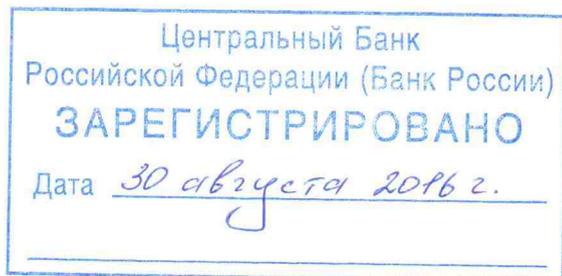


УТВЕРЖДЕНЫ



решением Наблюдательного совета
Банка НКЦ (АО)

от «20» июля 2016 года (Протокол № 4)

Председатель Наблюдательного совета

Банка НКЦ (АО)



 Денисов Ю.О.

**ПРАВИЛА КЛИРИНГА
БАНКА «НАЦИОНАЛЬНЫЙ КЛИРИНГОВЫЙ ЦЕНТР»
(АКЦИОНЕРНОЕ ОБЩЕСТВО).
ЧАСТЬ VI. ПРАВИЛА КЛИРИНГА НА ТОВАРНОМ РЫНКЕ**

Москва, 2016 г.

СОДЕРЖАНИЕ

РАЗДЕЛ I. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ	4
Статья 1. Термины и определения	4
Статья 2. Общие положения	4
Статья 3. Особенности использования Аналога собственноручной подписи	6
Статья 4. Торговые и клиринговые счета	6
Статья 5. Клиринговые регистры	7
РАЗДЕЛ II. ТРЕБОВАНИЯ К УЧАСТНИКАМ КЛИРИНГА	8
Статья 6. Условия клирингового обслуживания. Порядок предоставления допуска к клиринговому обслуживанию	8
Статья 7. Особенности регистрации Участников клиринга, особенности открытия и использования Расчетных кодов Участника клиринга, особенности регистрации и порядок аннулирования Торгово-клиринговых счетов Участника клиринга	9
Статья 8. Особенности регистрации Обособленных клиентов	10
Статья 9. Особенности приостановления и прекращения допуска к клиринговому обслуживанию	10
РАЗДЕЛ III. МЕРЫ, НАПРАВЛЕННЫЕ НА УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ ПРИ ОСУЩЕСТВЛЕНИИ КЛИРИНГА	12
Статья 10. Перечень мер, направленных на управление рисками при осуществлении клиринга	12
Статья 11. Единый лимит по Расчетному коду и риск-параметры	12
РАЗДЕЛ IV. ПОРЯДОК И УСЛОВИЯ ДОПУСКА ОБЯЗАТЕЛЬСТВ К КЛИРИНГУ ...	16
Статья 12. Порядок взаимодействия с Биржей при подаче заявок и заключении Договоров	16
РАЗДЕЛ V. ПОРЯДОК ПРОВЕДЕНИЯ КЛИРИНГА	21
ПОДРАЗДЕЛ V-I. ПОРЯДОК ВНЕСЕНИЯ И ВОЗВРАТА ОБЕСПЕЧЕНИЯ	21
Статья 13. Порядок внесения Обеспечения	21
Статья 14. Порядок возврата Обеспечения	23
ПОДРАЗДЕЛ V-II. КЛИРИНГОВЫЕ СЕССИИ	28
Статья 15. Порядок проведения клиринговых сессий. Порядок возникновения и исполнения Маржинальных требований	28
ПОДРАЗДЕЛ V-III. ПОРЯДОК ОПРЕДЕЛЕНИЯ И ИСПОЛНЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ	

ПО ДОГОВОРАМ	30
Статья 16. Порядок включения в клиринговый пул обязательств по Договорам.....	30
Статья 17. Порядок действий в случае наличия Задолженности и/или обязательств, не обеспеченных средствами под исполнение	32
Статья 18. Порядок заключения и условия своп договоров и форвардных договоров, заключаемых с Недобросовестными участниками клиринга	36
ПОДРАЗДЕЛ V-IV. ПОРЯДОК ИСПОЛНЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ, ВКЛЮЧЕННЫХ В КЛИРИНГОВЫЙ ПУЛ	40
Статья 19. Порядок исполнения обязательств и требований Участников клиринга и Клирингового центра, включенных в клиринговый пул.....	40
РАЗДЕЛ VI. ПОРЯДОК ВЗАИМОДЕЙСТВИЯ С ОПЕРАТОРОМ ТОВАРНЫХ ПОСТАВОК	42
Статья 20. Порядок взаимодействия с Оператором товарных поставок	42
РАЗДЕЛ VII. ПОРЯДОК ОПЛАТЫ УСЛУГ. ОТЧЕТЫ ПО ИТОГАМ КЛИРИНГА	44
Статья 21. Порядок оплаты услуг Клирингового центра, Биржи, Технического центра, Оператора товарных поставок и Экспедитора	44
Статья 22. Порядок предоставления отчетов по итогам клиринга.....	47
РАЗДЕЛ VIII. ПРОЧИЕ УСЛОВИЯ	49
Статья 23. Особенности перевода обязательств и Обеспечения одного Участника клиринга другому Участнику клиринга	49
Приложение № 1 Временной регламент на товарном рынке	50

РАЗДЕЛ I. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ

Настоящие «Правила клиринга Банка «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество). Часть VI. Правила клиринга на товарном рынке» (далее – Правила клиринга на товарном рынке) являются неотъемлемой частью Правил клиринга Банка «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество) и совместно с «Правилами клиринга Банка «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество). Часть I. Общая часть» (далее – общая часть Правил клиринга) и «Правилами клиринга Банка «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество). Часть II. Тарифы» (далее – Тарифы Клирингового центра) регулируют отношения, связанные с исполнением договоров, являющихся производными финансовыми инструментами, базисным активом которых является товар, заключаемых на торгах, организуемых АО НТБ.

Статья 1. Термины и определения

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

<i>Договор -</i>	своп договор или форвардный договор, заключаемый на торгах Биржи.
<i>Методика определения расчетной цены -</i>	внутренний документ Биржи, устанавливающий порядок определения Расчетной цены и Расчетной цены своп.
<i>Методика определения риск-параметров товарного рынка -</i>	внутренний документ Клирингового центра, устанавливающий порядок определения риск-параметров товарного рынка АО НТБ.

1.2. Термины, специально не определенные в Правилах клиринга на товарном рынке, используются в значениях, установленных Условиями оказания услуг оператора товарных поставок Банка «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество).

Статья 2. Общие положения

2.1. Клиринговый центр осуществляет клиринг, выполняя функции центрального контрагента по всем Договорам, стороной по которым являются Участники клиринга.

2.2. Клиринговый центр осуществляет по Договорам клиринг с частичным обеспечением и клиринг с полным обеспечением по товарам и/или денежным средствам.

2.2.1. Клиринговый центр осуществляет клиринг с частичным обеспечением по товару:

- по форвардным договорам, заключенным Участниками клиринга категории «Б», в которых количество Расчетных дней между датой заключения и Датой исполнения больше или равно количеству Расчетных дней, установленному решением Клирингового центра;
- по вторым частям своп договоров.

2.2.2. Клиринговый центр осуществляет клиринг с частичным обеспечением по

денежным средствам:

- по форвардным договорам, заключенным Участниками клиринга категории «Б»;
- по вторым частям своп договоров;
- по первым частям своп договоров, заключенных Участниками клиринга категории «Б».

2.2.3. Клиринговый центр осуществляет клиринг с полным обеспечением по товару:

- по форвардным договорам, заключенным Участниками клиринга категории «Б», в которых количество Расчетных дней между датой заключения и Датой исполнения меньше количества дней, установленного решением Клирингового центра;
- по форвардным договорам, заключенным Участниками клиринга категории «В»;
- по первым частям своп договоров.

2.2.4. Клиринговый центр осуществляет клиринг с полным обеспечением по денежным средствам:

- по форвардным договорам, заключенным Участниками клиринга категории «В».
- по первым частям своп договоров, заключенных Участниками клиринга категории «В».

2.2.5. Участник клиринга категории «Б» при подаче заявки на продажу на заключение форвардного договора, у которого количество Расчетных дней между датой заключения и Датой исполнения больше или равно количеству Расчетных дней, установленному решением Клирингового центра, вправе указать, что по форвардному договору, заключенному на основании такой заявки должен осуществляться клиринг с полным обеспечением по товару.

2.3. Обмен электронными документами между Участником клиринга и Клиринговым центром осуществляется посредством ЭДО и/или системы S.W.I.F.T., порядок использования которых установлен общей частью Правил клиринга.

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

2.4. Формы и форматы документов, предоставляемых Участниками клиринга и/или их клиентами Клиринговому центру в соответствии с Правилами клиринга на товарном рынке и способ их предоставления установлены документом «Формы и форматы документов, предоставляемых Участниками клиринга, клиентами Участников клиринга на товарном рынке», если иное не установлено Правилами клиринга.

2.5. Сроки исполнения обязательств, определенных Правилами клиринга на товарном

рынке, время проведения клиринговых сессий, а также сроки проведения клиринговых операций, сроки предоставления документов Клиринговому центру / Клиринговым центром в процессе взаимодействия с Участниками клиринга при проведении клиринга и расчетов по Договорам в соответствии с Правилами клиринга на товарном рынке, установлены Временным регламентом на товарном рынке, являющимся приложением № 1 к Правилам клиринга на товарном рынке.

2.6. Техническим центром на товарном рынке является АО НТБ.

Статья 3. Особенности использования Аналога собственноручной подписи

3.1. Аналогом собственноручной подписи признается Клиринговый идентификатор, позволяющий однозначно идентифицировать Участника клиринга или Клиринговый центр, направивших электронное сообщение и достоверно установить, что электронное сообщение исходит от Участника клиринга или Клирингового центра, которому присвоен данный Клиринговый идентификатор.

3.2. Присвоение Клирингового идентификатора Участнику клиринга или Клиринговому центру осуществляется Клиринговым центром.

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

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

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

Статья 4. Торговые и клиринговые счета

4.1. При осуществлении клиринга на товарном рынке Клиринговый центр использует следующие типы торговых товарных счетов Участников клиринга, открытых Оператором товарных поставок с указанием Клирингового центра в качестве клиринговой организации, которая вправе давать распоряжения по этим счетам:

- торговый товарный счет для учета товаров Участника клиринга;
- торговый товарный счет для учета товаров клиента Участника клиринга;
- торговый товарный счет Клирингового центра.

4.2. При осуществлении клиринга на товарном рынке Клиринговый центр использует:

- торговые разделы торговых товарных счетов, открытых Оператором товарных поставок (далее – торговые разделы);
- поставочные разделы торговых товарных счетов, открытых Оператором товарных поставок (далее – поставочные разделы).

4.3. При осуществлении клиринга на товарном рынке Клиринговый центр использует клиринговые счета, предусмотренные общей частью Правил клиринга.

Статья 5. Клиринговые регистры

- 5.1. При осуществлении клиринга на товарном рынке Клиринговый центр открывает и ведет клиринговые регистры, предусмотренные общей частью Правил клиринга, а также на клиринговых регистрах Клиринговый центр учитывает:
- Единый лимит по Расчетным кодам;
 - обязанности и требования Участника клиринга по каждому Договору, обязательства по которому допущены к клирингу;
 - Нетто-обязательства / Нетто-требования Участника клиринга по денежным средствам в разрезе Расчетных кодов и Дат исполнения;
 - Нетто-обязательства / Нетто-требования Участника клиринга по товарам в разрезе торговых разделов, товаров, Дат исполнения;
 - Итоговое нетто-обязательство / Итоговое нетто-требование Участника клиринга по денежным средствам в разрезе Расчетных кодов;
 - Обеспечение Участника клиринга в денежных средствах в разрезе Расчетных кодов и валют;
 - Обеспечение Участника клиринга в товарах в разрезе торговых разделов и товаров (с основными характеристиками);
 - Обеспечение Участника клиринга в товарах в разрезе торговых разделов и товаров с полным набором характеристик, включая основные и дополнительные характеристики.;
 - Маржинальное требование Участника клиринга в разрезе Расчетных кодов (в случае наличия).
- 5.2. Обеспечение Участника клиринга в российских рублях или иностранной валюте, учитываемое по Расчетному коду, также учитывается на Счете обеспечения в соответствующей валюте, соответствующем Расчетному коду.
- 5.3. Порядок ведения клиринговых регистров определен в соответствующих статьях разделов IV и V Правил клиринга на товарном рынке.

РАЗДЕЛ II. ТРЕБОВАНИЯ К УЧАСТНИКАМ КЛИРИНГА

Статья 6. Условия клирингового обслуживания. Порядок предоставления допуска к клиринговому обслуживанию

- 6.1. На товарном рынке Участникам клиринга могут быть присвоены следующие категории Участников клиринга:
- Участники клиринга категории «Б»;
 - Участники клиринга категории «В».
- 6.2. Допуск к клиринговому обслуживанию на товарном рынке предоставляется Участнику клиринга, соответствующему требованиям, установленным для категории «Б» в общей части Правил клиринга, а также требованиям, указанным в пункте 6.3 Правил клиринга на товарном рынке.
- 6.3. Для допуска к клиринговому обслуживанию Участник клиринга должен дополнительно соответствовать следующим требованиям:
- 6.3.1. иметь хотя бы один зарегистрированный в Клиринговом центре Торгово-клиринговый счет;
- 6.3.2. Участник клиринга, не являющийся профессиональным участником рынка ценных бумаг, - иметь собственные средства (капитал) не менее 1 000 000 000 (одного миллиарда) российских рублей, либо
- 6.3.3. Участник клиринга, не являющийся профессиональным участником рынка ценных бумаг, - иметь собственные средства (капитал) не менее 100 000 000 (ста миллионов) российских рублей и предоставить письмо, выданное организацией, имеющей право прямо или косвенно осуществлять контроль за деятельностью Участника клиринга, собственные средства (капитал) которой не менее 1 000 000 000 (одного миллиарда) российских рублей, содержащее:
- 1) подтверждение, что указанная организация знает о намерении лица, в отношении которого выдается указанное письмо, получить статус Участника клиринга на товарном рынке АО НТБ;
 - 2) сведения о доле участия организации, выдающей указанное письмо, в организации, в отношении которой выдается указанное письмо и/или подтверждение осуществления контроля и заверение об отсутствии намерений уменьшить указанную долю / прекратить осуществлять контроль;
 - 3) подтверждение намерения организации, выдающей указанное письмо, в случае недостаточности у Участника клиринга, в отношении которого выдается такое письмо, денежных средств для исполнения своих обязательств перед Клиринговым центром, предоставить Участнику клиринга необходимое финансирование.
- Указанное в настоящем подпункте Правил клиринга на товарном рынке письмо может быть предоставлено на русском или английском языке.
- 6.4. Клиринговый центр вправе предоставить Участнику клиринга допуск к клиринговому обслуживанию по всем Договорам или по отдельным видам Договоров.

- 6.5. Клиринговый центр вправе установить Участнику клиринга категорию «В» по основаниям, предусмотренным общей частью Правил клиринга.
- 6.6. Участник клиринга на товарном рынке не вправе предоставить Клиринговому центру Заявление об изменении категории Участника клиринга с категории «Б» на категорию «В».

Статья 7. Особенности регистрации Участников клиринга, особенности открытия и использования Расчетных кодов Участника клиринга, особенности регистрации и порядок аннулирования Торгово-клиринговых счетов 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 на основании данных, полученных от Биржи).
- 7.2. При осуществлении клиринга на товарном рынке Участнику клиринга могут быть открыты собственные и клиентские Расчетные коды.
- 7.3. На товарном рынке необходима регистрация Торгово-клиринговых счетов Участника клиринга в соответствии с порядком, определенным общей частью Правил клиринга.
- 7.4. В состав Торгово-клирингового счета Участника клиринга, используемого на товарном рынке, входят Расчетный код и торговый раздел соответствующих типов:
- собственный Расчетный код и торговый раздел торгового товарного счета для учета товаров Участника клиринга;
 - клиентский Расчетный код и торговый раздел торгового товарного счета для учета товаров клиента Участника клиринга.
- Один торговый раздел может входить в состав только одного Торгово-клирингового счета.
- Один Расчетный код может входить в состав нескольких Торгово-клиринговых счетов.
- 7.5. Заявление на регистрацию Торгово-клирингового счета Участника клиринга должно содержать информацию о торговом разделе и Расчетном коде.
- 7.6. Клиринговый центр посредством Системы торгов передает Бирже информацию:
- о зарегистрированных Торгово-клиринговых счетах Участника клиринга;
 - об Обособленных клиентах.
- 7.7. Расчет Единого лимита, определение Нетто-обязательств / Нетто-требований, Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований, Задолженностей Участника клиринга, проверка возможности регистрации заявок, перечисление и учет денежных средств Участника клиринга, исполнение (прекращение) обязательств по Договорам, возникновение и прекращение Маржинального

требования, уплата комиссионных вознаграждений осуществляется по Расчетному коду Участника клиринга.

7.8. Аннулирование Торгово-клирингового счета Участника клиринга осуществляется на основании Заявления об аннулировании Торгово-клирингового счета, предоставленного Участником клиринга Клиринговому центру.

7.8.1. Клиринговый центр осуществляет аннулирование Торгово-клирингового счета Участника клиринга при соблюдении следующих условий:

- отсутствуют неисполненные обязательства и / или требования, учитываемые по Расчетному коду и / или по торговому разделу, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в Заявлении об аннулировании Торгово-клирингового счета;
- отсутствует Обеспечение в товарах, учитываемое по торговому разделу, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в Заявлении об аннулировании Торгово-клирингового счета.

Статья 8. Особенности регистрации Обособленных клиентов

8.1. Помимо отдельного клиентского Расчетного кода Участник клиринга должен открыть для Обособленного клиента отдельный торговый раздел торгового товарного счета для учета товаров клиента Участника клиринга и зарегистрировать такой торговый раздел и такой Расчетный код в составе отдельного Торгово-клирингового счета.

8.2. В Заявлении на регистрацию Обособленного клиента помимо информации, предусмотренной общей частью Правил клиринга, Участник клиринга обязан указать Торгово-клиринговые счета, открытые для Обособленного клиента.

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

Статья 9. Особенности приостановления и прекращения допуска к клиринговому обслуживанию

9.1. Клиринговый центр вправе установить Участнику клиринга категории «Б» категорию «В», а также приостановить допуск к клиринговому обслуживанию Участника клиринга по всем Договорам или по отдельным видам Договоров по основаниям, предусмотренным общей частью Правил клиринга, а также при несоответствии размера собственных средств (капитала) Участника клиринга требованию, установленному подпунктом 6.3.2 или 6.3.3 Правил клиринга на товарном рынке.

9.2. Клиринговый центр вправе приостановить допуск к клиринговому обслуживанию Участника клиринга по всем Договорам или по отдельным видам Договоров, по основаниям, указанным в пункте 9.1 Правил клиринга на товарном рынке, а также при отсутствии у Участника клиринга хотя бы одного зарегистрированного

Торгово-клирингового счета.

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 товарном рынке, Клиринговый центр применяет меры, предусмотренные общей частью Правил клиринга.
- 10.2. Гарантийный фонд формируется Клиринговым центром за счет взносов в Гарантийный фонд всех Участников клиринга категории «Б».
Размер взноса в Гарантийный фонд каждого Участника клиринга категории «Б» составляет 1 000 000 (один миллион) российских рублей.
- 10.3. Обеспечение под стресс обязаны вносить Участники клиринга категории «Б».
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 категории «Б» устанавливается категория «В».
- 10.5. При использовании взноса Недобросовестного участника клиринга в Гарантийный фонд товарного рынка и/или Обеспечения под стресс на товарном рынке, Участнику клиринга категории «Б» устанавливается категория «В».
- 10.6. В случае возмещения Недобросовестным участником клиринга средств Гарантийного фонда товарного рынка и Обеспечения под стресс на товарном рынке в течение 1 (одного) Расчетного дня после направления Клиринговым центром такому Недобросовестному Участнику клиринга Маржинального требования по фонду и/или Маржинального требования по Обеспечению под стресс, Участнику клиринга категории «В» устанавливается категория «Б».

Статья 11. Единый лимит по Расчетному коду и риск-параметры

- 11.1. Единый лимит по Расчетному коду рассчитывается Клиринговым центром при изменении размера Обеспечения Участника клиринга, при подаче и снятии Участником торгов заявок на заключение Договоров, стороной по которым будет являться Участник клиринга, при заключении Договоров или исполнении / прекращении обязательств по Договорам, стороной по которым является Участник клиринга, изменении риск-параметров.
- 11.2. Единый лимит по Расчетному коду используется для проверки возможности подачи Участником торгов заявок на заключение Договоров, стороной по которым будет являться Участник клиринга, возврата Участнику клиринга Обеспечения в денежных средствах / товарах, а также выполнения иных операций,

предусмотренных Правилами клиринга на товарном рынке. Указанная проверка осуществляется, исходя из анализа изменения значения Единого лимита по Расчетному коду до и после проведения соответствующей операции.

11.3. Единый лимит по Расчетному коду рассчитывается с учетом:

- Обеспечения Участника клиринга в российских рублях и иностранной валюте, учитываемого по Расчетному коду;
- Обеспечения Участника клиринга в товарах, учитываемых по торговым разделам, входящим в состав Торгово-клиринговых счетов совместно с Расчетным кодом;
- Нетто-обязательств / Нетто-требований Участника клиринга в российских рублях, учитываемых по Расчетному коду по всем Датам исполнения;
- Нетто-обязательств / Нетто-требований Участника клиринга в товарах, учитываемых по всем торговым разделам, входящим в состав Торгово-клиринговых счетов совместно с Расчетным кодом, по всем Датам исполнения;
- обязательств по уплате комиссионных вознаграждений учитываемых по Расчетному коду, за исключением обязательств по уплате транспортного дифференциала;
- Задолженности Участника клиринга перед Клиринговым центром, учитываемой по Расчетному коду.

11.4. При расчете Единого лимита по Расчетному коду в ходе торгов кроме величин, указанных в пункте 11.3 Правил клиринга на товарном рынке, также учитываются зарегистрированные заявки на заключение Договоров, стороной по которым будет являться Участник клиринга.

11.5. Базовыми риск-параметрами, используемыми Клиринговым центром для контроля и управления рисками, являются:

- Расчетная цена товара;
- Верхняя и Нижняя границы ценового коридора;
- Верхняя и Нижняя границы диапазона оценки рыночных рисков 1-го, 2-го и 3-го уровня;
- Расчетная цена своп;
- Верхняя и Нижняя границы коридора цен своп;
- Верхняя и Нижняя границы диапазона оценки процентных рисков 1-го, 2-го и 3-го уровня;
- Лимиты концентрации 1-го и 2-го уровня.

Помимо базовых риск-параметров Клиринговым центром используются дополнительные риск-параметры, приведенные в Методике определения риск-параметров товарного рынка.

Расчетная цена товара и Расчетная цена своп определяются в соответствии с Методикой определения расчетной цены.

- 11.6. Расчет и 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 определения риск-параметров товарного рынка.
- 11.7. Верхняя или Нижняя границы диапазона оценки рыночных рисков 1-го уровня применяется при расчете Единого лимита по Расчетному коду к части суммы с учетом знака Нетто-обязательств и Нетто-требований Участника клиринга в товаре, учитываемых по торговому разделу, входящему в состав Торгово-клирингового счета совместно с Расчетным кодом, по всем Датам исполнения и Обеспечения в товаре, учитываемому по тому же торговому разделу, не превышающей по абсолютной величине значения Лимита концентрации 1-го уровня, Верхняя или Нижняя границы диапазона оценки рыночных рисков 2-го уровня – к части указанной суммы, превышающей по абсолютной величине значение Лимита концентрации 1-го уровня и не превышающей по абсолютной величине Лимита концентрации 2-го уровня, Верхняя или Нижняя границы диапазона оценки рыночных рисков 3-го уровня – к части указанной суммы, превышающей по абсолютной величине значение Лимита концентрации 2-го уровня.
- 11.8. Верхняя или Нижняя граница диапазона оценки процентных рисков 1-го уровня, установленная для Даты исполнения, применяется при расчете Единого лимита по Расчетному коду к части суммы с учетом знака Нетто-обязательств и Нетто-требований Участника клиринга в товаре, учитываемых по торговому разделу, входящему в состав Торгово-клирингового счета совместно с Расчетным кодом, по такой Дате исполнения, не превышающей по абсолютной величине значения Лимита концентрации 1-го уровня, Верхняя или Нижняя границы диапазона оценки процентных рисков 2-го уровня – к части указанной суммы, превышающей по абсолютной величине значение Лимита концентрации 1-го уровня и не превышающей по абсолютной величине Лимита концентрации 2-го уровня, Верхняя или Нижняя границы диапазона оценки процентных рисков 3-го уровня – к части указанной суммы, превышающей по абсолютной величине значение Лимита концентрации 2-го уровня.
- 11.9. Участник клиринга категории «Б» вправе с использованием Клиринговой системы установить индивидуальные Верхние и Нижние границы диапазона оценки рыночных рисков 1-го, 2-го или 3-го уровня и Верхние и Нижние границы диапазона оценки процентных рисков 1-го, 2-го или 3-го уровня, расширяющие указанные диапазоны, для определенных Расчетных кодов Участника клиринга.
- 11.10. Единый лимит по Расчетному коду рассчитывается Клиринговым центром исходя из оценки в российских рублях максимально возможного уменьшения в течение срока, необходимого для прекращения обязательств по Договорам в случае неисполнения Участником клиринга Маржинального требования, общей стоимости активов и обязательств Участника клиринга, указанных в пункте 11.3 Правил клиринга на товарном рынке, в связи с изменением Расчетных цен товаров и/или изменением процентных ставок по своп договорам.

Указанная оценка проводится с использованием Верхних и Нижних границ диапазона оценки рыночных рисков 1-го, 2-го и 3-го уровня и Верхних и Нижних границ диапазона оценки процентных рисков 1-го, 2-го и 3-го уровня. В случае если Участником клиринга установлены индивидуальные значения указанных риск-параметров, указанная оценка проводится с использованием таких индивидуальных значений указанных риск-параметров.

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

РАЗДЕЛ IV. ПОРЯДОК И УСЛОВИЯ ДОПУСКА ОБЯЗАТЕЛЬСТВ К КЛИРИНГУ

Статья 12. Порядок взаимодействия с Биржей при подаче заявок и заключении Договоров

- 12.1. Немедленно после того, как информация о поданной Участником торгов заявке на заключение Договора, по которому осуществляется клиринг с полным обеспечением по товару, стороной по которому будет являться Участник клиринга, имеющей направленность «продажа» для форвардного договора или «продажа/покупка» для своп договора, стала доступной Клиринговому центру посредством Системы торгов, Клиринговый центр:
- 12.1.1. для заявки на заключение форвардного договора проверяет, что значение цены, указанной в заявке, больше либо равно Нижней границе ценового коридора и меньше либо равно Верхней границе ценового коридора, установленных Клиринговым центром для товара, по которому подана заявка, и для даты, соответствующей Дате исполнения обязательства по заключаемому Договору;
- 12.1.2. для заявки на заключение своп договора проверяет, что значение цены, указанной в заявке, больше либо равно Нижней границе коридора цен своп и меньше либо равно Верхней границе коридора цен своп, установленных Клиринговым центром для товара, по которому подана заявка, и для даты, соответствующей Дате исполнения обязательства по заключаемому Договору;
- 12.1.3. рассчитывает размер Обеспечения Участника клиринга в товаре, по которому подана заявка, которое может быть использовано для заключения Договора, с учетом:
- Обеспечения Участника клиринга в таком товаре с полным набором характеристик, соответствующих набору характеристик товара, указанных в заявке, учитываемого по торговому разделу, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в заявке;
 - обязательств и/или требований Участника клиринга по Договорам, по которым осуществляется клиринг с полным обеспечением по товару, в таком товаре с полным набором характеристик, соответствующих набору характеристик товара, указанных в заявке, учитываемых по торговому разделу, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в заявке;
 - обязательств по передаче товара Участника клиринга по Договорам, по которым осуществляется клиринг с частичным обеспечением по товару, в таком товаре с полным набором характеристик, соответствующих набору характеристик товара, указанных в заявке, учитываемых по торговому разделу, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в заявке, прошедших проверку наличия Обеспечения в товарах в соответствии с пунктом 16.2 Правил клиринга на товарном рынке;
 - всех зарегистрированных заявок, имеющих направленность «продажа», поданных Участниками торгов с указанием Торгово-клирингового счета, указанного в проверяемой заявке, и направленных на заключение Договоров с товаром с полным набором характеристик, соответствующих набору характеристик товара, указанных в заявке, стороной по которым будет

являться Участник клиринга и по которым осуществляется клиринг с полным обеспечением по товару.

Для заявок на заключение своп договоров расчет, указанный в настоящем подпункте Правил клиринга на товарном рынке, осуществляется с учетом обязательств по первой и второй части своп договора и одновременности их возникновения;

- 12.1.4. проверяет, что размер обязательства по передаче товара по Договору, который может быть заключен на основании поданной заявки, в Дату его исполнения не превышает размера Обеспечения Участника клиринга в таком товаре с полным набором характеристик, соответствующих набору характеристик товара, указанных в заявке, рассчитанного в соответствии с подпунктом 12.1.3 Правил клиринга на товарном рынке.
- 12.1.5. рассчитывает значение Единого лимита по Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета Участника клиринга, указанного в заявке, с учетом поданной заявки;
- 12.1.6. осуществляет контроль рассчитанного Единого лимита по Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета Участника клиринга, указанного в заявке, в соответствии с пунктом 12.5 Правил клиринга на товарном рынке.
- 12.2. Немедленно после того как информация о поданной Участником торгов заявке на заключение Договора, по которому осуществляется клиринг с полным обеспечением по денежным средствам, стороной по которому будет являться Участник клиринга, имеющей направленность «покупка» для форвардного договора или «покупка/продажа» для своп договора, стала доступной Клиринговому центру посредством Системы торгов, Клиринговый центр:
 - 12.2.1. для заявки на заключение форвардного договора проверяет, что значение цены, указанной в заявке, больше либо равно Нижней границе ценового коридора и меньше либо равно Верхней границе ценового коридора, установленных Клиринговым центром для товара, по которому подана заявка, и для даты, соответствующей Дате исполнения обязательства по заключаемому Договору;
 - 12.2.2. для заявки на заключение своп договора проверяет, что значение цены, указанной в заявке, больше либо равно Нижней границе коридора цен своп и меньше либо равно Верхней границе коридора цен своп, установленных Клиринговым центром для товара, по которому подана заявка, и для даты, соответствующей Дате исполнения обязательства по заключаемому Договору;
 - 12.2.3. рассчитывает сумму Обеспечения Участника клиринга в российских рублях, которое может быть использовано для заключения Договора, с учетом:
 - Обеспечения Участника клиринга в российских рублях, учитываемого по Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в заявке;
 - обязательств и/или требований Участника клиринга по Договорам, по которым осуществляется клиринг с полным обеспечением по денежным средствам, учитываемых по Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в заявке, с Датой исполнения в дату заключения Договора;
 - всех зарегистрированных заявок, имеющих направленность «покупка»,

поданных Участниками торгов с указанием Торгово-клирингового счета, указанного в проверяемой заявке и направленных на заключение Договоров, стороной по которым будет являться Участник клиринга и по которым осуществляется клиринг с полным обеспечением по денежным средствам, с Датой исполнения в дату заключения Договора;

Для заявок на заключение своп договоров расчет, указанный в настоящем подпункте Правил клиринга на товарном рынке, осуществляется для каждой части своп договора;

- 12.2.4. проверяет, что размер обязательства по оплате товара по Договору, который может быть заключен на основании поданной заявки, не превышает Обеспечения Участника клиринга в российских рублях, рассчитанного в соответствии с подпунктом 12.2.3 Правил клиринга на товарном рынке;
- 12.2.5. рассчитывает значение Единого лимита по Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета Участника клиринга, указанного в заявке, с учетом поданной заявки;
- 12.2.6. осуществляет контроль рассчитанного Единого лимита по Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета Участника клиринга, указанного в заявке, в соответствии с пунктом 12.5 Правил клиринга на товарном рынке.
- 12.3. Немедленно после того, как информация о поданной Участником торгов заявке, направленной на заключение Договора, по которому осуществляется клиринг с частичным обеспечением, стороной по которому будет являться Участник клиринга, стала доступной Клиринговому центру посредством Системы торгов, Клиринговый центр:
 - 12.3.1. для заявки на заключение форвардного договора проверяет, что значение цены, указанной в заявке, больше либо равно Нижней границе ценового коридора и меньше либо равно Верхней границе ценового коридора, установленных Клиринговым центром для товара, по которому подана заявка, и для даты, соответствующей Дате исполнения обязательства по заключаемому Договору;
 - 12.3.2. для заявки на заключение своп договора проверяет, что значение цены, указанной в заявке, больше либо равно Нижней границе коридора цен своп и меньше либо равно Верхней границе коридора цен своп, установленных Клиринговым центром для товара, по которому подана заявка, и для даты, соответствующей Дате исполнения обязательства по заключаемому Договору;
 - 12.3.3. рассчитывает значение Единого лимита по Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в заявке, с учетом поданной заявки;
 - 12.3.4. осуществляет контроль рассчитанного Единого лимита по Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в заявке, в соответствии с пунктом 12.5 Правил клиринга на товарном рынке.
- 12.4. Немедленно после того, как информация о поданной Участником торгов Комбинированной заявке стала доступной Клиринговому центру посредством Системы торгов, Клиринговый центр:
 - 12.4.1. проверяет, что значение указанной в заявке цены форвардного договора, который может быть заключен на основании такой Комбинированной заявки, больше либо равно Нижней границе ценового коридора и меньше либо равно Верхней границе

ценового коридора, установленных Клиринговым центром для товара, по которому подана заявка, и для даты, соответствующей Дате исполнения обязательств по форвардному договору, заключаемому на основании такой Комбинированной заявки;

- 12.4.2. выполняет проверки, предусмотренные настоящей статьей Правил клиринга на товарном рынке, в отношении первой части своп договора и обязательства по уплате своп разницы по своп договору, который может быть заключен на основании такой Комбинированной заявки, с учетом вида клиринга (клиринг с полным или клиринг с частичным обеспечением), осуществляемого по указанному своп договору.
- 12.5. Контроль Единого лимита по Расчетному коду по заявке считается пройденным, при условии, что значение Единого лимита по Расчетному коду с учетом обязательств по Договору, который может быть заключен на основании поданной заявки, не станет отрицательным, или, если Единый лимит по такому Расчетному коду был отрицательным до момента подачи заявки, при условии, что Единый лимит по такому Расчетному коду, рассчитанный с учетом указанных обязательств, не станет меньше, чем Единый лимит по этому Расчетному коду, рассчитанный до момента подачи заявки.
- Для заявок на заключение своп договоров проверка, указанная в настоящем пункте Правил клиринга на товарном рынке, осуществляется с учетом обязательств по первой и второй части своп договора и одновременности их возникновения.
- 12.6. Немедленно после проведения Клиринговым центром проверок, предусмотренных настоящей статьей Правил клиринга на товарном рынке для соответствующих заявок, информация о результате таких проверок становится доступной Бирже посредством Системы торгов: в случае положительного результата всех необходимых проверок – информация о возможности регистрации заявки, в случае отрицательного результата хотя бы одной из необходимых проверок – информация о невозможности регистрации заявки.
- 12.7. В случае возможности регистрации заявки, Клиринговый центр начинает учитывать значение Единого лимита по соответствующему Расчетному коду, рассчитанное при проверке возможности регистрации заявки, в качестве нового значения Единого лимита по такому Расчетному коду.
- 12.7.1. В случае невозможности регистрации заявки, Клиринговый центр не изменяет значения Единого лимита по Расчетному коду.
- 12.8. После того, как информация о снятии зарегистрированной заявки, в которой Участник клиринга был указан в качестве стороны по Договору, стала доступной Клиринговому центру посредством Системы торгов, Клиринговый центр рассчитывает Единый лимит по соответствующему Расчетному коду без учета отозванной заявки.
- 12.9. При регистрации заявки, являющейся в соответствии с Правилами торгов на товарном рынке допустимой встречной по отношению к ранее зарегистрированной заявке, Клиринговый центр заключает Договор с каждым из Участников клиринга, указанным в заявке в качестве стороны по Договору.

- 12.10. После того, как информация о регистрации Договора стала доступной Клиринговому центру посредством Системы торгов, Клиринговый центр:
- рассчитывает Единый лимит Участника клиринга по соответствующему Расчетному коду без учета заявки (части заявки), на основании которой заключен Договор, и с учетом заключенного Договора;
 - допускает к клирингу обязательства по заключенному Договору;
 - изменяет с учетом заключенного Договора Нетто-обязательство и/или Нетто-требование Участника клиринга по денежным средствам по Расчетному коду, соответствующему Счету обеспечения, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в заявке, на основании которой заключен Договор, с Датами исполнения, соответствующими Дате (Датам) исполнения обязательств по оплате товара по заключенному Договору;
 - изменяет с учетом заключенного Договора Нетто-обязательство и/или Нетто-требование Участника клиринга по товарам по торговому разделу, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в заявке, на основании которой заключен Договор, с Датами исполнения, соответствующими Дате (Датам) исполнения обязательств по передаче товара по заключенному Договору.

РАЗДЕЛ V. ПОРЯДОК ПРОВЕДЕНИЯ КЛИРИНГА

ПОДРАЗДЕЛ V-I. ПОРЯДОК ВНЕСЕНИЯ И ВОЗВРАТА ОБЕСПЕЧЕНИЯ

Статья 13. Порядок внесения Обеспечения

- 13.1. В качестве Обеспечения принимаются российские рубли, товары, а также иностранная валюта, входящая в установленный решением Клирингового центра Перечень иностранной валюты, принимаемой в качестве Обеспечения.
- 13.2. Обеспечение Участника клиринга в российских рублях и иностранной валюте вносится на соответствующий клиринговый банковский счет Клирингового центра в Расчетной организации.
- 13.3. Денежные средства в соответствующей валюте, предоставляемые в качестве Обеспечения в российских рублях и/или Обеспечения в иностранной валюте, перечисляются на соответствующий клиринговый банковский счет Клирингового центра по реквизитам, размещенным на Сайте Клирингового центра, с обязательным указанием в назначении платежа Расчетного кода Участника клиринга.
- 13.4. 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, и увеличивает Единый лимит по такому Расчетному коду с учетом перечисленной суммы денежных средств.
 - 13.4.1. Если Расчетный код, указанный в назначении платежа, не найден среди зарегистрированных Клиринговым центром Расчетных кодов, Клиринговый центр вправе запросить у Участника клиринга уточнение назначения платежа. В случае получения от Участника клиринга уточнения назначения платежа, учет денежных средств в качестве Обеспечения Участника клиринга в соответствии с пунктом 13.4 Правил клиринга на товарном рынке, осуществляется Клиринговым центром после получения от Участника клиринга такого уточнения назначения платежа с правильно указанным Расчетным кодом.
 - 13.4.2. 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 счет Клирингового центра с не указанным / неправильно указанным Расчетным кодом в назначении платежа, Участник клиринга не предоставит Клиринговому центру уточнение назначения платежа с правильно указанным Расчетным кодом соответствующего уровня, Клиринговый центр возвращает указанные денежные средства по реквизитам плательщика.
 - 13.4.3. Денежные средства, зачисленные на соответствующий клиринговый банковский счет Клирингового центра, позднее времени, установленного Временным регламентом на товарном рынке, учитываются Клиринговым центром в качестве Обеспечения Участника клиринга в следующем Расчетном дне.
- 13.5. Денежные средства, учитываемые в качестве Обеспечения Участника клиринга,

используются для расчета Единого лимита по Расчетному коду, обеспечения исполнения обязательств по Договору, исполнения Итоговых нетто-обязательств по денежным средствам и исполнения обязательств по уплате комиссионных вознаграждений, учитываемых по тому же Расчетному коду, по которому указанное Обеспечение учитывается.

- 13.6. Участник клиринга может перевести денежные средства, учитываемые в качестве Обеспечения, между своими Расчетными кодами, подав в Клиринговый центр Заявление о переводе.

Данное заявление не принимается Клиринговым центром к исполнению, если сумма денежных средств в определенной валюте, указанная Участником клиринга в заявлении, превышает сумму денежных средств, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга по Расчетному коду, с которого денежные средства должны быть списаны, или если Единый лимит Участника клиринга по Расчетному коду, с которого денежные средства, учитываемые в качестве Обеспечения Участника клиринга, должны быть списаны, в результате такого списания станет отрицательным, или отрицательный Единый лимит Участника клиринга по такому Расчетному коду в результате такого списания уменьшится.

При исполнении Заявления о переводе, сумма денежных средств Участника клиринга, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга по Расчетному коду, с которого списываются денежные средства, уменьшается, а по Расчетному коду, на который зачисляются денежные средства, - увеличивается на сумму переводимых денежных средств.

- 13.7. Обеспечение Участника клиринга в российских рублях используется в следующей очередности:

- 1) для погашения Задолженности Участника клиринга перед Клиринговым центром;
- 2) для обеспечения исполнения обязательств Участника клиринга по Договорам;
- 3) для исполнения обязательств Участника клиринга в российских рублях по Договорам;
- 4) для исполнения обязательств Участника клиринга по уплате комиссионных вознаграждений;
- 5) для уплаты пеней за наличие непогашенной Задолженности.

- 13.8. Обеспечение Участника клиринга в иностранной валюте используется для обеспечения исполнения обязательств Участника клиринга по Договорам.

- 13.9. После перечисления Участником клиринга денежных средств на клиринговый банковский счет Клирингового центра, открытый в Расчетной организации, и учета их в качестве Обеспечения Участника клиринга, у Клирингового центра возникает обязательство вернуть денежные средства Участнику клиринга в размере, определяемом в соответствии с пунктом 14.4 Правил клиринга на товарном рынке.

- 13.10. Внесение Обеспечения в товарах осуществляется путем зачисления товаров на торговые разделы Участника клиринга.

- 13.11. При получении от Оператора товарных поставок информации о зачислении

товаров на торговые разделы Участника клиринга Клиринговый центр увеличивает размер Обеспечения Участника клиринга в таком товаре (с основными характеристиками) и размер Обеспечения Участника клиринга в товаре с полным набором характеристик, учитываемые по торговому разделу, и увеличивает Единый лимит Участника клиринга с учетом зачисленного количества товара.

- 13.12. Товары, учитываемые в качестве Обеспечения Участника клиринга, используются для расчета Единого лимита по Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета совместно с торговым разделом, по которому такое Обеспечение учитывается, и для исполнения обязательств по передаче товара по торговому разделу, по которому указанное Обеспечение учитывается.
- 13.13. Обеспечение в товарах используется в следующей очередности:
- 1) для обеспечения исполнения обязательств Участника клиринга по Договорам;
 - 2) для исполнения обязательств в соответствующих товарах по Договорам.

Статья 14. Порядок возврата Обеспечения

14.1. Возврат Клиринговым центром Участнику клиринга денежных средств, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга, осуществляется на основании:

- Запроса о возврате;
- Постоянного поручения на возврат.

14.2. Запрос о возврате может содержать:

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

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

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

14.2.3. Запрос о возврате действует в день его предоставления.

14.2.4. 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 14.4 Правил клиринга на товарном рынке, при этом проверка указанных условий осуществляется в отношении суммы денежных средств, указанных 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 14.4 Правил клиринга на товарном рынке, будут выполняться.

- 14.2.5. Запрос о возврате, содержащий сумму денежных средств, не исполненный сразу после его получения по причине несоблюдения условий, указанных в пункте 14.4 Правил клиринга на товарном рынке, может быть исполнен Клиринговым центром позднее, в период до окончания срока, установленного Временным регламентом на товарном рынке для передачи Участником клиринга в Клиринговый центр Запросов о возврате в соответствующей валюте, если будут соблюдены условия, указанные в пункте 14.4 Правил клиринга на товарном рынке.
- 14.2.6. 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 14.4 Правил клиринга на товарном рынке, не выполняются ни для какой суммы денежных средств, аннулируется.
- 14.2.7. В случае если между Участником клиринга и Клиринговым центром предусмотрен обмен сообщениями по системе S.W.I.F.T., Участник клиринга вправе направить Запрос о возврате денежных средств в форме сообщения по системе S.W.I.F.T.
- 14.3. Постоянное поручение на возврат может содержать:
- а) признак, указывающий на необходимость возврата денежных средств в размере Итогового нетто-требования, или
 - б) признак, указывающий на необходимость возврата всей доступной суммы денежных средств.
- 14.3.1. 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.
- 14.3.2. Исполнение Клиринговым центром Постоянного поручения на возврат, содержащего признак, указывающий на необходимость возврата денежных средств в размере Итогового нетто-требования, осуществляется после определения Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований Участника клиринга в размере Итогового нетто-требования в соответствующей валюте при соблюдении условий, указанных в пункте 14.4 Правил клиринга на товарном рынке, при этом проверка указанных условий осуществляется в отношении указанного Итогового нетто-требования.
- Исполнение Клиринговым центром Постоянного поручения на возврат, содержащего признак, указывающий на необходимость возврата всей доступной суммы денежных средств, осуществляется непосредственно перед окончанием срока, установленного Временным регламентом на товарном рынке для передачи Участником клиринга в Клиринговый центр Запросов о возврате в соответствующей валюте, в максимально возможной сумме денежных средств, при которой условия, указанные в пункте 14.4 Правил клиринга на товарном рынке, будут выполняться.
- 14.3.3. Постоянное поручение на возврат, содержащее признак, указывающий на необходимость возврата денежных средств в размере Итогового нетто-требования, не исполненное сразу после определения Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований Участника клиринга по причине несоблюдения условий, указанных в пункте 14.4 Правил клиринга на товарном рынке, может быть

исполнено Клиринговым центром позднее, в период до окончания срока, установленного Временным регламентом на товарном рынке для передачи Участником клиринга в Клиринговый центр Запросов о возврате в соответствующей валюте, если будут соблюдены условия, указанные в пункте 14.4 Правил клиринга на товарном рынке.

- 14.3.4. Постоянное поручение на возврат, содержащее признак, указывающий на необходимость возврата денежных средств в размере Итогового нетто-требования, не исполненное до окончания срока, установленного Временным регламентом на товарном рынке для передачи Участником клиринга в Клиринговый центр Запросов о возврате в соответствующей валюте по причине несоблюдения условий, указанных в пункте 14.4 Правил клиринга на товарном рынке, исполняется Клиринговым центром непосредственно перед окончанием указанного срока в максимально возможной сумме денежных средств, при котором условия, указанные в пункте 14.4 Правил клиринга на товарном рынке, будут выполняться.
- 14.3.5. Клиринговый центр вправе принять решение об аннулировании действующих Постоянных поручений на возврат в случае, если у Клирингового центра возникнут основания полагать, что существует необходимость в уточнении информации, указанной в Постоянном поручении на возврат.
- 14.3.6. Постоянное поручение на возврат действует до его отмены Участником клиринга или до даты принятия Клиринговым центром решения об аннулировании Постоянных поручений на возврат.
- 14.3.7. Отмена Постоянного поручения на возврат Участником клиринга осуществляется с использованием Клиринговой системы или путем направления Участником клиринга Клиринговому центру документа на бумажном носителе в свободной форме или электронного документа.
- 14.4. Исполнение Клиринговым центром Запроса о возврате осуществляется при соблюдении следующих условий:
- Единый лимит по Расчетному коду, указанному в Запросе о возврате, рассчитанный без учета возвращаемой суммы денежных средств, не станет отрицательным;
 - возвращаемая сумма денежных средств не превышает суммы Обеспечения в соответствующей валюте, рассчитанной в соответствии с подпунктом 12.2.3 Правил клиринга на товарном рынке.
- 14.5. Для исполнения своего обязательства по возврату Участнику клиринга денежных средств в соответствующей валюте Клиринговый центр перечисляет денежные средства в данной валюте на соответствующий Счет для возврата, зарегистрированный в Клиринговом центре для соответствующего Расчетного кода Участника клиринга в порядке, установленном общей частью Правил клиринга.
- 14.6. Обязательство Клирингового центра по возврату денежных средств Участнику клиринга считается исполненным с момента списания Расчетной организацией, в которой открыт клиринговый банковский счет Клирингового центра, предназначенный для внесения Обеспечения, денежных средств с соответствующего клирингового счета Клирингового центра.
Клиринговый центр не несет ответственности за неисполнение (ненадлежащее

исполнение) Расчетной организацией распоряжения Клирингового центра о списании денежных средств в пользу Участника клиринга за исключением случаев, если такое неисполнение явилось следствием вины Клирингового центра.

- 14.7. При возврате Участнику клиринга денежных средств в соответствующей валюте размер Обеспечения Участника клиринга в этой валюте, учитываемого по Счету обеспечения, соответствующему Расчетному коду, уменьшается на сумму возвращаемых денежных средств.
- 14.8. Клиринговый центр вправе осуществить в любое время зачет денежных требований Участника клиринга по возврату ему денежных средств в соответствующей валюте с денежными требованиями Клирингового центра к этому Участнику клиринга в соответствующей валюте.
- 14.9. Возврат Клиринговым центром Участнику клиринга товаров, учитываемых в качестве Обеспечения, осуществляется на основании распоряжения на списание товара с торгового раздела, поданного Оператору товарных поставок. Исполнение указанного распоряжения осуществляется в порядке, установленном статьей 20 Правил клиринга на товарном рынке.
- 14.10. Возврат Клиринговым центром Участнику клиринга товаров в соответствии с запросом согласия Клирингового центра на списание товара с торгового раздела осуществляется при соблюдении следующих условий:
- количество товара с полным набором характеристик, учитываемое по торговому разделу, указанному в запросе согласия Клирингового центра на списание товара с торгового раздела, , не меньше, чем количество соответствующего товара, указанное в таком запросе;
 - возвращаемое количество товара с полным набором характеристик не превышает размера Обеспечения в соответствующем товаре с полным набором характеристик, рассчитанного в соответствии с подпунктом 12.1.3 Правил клиринга на товарном рынке;
 - если Единый лимит по Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета совместно с торговым разделом, указанным в запросе согласия Клирингового центра на списание товара с торгового раздела, рассчитанный без учета возвращаемого количества товара, не станет отрицательным.
- 14.11. При возврате Участнику клиринга товаров размер Обеспечения Участника клиринга в таком товаре (с основными характеристиками) и размер Обеспечения Участника клиринга в товаре с полным набором характеристик, учитываемые по торговому разделу, уменьшаются на количество возвращаемого товара.
- 14.12. Информация о размере Обеспечения и об изменении размера Обеспечения в денежных средствах и товарах передается Участнику клиринга в составе Отчета об Обеспечении.
- Информация об операциях с Обеспечением Участника клиринга в денежных средствах передается Участнику клиринга в составе Отчета о движении денежных средств.
- Отчет об Обеспечении и Отчет о движении денежных средств направляются

Участнику клиринга в форме электронного документа в срок, установленный
Временным регламентом на товарном рынке.

ПОДРАЗДЕЛ V-II. КЛИРИНГОВЫЕ СЕССИИ

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

- 15.1. Каждый Расчетный день в срок, установленный Временным регламентом на товарном рынке, Клиринговый центр проводит клиринговую сессию, в ходе которой Клиринговый центр:
- 15.1.1. устанавливает риск-параметры в соответствии с Методикой определения риск-параметров товарного рынка;
 - 15.1.2. для каждого Участника клиринга рассчитывает и устанавливает новые значения Единых лимитов по Расчетному коду;
 - 15.1.3. формирует и направляет каждому Участнику клиринга, имеющему обязательства по Договорам, Отчет об обязательствах;
 - 15.1.4. формирует и направляет Участникам клиринга, у которых возникли Задолженности, Отчет «Требование о погашении Задолженности»;
 - 15.1.5. определяет Участников клиринга, у которых возникли Маржинальные требования и суммы указанных Маржинальных требований;
 - 15.1.6. формирует и направляет Участникам клиринга, у которых возникли Маржинальные требования, Отчет о Маржинальном требовании, содержащий информацию о его сумме.
- 15.2. Маржинальное требование возникает у Участника клиринга, Единый лимит по Расчетному коду которого по итогам клиринговой сессии стал отрицательным. Сумма Маржинального требования равна абсолютному значению Единого лимита по Расчетному коду, определенного по итогам клиринговой сессии.
- 15.3. Маржинальное требование, возникшее у Участника клиринга по итогам клиринговой сессии, должно быть исполнено Участником клиринга не позднее установленного Временным регламентом на товарном рынке времени текущего Рабочего дня.
- 15.4. Маржинальное требование должно быть исполнено Участником клиринга путем перечисления денежных средств в любой валюте, принимаемой в качестве Обеспечения, на соответствующий клиринговый счет Клирингового центра либо путем внесения Обеспечения в товарах на соответствующий торговый раздел в порядке, определенном статьей 13 Правил клиринга на товарном рынке.
- 15.5. Маржинальное требование может быть также прекращено полностью или в части в случаях:
- прекращения обязательств по Договорам с наступившей Датой исполнения;
 - заключения Договоров, приводящих к увеличению Единого лимита по Расчетному коду.
- 15.6. Маржинальное требование по Расчетному коду, возникшее у Участника клиринга, считается прекращенным в момент времени, когда Единый лимит по такому

Расчетному коду станет неотрицательным.

- 15.7. В случае неисполнения Участником клиринга Маржинального требования, учитываемого по Расчетному коду, в срок, установленный Временным регламентом на товарном рынке, Клиринговый центр:
- 15.7.1. направляет Бирже уведомление о необходимости приостановления возможности подачи заявок с указанием Торгово-клиринговых счетов, в состав которых входит Расчетный код, по которому учитывается неисполненное Маржинальное требование;
- 15.7.2. вправе направить Бирже уведомление о необходимости снятия всех или части заявок с указанием Торгово-клиринговых счетов, в состав которых входит Расчетный код, по которому учитывается неисполненное Маржинальное требование;
- 15.7.3. заключает с Участником клиринга, не исполнившим Маржинальное требование, закрывающие Договоры, приводящие к увеличению Единого лимита по такому Расчетному коду.

Указанные Договоры заключаются без подачи заявок.

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

Указанные Договоры заключаются до момента исполнения Маржинального требования, учитываемого по Расчетному коду, или до момента невозможности заключения указанных Договоров.

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

Договоры, заключенные в соответствии с настоящим подпунктом Правил клиринга на товарном рынке, учитываются при расчете Нетто-обязательств / Нетто-требований Участника клиринга в денежных средствах / товарах по соответствующим Датам исполнения.

- 15.7.4. после завершения заключения Договоров в соответствии с подпунктом 15.7.3 Правил клиринга на товарном рынке Клиринговый центр направляет Бирже уведомление о снятии ограничений на подачу заявок с указанием Торгово-клиринговых счетов, в состав которых входит Расчетный код, по которому учитывалось неисполненное Маржинальное требование.

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

Статья 16. Порядок включения в клиринговый пул обязательств по Договорам

- 16.1. Для исполнения обязательств по Договорам Участники клиринга обязаны обеспечивать наличие денежных средств, учитываемых по Расчетному коду, и/или товаров на торговых разделах, по которым должны исполняться обязательства по Договору.
- 16.1.1. Расчетным кодом, по которому должно учитываться исполнение обязательства по оплате товаров по Договору, является Расчетный код, входящий в состав Торгово-клирингового счета, указанного при подаче заявки на заключение Договора.
- 16.1.2. Торговым разделом, по которому должны исполняться обязательства по передаче / требования по получению товаров по Договору, является торговый раздел, входящий в состав Торгово-клирингового счета, указанного при подаче заявки на заключение Договора.
- 16.2. В Расчетный день, предшествующий Дате исполнения обязательств по форвардному договору на количество Расчетных дней, установленное решением Клирингового центра, в срок, установленный Временным регламентом на товарном рынке, по форвардным договорам, по которым при подаче заявки на их заключение осуществлялся клиринг с частичным обеспечением по товару, Клиринговый центр осуществляет проверку наличия Обеспечения в товарах, учитываемого по торговому разделу, по которому должны исполняться обязательства по передаче товара по форвардному договору, в количестве, необходимом для исполнения указанных обязательств в полном объеме. Размер указанного Обеспечения в товарах рассчитывается в соответствии с подпунктом 12.1.3 Правил клиринга на товарном рынке.
- В случае отсутствия указанного Обеспечения в необходимом количестве, обязательства по передаче товаров по Договору в полном объеме считаются не обеспеченными средствами под исполнение, Участник клиринга признается Недобросовестным участником клиринга, к нему применяются меры, предусмотренные статьей 17 Правил клиринга на товарном рынке.
- 16.3. В Дату исполнения в срок, установленный Временным регламентом на товарном рынке:
- 16.3.1. встречные однородные обязательства и требования Участника клиринга и Клирингового центра по Договорам, заключенным на основании Комбинированных заявок, с наступившей Датой исполнения прекращаются зачетом. Обязательства и требования в части, в которой они не были прекращены зачетом, подлежат включению в клиринговый пул в соответствии с подпунктом 16.3.2 Правил клиринга на товарном рынке;
- 16.3.2. Клиринговый центр включает в клиринговый пул обязательства и требования Участников клиринга и Клирингового центра по оплате и передаче / получению товара по Договорам с наступившей Датой исполнения, в том числе, обязательства и требования, не прекращённые в соответствии с подпунктом 16.3.1 Правил клиринга на товарном рынке;

- 16.3.3. зачитывает встречные однородные обязательства и требования Участника клиринга и Клирингового центра по оплате товаров, включенные в клиринговый пул и учитываемые по одному Расчетному коду, а в части, в которой обязательства и требования не были зачтены – определяет Итоговые нетто-обязательства и/или Итоговые нетто-требования каждого Участника клиринга по денежным средствам;
- 16.3.4. формирует и передает Участникам клиринга Клиринговые отчеты, содержащие информацию об обязательствах, включенных в клиринговый пул, и отчеты, содержащие информацию об Итоговых нетто-обязательствах / Итоговых нетто-требованиях по денежным средствам.
- 16.4. Участник клиринга обязан исполнить свои Итоговые нетто-обязательства по денежным средствам до времени, установленного Временным регламентом на товарном рынке.
- 16.5. Клиринговый центр исполняет требования Участника клиринга по получению товаров по Договорам, учитываемые по торговому разделу, входящему в состав Торгово-клирингового счета совместно с Расчетным кодом, при условии исполнения Участником клиринга Итогового нетто-обязательства по денежным средствам, учитываемого по тому же Расчетному коду.
Клиринговый центр исполняет Итоговое нетто-требование Участника клиринга, по денежным средствам учитываемое по Расчетному коду, при условии исполнения Участником клиринга обязательств по поставке товаров по Договорам, учитываемых по всем торговым разделам, входящим в состав Торгово-клиринговых счетов совместно с тем же Расчетным кодом.
- 16.6. Для исполнения Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам, учитываемого по Расчетному коду, используется Обеспечение Участника клиринга в соответствующих денежных средствах, внесенное Участником клиринга в порядке, определенном статьей 13 Правил клиринга на товарном рынке, учитываемое по тому же Расчетному коду. Обеспечение, учитываемое по другим Расчетным кодам этого же Участника клиринга, не используется.
- 16.6.1. Итоговое нетто-обязательство Участника клиринга по денежным средствам, учитываемое по Расчетному коду, является обеспеченным средствами под исполнение, если размер Обеспечения Участника клиринга в соответствующих денежных средствах, учитываемого по тому же Расчетному коду больше или равен величине указанного обязательства, и не обеспеченным – если меньше.
- 16.6.2. Участник клиринга, имеющий Итоговое нетто-обязательство по денежным средствам, не обеспеченное средствами под исполнение, признается Недобросовестным участником клиринга, к нему применяются меры, предусмотренные статьей 17 Правил клиринга на товарном рынке.
- 16.7. Итоговые нетто-обязательства / Итоговые нетто-требования Участников клиринга по денежным средствам, в том числе определенные по итогам выполнения действий, предусмотренных статьей 17 Правил клиринга на товарном рынке, и обязательства / требования по передаче / получению товаров, включенные в клиринговый пул, исполняются в порядке, определенном статьей 19 Правил клиринга на товарном рынке.

Статья 17. Порядок действий в случае наличия Задолженности и/или обязательств, не обеспеченных средствами под исполнение

- 17.1. В случае наличия у Участника клиринга обязательств по передаче товаров по Договору, не обеспеченных средствами под исполнение, в период времени, установленный Временным регламентом на товарном рынке, между Клиринговым центром и Недобросовестным участником клиринга без подачи заявок заключается закрывающий форвардный договор, условия которого определены в пункте 17.4 Правил клиринга на товарном рынке.
- 17.2. 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 товарном рынке без специального полномочия (доверенности), а также без согласия Участника клиринга.
- 17.3. Форвардный договор, указанный в пункте 17.1 Правил клиринга на товарном рынке, заключается при соблюдении следующих условий:
- 17.3.1. у Участника клиринга – кредитной организации не отозвана (не аннулирована) лицензия Банка России на осуществление банковских операций;
- 17.3.2. количество товара, в отношении которого необходимо заключить форвардный договор, больше или равно лоту такого товара, установленного Биржей.
- 17.4. Условия закрывающего форвардного договора, заключаемого между Клиринговым центром и Недобросовестным участником клиринга в случае, указанном в пункте 17.1 Правил клиринга на товарном рынке, соответствуют определенным Правилами торгов на товарном рынке условиям форвардных договоров с учетом следующих особенностей:
- 17.4.1. по закрывающему форвардному договору у Участника клиринга возникают требования по соответствующему товару в количестве, равном величине не обеспеченного средствами под исполнение обязательства по передаче товаров по Договору (в полном объеме);
- 17.4.2. цена закрывающего форвардного договора равна цене балансирующей сделки с соответствующим товаром, порядок заключения которой определен общей частью Правил клиринга;
- 17.4.3. Датой исполнения обязательств по закрывающему форвардному договору является Дата исполнения обязательств по Договору, не обеспеченному средствами под исполнение. Дата исполнения обязательств по закрывающему форвардному договору не может быть ранее, чем третий Расчетный день после даты его заключения.
- 17.5. В случае:
- 17.5.1. если Итоговое нетто-обязательство Участника клиринга по денежным средствам в российских рублях не обеспечено средствами под исполнение (полностью или частично);
- 17.5.2. непогашения Участником клиринга до времени, установленного Временным регламентом на товарном рынке, Задолженности,

Клиринговый центр:

- 17.5.3. В первую очередь, использует Обеспечение Участника клиринга в иностранной валюте для удовлетворения требований Клирингового центра по неисполненному Итоговому нетто-обязательству Участника клиринга / Задолженности Участника клиринга (или неисполненной части Итогового нетто-обязательства / Задолженности) путем продажи Клиринговым центром иностранной валюты, являющейся Обеспечением Участника клиринга, за российские рубли по курсу, не меньшему, чем Нижняя граница диапазона оценки рыночных рисков соответствующего уровня по иностранной валюте, установленная Клиринговым центром в соответствии с Методикой определения риск-параметров валютного рынка и рынка драгоценных металлов на конец Расчетного дня даты удовлетворения требований.
- Удовлетворение требований за счет Обеспечения Участника клиринга в иностранной валюте осуществляется Клиринговым центром без предварительного уведомления Участника клиринга.
- Сумма, полученная по указанной конверсионной сделке засчитывается Клиринговым центром в счет исполнения Итогового нетто-обязательства Участника клиринга / Задолженности Участника клиринга.
- Размер Обеспечения в иностранной валюте, учитываемого по Счету обеспечения, уменьшается на сумму использованного Обеспечения Участника клиринга.
- 17.5.4. Во вторую очередь, в период времени, установленный Временным регламентом на товарном рынке, Клиринговый центр без подачи заявок заключает с Недобросовестным участником клиринга своп договор или форвардный договор, условия и порядок заключения которых определены в статье 18 Правил клиринга на товарном рынке.
- 17.6. При наличии случаев, указанных в пунктах 17.1, 18.4 Правил клиринга на товарном рынке, с Участника клиринга взимается штраф, рассчитываемый по формуле:
$$\text{Penalty} = \text{ROUND} (\text{VAL_OBL} \times \text{C} \times \text{K} \times \text{R} / 365; 2),$$
 где
Penalty – сумма штрафа, в российских рублях,
VAL_OBL – необеспеченное средствами под исполнение обязательство по передаче товара по Договору (в полном объеме) / Итоговое нетто-обязательство по денежным средствам (в российских рублях),
C – Расчетная цена товара / C=1 для российских рублей;
K – коэффициент, установленный решением Клирингового центра; по умолчанию K=1;
R – ставка, установленная Клиринговым центром в соответствии с Методикой определения риск-параметров товарного рынка.
- Сумма штрафа, рассчитанная в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга на товарном рынке, не облагается НДС.
- Обязательство по уплате штрафа, рассчитанное в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга на товарном рынке, учитывается по основному Расчетному коду.
- 17.7. Клиринговый центр зачитывает обязательство Участника клиринга по уплате штрафа, учитываемое по основному Расчетному коду и рассчитанное в

соответствии с пунктом 17.6 Правил клиринга на товарном рынке, с требованием Участника клиринга по возврату Обеспечения в российских рублях, учитываемого по основному Расчетному коду, за исключением случаев введения в отношении Участника клиринга одной из процедур банкротства, а в отношении Участника клиринга – кредитной организации - отзыва (аннулирования) у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций.

17.8. При наличии Недобросовестных участников клиринга, имеющих не обеспеченные полностью или частично средствами под исполнение Итоговые нетто-обязательства по денежным средствам / обязательства по передаче товаров по Договорам, для исполнения Итоговых нетто-требований по денежным средствам / требований по получению товаров по Договорам Добросовестных участников клиринга:

- Клиринговый центр использует свободные собственные денежные средства и/или товары;
- в случае недостаточности свободных собственных товаров обязательства по Договорам Добросовестных участников клиринга и Клирингового центра прекращаются в клиринговом пуле выплатой отступного в пользу Добросовестного участника клиринга, рассчитываемого по формуле:

$Penalty = | OBL_C \times Rc_RUB_C + OBL_RUB |$, где

Penalty – сумма отступного, в российских рублях,

OBL_C - требование Добросовестного участника клиринга по получению товара, прекращенное выплатой отступного, - требование Добросовестного участника клиринга по получению товара, для исполнения которого полностью или частично у Клирингового центра недостаточно товара,

OBL_RUB - обязательство Добросовестного участника клиринга по оплате товара (в российских рублях), прекращенное выплатой отступного, - обязательство Добросовестного участника клиринга по оплате товара, соответствующее требованию Добросовестного участника клиринга по получению товара, прекращенному выплатой отступного,

Обязательство учитывается со знаком «минус», требование - со знаком «плюс»,

Rc_RUB_C – Расчетная цена товара, обязательства / требования по оплате / получению которого прекращаются выплатой отступного, рассчитанная по итогам дня прекращения указанных обязательств.

Сумма отступного, рассчитанная в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга на товарном рынке, не облагается НДС.

17.9. После заключения своп договоров / форвардных договоров в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на товарном рынке Клиринговый центр:

17.9.1. допускает к клирингу обязательства по указанным Договорам;

17.9.2. включает обязательства с наступившей Датой исполнения по указанным Договорам в клиринговый пул;

17.9.3. зачитывает встречные однородные Итоговые нетто-обязательства / Итоговые нетто-требования по денежным средствам в соответствующей валюте и/или Задолженности в российских рублях Участника клиринга с обязательствами и

требованиями в соответствующих валютах с наступившей Датой исполнения по указанным заключенным Договорам;

- 17.9.4. формирует и направляет Участнику клиринга новый Клиринговый отчет, а также новый отчет об Итоговых нетто-обязательствах / Итоговых нетто-требованиях по денежным средствам;
- 17.9.5. осуществляет исполнение / прекращение Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований Участников клиринга, определенных в соответствии с подпунктом 17.9.3 Правил клиринга на товарном рынке, в порядке, установленном статьей 16 Правил клиринга на товарном рынке.
- 17.10. Обязательства по Договорам, заключенным в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на товарном рынке, с ненаступившей Датой исполнения учитываются в составе Нетто-обязательств / Нетто-требований Участника клиринга по денежным средствам / товарам с Датой исполнения, соответствующей дате исполнения указанных обязательств.
- 17.11. Итоговое нетто-обязательство в российских рублях, учитываемое по Расчетному коду Участника клиринга, не прекращенное по итогам действий, выполненных в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на товарном рынке, учитывается как Задолженность Участника клиринга перед Клиринговым центром по этому Расчетному коду Участника клиринга.
- 17.12. Задолженность Участника клиринга должна быть погашена Участником клиринга не позднее времени, установленного Временным регламентом на товарном рынке. Информация о наличии у Участника клиринга Задолженности и ее размере предоставляется Участнику клиринга в составе отчета «Требование о погашении Задолженности».
- Задолженность Участника клиринга считается погашенной, если на момент времени, установленный Временным регламентом на товарном рынке в качестве времени погашения соответствующей Задолженности, значение Обеспечения в российских рублях, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, по которому учитывалась Задолженность, является неотрицательным.
- 17.13. В случае непогашения Участником клиринга до времени, установленного Временным регламентом на товарном рынке, Задолженности:
- 17.13.1. Участник клиринга обязан уплатить Клиринговому центру пеню, рассчитываемую по формуле:
- $$\text{Fine} = D \times 2 \times S \times n / 365, \text{ где}$$
- Fine – сумма пени, в российских рублях,
D – сумма Задолженности, в российских рублях,
S – ключевая ставка, установленная Банком России на дату расчета суммы пени,
n - количество календарных дней между датой расчета суммы пени и следующим Расчетным днем.
- Сумма пени, рассчитанная в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга на товарном рынке, не облагается НДС.
- Обязательство по уплате пени, рассчитанное в соответствии с настоящим пунктом

Правил клиринга на товарном рынке, учитывается по тому же Расчетному коду Участника клиринга, что и Задолженность.

- 17.13.2. Указанная Задолженность урегулируется в соответствии с пунктом 17.5 Правил клиринга на товарном рынке.
- 17.14. Если Задолженность Участника клиринга не погашена полностью по итогам действий, выполненных в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на товарном рынке, и/или Участником клиринга в срок, установленный Временным регламентом на товарном рынке, Клиринговый центр использует Обеспечение Участника клиринга, учитываемое по иным собственным Расчетным кодам в соответствии с Правилами клиринга, а также средства Гарантийных фондов и/или Обеспечение под стресс в порядке, определенном общей частью Правил клиринга.

Статья 18. Порядок заключения и условия своп договоров и форвардных договоров, заключаемых с Недобросовестными участниками клиринга

- 18.1. Свop договоры, указанные в подпункте 17.5.4 Правил клиринга на товарном рынке, заключаются при соблюдении следующих условий:
- 18.1.1. у Участника клиринга – кредитной организации не отозвана (не аннулирована) лицензия Банка России на осуществление банковских операций;
- 18.1.2. допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию не приостановлен;
- 18.1.3. у Клирингового центра отсутствует информация об обстоятельствах в отношении Участника клиринга, перечисленных в общей части Правил клиринга, при наступлении которых допуск к клиринговому обслуживанию Участника клиринга будет приостановлен в следующий Расчетный день;
- 18.1.4. у Участника клиринга отсутствуют не обеспеченное полностью или частично средствами под исполнение Итоговое нетто-обязательства в российских рублях, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, в Дату исполнения второй части сделки свop, заключенной в соответствии с подпунктом 17.5.4 Правил клиринга на товарном рынке.
- 18.2. Условие, указанное в подпункте 18.1.4 Правил клиринга на товарном рынке, не применяется, если причиной необеспеченности Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам в соответствующей валюте средствами под исполнение / причиной непогашения Задолженности является несвоевременное зачисление денежных средств на клиринговые банковские счета Клирингового центра в Расчетной организации, вызванное проведением процедур комплаенс-контроля в банках-корреспондентах, сбоями в работе платежных систем, а также обстоятельствами непреодолимой силы, определенными в пункте 18.5 Правил клиринга на товарном рынке.
- Участник клиринга обязан предоставить Клиринговому центру документы, подтверждающие действие причин, указанных в настоящем пункте Правил клиринга на товарном рынке.
- 18.3. Условия свop договоров, заключаемых Клиринговым центром от имени Недобросовестного участника клиринга в отношении себя лично в случае, указанном в подпункте 17.5.4 Правил клиринга на товарном рынке, соответствуют

определенным Правилами торгов на товарном рынке условиям своп договоров с учетом следующих особенностей:

- 18.3.1. по первой части своп договора у Участника клиринга возникают требования в российских рублях и обязательства по товарам. Количество товара в своп договоре определяется таким образом, чтобы соответствующее ему требование по оплате товара было равно сумме Задолженности Участника клиринга / Итогового нетто-обязательства Участника клиринга (или неисполненной части Итогового нетто-обязательства / Задолженности), или превышало указанную Задолженность / указанное обязательство на величину, не большую, чем произведение лота товара, установленного Биржей, и последней определенной Клиринговым центром Расчетной цены товара;
- 18.3.2. Датой исполнения обязательств по первой части своп договора является день ее заключения;
- 18.3.3. Датой исполнения обязательств по второй части своп договора является третий Расчетный день, следующий за датой заключения своп договора;
- 18.3.4. Базовый курс своп договора устанавливается равным Расчетной цене товара, определенной в соответствии с Методикой определения расчетной цены в 16:00 по московскому времени текущего Рабочего дня;
- 18.3.5. Цена своп договора устанавливается равной ставке, установленной Клиринговым центром в соответствии с Методикой определения риск-параметров товарного рынка.
- 18.4. При несоблюдении любого из условий, указанных в подпунктах 18.1.2-18.1.4 Правил клиринга на товарном рынке, Клиринговый центр без подачи заявок заключает с Недобросовестным участником клиринга закрывающий форвардный договор, условия которого соответствуют определенным Правилами торгов на товарном рынке условиям форвардных договоров с учетом следующих особенностей:
 - 18.4.1. у Участника клиринга возникают требования в российских рублях и обязательства по товарам;
 - 18.4.2. количество товара в закрывающем форвардном договоре должно быть кратно лоту товара, установленному Биржей, и не может превышать суммы Обеспечения в товарах, учитываемого по торговому разделу. Количество товара в закрывающем форвардном договоре определяется таким образом, чтобы соответствующее ему требование по оплате товара было равно сумме Задолженности Участника клиринга / Итоговому нетто-обязательству (или неисполненной части Итогового нетто-обязательства / Задолженности) Участника клиринга, или превышало указанную Задолженность / Итоговое нетто-обязательство (или неисполненной части Итогового нетто-обязательства / Задолженности) на величину, не большую, чем произведение лота товара, установленного Биржей, и цены заключаемого закрывающего форвардного договора;
 - 18.4.3. закрывающий форвардный договор заключается в отношении товара, учитываемого по торговому разделу, относящемуся к Расчетному коду, по которому учитывается Задолженность Участника клиринга или Итоговое нетто-обязательство Участника клиринга. Выбор товара, в отношении которого заключается закрывающий форвардный договор, осуществляется Клиринговым

центром;

18.4.4. цена закрывающего форвардного договора с товаром, указанным в подпункте 18.4.3 Правил клиринга на товарном рынке, или с иным товаром, отличающимся базисом от товара, указанного в подпункте 18.4.3 Правил клиринга на товарном рынке, устанавливается равной цене балансирующей сделки, порядок заключения которой определен общей частью Правил клиринга;

18.4.5. Датой исполнения обязательств по оплате и поставке товара по закрывающему форвардному договору является третий Расчетный день после даты его заключения.

18.5. В случае невозможности исполнения Участником клиринга своих Итоговых нетто-обязательств по денежным средствам в соответствующей валюте вследствие непреодолимой силы или сбоя в платежной системе Банка России, Клиринговым центром с Участником клиринга заключаются своп договоры с ценой своп договора, равной нулю.

Под обстоятельствами непреодолимой силы понимаются:

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

О возникновении обстоятельств непреодолимой силы, вследствие которых исполнение Участником клиринга своих Итоговых нетто-обязательств по денежным средствам в соответствующей валюте невозможно, Участник клиринга обязан уведомить Клиринговый центр любыми доступными средствами связи до установленного Временным регламентом на товарном рынке времени заключения Договоров в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на товарном рынке.

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 своп договора, рассчитанной в соответствии с подпунктом 18.3.5 Правил клиринга на товарном рынке в расчете на количество календарных дней между датой исполнения первой части своп договора и датой расчета неустойки.

Уплата Участником клиринга неустойки в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга на товарном рынке не освобождает Участника клиринга от исполнения обязательств по второй части своп договора, заключенного в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на товарном рынке.

18.6. Клиринговый центр вправе принять решение о заключении от имени Недобросовестного участника клиринга своп договоров в соответствии с

настоящей статьей Правил клиринга на товарном рынке с ценой своп договора, равной нулю, при наличии обстоятельств, не указанных в пункте 18.5 Правил клиринга на товарном рынке и свидетельствующих об отсутствии вины такого Участника клиринга.

- 18.7. При наличии у Клирингового центра информации об обстоятельствах в отношении Участника клиринга, перечисленных в общей части Правил клиринга, при наступлении которых допуск к клиринговому обслуживанию Участника клиринга будет приостановлен в следующий Расчетный день, Клиринговый центр вправе принять решение о том, что Дата исполнения обязательств по Договорам, стороной которых является такой Участник клиринга, считается наступившей в текущий Расчетный день.
- 18.7.1. Обязательства по Договорам, в отношении которых Клиринговым центром принято решение в соответствии с пунктом 18.7 Правил клиринга на товарном рынке, включаются в клиринговый пул и участвуют в определении Итогового нетто-обязательства / Итогового нетто-требования Участника клиринга по денежным средствам в соответствии со статьей 16 Правил клиринга на товарном рынке, при этом при наличии неисполненного Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам Клиринговый центр заключает с Недобросовестным участником клиринга закрывающий форвардный договор с условиями, определенными пунктом 18.4 Правил клиринга на товарном рынке.
- 18.8. Клиринговый центр, действуя от имени Участника клиринга в отношении себя лично, осуществляет все юридические и фактические действия, необходимые для заключения Договоров в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на товарном рынке без специального полномочия (доверенности), а также без согласия Участника клиринга.

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

Статья 19. Порядок исполнения обязательств и требований Участников клиринга и Клирингового центра, включенных в клиринговый пул

- 19.1. Обязательства по передаче товаров по Договорам, включенные в клиринговый пул, исполняются за счет товаров, учитываемых на торговом разделе Участника клиринга - продавца.
- 19.2. Обязательства / требования по передаче / получению товаров по Договорам, включенные в клиринговый пул, включаются в распоряжение на перевод товаров, направляемое Клиринговым центром Оператору товарных поставок в соответствии с пунктом 20.6 Правил клиринга на товарном рынке и содержащее распоряжения на перевод товаров с торговых разделов Участников клиринга – продавцов на торговый раздел Клирингового центра и распоряжения на перевод товаров с торгового раздела Клирингового центра на торговые или поставочные разделы Участников клиринга – покупателей.
- 19.2.1. В распоряжение на перевод товаров включается распоряжение на перевод товаров с торгового раздела Клирингового центра на поставочный раздел Участника клиринга в следующих случаях:
- Участник клиринга – покупатель по форвардному договору имеет обязательство по уплате транспортного дифференциала и в Дату исполнения обязательства по форвардному договору в отношении товара, являющегося предметом указанного форвардного договора, не заключен своп договор,;
 - в Дату исполнения обязательства по второй части своп договора, заключенного в отношении товара, полученного по форвардному договору, при условии, если в Дату исполнения обязательств по указанному форвардному договору Участник клиринга имел обязательство по уплате транспортного дифференциала и обязательство по уплате транспортного дифференциала не прекращено в соответствии с пунктом 21.13 Правил клиринга на товарном рынке.
- В иных случаях в распоряжение на перевод товаров включается распоряжение на перевод товаров с торгового раздела Клирингового центра на торговый раздел Участника клиринга – покупателя.
- 19.3. Обязательства Участника клиринга по оплате товаров, включенные в клиринговый пул, исполняются за счет денежных средств, учитываемых по Расчетному коду Участника клиринга – покупателя.
- 19.3.1. Размер Обеспечения Участника клиринга в денежных средствах уменьшается на сумму Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам, обеспеченного средствами под исполнение.
- 19.4. Итоговое нетто-требование Участника клиринга по денежным средствам в российских рублях прекращается возникновением обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга денежных средств в российских рублях, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга, в размере Итогового

нетто-требования Участника клиринга по денежным средствам.

При этом размер Обеспечения Участника клиринга в российских рублях увеличивается на сумму прекращенного Итогового нетто-требования Участника клиринга по денежным средствам.

- 19.5. После исполнения (прекращения) Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований Участников клиринга по денежным средствам в соответствии с пунктами 19.3 / 19.4 Правил клиринга на товарном рынке и направления Оператору товарных поставок распоряжения на перевод товаров в соответствии с пунктом 20.6 Правил клиринга на товарном рынке, обязательства / требования Участников клиринга по передаче / получению товаров, включенные в клиринговый пул, считаются прекращенными в клиринговом пуле.

После получения от Оператора товарных поставок отчета об исполнении распоряжения на перевод товаров в соответствии с пунктом 20.7 Правил клиринга на товарном рынке, расчеты по товарам по итогам клиринга считаются завершенными, размер Обеспечения Участника клиринга в соответствующем товаре увеличивается на сумму исполненного требования Участника клиринга по получению такого товара.

РАЗДЕЛ VI. ПОРЯДОК ВЗАИМОДЕЙСТВИЯ С ОПЕРАТОРОМ ТОВАРНЫХ ПОСТАВОК

Статья 20. Порядок взаимодействия с Оператором товарных поставок

- 20.1. Каждый Расчетный день до начала торгов Оператор товарных поставок передает Клиринговому центру список торговых разделов и выписку по торговым и выписку по поставочным разделам.
- 20.2. После получения от Оператора товарных поставок выписки по торговым разделам Клиринговый центр устанавливает в Клиринговой системе:
- значения Обеспечения в товарах с полным набором характеристик, учитываемого по торговому разделу, в соответствии с информацией о количестве соответствующего товара, учитываемого на торговых разделах, полученной от Оператора товарных поставок в выписке по торговым разделам;
 - значения Обеспечения в товарах (с основными характеристиками), учитываемого по торговому разделу, как сумму значений Обеспечения в товарах с полным набором характеристик, учитываемого по тому же торговому разделу, основные характеристики которого соответствуют основным характеристикам товара.
- 20.3. Клиринговый центр соглашается с проведением любых операций, связанных с зачислением товаров на торговые разделы, по поручению лица, которому открыт торговый товарный счет.
- 20.4. Зачисление товаров на поставочные разделы осуществляется только по распоряжению Клирингового центра.
Списание товаров с поставочных разделов осуществляется по распоряжению или с согласия Клирингового центра в соответствии с пунктом 21.15 Правил клиринга на товарном рынке.
- 20.5. В случае необходимости списания товара с торгового раздела, в том числе в случае получения от Участника клиринга распоряжения на списание товара с торгового раздела, Оператор товарных поставок направляет Клиринговому центру запрос согласия Клирингового центра на списание товара с торгового раздела.
Списание товара с торгового раздела, в том числе на основании распоряжения Участника клиринга на списание товара с торгового раздела, осуществляется Оператором товарных поставок только в случае получения положительного ответа Клирингового центра на указанный запрос.
- 20.6. Проведение расчетов по товарам осуществляется Оператором товарных поставок на основании полученного от Клирингового центра распоряжения на перевод товаров, содержащего информацию об обязательствах / требованиях Участников клиринга по передаче / получению товаров.
Исполнение распоряжения на перевод товаров, полученного от Клирингового центра в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга на товарном рынке, осуществляется Оператором товарных поставок в корреспонденции с торговым

разделом Клирингового центра.

Переводы товаров, включенные в распоряжение на перевод товаров, исполняются Оператором товарных поставок последовательно, в том порядке, в котором они содержатся в распоряжении на перевод товаров, полученном от Клирингового центра.

- 20.7. После исполнения распоряжения на перевод товаров, полученного от Клирингового центра, Оператор товарных поставок направляет Клиринговому центру отчет об исполнении распоряжения на перевод товаров.
- 20.8. Клиринговый центр соглашается с закрытием торгового товарного счета при условии, что на таком торговом товарном счете не учитывается товар, и Клиринговый центр не учитывает обязательств по передаче / требований по получению товара, которые должны исполняться по такому торговому товарному счету.
- 20.9. Списание товаров с торговых товарных счетов Участника клиринга после прекращения Договора об оказании клиринговых услуг с таким Участником клиринга осуществляется без согласия Клирингового центра с учетом положений общей части Правил клиринга о порядке ликвидационного неттинга.

РАЗДЕЛ VII. ПОРЯДОК ОПЛАТЫ УСЛУГ. ОТЧЕТЫ ПО ИТОГАМ КЛИРИНГА

Статья 21. Порядок оплаты услуг Клирингового центра, Биржи, Технического центра, Оператора товарных поставок и Экспедитора

- 21.1. На товарном рынке Клиринговый центр взимает:
- комиссионное вознаграждение в пользу Клирингового центра за клиринговое обслуживание (далее – комиссионное вознаграждение Клирингового центра);
 - Биржевой сбор в пользу Биржи;
 - вознаграждение в пользу Технического центра за предоставление интегрированного технологического сервиса (ИТС), при условии, что такой порядок оплаты услуг Технического центра предусмотрен внутренними документами / решением Технического центра;
 - комиссионное вознаграждение в пользу Оператора товарных поставок за услуги Оператора товарных поставок;
 - транспортный дифференциал в пользу Экспедитора.
- 21.2. Комиссионное вознаграждение в пользу Оператора товарных поставок рассчитывается и взимается Клиринговым центром в соответствии с действующими тарифами Оператора товарных поставок.
- 21.3. Информация о размере транспортного дифференциала за Доставку Товара, приобретенного по Договору, подлежащего уплате Участником клиринга в пользу Экспедитора, рассчитанная Биржей, становится доступной Клиринговому центру посредством Системы торгов сразу после заключения Договора.
- 21.4. Размер Биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за клиринговое обслуживание рассчитывается после заключения Договора и удерживается Клиринговым центром с Участника клиринга в Расчетный день, следующий за датой заключения Договора, со Счета обеспечения в российских рублях, по которому должны исполняться обязательства по Договору.
- 21.5. Комиссионное вознаграждение в пользу Оператора товарных поставок, уплачиваемое ежедневно, рассчитывается Клиринговым центром по итогам каждого дня оказания услуг и удерживается Клиринговым центром с Участника клиринга в Расчетный день, следующий за днем оказания услуг, со Счета обеспечения в российских рублях, входящего в Торгово-клиринговый счет совместно с торговым разделом, за операции по которому взимается комиссионное вознаграждение Оператора товарных поставок.
- 21.6. Вознаграждение Технического центра за предоставление ИТС, комиссионное вознаграждение в пользу Оператора товарных поставок, уплачиваемое ежемесячно, удерживается Клиринговым центром с Участника клиринга в первый Рабочий день календарного месяца, следующего за месяцем фактического оказания услуг, по Счету обеспечения в российских рублях, соответствующему Расчетному коду, указанному Участником клиринга в Заявлении о выборе Расчетного кода для списания комиссионных вознаграждений (в случае предоставления указанного заявления) либо основному Расчетному коду.

- 21.6.1. Заявление о выборе Расчетного кода для списания комиссионных вознаграждений действует, начиная с дня, следующего за днем его предоставления.
- 21.6.2. В случае приостановки / прекращения допуска Участника торгов к торгам в течение календарного месяца, вознаграждение за предоставление ИТС, комиссионное вознаграждение в пользу Оператора товарных поставок, удерживается в последний Рабочий день, когда Участник торгов был допущен к торгам, за исключением случаев, предусмотренных Тарифами Технического центра / тарифами Оператора товарных поставок.
- 21.7. 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 основному Расчетному коду.
- 21.8. Информация о размере Биржевого сбора, комиссионного вознаграждения Клирингового центра, Оператора товарных поставок, вознаграждения Технического центра, транспортного дифференциала, начисленного в отчетную дату, указывается в Отчете о комиссионных вознаграждениях, направляемом Клиринговым центром Участникам клиринга в сроки, установленные Временным регламентом на товарном рынке.
- 21.9. Информация о рассчитанном Клиринговым центром размере Биржевого сбора, комиссионного вознаграждения Клирингового центра за клиринговое обслуживание по каждому Договору становится доступной Бирже посредством Системы торгов немедленно после его расчета.
- 21.10. В Дату исполнения обязательств по уплате соответствующих комиссионных вознаграждений в срок, установленный Временным регламентом на товарном рынке, Клиринговый центр проверяет достаточность Обеспечения Участника клиринга в российских рублях для исполнения обязательства по уплате комиссионных вознаграждений.
- 21.10.1. Обеспечение Участника клиринга в российских рублях является достаточным для исполнения обязательств по уплате комиссионных вознаграждений, если размер Обеспечения Участника клиринга в российских рублях не меньше, чем размер указанных обязательств.
- 21.10.2. Для исполнения обязательства по уплате комиссионных вознаграждений Клиринговый центр зачитывает соответствующее обязательство с требованием Участника клиринга по возврату денежных средств в российских рублях, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга по Расчетному коду Участника клиринга в российских рублях, по которому должно исполняться обязательство по уплате комиссионного вознаграждения.
При этом размер Обеспечения Участника клиринга в российских рублях, учитываемого по Расчетному коду, уменьшается на сумму исполненного обязательства.
- 21.10.3. Обязательства Участника клиринга по уплате комиссионных вознаграждений, для исполнения которых недостаточно Обеспечения в российских рублях, учитываются как Задолженность Участника клиринга перед Клиринговым центром по

Расчетному коду.

- 21.10.4. Указанная Задолженность Участника клиринга урегулируется в порядке, установленном пунктами 17.12-17.14 Правил клиринга на товарном рынке.
- 21.11. В Дату исполнения обязательств по Договору, Клиринговый центр проверяет достаточность Обеспечения Участника клиринга в российских рублях для исполнения обязательства по уплате транспортного дифференциала за Доставку Товара, приобретенного по Договору.
- 21.11.1. Обязательство по уплате транспортного дифференциала исполняются за счет денежных средств, учитываемых по Счету обеспечения Участника клиринга - покупателя в российских рублях, по которому должны исполняться обязательства по Договору.
- 21.11.2. Обеспечение Участника клиринга в российских рублях является достаточным для исполнения обязательства по уплате транспортного дифференциала, если размер Обеспечения Участника клиринга в российских рублях не меньше, чем размер обязательства по уплате транспортного дифференциала.
- 21.11.3. Если Обеспечение Участника клиринга в российских рублях является достаточным для исполнения обязательства по уплате транспортного дифференциала, Клиринговый центр исполняет указанное обязательство в соответствии с пунктом 21.14 Правил клиринга на товарном рынке.
- 21.12. Если в Дату исполнения обязательств по Договору Обеспечение Участника клиринга в российских рублях является не достаточным для исполнения обязательства по уплате транспортного дифференциала за Доставку Товара, приобретенного по Договору, Клиринговый центр осуществляет проверку достаточности Обеспечения Участника клиринга для исполнения указанного обязательства в соответствии с пунктом 21.11 Правил клиринга на товарном рынке в течение 5 (пяти) Расчетных дней, следующих за Датой исполнения обязательств по Договору.
- Если в один из указанных дней Обеспечение Участника клиринга в российских рублях является достаточным для исполнения обязательства по уплате транспортного дифференциала за Доставку Товара, приобретенного по Договору, Клиринговый центр исполняет указанное обязательство в соответствии с пунктом 21.14 Правил клиринга на товарном рынке и взимает с Участника клиринга штраф за ненадлежащее исполнение обязательств по уплате транспортного дифференциала в пользу Экспедитора в соответствии с тарифами Экспедитора.
- Порядок уплаты штрафа за ненадлежащее исполнение обязательств по уплате транспортного дифференциала установлен пунктом 21.14 Правил клиринга на товарном рынке.
- 21.13. Если обязательство по уплате транспортного дифференциала за Доставку Товара, приобретенного по Договору, не исполнены в течение срока, установленного пунктом 21.12 Правил клиринга на товарном рынке, обязательство по уплате транспортного дифференциала за Доставку Товара, приобретенного по Договору, прекращается, если товар был переведен на поставочный раздел, Клиринговый центр направляет Оператору товарных поставок распоряжение на перевод товара с

полным набором характеристик с соответствующего поставочного раздела на соответствующий торговый раздел со значением базиса, установленным Клиринговым центром.

- 21.14. Для исполнения обязательства по уплате транспортного дифференциала за Доставку Товара, приобретенного по Договору / обязательства по уплате штрафа за ненадлежащее исполнение обязательств по уплате транспортного дифференциала за Доставку Товара, приобретенного по Договору, Клиринговый центр зачитывает соответствующее обязательство с требованием Участника клиринга по возврату денежных средств в российских рублях, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга по Счету обеспечения Участника клиринга - покупателя в российских рублях, по которому должны исполняться обязательства по Договору. При этом размер Обеспечения Участника клиринга в российских рублях, учитываемого по Счету обеспечения, уменьшается на сумму исполненного обязательства.
- 21.15. После исполнения обязательства по уплате транспортного дифференциала за Доставку Товара, приобретенного по Договору, Клиринговый центр направляет Оператору товарных поставок согласие на списание с поставочного раздела товара с полным набором характеристик.

Статья 22. Порядок предоставления отчетов по итогам клиринга

- 22.1. Клиринговый центр обеспечивает Участнику клиринга с использованием рабочего места Участника клиринга возможность получения следующей информации из Клиринговой системы:
- о Договорах, стороной по которым является Участник клиринга;
 - о размере Обеспечения Участника клиринга в каждой валюте / каждом товаре;
 - о размере Единого лимита по Расчетному коду;
 - о значении Нетто-обязательства и/или Нетто-требования Участника клиринга по денежным средствам / товарам с каждой Датой исполнения;
 - о наличии / отсутствии Маржинального требования Участника клиринга, о сумме Маржинального требования в российских рублях (в случае наличия);
 - о наличии / отсутствии Задолженности Участника клиринга перед Клиринговым центром, о сумме Задолженности Участника клиринга (в случае наличия).
- 22.2. Клиринговый центр формирует следующие отчеты по итогам клиринга для Участников клиринга:
- Отчет об обязательствах, содержащий информацию о допущенных к клирингу обязательствах по Договорам, по всем Датам исполнения;
 - Клиринговый отчет, содержащий информацию об обязательствах, включенных в клиринговый пул;
 - Отчет об Итоговых нетто-обязательствах / Итоговых нетто-требованиях по денежным средствам, содержащий информацию об обязательствах в денежных средствах, определенных по результатам клиринга;

- Отчет об Обеспечении, содержащий информацию о размере Обеспечения в денежных средствах и товарах и об изменении размера Обеспечения, включая информацию об использовании Обеспечения, в том числе для исполнения обязательств, определенных по итогам клиринга;
- Отчет о движении денежных средств, содержащий информацию об операциях с Обеспечением Участника клиринга в денежных средствах;
- Отчет о комиссионных вознаграждениях;
- Отчет о торгово-клиринговых счетах Участника клиринга;
- Отчет о Клиринговых идентификаторах;
- Требование о погашении Задолженности;
- Отчет о Маржинальном требовании.

22.3. Отчеты, указанные в пункте 22.2 Правил клиринга на товарном рынке, направляются Участнику клиринга в форме электронных документов в соответствии с Порядком ЭДО.

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

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

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

22.5. Клиринговый центр предоставляет Участнику клиринга с использованием Клиринговой системы информацию об Итоговых нетто-обязательствах и/или Итоговых нетто-требованиях Участника клиринга по денежным средствам.

В случае несоответствия информации, полученной Участником клиринга с использованием Клиринговой системы, и информации, содержащейся в полученном от Клирингового центра Отчете об Итоговых нетто-обязательствах / Итоговых нетто-требованиях по денежным средствам, исполнения обязательств должно осуществляться Участником клиринга на основании указанного отчета.

РАЗДЕЛ VIII. ПРОЧИЕ УСЛОВИЯ

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

23.1. Согласие на прием, предоставляемое Участником клиринга - реципиентом, помимо информации, предусмотренной общей частью Правил клиринга, должно содержать информацию о торговых разделах, номерах торговых товарных счетов, на которых открыты такие торговые разделы, или информацию о Торгово-клиринговых счетах Участника клиринга – реципиента, по которым необходимо учесть переводимые обязательства и Обеспечение.

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

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

- регистрирует Торгово-клиринговый счет Участника клиринга – реципиента, в состав которого входят клиентский Расчетный код, открытый Участнику клиринга – реципиенту для такого Обособленного клиента, и торговый раздел, открытый Участником клиринга – реципиентом для обособленного учета Обеспечения в товарах Обособленного клиента в соответствии с требованием общей части Правил клиринга, если в Согласии на прием Торгово-клиринговый счет Участника клиринга – реципиента не был указан;
- направляет Оператору товарных поставок распоряжение на перевод товаров с торгового(-ых) раздела(-ов), входящего(-их) в состав Торгово-клирингового(-ых) счета(-ов) Базового Участника клиринга, открытого(-ых) для такого Обособленного клиента, на торговый(-ые) раздел(-ы), входящий(-ие) в состав Торгово-клирингового(-ых) счета(-ов) Участника клиринга – реципиента.

23.3. После завершения процедуры Перевода обязательств и Обеспечения Клиринговый центр аннулирует регистрацию Торгово-клиринговых счетов, открытых Базовым Участником клиринга для Обособленного клиента.

Приложение № 1
к Правилам клиринга на товарном рынке

Временной регламент на товарном рынке

№ п/п	Наименование операции	Время (москowsкое)
1.	Зачисление денежных средств на клиринговый банковский счет Клирингового центра для учета в текущем Расчетном дне.	до 21:00
2.	Проведение клиринговой сессии.	с 9:30 до 10:00 Расчетного дня
3.	Передача Клиринговым центром Участникам клиринга Отчетов о Маржинальном требовании, Требований о погашении задолженности, Отчетов об Обеспечении, Отчетов о движении денежных средств.	до 10:15 Расчетного дня
4.	Исполнение Маржинальных требований.	до 15:00 дня возникновения Маржинального требования
5.	Заключение закрывающих Договоров в случае неисполнения Участником клиринга Маржинального требования.	с 15:00 дня возникновения Маржинального требования
6.	Проверка наличия Обеспечения в товарах, необходимого для исполнения обязательств по передаче товаров по форвардному договору.	10:00 Расчетного дня, предшествующего Дате исполнения обязательств по форвардному договору на количество Расчетных дней, установленное решением Клирингового центра
7.	Заключение закрывающих форвардных договоров в случае наличия у Участника клиринга не обеспеченных средствами под исполнение обязательств по передаче товаров по форвардному договору и/или в случае наличия у Участника клиринга не обеспеченных средствами под исполнение Итоговых нетто-обязательств по денежным средствам и превышении количества Расчетных дней, в течение которых у Участника клиринга может возникать Итоговое нетто-обязательство, не обеспеченное средствами под исполнение.	с 10:00 до 16:00
8.	Определение Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований по денежным средствам.	16:05 Даты исполнения
9.	Передача Клиринговым центром Участникам клиринга Клиринговых отчетов и Отчетов об Итоговых нетто-обязательствах / Итоговых нетто-требованиях по денежным средствам.	до 16:30 Даты исполнения
10.	Передача Клиринговым центром Участникам клиринга Отчетов об обязательствах, Отчетов о комиссионных вознаграждениях.	до 16:30
11.	Исполнение Участником клиринга Итоговых нетто-обязательств по денежным средствам.	до 20:00 ¹ Даты исполнения

№ п/п	Наименование операции	Время (московское)
12.	Исполнение Участником клиринга обязательств по уплате транспортного дифференциала.	до 20:00 ¹ Даты исполнения
13.	Исполнение Участником клиринга обязательств по уплате комиссионных вознаграждений.	до 20:00 ¹ Расчетного дня, следующего за датой получения Отчета о комиссионном вознаграждении
14.	Погашение Задолженности.	до 20:00 ¹ Расчетного дня, следующего за днем возникновения Задолженности
15.	Прекращение Клиринговым центром Итоговых нетто-требований Участников клиринга по денежным средствам по Договорам.	В Дату исполнения
16.	Заключение своп договоров в случае наличия у Участника клиринга Задолженности и/или Итоговых нетто-обязательств по денежным средствам, не обеспеченных средствами под исполнение.	с 20:00 ¹ до 20:30 ¹
17.	Передача Клиринговым центром Участникам клиринга Клиринговых отчетов и Отчетов об Итоговых нетто-обязательствах / Итоговых нетто-требованиях по денежным средствам по итогам заключения своп договоров в случае наличия Задолженности и/или Итоговых нетто-обязательств по денежным средствам, не обеспеченных средствами под исполнение.	до 20:45 ¹ Расчетного дня
18.	Передача Участником клиринга в Клиринговый центр Запросов о возврате денежных средств в российских рублях.	до 20:00 Расчетного дня

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