открытым на балансовом счете № 30420 (30421);
 - уведомляет Участника клиринга о выполненных переводах Обеспечения в иностранных валютах по Счетам обеспечения в Отчетах о движении денежных средств, предоставляемых по итогам Расчетного дня исполнения Заявления об изменении статуса Обеспечения с иностранной валюте на рынке Стандартизированных ПФИ.
- 20.5.2. Начиная с Расчетного дня по соответствующей валюте, следующего за днем исполнения указанного заявления, Участник клиринга обязан вносить Обеспечение в иностранной валюте в соответствии с пунктом 20.2 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ.
- 20.6. Участник клиринга может перевести денежные средства, учитываемые в качестве Обеспечения, между своими Расчетными кодами, подав в Клиринговый центр Заявление о переводе.
- 20.6.1. Заявление о переводе не принимается Клиринговым центром к исполнению, если не выполняется хотя бы одно из следующих условий:
- сумма денежных средств в валюте, указанная Участником клиринга в Заявлении о переводе, превышает сумму денежных средств, учитываемую в качестве Обеспечения Участника клиринга по Расчетному коду, по которому осуществляется уменьшение денежных средств;
 - у Участника клиринга учитывается Задолженность по Расчетному коду, по которому осуществляется уменьшение денежных средств;
 - Уровень обеспеченности позиций по Расчетному коду, по которому осуществляется уменьшение денежных средств, является отрицательным;

- в результате уменьшения Обеспечения на сумму, указанную в Заявлении о переводе, Уровень обеспеченности позиций по Расчетному коду, по которому осуществляется уменьшение денежных средств, станет отрицательным.

20.6.2. При исполнении Заявления о переводе, сумма денежных средств Участника клиринга в соответствующей валюте, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга по Расчетному коду, по которому осуществляется уменьшение денежных средств, уменьшается, а по Расчетному коду, по которому осуществляется увеличение денежных средств, - увеличивается на сумму переводимых денежных средств.

20.7. Обеспечение Участника клиринга в российских рублях, учитываемое по Расчетному коду Участника клиринга, используется в следующей очередности:

- 1) для погашения Задолженности Участника клиринга перед Клиринговым центром;
- 2) для обеспечения исполнения обязательств Участника клиринга по Договорам СПФИ;
- 3) для исполнения обязательств в российских рублях из Договоров СФПИ;
- 4) для исполнения обязательств Участника клиринга по уплате комиссионных вознаграждений;
- 5) для уплаты пеней, штрафов, неустоек, предусмотренных Правилами клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ.

20.8. Обеспечение Участника клиринга в иностранной валюте, учитываемое по Расчетному коду Участника клиринга, используется в следующей очередности:

- 1) для обеспечения исполнения обязательств Участника клиринга по Договорам СПФИ;
- 2) для исполнения обязательств Участника клиринга в иностранной валюте из Договоров СПФИ.

20.9. После перечисления Участником клиринга денежных средств на счет Клирингового центра, открытый в Расчетной организации / Расчетном банке, и учета их в качестве Обеспечения Участника клиринга по Расчетному коду Участника клиринга, у Клирингового центра возникает обязательство вернуть Обеспечение Участнику клиринга в сумме, для которой условия, указанные в пункте 21.5 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ, будут выполняться.

Статья 21. Порядок возврата Обеспечения

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

- Запроса о возврате;
- Постоянного поручения на возврат.

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

21.3. Запрос о возврате может содержать:

- а) сумму денежных средств, или
- б) признак, указывающий на необходимость возврата всей доступной суммы денежных средств.

21.3.1. Запросы о возврате соответствующей валюты принимаются Клиринговым центром в Расчетные дни по соответствующей валюте в период времени, установленный Временным регламентом на рынке Стандартизированных ПФИ.

21.3.2. При предоставлении Запроса о возврате позднее времени, указанного во Временном регламенте на рынке Стандартизированных ПФИ, Клиринговый центр вправе не исполнять Запрос о возврате.

21.3.3. Запрос о возврате действует в день его предоставления.

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

Запрос о возврате, содержащий сумму денежных средств, исполняется при соблюдении условий, указанных в пункте 21.5 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ, при этом проверка указанных условий осуществляется в отношении суммы денежных средств, указанной в Запросе о возврате.

Исполнение Клиринговым центром Запроса о возврате, содержащего признак, указывающий на необходимость возврата всей доступной суммы денежных средств, осуществляется в максимально возможной сумме денежных средств, при котором условия, указанные в пункте 21.5 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ, будут выполняться, за вычетом суммы (сумм) денежных средств, указанных в Запросе на депонирование денежных средств и/или Постоянном поручении на депонирование денежных средств (в случае предоставления Участником клиринга Клиринговому центру Запроса на депонирование денежных средств и/или Постоянного поручения на депонирование денежных средств в соответствии с пунктом 21.4 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ).

21.3.5. Запрос о возврате, содержащий сумму денежных средств, не исполненный сразу после его получения по причине несоблюдения условий, указанных в пункте 21.5 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ, может быть исполнен Клиринговым центром позднее, в период до установленного Временным регламентом на рынке Стандартизированных ПФИ времени исполнения Постоянного поручения на возврат в соответствующей валюте, если будут соблюдены условия, указанные в пункте 21.5 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ.

21.3.6. Запрос о возврате, содержащий признак, указывающий на необходимость возврата всей доступной суммы денежных средств, не исполненный сразу после его получения по причине, что условия, указанные в пункте 21.5 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ, не выполняются ни для какой суммы денежных средств, аннулируется.

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

- 21.3.8. Постоянное поручение на возврат исполняется Клиринговым центром каждый Расчетный день по соответствующей валюте, начиная с первого Расчетного дня по соответствующей валюте, следующего за датой предоставления указанного поручения, при соблюдении условий его исполнения.
- 21.3.9. Исполнение Клиринговым центром Постоянного поручения на возврат осуществляется в срок, установленный Временным регламентом на рынке Стандартизированных ПФИ, в максимально возможной сумме денежных средств, при которой условия, указанные в пункте 21.5 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ, будут выполняться, за вычетом суммы (сумм) денежных средств, указанных в Запросе на депонирование денежных средств и/или Постоянном поручении на депонирование денежных средств (в случае предоставления Участником клиринга Клиринговому центру Запроса на депонирование денежных средств и/или Постоянного поручения на депонирование денежных средств в соответствии с пунктом 21.4 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ).
- 21.3.10. Клиринговый центр вправе принять решение об аннулировании действующих Постоянных поручений на возврат не ранее, чем начиная с Расчетного дня, следующего за днем принятия такого решения, в случае, если у Клирингового центра возникнут основания полагать, что существует необходимость в уточнении информации, указанной в Постоянном поручении на возврат. Клиринговый центр уведомляет Участника клиринга о принятом решении об аннулировании Постоянных поручений на возврат не позднее рабочего дня, следующего за днем принятия такого решения.
- 21.3.11. Постоянное поручение на возврат действует до его отмены Участником клиринга или до даты вступления в силу решения Клирингового центра об аннулировании Постоянных поручений на возврат.
- 21.3.12. Отмена Постоянного поручения на возврат Участником клиринга осуществляется с использованием Клиринговой системы или путем направления Участником клиринга Клиринговому центру документа на бумажном носителе в свободной форме или электронного документа.
- 21.4. Участник клиринга вправе предоставить Клиринговому центру Запрос о депонировании денежных средств или Постоянное поручение на депонирование денежных средств, содержащие указание на сумму денежных средств в определенной валюте, которую необходимо оставить в составе Обеспечения Участника клиринга в такой валюте при возврате денежных средств.
- Запрос о депонировании денежных средств или Постоянное поручение на депонирование денежных средств не применяются при исполнении Запроса о возврате, содержащего сумму денежных средств.
- 21.4.1. Запрос о депонировании денежных средств или Постоянное поручение на депонирование денежных средств должны содержать:
- а) Расчетный код Участника клиринга;
 - б) код валюты;
 - в) сумму денежных средств.
- 21.4.2. Запросы о депонировании денежных средств в соответствующей валюте принимаются Клиринговым центром в Расчетные дни по соответствующей валюте

в период времени, установленный Временным регламентом на рынке Стандартизированных ПФИ.

- 21.4.3. Запрос о депонировании денежных средств действует в день его предоставления.
- 21.4.4. Постоянное поручение на депонирование денежных средств выполняется Клиринговым центром каждый Расчетный день по соответствующей валюте, начиная с первого Расчетного дня по соответствующей валюте, следующего за датой предоставления указанного поручения.
- 21.4.5. Постоянное поручение на депонирование денежных средств действует до его отмены Участником клиринга.
- Отмена Постоянного поручения на депонирование денежных средств Участником клиринга осуществляется с использованием Клиринговой системы или путем направления Участником клиринга Клиринговому центру документа на бумажном носителе в свободной форме или электронного документа.
- 21.4.6. При наличии действующего Постоянного поручения на депонирование денежных средств в соответствующей валюте и подачи Запроса о депонировании денежных средств в такой валюте суммы денежных средств в такой валюте, указанные в таких документах складываются при определении суммы денежных средств, подлежащей возврату Участнику клиринга в соответствии с подпунктами 21.3.4, 21.3.9 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ.
- 21.5. Возврат Клиринговым центром Обеспечения Участнику клиринга осуществляется при соблюдении следующих условий:
- сумма Обеспечения в соответствующей валюте, подлежащая возврату, не превышает сумму денежных средств в такой валюте, учитываемую в качестве Обеспечения Участника клиринга по Расчетному коду;
 - у Участника клиринга отсутствует Задолженность по Расчетному коду;
 - Уровень обеспеченности позиций по Расчетному коду является неотрицательным;
 - в результате уменьшения Обеспечения на сумму, подлежащую возврату, Уровень обеспеченности позиций по Расчетному коду не станет отрицательным.
- 21.6. Для исполнения своего обязательства по возврату Участнику клиринга денежных средств в соответствующей валюте Клиринговый центр перечисляет денежные средства в такой валюте на соответствующий Счет для возврата, зарегистрированный в Клиринговом центре для соответствующего Расчетного кода Участника клиринга.
- 21.7. Обязательство Клирингового центра по возврату денежных средств Участнику клиринга считается исполненным с момента списания Расчетной организацией / Расчетным банком денежных средств с клирингового банковского / корреспондентского счета Клирингового центра.
- Клиринговый центр не несет ответственности за неисполнение (ненадлежащее исполнение) Расчетной организацией / Расчетным банком распоряжения Клирингового центра о списании денежных средств в пользу Участника клиринга за исключением случаев, если такое неисполнение явилось следствием вины

Клирингового центра.

- 21.8. При возврате Участнику клиринга Обеспечения в соответствующей валюте размер Обеспечения, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, в такой валюте уменьшается на сумму возвращаемых денежных средств.
- 21.9. Клиринговый центр вправе осуществить в любое время зачет денежных требований Участника клиринга по возврату ему Обеспечения в соответствующей валюте с денежными требованиями Клирингового центра к этому Участнику клиринга в соответствующей валюте.
- 21.10. В случае неисполнения Клиринговым центром обязательств по возврату Участнику клиринга денежных средств, учитываемых в качестве Обеспечения, Участник клиринга вправе инициировать дефолт Клирингового центра в отношении такого Участника клиринга в порядке, определенном общей частью Правил клиринга.

ПОДРАЗДЕЛ V-II. КЛИРИНГОВЫЕ СЕССИИ

Статья 22. Порядок проведения клиринговых сессий

- 22.1. Каждый Расчетный день в срок, установленный Временным регламентом на рынке Стандартизированных ПФИ, Клиринговый центр проводит клиринговую сессию, в ходе которой выполняет следующие действия в следующей последовательности:
- 22.1.1. устанавливает риск-параметры в соответствии с Методикой расчета рисков на рынке Стандартизированных ПФИ;
 - 22.1.2. учитывает на регистрах учета позиций изменение условий Договоров СПФИ на основании Соглашений об изменении условий Договора СПФИ;
 - 22.1.3. изменяет учет обязательств по Договорам СПФИ на регистрах учета позиций на основании заявлений Участников клиринга;
 - 22.1.4. определяет обязательства / требования Участников клиринга и Клирингового центра по уплате / получению вариационной / депозитной маржи в соответствии со статьями 23, 24 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ с учетом Соглашений об изменении условий Договора СПФИ, Соглашений о досрочном прекращении Договора СПФИ, изменения учета обязательств по Договорам СПФИ на основании заявлений Участников клиринга;
 - 22.1.5. учитывает на регистрах учета позиций прекращение обязательств по Договорам СПФИ на основании Соглашений о досрочном прекращении Договора СПФИ;
 - 22.1.6. определяет обязательства по Договорам СПФИ, Дата исполнения которых наступила и размер которых не был определен в момент заключения Договора СПФИ;
 - 22.1.7. формирует клиринговый пул текущей клиринговой сессии и проводит исполнение (прекращение) обязательств, включенных в клиринговый пул;
 - 22.1.8. зачитывает встречные однородные обязательства и требования Участника клиринга и Клирингового центра в соответствующей валюте, включенные в клиринговый пул и учитываемые по одному Расчетному коду, а в части, в которой обязательства и требования не были зачтены – определяет Итоговое нетто-обязательство и/или Итоговое нетто-требование каждого Участника клиринга в соответствующей валюте по каждому Расчетному коду;
 - 22.1.9. проводит исполнение (прекращение) Итоговых нетто-обязательств и Итоговых нетто-требований в порядке, установленном статьей 25 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ, и урегулирование неисполненных обязательств в порядке, установленном статьей 27 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ;
 - 22.1.10. для каждого Расчетного кода рассчитывает Уровень обеспеченности позиций;
 - 22.1.11. определяет Участников клиринга, у которых возникли Маржинальные требования и суммы указанных Маржинальных требований;
 - 22.1.12. формирует и направляет Участникам клиринга отчеты по итогам клиринга.
- 22.2. В клиринговый пул текущей клиринговой сессии включаются следующие допущенные к клирингу обязательства:

- 22.2.1. Задолженность Участника клиринга в соответствующей валюте, возникшая в предыдущий Расчетный день и не погашенная по состоянию на момент начала клиринговой сессии;
- 22.2.2. обязательства Участника клиринга и/или Клирингового центра из Договоров СПФИ по уплате денежных сумм, Дата исполнения которых наступила:
- обязательства Участников клиринга и Клирингового центра по уплате / получению вариационной маржи, определенные в ходе клиринговой сессии в соответствии с подпунктом 22.1.4 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ;
 - обязательства Участников клиринга и Клирингового центра по уплате депозитной маржи, определенные в ходе клиринговой сессии в соответствии с подпунктом 22.1.4 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ;
 - обязательства Участников клиринга и Клирингового центра по возврату (уплате) накопленной депозитной маржи, по уплате процентов на накопленную депозитную маржу, определенные в соответствии со статьей 24 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ;
 - обязательства Участника клиринга и Клирингового центра по уплате премии, суммы платежа, суммы первоначального платежа, суммы окончательного платежа, суммы промежуточного платежа, дополнительного платежа, плавающей суммы, фиксированной суммы, суммы периода капитализации, номинальной суммы, определенные в соответствии со Спецификацией соответствующего Договора СПФИ;
 - обязательства Участника клиринга и/или Клирингового центра по уплате иных денежных сумм, указанные в Спецификации соответствующего Договора СПФИ, определенные в соответствии с такой Спецификацией;
- 22.2.3. обязательства Участника клиринга и Клирингового центра из сделок купли-продажи иностранной валюты, заключенных в соответствии с подпунктом 26.6.5 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ, Дата исполнения которых наступила;
- 22.2.4. обязательства Участника клиринга и Клирингового центра из сделок своп и сделок купли-продажи с иностранной валютой, заключенных в соответствии со статьей 27 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ, Дата исполнения которых наступила;
- 22.2.5. обязательства / требования Участника клиринга и Клирингового центра по внесению / получению платы за заключение Аукционных договоров;
- 22.2.6. обязательства Участника клиринга и Клирингового центра из Соглашений об изменении условий Договора СПФИ;
- 22.2.7. обязательства Участника клиринга и Клирингового центра из Соглашений о досрочном прекращении Договора СПФИ;
- 22.2.8. обязательства Участника клиринга по уплате комиссионного вознаграждения Клирингового центра и Биржи;
- 22.2.9. обязательства Участника клиринга по уплате неустоек (штрафов, пени) Клиринговому центру.

ПОДРАЗДЕЛ V-III. ПОРЯДОК ОПРЕДЕЛЕНИЯ И ИСПОЛНЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ, ВКЛЮЧЕННЫХ В КЛИРИНГОВЫЙ ПУЛ КЛИРИНГОВОЙ СЕССИИ

Статья 23. Вариационная маржа

23.1. Вариационная маржа по биржевому Договору СПФИ рассчитывается и уплачивается каждый Расчетный день по соответствующей валюте в период с даты заключения Договора СПФИ до последней Даты исполнения обязательств из Договоров СПФИ по уплате денежных сумм в соответствии со Спецификацией / даты досрочного прекращения Договора СПФИ, включительно.

23.2. Вариационная маржа по биржевому Договору СПФИ, по которому расчет вариационной маржи ранее не осуществлялся, рассчитывается по формуле:

$VM_O = RS$, где

VM_O – вариационная маржа по Договору СПФИ;

RS – расчетная стоимость Договора СПФИ, определенная в текущий Расчетный день по соответствующей валюте.

Вариационная маржа по биржевому Договору СПФИ, обязательства по которому не прекращены, по которому расчет вариационной маржи осуществлялся ранее, рассчитывается по формуле:

$VM_T = RS - RS_p$, где

VM_T – вариационная маржа по Договору СПФИ;

RS – расчетная стоимость Договора СПФИ, определенная в текущий Расчетный день по соответствующей валюте;

RS_p – расчетная стоимость Договора СПФИ, определенная в предыдущий Расчетный день по соответствующей валюте. При расчете вариационной маржи по Договору СПФИ в последнюю Дату исполнения обязательств из Договора СПФИ по уплате денежных сумм / дату досрочного прекращения Договора СПФИ расчетная стоимость Договора СПФИ принимается равной нулю.

Вариационная маржа в соответствующей валюте по Договору СПФИ, рассчитанная в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ, округляется с точностью до второго знака после запятой по правилам математического округления.

23.3. Вариационная маржа по биржевому Договору СПФИ рассчитывается в соответствии с пунктом 23.1 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ для каждой стороны Договора СПФИ.

Если значение вариационной маржи по Договору СПФИ, рассчитанное для Участника клиринга, является отрицательным, это означает наличие обязанности Участника клиринга по уплате вариационной маржи в соответствующей валюте Клиринговому центру в размере, равном абсолютной величине рассчитанного значения, если положительным - наличие требования Участника клиринга к Клиринговому центру по получению вариационной маржи в соответствующей

валюте.

Обязательства по уплате вариационной маржи носят безвозвратный характер.

- 23.3.1. Обязанности / требования по уплате вариационной маржи учитываются по Расчетному коду Участника клиринга, соответствующему регистру учета позиций, на котором учтены Договоры СПФИ.
- 23.3.2. Информация о размере обязательств по уплате вариационной маржи, учитываемых по Расчетному коду Участника клиринга, предоставляется Участнику клиринга в составе Клирингового отчета.
- 23.4. Проценты на сумму уплаченной и/или полученной вариационной маржи Клиринговым центром не начисляются и не уплачиваются.

Статья 24. Депозитная маржа

- 24.1. Депозитная маржа по внебиржевому Договору СПФИ рассчитывается и уплачивается каждый Расчетный день по соответствующей валюте в период с даты заключения Договора СПФИ до Расчетного дня, предшествующего последней Дате исполнения обязательств из Договоров СПФИ по уплате денежных сумм в соответствии со Спецификацией / дате досрочного прекращения Договора СПФИ, включительно.

- 24.2. Депозитная маржа по внебиржевому Договору СПФИ, по которому расчет депозитной маржи ранее не осуществлялся, рассчитывается по формуле:

$DM_O = RS$, где

DM_O – депозитная маржа по Договору СПФИ;

RS – расчетная стоимость Договора СПФИ, определенная в текущий Расчетный день по соответствующей валюте.

Депозитная маржа по внебиржевому Договору СПФИ, обязательства по которому не прекращены, по которому расчет депозитной маржи осуществлялся ранее, рассчитывается по формуле:

$DM_T = RS - RS_p$, где

DM_T – депозитная маржа по Договору СПФИ;

RS – расчетная стоимость Договора СПФИ, определенная в текущий Расчетный день по соответствующей валюте;

RS_p – расчетная стоимость Договора СПФИ, определенная в предыдущий Расчетный день по соответствующей валюте.

Депозитная маржа в соответствующей валюте по Договору СПФИ, рассчитанная в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ, округляется с точностью до второго знака после запятой по правилам математического округления.

- 24.3. Депозитная маржа по внебиржевому Договору СПФИ рассчитывается в соответствии с пунктом 24.1 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ для каждой стороны Договора СПФИ.

Если значение депозитной маржи по Договору СПФИ, рассчитанное для Участника клиринга, является отрицательным, это означает наличие обязанности Участника клиринга по уплате депозитной маржи в соответствующей валюте Клиринговому центру в размере, равном абсолютной величине рассчитанного значения, если положительным - наличие требования Участника клиринга к Клиринговому центру по получению депозитной маржи в соответствующей валюте.

24.4. Накопленная депозитная маржа в сумме, равной расчетной стоимости Договора СПФИ, определенной в предыдущий Расчетный день, подлежит возврату (уплате) в следующих случаях:

- в последнюю Дату исполнения обязательств из Договоров СПФИ по уплате денежных сумм в соответствии со Спецификацией с учетом особенностей, установленных Спецификацией соответствующего Договора СПФИ;
- при досрочном прекращении Договора СПФИ – в дату досрочного прекращения Договора СПФИ;
- при изменении валюты уплаты депозитной маржи – в дату изменения валюты уплаты депозитной маржи;
- в иных случаях, установленных Спецификацией соответствующего Договора СПФИ.

24.5. Накопленная депозитная маржа по внебиржевому Договору СПФИ рассчитывается в соответствии с пунктом 24.4 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ для каждой стороны Договора СПФИ.

Если значение накопленной депозитной маржи по Договору СПФИ, рассчитанное для Участника клиринга, является отрицательным, это означает наличие обязанности Участника клиринга по возврату (уплате) накопленной депозитной маржи в соответствующей валюте Клиринговому центру в размере, равном абсолютной величине рассчитанного значения, если положительным - наличие требования Участника клиринга к Клиринговому центру по получению накопленной депозитной маржи в соответствующей валюте.

24.6. Проценты на накопленную депозитную маржу рассчитываются по формуле:

$$PDM_i = -RS_p \times S \times n / y / 100, \text{ где}$$

PDM_i – проценты на накопленную депозитную маржу, начисленные в Расчетный день i по соответствующей валюте с учетом корректировки, предусмотренной подпунктами 24.6.1-24.6.2 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ;

RS_p – расчетная стоимость Договора СПФИ, определенная в предыдущий Расчетный день по соответствующей валюте;

S – раскрываемая на Сайте Клирингового центра процентная ставка в процентах годовых, установленная на предыдущий Расчетный день по соответствующей валюте;

n – количество календарных дней текущего календарного месяца от предыдущего Расчетного дня до текущего Расчетного дня i по соответствующей валюте, если предыдущий и текущий Расчетные дни по соответствующей валюте находятся в одном календарном месяце и одном календарном годе, или количество календарных дней текущего календарного месяца от предыдущего Расчетного дня по соответствующей валюте до последнего календарного дня текущего месяца

включительно, если последний календарный день текущего месяца не является Расчетным днем по соответствующей валюте, или количество календарных дней текущего календарного месяца с первого календарного дня текущего месяца включительно до текущего Расчетного дня i по соответствующей валюте, если первый календарный день текущего месяца не является Расчетным днем по соответствующей валюте;

u – количество календарных дней в году. Если если предыдущий и текущий Расчетные дни находятся в разных календарных годах, соотношение n / u в формуле процентов на накопленную депозитную маржу заменяется на $k1/365+k2/366$, где $k1$ – количество из дней n , не попадающих на високосный год, $k2$ – количество из дней n , попадающих на високосный год.

Проценты на накопленную депозитную маржу рассчитываются и уплачиваются в валюте, в которой осуществлялся расчет и уплата депозитной маржи в предыдущий Расчетный день по соответствующей валюте.

- 24.6.1. При наличии в предыдущий Расчетный день по соответствующей валюте у Участника клиринга Задолженности по Расчетному коду в определенной валюте и положительной разности сумм депозитной маржи в такой валюте по всем Договорам СПФИ, подлежащей уплате и получению Участником клиринга в предыдущий Расчетный день и учитываемой по такому Расчетному коду, значение RS_p в целях расчета процентов на накопленную депозитную маржу по всем Договорам СПФИ, по которым в предыдущий Расчетный день по соответствующей валюте у Участника клиринга были обязательства по уплате депозитной маржи, увеличивается на распределенную по всем таким Договорам СПФИ величину, равную минимальному значению из абсолютных величин Задолженности в такой валюте, учитываемой по такому Расчетному коду в предыдущий Расчетный день по соответствующей валюте, и разности сумм уплаченной и полученной Участником клиринга в предыдущий Расчетный день по соответствующей валюте депозитной маржи в такой валюте по всем Договорам СПФИ, пропорционально значению RS_p по каждому такому Договору СПФИ.
- 24.6.2. В случае осуществления корректировки значений RS_p в соответствии с подпунктом 24.6.1 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ для Участников клиринга, значения RS_p для Клирингового центра по Договорам СПФИ уменьшается на величину такой корректировки.
- 24.7. Проценты на накопленную депозитную маржу по внебиржевому Договору СПФИ рассчитываются в соответствии с пунктом 24.6 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ для каждой стороны Договора СПФИ.
- Если значение процентов на накопленную депозитную маржу по Договору СПФИ, рассчитанное для Участника клиринга, является отрицательным, это означает наличие обязанности Участника клиринга по уплате процентов на накопленную депозитную маржу в соответствующей валюте Клиринговому центру в размере, равном абсолютной величине рассчитанного значения, если положительным - наличие требования Участника клиринга к Клиринговому центру по получению процентов на накопленную депозитную маржу в соответствующей валюте.
- 24.7.1. Выплата процентов на накопленную депозитную маржу производится ежемесячно: в период действия Договора СПФИ - в первый Расчетный день месяца по соответствующей валюте, следующего за месяцем, за который выплачиваются

указанные проценты; в месяц окончания действия Договора СПФИ - в дату возврата (уплаты) накопленной депозитной маржи.

- 24.7.2. При прекращении договора об оказании клиринговых услуг в случае отзыва (аннулировании) лицензии на осуществление банковских операций у Участника клиринга - Кредитной организации начисление процентов на накопленную депозитную маржу производится до дня (включительно), предшествующего дню отзыва (аннулирования) лицензии на осуществление банковских операций у Участника клиринга - Кредитной организации, выплата указанных процентов – в день отзыва (аннулирования) лицензии на осуществление банковских операций у Участника клиринга - Кредитной организации.
- 24.7.3. При прекращении договора об оказании клиринговых услуг в случае назначения временной администрации или принятия арбитражным судом решения о введении одной из процедур банкротства в отношении Участника клиринга – Некредитной организации начисление процентов на накопленную депозитную маржу производится до дня (включительно), предшествующего дате назначения временной администрации, или дате принятия арбитражным судом решения о введении одной из процедур банкротства, или дате принятия арбитражным судом решения о признании Участника клиринга банкротом и об открытии конкурсного производства, в зависимости от того, какая из указанных дат наступила ранее, выплата указанных процентов – в день, следующий за датой назначения временной администрации, или день, следующий за датой принятия арбитражным судом решения о введении одной из процедур банкротства, или день, следующий за датой принятия арбитражным судом решения о признании Участника клиринга банкротом и об открытии конкурсного производства, в зависимости от того, какая из указанных дат наступила ранее.
- 24.8. Обязанности / требования по уплате депозитной маржи, накопленной депозитной маржи, процентов на накопленную депозитную маржу учитываются по Расчетному коду Участника клиринга, соответствующему регистру учета позиций, на котором учтены Договоры СПФИ.
- 24.8.1. Информация о размере обязательств по уплате депозитной маржи, накопленной депозитной маржи, процентов на накопленную депозитную маржу, учитываемых по Расчетному коду Участника клиринга, предоставляется Участнику клиринга в составе Клирингового отчета.
- 24.8.2. Информация о начисленных и выплаченных процентах на накопленную депозитную маржу предоставляется Клиринговым центром Участникам клиринга в Отчете о движении денежных средств, о начисленных - ежедневно, о выплаченных – в дату выплаты.

Статья 25. Порядок исполнения (прекращения) обязательств, включенных в клиринговый пул

- 25.1. Участник клиринга обязан зачислить денежные средства для исполнения своих Итоговых нетто-обязательств в соответствующей валюте до времени, указанного во Временном регламенте на рынке Стандартизированных ПФИ.
- 25.2. Клиринговый центр исполняет Итоговые нетто-требования Участника клиринга,

учитываемые по Расчетному коду, при условии исполнения Участником клиринга своих Итоговых нетто-обязательств, учитываемых по тому же Расчетному коду.

- 25.3. Итоговое нетто-обязательство, учитываемое по Расчетному коду Участника клиринга, исполняется за счет Обеспечения Участника клиринга, учитываемого по тому же Расчетному коду.

Клиринговый центр зачитывает Итоговое нетто-обязательство Участника клиринга (или его часть) в соответствующей валюте с требованием Участника клиринга к Клиринговому центру по возврату Обеспечения в такой валюте. При этом размер Обеспечения Участника клиринга в соответствующей валюте, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, уменьшается на размер прекращенного Итогового нетто-обязательства Участника клиринга в такой валюте.

Итоговое нетто-обязательство Участника клиринга в соответствующей валюте прекращается в части, не превышающей размер Обеспечения Участника клиринга в соответствующей валюте.

- 25.4. Если Обеспечения Участника клиринга в соответствующей валюте, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, недостаточно для исполнения Итогового нетто-обязательства Участника клиринга в такой валюте в полном объеме, такой Участник клиринга признается Недобросовестным участником клиринга и в отношении него и его Итоговое нетто-обязательство, для исполнения которого недостаточно Обеспечения, Клиринговым центром осуществляются действия, предусмотренные статьей 27 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ.

- 25.5. Итоговое нетто-требование в соответствующей валюте, учитываемое по Расчетному коду Участника клиринга, прекращается возникновением обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга Обеспечения в такой валюте, учитываемого по тому же Расчетному коду. При этом размер Обеспечения Участника клиринга в соответствующей валюте, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, увеличивается на размер Итогового нетто-требования Участника клиринга в такой валюте.

- 25.5.1. При исполнении Итогового нетто-требования, а также иных предусмотренных Правилами клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ требований Участника клиринга, являющихся доходом Участника клиринга – нерезидента, Клиринговый центр в установленных российским законодательством случаях как налоговый агент удерживает сумму налога на прибыль организаций.

- 25.6. Обязательства Участника клиринга и/или Клирингового центра из сделок своп и сделок купли-продажи с иностранной валютой, заключенных в соответствии со статьей 27 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ, прекращаются в порядке, установленном статьей 27 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ.

Статья 26. Порядок возникновения и исполнения Маржинальных требований

- 26.1. Маржинальное требование возникает у Участника клиринга, Уровень обеспеченности позиций по Расчетному коду которого стал меньше нуля. Сумма Маржинального требования равна абсолютному значению Уровня обеспеченности

позиций по Расчетному коду, определенного в ходе клиринговой сессии.

- 26.2. Информация о наличии у Участника клиринга Маржинального требования и его сумме предоставляется Участнику клиринга в составе Клирингового отчета.
- 26.3. Маржинальное требование, возникшее у Участника клиринга в ходе клиринговой сессии, должно быть исполнено Участником клиринга не позднее срока, установленного Временным регламентом на рынке Стандартизированных ПФИ.
- 26.4. Маржинальное требование должно быть исполнено Участником клиринга путем внесения Обеспечения по Расчетному коду, по которому учитывается Маржинальное требование, в порядке, определенном статьей 20 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ.
Маржинальное требование, учитываемое по Расчетному коду Участника клиринга, может быть также прекращено полностью или в части в случае заключения Договоров СПФИ, досрочного прекращения Договоров СПФИ, изменения условий Договоров СПФИ, в результате которых увеличится Уровень обеспеченности позиций по такому Расчетному коду.
- 26.5. Маржинальное требование, учитываемое по Расчетному коду Участника клиринга, считается прекращенным в момент времени, когда Уровень обеспеченности позиций по Расчетному коду станет неотрицательным.
- 26.6. В случае неисполнения Участником клиринга Маржинального требования, учитываемого по Расчетному коду, в срок, установленный Временным регламентом на рынке Стандартизированных ПФИ, Клиринговый центр:
- 26.6.1. направляет Бирже уведомление о необходимости приостановления возможности подачи Заявок с указанием регистров учета позиций, соответствующих Расчетному коду, по которому учитывается неисполненное Маржинальное требование;
- 26.6.2. вправе направить Бирже уведомление о необходимости снятия всех или части Заявок с указанием регистров учета позиций, соответствующих Расчетному коду, по которому учитывается неисполненное Маржинальное требование;
- 26.6.3. приостанавливает возможность подачи Участником клиринга Предложений, Предложений «Стратегия» и иных оферт, предусмотренных Правилами клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ, направленных на изменение или прекращение Договоров СПФИ, с указанием регистров учета позиций, соответствующих Расчетному коду, по которому учитывается неисполненное Маржинальное требование;
- 26.6.4. вправе удалить все или часть Предложений и Предложений «Стратегия», а также отказать в акцепте всех или части оферт, предусмотренных Правилами клиринга, направленных на изменение или прекращение Договоров СПФИ и поданных с указанием регистров учета позиций, соответствующих Расчетному коду, по которому учитывается неисполненное Маржинальное требование;
- 26.6.5. заключает с Участником клиринга, не исполнившим Маржинальное требование, учитываемое по Расчетному коду Участника клиринга, закрывающие биржевые или внебиржевые Договоры СПФИ и/или закрывающие сделки купли-продажи иностранной валюты, приводящие к увеличению Уровня обеспеченности позиций

по такому Расчетному коду.

Указанные сделки заключаются без подачи заявок.

Условия указанных закрывающих биржевых Договоров СПФИ соответствуют условиям Договоров СПФИ, установленным Правилами торгов на рынке Стандартизированных ПФИ, внебиржевых Договоров СПФИ – условиям Договоров СПФИ, установленных Правилами клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ, условия сделок купли-продажи иностранной валюты – условиям спот сделок с иностранной валютой, установленным Правилами торгов на валютном рынке, и являются противоположными условиям балансирующих сделок, порядок заключения которых определен общей частью Правил клиринга.

Указанные Договоры СПФИ и/или сделки купли-продажи иностранной валюты заключаются до момента прекращения Маржинального требования, учитываемого по Расчетному коду, или до момента невозможности заключения указанных сделок.

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

Договоры СПФИ и/или сделки купли-продажи иностранной валюты, заключенные в соответствии с настоящим подпунктом Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ, допускаются к клирингу, обязательства по указанным сделкам включаются в клиринговой пул клиринговой сессии в Дату исполнения соответствующих обязательств в соответствии со статьей 22 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ;

26.6.6. после завершения заключения сделок в соответствии с подпунктом 26.6.5 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ и прекращения Маржинального требования, учитываемого по Расчетному коду, Клиринговый центр:

- направляет Бирже уведомление о снятии ограничений на подачу заявок с указанием регистров учета позиций, соответствующих Расчетному коду, по которому учитывалось неисполненное Маржинальное требование;
- возобновляет возможность подачи Участником клиринга Предложений, Предложений «Стратегия» и иных оферт, предусмотренных Правилами клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ, направленных на изменение или прекращение Договоров СПФИ, с указанием регистров учета позиций, соответствующих Расчетному коду, по которому учитывалось неисполненное Маржинальное требование.

26.7. Действия, предусмотренные пунктом 26.6 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ также осуществляются в рамках проведения процедуры кросс-дефолта в отношении Участника клиринга в соответствии с общей частью Правил клиринга с целью увеличения объема свободного Обеспечения Недобросовестного участника клиринга, учитываемого по собственным Расчетным кодам на рынке Стандартизированных ПФИ.

Статья 27. Порядок действий в случае наличия Задолженности и/или обязательств, не обеспеченных средствами под исполнение

27.1. В случае если Обеспечения в соответствующей валюте, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, недостаточно для исполнения Итогового нетто-обязательства Участника клиринга в такой валюте,

Клиринговый центр в ходе клиринговой сессии без подачи заявок заключает с Недобросовестным участником клиринга сделку своп или сделку купли-продажи с иностранной валютой, условия и порядок заключения которых определены в статье 28 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ.

27.2. При превышении установленного в подпункте 28.1.5 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ количества Расчетных дней, в течение которых у Участника клиринга может возникать Итоговое нетто-обязательство в соответствующей валюте, учитываемое по Расчетному коду Участника клиринга, для исполнения которого недостаточно Обеспечения в такой валюте, с Участника клиринга взимается штраф, рассчитываемый по формуле:

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

Penalty – сумма штрафа, в российских рублях,

VAL_OBL – Итоговое нетто-обязательство в иностранной валюте / российских рублях, для исполнения которого недостаточно Обеспечения в такой валюте,

C – Центральный курс иностранной валюты, установленный Клиринговым центром в соответствии с Методикой определения риск-параметров валютного рынка и рынка драгоценных металлов / C=1 для российских рублей;

K – коэффициент, установленный решением Клирингового центра; по умолчанию K=5;

R – штрафная ставка, равная ставке, установленной Клиринговым центром в соответствии с Методикой определения риск-параметров валютного рынка и рынка драгоценных металлов.

Сумма штрафа, рассчитанная в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ, не облагается НДС.

Обязательство по уплате штрафа, рассчитанное в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ, учитывается по тому же Расчетному коду Участника клиринга, что и Итоговое нетто-обязательство, для исполнения которого недостаточно Обеспечения, и подлежит исполнению в ходе следующей клиринговой сессии.

27.3. После заключения сделок своп / сделок купли-продажи с иностранной валютой в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ Клиринговый центр:

27.3.1. допускает к клирингу обязательства по указанным сделкам;

27.3.2. включает обязательства с наступившей Датой исполнения по указанным сделкам в клиринговый пул;

27.3.3. зачитывает встречные однородные Итоговые нетто-обязательства Участника клиринга в соответствующей валюте, для исполнения которых недостаточно Обеспечения в такой валюте, с требованиями в такой валюте с наступившей Датой

исполнения по указанным заключенным сделкам;

- 27.3.4. учитывает обязательства / требования в соответствующих валютах по вторым частям сделок своп, заключенных в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ по соответствующему Расчетному коду и по Дате исполнения, соответствующей дате исполнения обязательств по вторым частям указанных сделок своп.
- 27.4. Итоговое нетто-обязательство в соответствующей валюте, учитываемое по Расчетному коду Участника клиринга, не прекращенное по итогам действий, выполненных в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ, прекращается возникновением Задолженности Участника клиринга перед Клиринговым центром, учитываемой по такому Расчетному коду Участника клиринга.
- 27.4.1. Участник клиринга обязан уплатить Клиринговому центру пеню за наличие Задолженности, рассчитываемую по формуле:
- $$\text{Fine} = D \times 2 \times S \times n / 365, \text{ где}$$
- Fine – сумма пени, в российских рублях,
D – сумма Задолженности, в российских рублях,
S – ключевая ставка, установленная Банком России на дату расчета суммы пени,
n - количество календарных дней между датой расчета суммы пени и следующим Расчетным днем.
- Сумма пени, рассчитанная в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ, не облагается НДС.
- Обязательство по уплате пени, рассчитанное в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ, учитывается по тому же Расчетному коду Участника клиринга, что и Задолженность, и подлежит исполнению в ходе следующей клиринговой сессии.
- 27.4.2. Информация о наличии у Участника клиринга Задолженности и ее размере предоставляется Участнику клиринга в составе Клирингового отчета.
- 27.4.3. Задолженность, учитываемая по Расчетному коду Участника клиринга, у которого отсутствует Маржинальное требование, учитываемое по такому Расчетному коду и не исполненное в срок, установленный Правилами клиринга, должна быть погашена Участником клиринга не позднее времени, установленного Временным регламентом на рынке Стандартизированных ПФИ.
- 27.4.4. Задолженность Участника клиринга в соответствующей валюте считается погашенной, если до момента времени, установленного Временным регламентом на рынке Стандартизированных ПФИ в качестве времени погашения Задолженности, значение Обеспечения в такой валюте, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, по которому учитывалась Задолженность, станет неотрицательным.
- 27.5. Если Задолженность Участника клиринга не погашена полностью Участником клиринга в срок, установленный Временным регламентом на рынке Стандартизированных ПФИ, Клиринговый центр использует Обеспечение Участника клиринга, учитываемое по иным Расчетным кодам в соответствии с Правилами клиринга, а также средства Гарантийных фондов и/или Обеспечение

под стресс в порядке, определенном общей частью Правил клиринга (начинает процедуру кросс-дефолта в отношении Участника клиринга) в следующих случаях:

- 27.5.1. Если у Участника клиринга по такому Расчетному коду учитывается Маржинальное требование, не исполненное в срок, установленный Правилами клиринга, или;
- 27.5.2. Если Участник клиринга, у которого отсутствует Маржинальное требование по Расчетному коду, не исполненное в срок, установленный Правилами клиринга, не погасил Задолженность, учитываемую по такому Расчетному коду, в срок, установленный Временным регламентом на рынке Стандартизированных ПФИ.
- 27.6. При заключении закрывающих сделок, направленных на прекращение обязательств Недобросовестного участника клиринга в рамках процедуры кросс-дефолта, проводимой в соответствии с общей частью Правил клиринга, все обязательства Недобросовестного участника клиринга из Договоров СПФИ и Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ прекращаются возникновением нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга, рассчитанных в отношении указанных обязательств Недобросовестного участника клиринга, а также Обеспечения, Обеспечения под стресс, взноса в Гарантийный фонд Недобросовестного участника клиринга, внесенных на рынке Стандартизированных ПФИ, в порядке, аналогичном порядку, предусмотренному общей частью Правил клиринга при проведении ликвидационного неттинга в отношении Участника клиринга.

Статья 28. Порядок заключения и условия сделок своп / сделки купли-продажи с иностранной валютой, заключаемых с Недобросовестными участниками клиринга

- 28.1. Сделки своп с иностранной валютой, указанные в пункте 27.1 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ, заключаются при соблюдении следующих условий:
 - 28.1.1. у Участника клиринга – кредитной организации не отозвана (не аннулирована) лицензия Банка России на осуществление банковских операций;
 - 28.1.2. у Участника клиринга – Банка-нерезидента не отозвано (не аннулировано) специальное разрешение (лицензия или иное основание) компетентного органа государства учреждения Банка-нерезидента, в соответствии с которым Банк-нерезидент имеет право осуществлять банковские операции;
 - 28.1.3. допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию не приостановлен;
 - 28.1.4. у Клирингового центра отсутствует информация об обстоятельствах в отношении Участника клиринга, перечисленных в общей части Правил клиринга, при наступлении которых допуск к клиринговому обслуживанию Участника клиринга будет приостановлен в следующий Расчетный день;
 - 28.1.5. количество Расчетных дней, в которые у Участника клиринга возникает Итоговое нетто-обязательство Участника клиринга в соответствующей валюте, для исполнения которого недостаточно Обеспечения в такой валюте, учитываемое по одному Расчетному коду Участника клиринга, не превышает 2 (двух) Расчетных дней подряд.

28.2. Условие, указанное в подпункте 28.1.5 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ, не применяется, если причиной непогашения Задолженности является несвоевременное зачисление денежных средств на клиринговые счета Клирингового центра в Расчетных организациях, вызванное проведением процедур комплаенс-контроля в банках-корреспондентах, сбоями в работе платежных систем, а также обстоятельствами непреодолимой силы, определенными в пункте 28.5 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ.

Участник клиринга обязан предоставить Клиринговому центру документы, подтверждающие действие причин, указанных в настоящем пункте Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ.

28.3. Условия сделок своп с иностранной валютой, заключаемых Клиринговым центром от имени Недобросовестного участника клиринга в отношении себя лично в случае, установленном пунктом 27.1 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ, соответствуют определенным Правилами торгов на валютном рынке условиям сделок своп с учетом следующих особенностей:

28.3.1. в случае наличия у Участника клиринга Итогового нетто-обязательства в российских рублях, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, для исполнения которого недостаточно Обеспечения в российских рублях, по первой части сделки своп у Участника клиринга возникают требования в российских рублях и обязательства в иностранной валюте, в объеме, соответствующем Итоговому нетто-обязательству в российских рублях, для исполнения которого недостаточно Обеспечения, и не превышающем суммы Итогового нетто-требования Участника клиринга в иностранной валюте и Обеспечения Участника клиринга в такой иностранной валюте, учитываемого по тому же Расчетному коду Участника клиринга;

28.3.2. в случае наличия у Участника клиринга Итогового нетто-обязательства в иностранной валюте, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, для исполнения которого недостаточно Обеспечения в такой валюте, по первой части сделки своп у Участника клиринга возникают требования в такой иностранной валюте в объеме, равном Итоговому нетто-обязательству в иностранной валюте, для исполнения которого недостаточно Обеспечения, и обязательства в другой валюте, в том числе в российских рублях, в объеме, соответствующем Итоговому нетто-обязательству в иностранной валюте, для исполнения которого недостаточно Обеспечения, и не превышающем суммы Итогового нетто-требования Участника клиринга в такой другой валюте, в том числе в российских рублях, и Обеспечения Участника клиринга в такой другой валюте, в том числе в российских рублях, учитываемого по тому же Расчетному коду Участника клиринга;

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

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

28.3.5. Базовый курс сделки своп устанавливается равным значению фиксинга соответствующей валютной пары Московской Биржи, определенного по состоянию на 12:30 по московскому времени текущего Расчетного дня в соответствии с

Методикой расчета фиксингов Московской Биржи;

28.3.6. Цена сделки своп рассчитывается по следующей формуле:

$$\text{Swap_Price} = \text{Rc_VAL1_VAL2} \times S \times n / 365, \text{ где}$$

Swap_Price – цена сделки своп,

Rc_VAL1_VAL2 – Центральный курс сделок купли-продажи иностранной валюты VAL1 за валюту VAL2, рассчитанный в 19:00 по московскому времени текущего Расчетного дня в соответствии с Методикой определения риск-параметров валютного рынка и рынка драгоценных металлов,

VAL1 – валюта лота сделки своп,

VAL2 – сопряженная валюта сделки своп,

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

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

28.4. При несоблюдении любого из условий, указанных в подпунктах 28.1.3-28.1.5 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ, Клиринговый центр без подачи заявок заключает с Недобросовестным участником клиринга закрывающую сделку купли-продажи с иностранной валютой, условия которой соответствуют определенным Правилами торгов на валютном рынке условиям сделок спот с учетом следующих особенностей:

28.4.1. в случае наличия у Участника клиринга Итогового нетто-обязательства в российских рублях, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, для исполнения которого недостаточно Обеспечения в российских рублях, у Участника клиринга возникают требования в российских рублях и обязательства в иностранной валюте, в объеме, соответствующем Итоговому нетто-обязательству в российских рублях, для исполнения которого недостаточно Обеспечения, и не превышающем суммы Итогового нетто-требования Участника клиринга в иностранной валюте и Обеспечения Участника клиринга в такой иностранной валюте, учитываемого по тому же Расчетному коду Участника клиринга;

28.4.2. в случае наличия у Участника клиринга Итогового нетто-обязательства в иностранной валюте, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, для исполнения которого недостаточно Обеспечения в такой валюте, у Участника клиринга возникают требования в такой иностранной валюте в объеме, равном Итоговому нетто-обязательству в иностранной валюте, для исполнения которого недостаточно Обеспечения, и обязательства в другой валюте, в том числе в российских рублях, в объеме, соответствующем Итоговому нетто-обязательству в иностранной валюте, для исполнения которого недостаточно Обеспечения, и не превышающем суммы Итогового нетто-требования Участника клиринга в такой другой валюте, в том числе в российских рублях, и Обеспечения Участника клиринга в такой другой валюте, в том числе в российских рублях, учитываемого по тому же Расчетному коду Участника клиринга;

28.4.3. Датой исполнения обязательств по сделке является день ее заключения;

28.4.4. цена сделки устанавливается равной цене балансирующей сделки с соответствующей иностранной валютой, порядок заключения которой определен общей частью Правил клиринга.

28.5. В случае незачисления Участником клиринга денежных средств в соответствующей валюте для исполнения Итогового нетто-обязательства Участника клиринга в такой валюте в срок, установленный Временным регламентом на рынке Стандартизированных ПФИ, вследствие непреодолимой силы или сбоя в платежной системе Банка России / иных платежных системах, Клиринговым центром с Участником клиринга заключаются сделки своп с ценой сделки своп, равной нулю.

Под обстоятельствами непреодолимой силы понимаются:

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

О возникновении обстоятельств непреодолимой силы, вследствие которых зачисления Участником клиринга денежных средств в соответствующей валюте для исполнения Итогового нетто-обязательства Участника клиринга в такой валюте в срок, установленный Временным регламентом на рынке Стандартизированных ПФИ, невозможно, Участник клиринга обязан уведомить Клиринговый центр любыми доступными средствами связи до установленного Временным регламентом на рынке Стандартизированных ПФИ времени начала клиринговой сессии.

Участник клиринга обязан предоставить Клиринговому центру документы, подтверждающие обстоятельства непреодолимой силы в течение 7 (семи) дней. В случае непредоставления Участником клиринга Клиринговому центру таких документов в указанный срок с Участника клиринга по решению Клирингового центра взыскивается неустойка, равная цене сделки своп, рассчитанной в соответствии с подпунктом 28.3.6 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ в расчете на количество календарных дней между датой исполнения первой части сделки своп и датой расчета неустойки.

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

28.6. Клиринговый центр вправе принять решение о заключении от имени Недобросовестного участника клиринга сделок своп с иностранной валютой в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ с ценой сделки своп, равной нулю, при наличии обстоятельств, не указанных в пункте 28.5 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ и свидетельствующих об отсутствии вины такого Участника клиринга.

28.7. Клиринговый центр, действуя от имени Участника клиринга в отношении себя

лично, осуществляет все юридические и фактические действия, необходимые для заключения сделок в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ без специального полномочия (доверенности), а также без согласия Участника клиринга.

Статья 29. Особенности использования взносов Добросовестных участников клиринга в Гарантйный фонд

29.1. В случае необходимости использования взносов Добросовестных участников клиринга в Гарантйный фонд рынка Стандартизированных ПФИ в случаях, установленных общей частью Правил клиринга, указанные взносы используются Клиринговым центром в следующей очередности:

- 1) Взносы в Гарантйный фонд Участников клиринга, не подававших Аукционные заявки в ходе аукциона ликвидации, проведенного Клиринговым центром в соответствии со статьей 12 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ, - в равных долях;
- 2) Взносы в Гарантйный фонд Участников клиринга, подававших Аукционные заявки, на основании которых не были заключены Аукционные договоры, - в равных долях (в случае, если необходимость использования взносов Добросовестных участников клиринга в Гарантйный фонд сохранилась после использования взносов в Гарантйный фонд в соответствии с подпунктом 1) настоящего пункта Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ);
- 3) Взносы в Гарантйный фонд Участников клиринга, заключивших Аукционные договоры, - в равных долях (в случае, если необходимость использования взносов Добросовестных участников клиринга в Гарантйный фонд сохранилась после использования взносов в Гарантйный фонд в соответствии с подпунктом 2) настоящего пункта Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ).

ПОДРАЗДЕЛ V-IV. ПОРЯДОК ИСПОЛНЕНИЯ ОПЦИОННЫХ ДОГОВОРОВ

Статья 30. Порядок осуществления права на исполнение по внебиржевым опционным Договорам СПФИ

- 30.1. Настоящая статья Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ устанавливает порядок осуществления права на исполнение для любого внебиржевого опционного Договора СПФИ (далее в настоящей статье – Опционный договор).
- 30.2. Для осуществления права на исполнение по Опционному договору Участник клиринга – Покупатель по Опционному договору направляет в сроки, установленные Спецификацией Опционного договора в Клиринговый центр Требование об исполнении по Опционному договору. Направленное Участником клиринга – Покупателем указанное Требование об исполнении не подлежит отзыву.
- 30.3. При наличии полученного от Участника клиринга – Покупателя Требования об исполнении по Опционному договору Клиринговый центр осуществляет во время закрытия, определяемое в соответствии с условиями заключенного Опционного договора на основании Спецификации, проверки возможности осуществления права на исполнение. Указанные проверки осуществляются в следующем порядке:
- 30.3.1. По всем Опционным договорам, имеющим одно время закрытия, обязательства по которым учитываются на регистрах учета позиций, код которых соответствует одному Расчетному коду, открытому Участнику клиринга – Покупателю (далее в настоящей статье – Опционные договоры по Расчетному коду), и по которым Участником клиринга – Покупателем подано Требование об исполнении, осуществляются следующие проверки:
- при неотрицательном значении Уровня обеспеченности позиций по такому Расчетному коду - проверку того, что Уровень обеспеченности позиций по такому Расчетному коду не станет отрицательным с учетом обязательств при реализации права на исполнение (далее в настоящей статье – Обязательства по исполнению) по всем Опционным договорам по Расчетному коду;
 - при отрицательном значении Уровня обеспеченности позиций по такому Расчетному коду - проверку неуменьшения Уровня обеспеченности позиций по такому Расчетному коду с учетом Обязательств по исполнению по всем Опционным договорам по Расчетному коду;
 - при неотрицательном значении Уровня обеспеченности позиций по такому Расчетному коду и при условии, что на момент проверки Участнику клиринга установлен Режим закрытия позиций, - проверку неувеличения требования к Обеспечению по такому Расчетному коду с учетом Обязательств по исполнению по всем Опционным договорам по Расчетному коду.
- Право на исполнение осуществляется по всем Опционным договорам по Расчетному коду при положительном результате всех проверок.
- 30.3.2. При отрицательном результате хотя бы одной проверки, указанной в подпункте 30.3.1 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ, Клиринговый центр осуществляет по каждому Опционному договору по Расчетному коду в порядке

подачи Требований, начиная с самого раннего, следующие проверки:

- при неотрицательном значении Уровня обеспеченности позиций по такому Расчетному коду - проверку того, что Уровень обеспеченности позиций по такому Расчетному коду не станет отрицательным с учетом Обязательства по исполнению по такому Опционному договору;
- при отрицательном значении Уровня обеспеченности позиций по такому Расчетному коду - проверку неуменьшения Уровня обеспеченности позиций по такому Расчетному коду с учетом Обязательств по исполнению по такому Опционному договору;
- при неотрицательном значении Уровня обеспеченности позиций по такому Расчетному коду и при условии, что на момент проверки Участнику клиринга установлен Режим закрытия позиций, - проверку неувеличения требования к Обеспечению по такому Расчетному коду с учетом Обязательств по исполнению по такому Опционному договору.

Право на исполнение осуществляется по такому Опционному договору по Расчетному коду при положительном результате всех проверок.

- 30.4. При осуществлении Участником клиринга – Покупателем права на исполнение по Опционному договору, Клиринговый центр направляет Требование об исполнении Участнику клиринга – Продавцу по парному Договору СПФИ для такого Опционного договора. Право на исполнение при направлении указанного Требования об исполнении осуществляется без осуществления проверок.
- 30.5. При отсутствии Парного Договора СПФИ для Опционного договора, по которому Клиринговый центр является Покупателем, Клиринговый центр вправе направить Требование об исполнении по такому Опционному договору Участнику клиринга – Продавцу по такому Опционному договору. Указанное Требование об исполнении направляется во время закрытия, определяемое в соответствии с условиями такого Опционного договора на основании Спецификации. Право на исполнение при направлении указанного Требования об исполнении осуществляется без осуществления проверок.
- 30.6. При осуществлении права на исполнение по Опционному договору, базисным активом которого являются иностранные валюты или индексы, в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ, Клиринговый центр допускает к клирингу Обязательства по исполнению по данному Опционному договору. Указанные обязательства подлежат исполнению в порядке, установленном Правилами клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ.

РАЗДЕЛ VI. ПОРЯДОК ОПЛАТЫ УСЛУГ. ОТЧЕТЫ ПО ИТОГАМ КЛИРИНГА

Статья 31. Особенности оплаты услуг Клирингового центра и Биржи

31.1. На рынке Стандартизированных ПФИ Клиринговый центр взимает:

- комиссионное вознаграждение за оказание клиринговых услуг в пользу Клирингового центра (далее – комиссионное вознаграждение Клирингового центра);
- комиссионное вознаграждение в пользу Биржи за услуги по проведению организованных торгов (по биржевым Договорам СПФИ).

31.2. Участник клиринга исполняет обязательства по уплате комиссионных вознаграждений Биржи за Участника торгов, не совпадающего в одном лице с Участником клиринга и имеющего право подавать Заявки с указанием регистров учета позиций, соответствующих Расчетным кодам данного Участника клиринга.

31.3. Комиссионное вознаграждение Клирингового центра за учет индивидуального клирингового и иного обеспечения удерживается Клиринговым центром с Участника клиринга по Расчетному коду, указанному Участником клиринга в Заявлении о выборе Расчетного кода для списания комиссионных вознаграждений (в случае предоставления указанного заявления) либо по основному Расчетному коду.

31.4. Информация о размере комиссионного вознаграждения Биржи и Клирингового центра, подлежащего уплате Участником торгов / Участником клиринга в отчетную дату, указывается в Клиринговом отчете.

31.5. Обязательства Участника клиринга по уплате комиссионных вознаграждений Клирингового центра, Биржи включаются в клиринговый пул и прекращаются зачетом или надлежащим исполнением в ходе клиринговой сессии в порядке, установленной статьей 25 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ.

Статья 32. Порядок предоставления информации и отчетов по итогам клиринга

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

- о Договорах СПФИ, стороной по которым является Участник клиринга;
- о размере Обеспечения, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, в каждой валюте (по каждому Расчетному коду Участника клиринга);
- об обязательствах по уплате вариационной маржи (по каждому Договору СПФИ и суммарно по каждому Расчетному коду Участника клиринга);
- об обязательствах по уплате депозитной маржи (по каждому Договору СПФИ и суммарно по каждому Расчетному коду Участника клиринга);
- о наличии / отсутствии Маржинального требования Участника клиринга, о сумме Маржинального требования в российских рублях (в случае наличия) (по каждому Расчетному коду Участника клиринга);

- о наличии / отсутствии Задолженности Участника клиринга перед Клиринговым центром, о сумме Задолженности Участника клиринга (в случае наличия) (по каждому Расчетному коду Участника клиринга).

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

32.2.1. Клиринговый отчет, который содержит:

- информацию о заключенных биржевых и внебиржевых Договорах СПФИ, и сделках, заключенных в соответствии с подпунктом 26.6.5 и статьей 27 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ, обязательства по которым допущены к клирингу, стороной по которым является Участник клиринга;
- информацию об обязательствах из Договоров СПФИ, допущенных к клирингу и включенных в клиринговый пул, и об обязательствах, определенных по итогам клиринга;
- информацию о размере Обеспечения, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, и об изменении размера такого Обеспечения, об оценке такого Обеспечения, о размере требования к Обеспечению, о наличии и размере Маржинального требования;
- перечень Расчетных кодов и регистров учета позиций Участника клиринга;

32.2.2. Отчет о движении денежных средств, содержащий информацию о размере Обеспечения в денежных средствах, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, об изменении размера такого Обеспечения, включая информацию об использовании Обеспечения, в том числе для исполнения обязательств, определенных по итогам клиринга;

32.2.3. Отчет о Клиринговых идентификаторах.

32.3. Отчеты, указанные в пункте 32.2 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ, направляются Участнику клиринга в форме электронных документов в соответствии с Порядком ЭДО.

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

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

32.4. Формы и форматы отчетов по итогам клиринга, предоставляемых Клиринговым центром Участникам клиринга, установлены документом «Формы и форматы отчетов, предоставляемых Участникам клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ», раскрываемом на Сайте Клирингового центра.

РАЗДЕЛ VII. ПРОЧИЕ УСЛОВИЯ

Статья 33. Особенности перевода обязательств и Обеспечения одного Участника клиринга другому Участнику клиринга

33.1. Согласие на прием, предоставляемое Участником клиринга - реципиентом, помимо информации, предусмотренной общей частью Правил клиринга, может содержать:

33.1.1. информацию, необходимую для открытия Клиринговым центром клиентского регистра учета позиций и клиентских Расчетных кодов в соответствии с пунктом 9.1 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ, а также указание на необходимость обособления клиента.

Наличие в Согласии на прием указанной информации является соответствующими заявлениями Участника клиринга – реципиента на регистрацию Клиринговым центром Обособленного клиента и открытие Клиринговым центром клиентского регистра учета позиций и клиентского Расчетного кода;

33.1.2. указание клиентского регистра учета позиций и клиентского Расчетного кода, открытых Участником клиринга – реципиентом для Обособленного клиента, подавшего Заявление.

33.2. При отсутствии в Согласии на прием информации, указанной в пункте 33.1.1 или 33.1.2 Правил клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ, или некорректности указания этой информации Клиринговый центр вправе осуществить регистрацию Обособленного клиента Участника клиринга – реципиента и открыть для такого Обособленного клиента клиентский регистр учета позиций и клиентский Расчетный код без подачи Участником клиринга – реципиентом необходимых заявлений. При этом Клиринговый центр самостоятельно присваивает коды открытым клиентскому регистру учета позиций и соответствующему клиентскому Расчетному коду.

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

- открывает Участнику клиринга - реципиенту клиентский регистр учета позиций для Обособленного клиента, предоставившего Заявление (если указанные действия не были осуществлены предварительно);
- осуществляет регистрацию Обособленного клиента, предоставившего Заявление, как Обособленного клиента Участника клиринга – реципиента (в случае указания в Заявлении на необходимость обособления клиента);
- осуществляет закрытие клиентского Расчетного кода и клиентского регистра учета позиций, открытых Базовым Участником клиринга для Обособленного клиента.

Приложение № 1
к Правилам клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ

Временной регламент на рынке Стандартизированных ПФИ

№ п/п	Наименование операции	Время (московское)
1.	Подача Предложений или Предложений «Стратегия».	с 10:00 до 17:00 Расчетного дня
2.	Зачисление денежных средств на клиринговый банковский счет Клирингового центра для учета в текущем Расчетном дне.	до 21:00
3.	Проведение клиринговой сессии.	с 17:00 до 18:00 Расчетного дня
4.	Передача Клиринговым центром Участникам клиринга отчетов по итогам клиринга, за исключением Отчета о движении денежных средств.	до 19:00 Расчетного дня
5.	Передача Клиринговым центром Участникам клиринга Отчетов о движении денежных средств.	до 10:00 Расчетного дня, следующего за днем, за который формируется отчет
6.	Исполнение Участником клиринга Маржинальных требований.	до 16:00 Расчетного дня, следующего за днем возникновения Маржинального требования
7.	Заключение Клиринговым центром Договоров СПФИ и/или сделок купли-продажи иностранной валюты в случае неисполнения Участником клиринга Маржинального требования.	с 16:00 Расчетного дня, следующего за днем возникновения Маржинального требования
8.	Зачисление Участником клиринга денежных средств в целях исполнения Итоговых нетто-обязательств перед Клиринговым центром.	до 17:00 Даты исполнения
9.	Прекращение Клиринговым центром Итоговых нетто-требований Участников клиринга.	до 18:00 Даты исполнения
10.	Погашение Участником клиринга Задолженности.	до 17:00 Расчетного дня, следующего за днем возникновения Задолженности
11.	Погашение Участником клиринга Задолженности, для которой превышено количество Расчетных дней, в течение которых у Участника клиринга может возникать Задолженность.	до 10:00 Расчетного дня
12.	Прием Клиринговым центром от Участников клиринга Запросов о возврате и Запросов о депонировании денежных средств:	
	- евро;	до 17:00 Расчетного дня
	- долларов США, российских рублей.	до 20:00 Расчетного дня
13.	Исполнение Постоянных поручений на возврат для внешних платежей ¹ в:	
	- евро;	17:40 ² / 18:40
	- долларах США, российских рублях.	20:00
14.	Исполнение Постоянных поручений на возврат для внутренних платежей ¹ в:	
	- евро;	19:00 ² / 20:00
	- долларах США, российских рублях.	20:00

№ п/п	Наименование операции	Время (московское)
15.	Возврат Клиринговым центром Участникам клиринга денежных средств, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга, на основании Запроса о возврате / Постоянного поручения на возврат ³ .	в являющийся Расчетным днем день получения Запроса о возврате / в Расчетный день

¹ – под внутренним платежом понимается возврат денежных средств в иностранной валюте на Счет для возврата, открытый в кредитной организации, являющейся Расчетным банком по такой иностранной валюте, под внешним платежом - возврат денежных средств в иностранной валюте на Счет для возврата, открытый в кредитной организации, не являющейся Расчетным банком по такой иностранной валюте.

² – в период действия летнего времени на территории Европейского союза.

³ - зачисление на Счет для возврата будет произведено в соответствии со сроками исполнения распоряжений в иностранной валюте по корреспондентским счетам Расчетного банка, опубликованными на официальном сайте Расчетного банка в сети Интернет.