УТВЕРЖДЕНЫ

решением Наблюдательного совета
НКО НКЦ (АО)

от «19» мая 2020 года (Протокол № 19)

ПРАВИЛА КЛИРИНГА НЕБАНКОВСКОЙ КРЕДИТНОЙ ОРГАНИЗАЦИИ-ЦЕНТРАЛЬНОГО КОНТРАГЕНТА «НАЦИОНАЛЬНЫЙ КЛИРИНГОВЫЙ ЦЕНТР» (АКЦИОНЕРНОЕ ОБЩЕСТВО).
ЧАСТЬ II. ПРАВИЛА КЛИРИНГА НА ФОНДОВОМ РЫНКЕ И РЫНКЕ ДЕПОЗИТОВ

Москва, 2020 г.

СОДЕРЖАНИЕ

РАЗДЕЛ I. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ 5
Статья 1. Термины и определения 5
Статья 2. Общие положения 9
Статья 3. Условия и порядок заключения / расторжения договора об имущественном пуле 11
Статья 4. Порядок формирования и прекращения имущественного пула 12
Статья 5. Права владельца клирингового сертификата участия 14
Статья 6. Торговые и клиринговые счета 15
Статья 7. Клиринговые регистры 17
РАЗДЕЛ II. ТРЕБОВАНИЯ К УЧАСТНИКАМ КЛИРИНГА 20
Статья 8. Условия клирингового обслуживания. Порядок предоставления допуска к клиринговому обслуживанию 20
Статья 9. Особенности приостановления допуска к клиринговому обслуживанию 21
Статья 10. Требования к Держателям. Порядок получения (лишения) статуса Держателя 22
Статья 11. Порядок открытия и закрытия Торгово-клиринговых счетов Участника клиринга 24
Статья 12. Порядок открытия Торгово-клиринговых счетов имущественного пула 26
Статья 13. Особенности регистрации Обособленных клиентов 27
РАЗДЕЛ III. МЕРЫ, НАПРАВЛЕННЫЕ НА УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ ПРИ ОСУЩЕСТВЛЕНИИ КЛИРИНГА 28
Статья 14. Перечень мер, направленных на управление рисками при осуществлении клиринга 28
Статья 15. Перечень мер, направленных на управление рисками по операциям с клиринговыми сертификатами участия 29
Статья 16. Единый лимит по пулу 29
РАЗДЕЛ IV. ПОРЯДОК И УСЛОВИЯ ДОПУСКА ОБЯЗАТЕЛЬСТВ К КЛИРИНГУ 32
ПОДРАЗДЕЛ IV-I. ПОРЯДОК ЗАКЛЮЧЕНИЯ ВНЕБИРЖЕВЫХ СДЕЛОК С ЦЕННЫМИ БУМАГАМИ 32
Статья 17. Возможность заключения Внебиржевых сделок с ценными бумагами . 32
Статья 18. Порядок заключения Внебиржевых сделок с ценными бумагами 32
ПОДРАЗДЕЛ IV-II. ПОРЯДОК ВЗАИМОДЕЙСТВИЯ С БИРЖЕЙ ПРИ ЗАКЛЮЧЕНИИ СДЕЛОК 37
Статья 19. Порядок взаимодействия с Биржей при подаче заявок и заключении сделок, допуске к клирингу обязательств по биржевым сделкам и обязательств по внесению компенсационных взносов 37
Статья 20. Процедура контроля обеспечения по сделкам 41
ПОДРАЗДЕЛ IV-III. ОСОБЕННОСТИ ОПРЕДЕЛЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ ПО СДЕЛКАМ 46
Статья 21. Особенности определения обязательств по сделкам РЕПО и порядок определения обязательств по уплате компенсационного взноса 46

Статья 22. Особенности определения обязательств по депозитным договорам 55
РАЗДЕЛ V. ПОРЯДОК ПРОВЕДЕНИЯ КЛИРИНГА 59
ПОДРАЗДЕЛ V-I. ПОРЯДОК ВЫДАЧИ И ПОГАШЕНИЯ КЛИРИНГОВЫХ СЕРТИФИКАТОВ УЧАСТИЯ 59
Статья 23. Порядок внесения имущества в имущественный пул. Порядок выдачи клиринговых сертификатов участия 59
Статья 24. Порядок выдачи имущества из имущественного пула. Порядок погашения клиринговых сертификатов участия 63
Статья 25. Порядок замены имущества в имущественном пуле 66
ПОДРАЗДЕЛ V-II. КЛИРИНГОВЫЕ СЕССИИ 67
Статья 26. Особенности проведения клиринговой сессии mark-to-market. Порядок возникновения и исполнения Маржинальных требований по пулу 67
ПОДРАЗДЕЛ V-III. ПОРЯДОК ВКЛЮЧЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ В КЛИРИНГОВЫЙ ПУЛ 71
Статья 27. Общие требования к порядку исполнения обязательств по сделкам и обязательств по внесению компенсационных взносов 71
Статья 28. Порядок подачи и условия регистрации Отчетов на исполнение 76
Статья 29. Проверки, выполняемые при подаче Отчетов на исполнение, Специальных отчетов на исполнение, Срочных отчетов на исполнение, поручений на внесение компенсационных взносов, поручений на отказ от компенсационных взносов, Поручений на отказ от исполнения сделки РЕПО / Поручений на отказ от исполнения сделки купли-продажи ценных бумаг 78
Статья 30. Порядок подачи и условия регистрации поручений на внесение компенсационных взносов и поручений на отказ от компенсационных взносов 80
Статья 31. Порядок подачи и исполнения Поручений на отказ от исполнения сделки РЕПО / Поручений на отказ от исполнения сделки купли-продажи ценных бумаг 81
Статья 32. Порядок подачи и условия регистрации Специальных и Срочных отчетов на исполнение 82
Статья 33. Порядок определения и включения в клиринговый пул обязательств Участников клиринга по уплате Возмещения 86
Статья 34. Порядок включения в клиринговый пул и исполнения обязательств по депозитным договорам 87
Статья 35. Возврат части депозита до наступления Даты исполнения обязательств по возврату депозита 92
Статья 36. Порядок подачи и условия исполнения Поручений на изменение срока исполнения обязательств по сделке 98
Статья 37. Особенности возврата Обеспечения Участникам клиринга категории «К» 99
ПОДРАЗДЕЛ V-IV. ПОРЯДОК ДЕЙСТВИЙ В СЛУЧАЯХ НЕИСПОЛНЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ 100
Статья 38. Порядок выкупа клиринговых сертификатов участия у Банка России 100
Статья 39. Порядок действий в случае неисполнения обязательств по сделкам, заключенным без участия центрального контрагента 102

Статья 40. Процедура урегулирования взаимных требований по сделкам, заключенным без участия центрального контрагента 104
Статья 41. Порядок определения размера Фиксированного возмещения..... 109
ПОДРАЗДЕЛ V-V. ПОРЯДОК ИСПОЛНЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ, ВКЛЮЧЕННЫХ В КЛИРИНГОВЫЙ ПУЛ 111
Статья 42. Порядок исполнения обязательств и требований Участников клиринга и Клирингового центра, включенных в клиринговый пул 111
ПОДРАЗДЕЛ V-VI. ОСОБЕННОСТИ ВЗАИМОДЕЙСТВИЯ С РАСЧЕТНОЙ ОРГАНИЗАЦИЕЙ И РАСЧЕТНЫМ ДЕПОЗИТАРИЕМ..... 116
Статья 43. Особенности взаимодействия с Расчетной организацией 116
Статья 44. Особенности взаимодействия с Расчетным депозитарием 117
ПОДРАЗДЕЛ V-VII. ПОРЯДОК ПЕРЕДАЧИ ДОХОДА 120
Статья 45. Порядок передачи Доходов по сделкам РЕПО и сделкам купли-продажи ценных бумаг, заключенным с Клиринговым центром 120
РАЗДЕЛ VI. ПОРЯДОК ОПЛАТЫ УСЛУГ. ОТЧЕТЫ ПО ИТОГАМ КЛИРИНГА 125
Статья 46. Особенности оплаты услуг Клирингового центра, Биржи и Технического центра 125
Статья 47. Порядок представления информации и отчетов по итогам клиринга .. 128
РАЗДЕЛ VII. ПРОЧИЕ УСЛОВИЯ 134
Статья 48. Особенности Перевода обязательств и Обеспечения одного Участника клиринга другому Участнику клиринга 134
Статья 49. Порядок действий при возникновении обстоятельств, которые могут повлиять на возможность заключения Внебиржевых сделок с ценными бумагами .. 135
Приложение № 1 Документы, предоставляемые юридическим лицом для получения статуса Держателя 136
Приложение № 2 Временной регламент на фондовом рынке и рынке депозитов 141
Приложение № 3 Порядок изменения значений клиринговых регистров Счет обеспечения Т0 и Торгово-клиринговый счет Т0..... 143

РАЗДЕЛ I. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ

Настоящие «Правила клиринга Небанковской кредитной организации-центрального контрагента «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество). Часть II. Правила клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов» (далее – Правила клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов) являются неотъемлемой частью Правил клиринга Небанковской кредитной организации-центрального контрагента «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество) и совместно с «Правилами клиринга Небанковской кредитной организации-центрального контрагента «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество). Часть I. Общая часть» (далее – общая часть Правил клиринга) регулируют отношения, связанные с исполнением сделок купли-продажи ценных бумаг, заключаемых на торгах в Секции Фондового рынка ПАО Московская Биржа или не на организованных торгах в соответствии с Правилами клиринга, сделок РЕПО, заключаемых в Секции рынка РЕПО ПАО Московская Биржа, заключением и исполнением депозитных договоров на Рынке депозитов ПАО Московская Биржа, порядок заключения Внебиржевых сделок с ценными бумагами с Участниками клиринга, а также определяют условия договора об имущественном пуле.

Статья 1. Термины и определения

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

Биржевая сделка -	сделка купли-продажи ценных бумаг, или сделка РЕПО, или депозитный договор, заключенная (заключенный) на Бирже, и информация о которой (о котором) передана Биржей Клиринговому центру в порядке, предусмотренном Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.
Внебиржевая сделка с ценными бумагами / внебиржевая сделка -	сделка купли-продажи ценных бумаг, заключаемая Клиринговым центром с Участником клиринга не на организованных торгах. Значения кодов расчетов, используемых при заключении Внебиржевых сделок с ценными бумагами, соответствуют значениям кодов расчетов, определенных Правилами торгов на фондовом рынке и рынке депозитов.
Возмещение -	Фиксированное возмещение, определенное Правилами торгов на фондовом рынке и рынке депозитов.
Дата внесения компенсационного взноса -	дата, в которую Участник клиринга обязан исполнить обязательства по внесению компенсационного взноса в соответствии с условиями заключенной сделки РЕПО.
Дата прекращения исполнения -	дата, начиная с которой не допускается исполнение в натуре обязательств по сделке.
Держатель -	организация, получившая статус Держателя в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов с

	целью использования ценных бумаг, учитываемых на торговых счетах депо номинального держателя / торговых счетах депо иностранного номинального держателя, открытых такому Держателю, для проведения Клиринговым центром Процедуры контроля обеспечения по сделкам и расчетов по итогам клиринга сделок Участников клиринга, депозитарное обслуживание которых и/или их клиентов осуществляется Держателем.
Доход -	суммы денежных средств или количество ценных бумаг, соответствующие любым дивидендам, процентам, выплатам номинальной стоимости, доходам или иным распределениям на ценные бумаги, являющиеся предметом сделок, заключенных с Клиринговым центром.
Единый лимит по пулу -	величина, рассчитываемая Клиринговым центром в российских рублях по каждому Расчетному коду имущественного пула Участника клиринга в целях контроля за соответствием стоимости имущества, внесенного в соответствующий имущественный пул и учитываемого по такому Торгово-клиринговому счету, количеству выданных клиринговых сертификатов участия.
Клиринговый пул для расчетов в ходе торгов -	клиринговый пул, состоящий из подлежащих исполнению в дату формирования клирингового пула обязательств по сделке с ценными бумагами с кодом расчетов Z0, X0 или из обязательств по сделкам, включенным в Срочный отчет на исполнение.
Клиринговый пул для расчетов по депозитам -	клиринговый пул, состоящий из подлежащих исполнению в дату формирования клирингового пула обязательств по внесению депозитов и обязательств по возврату депозитов.
Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов -	клиринговый пул, состоящий из обязательств по сделкам и обязательств, возникших по итогам клиринга, подлежащих исполнению в определенный Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов момент времени в дату формирования клирингового пула.
Клиринговый пул для расчетов в ходе торгов по сделкам с центральным контрагентом -	клиринговый пул, состоящий из подлежащих исполнению в дату формирования клирингового пула обязательств по сделкам, заключенным с центральным контрагентом и включенным в Срочный отчет на исполнение.
Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов по сделкам с центральным контрагентом -	клиринговый пул, состоящий из подлежащих исполнению в определенный Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов момент времени в дату формирования клирингового пула обязательств по сделкам, заключенным с центральным контрагентом.

Код ценной бумаги -	код, позволяющий однозначно идентифицировать ценную бумагу в Клиринговой системе.
Компенсационный взнос -	сумма денежных средств или количество ценных бумаг, подлежащие уплате (поставке), в качестве частичного предварительного исполнения обязательств по второй части сделки РЕПО, в размере, определяемом в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, одним Участником клиринга другому Участнику клиринга, являющемуся его контрагентом по сделке РЕПО, условиями которой предусмотрено внесение компенсационных взносов.
Маржинальное требование по пулу -	требование Клирингового центра к Участнику клиринга, являющемуся Участником пула, о внесении дополнительного имущества в имущественный пул, предъявляемое в порядке и случаях, определенных Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.
Нетто-обязательство по денежным средствам / ценным бумагам по сделкам клирингового пула -	обязательство Участника клиринга или Клирингового центра по оплате / передаче ценных бумаг, возникшее в связи с прекращением всех обязательств, включенных в клиринговый пул, в результате неттинга в ходе клиринга в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, определяемое в отношении Расчетного кода / Торгово-клирингового счета Участника клиринга (Клирингового центра).
Нетто-требование по денежным средствам / ценным бумагам по сделкам клирингового пула -	требование Участника клиринга или Клирингового центра по оплате / передаче ценных бумаг, возникшее в связи с прекращением всех обязательств, включенных в клиринговый пул, в результате неттинга в ходе клиринга в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, определяемое в отношении Расчетного кода / Торгово-клирингового счета Участника клиринга (Клирингового центра).
Отчет на исполнение -	поручение Участника клиринга, направляемое Клиринговому центру с использованием Клиринговой системы в форме электронного сообщения, подписанного АСП Участника клиринга, и инициирующее включение обязательств по сделке с ценными бумагами, в том числе по первой/второй части сделки РЕПО, в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов / в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов по сделкам с центральным контрагентом.
Отчет на исполнение специальный / Специальный отчет на исполнение -	поручение Участника клиринга, направляемое Клиринговому центру с использованием Клиринговой системы в форме электронного сообщения, подписанного АСП Участника клиринга, и инициирующее включение обязательств по нескольким сделкам с ценными бумагами, в том числе по первым/вторым частям сделок РЕПО, и/или обязательств по внесению компенсационных взносов в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов / в Клиринговый пул для расчетов по

	итогам торгов по сделкам с центральным контрагентом.
Отчет на исполнение срочный / Срочный отчет на исполнение -	поручение Участника клиринга, направляемое Клиринговому центру с использованием Клиринговой системы в форме электронного сообщения, подписанного АСП Участника клиринга, и инициирующее включение обязательств по одной или нескольким сделкам с ценными бумагами, в том числе по первым/вторым частям сделок РЕПО, и/или обязательств по внесению компенсационных взносов в Клиринговый пул для расчетов в ходе торгов / в Клиринговый пул для расчетов в ходе торгов по сделкам с центральным контрагентом.
Период регистрации поручений -	период расчетного дня, установленный в соответствии с Временным регламентом на фондовом рынке и рынке депозитов, в течение которого Клиринговый центр регистрирует поручения от Участников клиринга и/или Клиринговых организаций.
Поручение на внесение компенсационного взноса -	поручение Участника клиринга, направляемое Клиринговому центру с использованием Клиринговой системы в форме электронного сообщения, подписанного АСП Участника клиринга, и инициирующее включение обязательства по внесению компенсационного взноса в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов.
Поручение на отказ от компенсационного взноса -	поручение Участника клиринга, / направляемое Клиринговому центру с использованием Клиринговой системы в форме электронного сообщения, подписанного АСП Участника клиринга, с целью отказа от получения компенсационного взноса.
Процедура контроля обеспечения по сделке с ценными бумагами / Процедура контроля обеспечения -	механизм контроля достаточности индивидуального клирингового обеспечения Участника клиринга для обеспечения исполнения обязательств по денежным средствам и/или ценным бумагам, осуществляемого при подаче заявки на заключение сделки с ценными бумагами или при заключении сделки.
Регламент открытия Торгово-клиринговых счетов -	внутренний документ Клирингового центра, устанавливающий порядок кодификации и открытия в Клиринговой системе Торгово-клиринговых счетов, особенности проведения операций, осуществляемых в Клиринговой системе в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов. Регламент открытия Торгово-клиринговых счетов раскрывается на Сайте Клирингового центра.
Сделка -	биржевая сделка, внебиржевая сделка.
Текущее значение дисконта (далее также – текущий дисконт) -	переменная величина, выраженная в процентах и отражающая соотношение между суммой текущего обязательства (в денежном выражении) Участника клиринга – продавца по первой части сделки РЕПО и рыночной стоимостью ценных бумаг, составляющих текущее обязательство Участника клиринга – покупателя по первой части сделки РЕПО, которая

	каждый торговый день рассчитывается в Клиринговой системе по заключенной сделке РЕПО в течение Срока сделки РЕПО (если условиями этой сделки РЕПО предусмотрены максимальные и минимальные предельные значения дисконта).
Торгово-клиринговый счет имущественного пула -	клиринговый регистр 1-го уровня, определяющий набор счетов, на которых учитываются денежные средства / ценные бумаги, внесенные Участником клиринга в соответствующий имущественный пул.
Участник пула -	Участник клиринга, внесший имущество в имущественный пул.

Статья 2. Общие положения

2.1. Клиринговый центр осуществляет клиринг, выполняя функции центрального контрагента по:

- биржевым сделкам купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов T0 (за исключением сделок размещения и выкупа), K0, Yn, Nn;
- сделкам РЕПО с кодом расчетов T0/Yn, Ym/Yn;
- депозитным договорам с кодом расчетов Ym/Yn;
- внебиржевым сделкам купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов T0, Yn.

2.2. Клиринговый центр осуществляет клиринг без выполнения функций центрального контрагента по:

- сделкам купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов Bn, B0-B30, Z0;
- сделкам РЕПО с кодом расчетов Rb, Sn, Z0;
- сделкам размещения и выкупа с кодом расчетов T0, Z0, X0, Bn.

2.3. Клиринговый центр осуществляет клиринг с частичным обеспечением, клиринг с полным обеспечением и клиринг без предварительного обеспечения.

2.4. Клиринговый центр осуществляет клиринг с частичным обеспечением по следующим сделкам, стороной по которым является Участник клиринга категории «О» или «Б»:

- сделкам купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов Yn, Nn;
- сделкам РЕПО с кодом расчетов Ym/Yn;
- депозитным договорам с кодом расчетов Ym/Yn;
- вторым частям сделок РЕПО с кодом расчетов T0/Yn.

2.5. Клиринговый центр осуществляет клиринг с полным обеспечением по:

- сделкам купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов T0, Z0, X0, K0;
- первым частям сделок РЕПО с кодом расчетов T0/Yn, Rb, Z0;
- сделкам, перечисленным в пункте 2.4 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, стороной по которым является Участник клиринга категории «В».

2.6. Клиринговый центр осуществляет клиринг без предварительного обеспечения по:

- сделкам купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов Bn, B0-B30;
- сделкам РЕПО с кодом расчетов Sn;
- вторым частям сделок РЕПО с кодом расчетов Rb, Z0;
- сделкам, стороной по которым является Участник клиринга категории «К»;
- сделкам, стороной по которым является Участник клиринга категории «А», если Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов и/или договором, заключенным с таким Участником клиринга, не установлен иной порядок осуществления клиринга.

2.7. Клиринговый центр осуществляет клиринг по сделкам с ценными бумагами, заключенным с расчетами в российских рублях или в иностранной валюте.

2.8. Клиринговый центр не осуществляет клиринг по сделкам с ценными бумагами с кодами расчетов, отличными от кодов расчетов, предусмотренных Правилами торгов на фондовом рынке и рынке депозитов.

2.9. Расчеты по результатам клиринга осуществляются в ходе торгов и по итогам торгов.

2.10. Порядок и сроки внесения и возврата Обеспечения определены общей частью Правил клиринга.

2.11. Способы обеспечения исполнения обязательств, допущенных к клирингу, установлены общей частью Правил клиринга. Имущество, составляющее имущественный пул, сформированный Клиринговый центром в соответствии со статьей 4 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, также является обеспечением исполнения обязательств, допущенных к клирингу.

2.11.1. Имущество, составляющее имущественный пул, является обеспечением исполнения следующих обязательств, допущенных к клирингу, с учетом положений пункта 23.9 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов:

1) обязательств по договору об имущественном пуле;
2) обязательств по Сделкам.

2.11.2. Способом обеспечения исполнения обязательств по сделкам РЕПО, заключенным без участия центрального контрагента, является Фиксированное возмещение.

2.12. Перечень видов используемых в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов торговых и клиринговых счетов, предназначенных для внесения ценных бумаг / денежных средств в качестве Обеспечения / в имущественный пул, приведен в статье 6 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

2.13. Сроки определения и исполнения обязательств, указанных в Правилах клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, время проведения клиринговых сессий, а также сроки проведения клиринговых операций, сроки предоставления документов Клиринговому центру / Клиринговым центром в процессе взаимодействия с Участниками клиринга при проведении клиринга и расчетов по сделкам в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов установлены Временным регламентом на фондовом рынке и рынке депозитов,

являющимся приложением № 2 к Правилам клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

Сроки, не установленные Временным регламентом на фондовом рынке и рынке депозитов, определяются в соответствии с Временным регламентом, являющимся приложением к общей части Правил клиринга.

2.14. Операции по объединению выпусков эмиссионных ценных бумаг и/или аннулированию индивидуальных номеров (кодов) дополнительных выпусков эмиссионных ценных бумаг осуществляются в Клиринговой системе на следующий Расчетный день после получения соответствующего уведомления от Расчетного депозитария и по окончании расчетов по сделкам с ценными бумагами по итогам клиринга этого дня. Проведение операций по объединению выпусков эмиссионных ценных бумаг и/или аннулированию индивидуальных номеров (кодов) дополнительных выпусков эмиссионных ценных бумаг в Клиринговой системе сопровождается корректировкой информации по сделкам с ценными бумагами, в том числе по сделкам РЕПО, Дата исполнения которых еще не наступила. Коды объединяемых выпусков ценных бумаг в реквизитах указанных сделок заменяются кодом объединенного выпуска, а аннулируемый код дополнительного выпуска ценных бумаг - кодом выпуска, по отношению к которому данный выпуск является дополнительным.

2.15. Техническим центром на фондовом рынке и рынке депозитов является ПАО Московская Биржа.

2.16. Участник клиринга, не совпадающий в одном лице с Участником торгов, соглашается с тем, что условия договоров, заключаемых на фондовом рынке и рынке депозитов, стороной по которым является (будет являться) Участник клиринга, содержатся, в том числе, в заявках, подаваемых Участником торгов с указанием в качестве стороны по договору Участника клиринга, и /или Правилах торгов на фондовом рынке и рынке депозитов, либо определяются в соответствии с указанными документами.

Статья 3. Условия и порядок заключения / расторжения договора об имущественном пуле

3.1. Правила клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов определяют условия договора об имущественном пуле, установленные Законом о клиринге, включая, но не ограничиваясь условиями, определенными настоящей статьей Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, а также:

- порядок формирования и прекращения имущественного пула (определен статьей 4 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов);
- права владельца клирингового сертификата участия (определены статьей 5 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов);
- права и обязанности Участников пула и Клирингового центра (определены Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов);
- порядок и условия выдачи клиринговых сертификатов участия (определены статьей 23 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов);
- порядок и условия погашения клиринговых сертификатов участия

(определены статьей 24 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов);

- порядок замены имущества в имущественном пуле (определен статьей 25 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов);
- порядок внесения в клиринговые регистры записей о внесенном в имущественный пул имуществе (определен в соответствующих статьях разделов IV-V Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов);
- порядок раскрытия и (или) предоставления информации об имущественном пуле (определен статьей 47 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов).

3.2. Заключение договора об имущественном пуле между Клиринговым центром и Участником клиринга осуществляется путем присоединения Участника клиринга к указанному договору в целом.

Договор об имущественном пуле считается заключенным с даты исполнения Клиринговым центром первого Запроса на открытие Расчетного кода, содержащего заявление Участника клиринга об открытии Торгово-клирингового счета имущественного пула.

Порядок подачи и исполнения указанного заявления установлен статьей 12 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

3.3. Участник пула вправе отказаться от договора об имущественном пуле только при условии погашения всех выданных ему клиринговых сертификатов в порядке, установленном статьей 24 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

3.4. Номинальная стоимость одного клирингового сертификата участия составляет 1 (один) российский рубль.

3.5. Клиринговый центр вправе использовать в своих интересах денежные средства, включенные в состав имущественного пула, с учетом ограничений, установленных внутренним документом Клирингового центра, определяющим критерии размещения временно свободных денежных средств Клирингового центра.

Доходы от такого использования указанных денежных средств не включаются в состав имущественного пула.

Статья 4. Порядок формирования и прекращения имущественного пула

4.1. Клиринговый центр вправе принять решение о формировании имущественного пула, которое содержит:

- код (индивидуальное обозначение) имущественного пула;
- наименование депозитария, осуществляющего централизованное хранение клиринговых сертификатов участия и учет прав на них;
- дату начала формирования имущественного пула.

4.2. Решение Клирингового центра о формировании имущественного пула публикуется на Сайте Клирингового центра не позднее, чем за 5 (пять) календарных дней до даты начала формирования имущественного пула.

4.3. Клиринговый центр вправе вносить изменения в решение о формировании имущественного пула.

4.4. Клиринговый центр вправе сформировать несколько имущественных пулов.

4.5. Перечень имущества, которое может быть внесено в каждый имущественный пул, состоит из ценных бумаг и денежных средств, в том числе в иностранной валюте.

4.5.1. Перечень иностранных валют, принимаемых в каждый из имущественных пулов, устанавливается решением Клирингового центра и раскрывается на Сайте Клирингового центра.

4.5.2. Включение ценной бумаги в каждый из имущественных пулов (за исключением имущественных пулов, в которые принимаются ценные бумаги, не принимаемые Клиринговым центром в качестве обеспечения исполнения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением) осуществляется одновременно при включении такой ценной бумаги в Перечень ценных бумаг, принимаемых в качестве обеспечения исполнения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением, в порядке, установленном общей частью Правил клиринга, без решения Клирингового центра.

Включение ценной бумаги в имущественные пулы, в которые принимаются ценные бумаги, не принимаемые Клиринговым центром в качестве обеспечения исполнения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением, осуществляется при включении такой ценной бумаги в список ценных бумаг, с которыми возможно заключение сделок РЕПО с центральным контрагентом, без решения Клирингового центра.

4.5.3. Исключение ценной бумаги из каждого имущественного пула (за исключением имущественных пулов, в которые принимаются ценные бумаги, не принимаемые Клиринговым центром в качестве обеспечения исполнения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением) осуществляется одновременно при исключении такой ценной бумаги из Перечня ценных бумаг, принимаемых в качестве обеспечения исполнения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением, в порядке, установленном общей частью Правил клиринга, без решения Клирингового центра.

Исключение ценной бумаги из имущественных пулов, в которые принимаются ценные бумаги, не принимаемые Клиринговым центром в качестве обеспечения исполнения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением, осуществляется при исключении такой ценной бумаги из списка ценных бумаг, с которыми возможно заключение сделок РЕПО с центральным контрагентом, без решения Клирингового центра.

При погашении ценной бумаги такая ценная бумага исключается из каждого имущественного пула с даты погашения без решения Клирингового центра.

4.5.4. Ценные бумаги, эмитентом которых является Участник пула или связанное с ним лицо, учитываемые по субсчету депо, открытому владельцу ценных бумаг, которым является Участник пула, не учитываются в качестве имущества, внесенного в соответствующий имущественный пул таким Участником пула.

4.6. Имущественный пул может быть прекращен по решению Клирингового центра только после погашения Клиринговым центром всех клиринговых сертификатов участия в порядке, установленном статьей 24 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

Статья 5. Права владельца клирингового сертификата участия

5.1. Владелец клирингового сертификата участия, являющийся Участником пула, вправе потребовать от Клирингового центра погашения всех или части выданных ему клиринговых сертификатов участия при условии владения им предъявляемыми к погашению клиринговыми сертификатами участия и отсутствия у Участника пула имущественных обязательств по договору об имущественном пуле.

Требование о погашении клиринговых сертификатов участия считается предъявленным Участником пула Клиринговому центру при подаче Участником пула Запроса на возврат обеспечения или распоряжения на перевод денежных средств / ценных бумаг в целях выдачи имущества из имущественного пула в соответствии со статьей 24 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

При погашении клиринговых сертификатов участия Клиринговый центр выдает Участнику пула имущество в порядке и при соблюдении условий, установленных статьей 24 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

Выполнение условий погашения клиринговых сертификатов участия, предусмотренных статьей 24 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, означает отсутствие у Участника пула имущественных обязательств по договору об имущественном пуле в части погашения соответствующего количества клиринговых сертификатов участия.

5.1.1. В случае отзыва (аннулирования) у Участника пула лицензии на осуществление банковских операций или принятия арбитражным судом решения о введении в отношении Участника пула одной из процедур банкротства прекращение обязательств по договору об имущественном пуле осуществляется в ходе ликвидационного неттинга в отношении Участника пула, проводимого в соответствии с общей частью Правил клиринга.

5.1.2. В случае отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций прекращение обязательств по договору об имущественном пуле осуществляется в ходе ликвидационного неттинга в отношении Клирингового центра, проводимого в соответствии с общей частью Правил клиринга.

5.2. Владелец клирингового сертификата участия, не являющийся Участником пула, вправе потребовать от Клирингового центра погашения принадлежащих ему клиринговых сертификатов участия и выплаты денежных средств в размере номинальной стоимости клиринговых сертификатов участия в случае отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций.

5.3. Банк России вправе потребовать от Клирингового центра выкупа его клиринговых сертификатов участия в случае, если Участник клиринга / клиент Участника

клиринга, являющийся продавцом по первой части договора репо с клиринговыми сертификатами участия, заключенного с Банком России, не исполнил обязательства по второй части договора репо, в том числе, в случае прекращения обязательств Участника клиринга по основаниям отзыв (аннулирование) Банком России у Участника клиринга / клиента Участника клиринга, являющегося Кредитной организацией, лицензии на осуществление банковских операций и назначение временной администрации по управлению Участником клиринга - Кредитной организацией в рамках мер по предупреждению банкротства кредитной организации.

Порядок предъявления и исполнения требования о выкупе клиринговых сертификатов участия определен статьей 38 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

Статья 6. Торговые и клиринговые счета

6.1. При осуществлении клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов Клиринговый центр использует следующие виды торговых банковских счетов в российских рублях / иностранных валютах, открытых в Расчетной организации с указанием Клирингового центра в качестве клиринговой организации, которая вправе давать распоряжения по этим счетам:

- торговый банковский счет Участника клиринга / клиента Участника клиринга;
- специальный брокерский счет Участника клиринга;
- специальный торговый счет Участника клиринга;
- торговый банковский счет для учета денежных средств, находящихся в доверительном управлении Участника клиринга.

6.2. Для использования при осуществлении клиринга торгового банковского счета клиента Участника клиринга Участник клиринга обязан предоставить Клиринговому центру Уведомление об использовании торгового банковского счета клиента Участника клиринга от такого клиента.

6.3. Торговые банковские счета используются для внесения денежных средств, предназначенных для обеспечения исполнения и исполнения обязательств по сделкам, за исключением Сделок Т+.

6.4. При осуществлении клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов Клиринговый центр использует следующие типы торговых счетов депо, открытых в Расчетном депозитарии с указанием Клирингового центра в качестве клиринговой организации, которая вправе давать распоряжения по этим счетам, а также следующие типы счетов, открытых в Расчетном депозитарии:

- торговый счет депо владельца Участника клиринга, Клирингового центра или клиента Участника клиринга;
- торговый счет депо номинального держателя Участника клиринга или Держателя;
- торговый счет депо иностранного номинального держателя Держателя;
- торговый счет депо доверительного управляющего Участника клиринга;

- счет брокера Участника клиринга;
- эмиссионный счет эмитента;
- казначейский счет депо эмитента или Клирингового центра.

6.5. При осуществлении клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов Клиринговый центр использует Разделы торговых счетов депо / счетов брокера, открытых в Расчетном депозитарии.

6.6. ***Раздел Т0*** – Раздел, являющийся торговым разделом типа «Блокировано для клиринга в НКЦ») торгового счета депо и используемый для учета ценных бумаг, предназначенных для обеспечения исполнения и исполнения обязательств по сделкам, за исключением Сделок Т+.

6.7. ***Раздел Т+*** – Раздел, являющийся торговым разделом типа «Блокировано для клиринга в НКЦ. Обеспечение» торгового счета депо, предназначенный для учета Обеспечения в ценных бумагах.

6.8. Разделы Т0 и Т+, открытые в рамках одного торгового счета депо, являются связанными, если коды таких разделов, за исключением первых двух символов, совпадают.

6.9. При осуществлении клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов Клиринговый центр использует клиринговые счета, предусмотренные общей частью Правил клиринга, а также:

- клиринговые счета депо, предназначенные для внесения ценных бумаг в соответствующие имущественные пулы.

Для каждого из имущественных пулов, формируемых Клиринговым центром, используется отдельный клиринговый счет депо.

6.10. При осуществлении клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов Клиринговый центр использует следующие типы субсчетов депо к клиринговому счету депо, предназначенному для внесения ценных бумаг в имущественный пул (далее – субсчета депо имущественного пула):

- субсчет депо, открытый владельцу ценных бумаг, которым является Участник клиринга или клиент Участника клиринга;
- субсчет депо, открытый номинальному держателю, которым является Участник клиринга или Держатель;
- субсчет депо, открытый иностранному номинальному держателю, которым является Держатель;
- субсчет депо, открытый доверительному управляющему, которым является Участник клиринга.

Для открытия субсчета депо имущественного пула лицо, которому открывается субсчет депо имущественного пула, должно являться депонентом Расчетного депозитария, а также выполнить иные действия, предусмотренные внутренними документами Расчетного депозитария.

Статья 7. Клиринговые регистры

7.1. При осуществлении клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов Клиринговый центр открывает и ведет клиринговые регистры, предусмотренные общей частью Правил клиринга, а также:

7.2. ***Счет обеспечения Т0*** – лицевой счет, открытый в Клиринговом центре на балансовом счете № 30420 (30421) «Средства для исполнения обязательств, допущенных к клирингу, для индивидуального клирингового и иного обеспечения» («Средства нерезидентов для исполнения обязательств, допущенных к клирингу, для индивидуального клирингового и иного обеспечения») для учета денежных средств, предназначенных для обеспечения исполнения и исполнения обязательств по сделкам, за исключением Сделок Т+.

Счет обеспечения Т0 используется в случае, если денежные средства, предназначенные для обеспечения исполнения и/или исполнения обязательств по сделкам, зачисляются на торговый банковский счет Участника клиринга или клиента Участника клиринга.

7.2.1. Счет обеспечения Т0 открывается к торговому банковскому счету Участника клиринга или его клиента.

7.2.2. Счет обеспечения Т0 в соответствующей валюте связывается с Расчетным кодом Участника клиринга на основании Запроса на открытие Торгово-клирингового счета, предоставляемого Участником клиринга Клиринговому центру в соответствии с пунктом 11.1 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

7.2.3. С одним Расчетным кодом Участника клиринга может быть связано не более одного Счета обеспечения Т0 в каждой валюте.

7.3. В состав Торгово-клирингового счета Участника клиринга, используемого на фондовом рынке и рынке депозитов, входят Расчетный код Участника клиринга / Счет обеспечения Т0 и Раздел, за исключением Торгово-клиринговых счетов, предназначенных для заключения депозитных договоров, указанных в подпункте 7.4.2 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

7.3.1. Один Раздел может входить в состав только одного Торгово-клирингового счета.

7.3.2. Один Расчетный код Участника клиринга / Счет обеспечения Т0 может входить в состав нескольких Торгово-клиринговых счетов.

7.3.3. Допустимые соответствия типов Расчетного кода Участника клиринга / Счетов обеспечения Т0 и Раздела в составе Торгово-клирингового счета установлены Регламентом открытия Торгово-клиринговых счетов.

7.4. Для заключения Сделок Т+ с ценными бумагами может использоваться только Торгово-клиринговый счет, в состав которого входят Раздел Т+ и Расчетный код Участника клиринга, к которому привязан Счет обеспечения (далее – Торгово-клиринговый счет Т+).

7.4.1. Для заключения иных сделок может использоваться Торгово-клиринговый счет, в состав которого входят:

- Раздел Т+ и Расчетный код Участника клиринга, к которому привязан Счет

обеспечения;

- Раздел Т0 и Расчетный код Участника клиринга, к которому привязан Счет обеспечения;
- Раздел Т0 и Счет обеспечения Т0.

7.4.2. Для заключения депозитных договоров может использоваться только Торгово-клиринговый счет, в состав которого входит только собственный Расчетный код или Расчетный код ДУ Участника клиринга, к которому привязан Счет обеспечения.

Такой Торгово-клиринговый счет имеет в Клиринговой системе специальный признак, означающий, что данный Торгово-клиринговый счет предназначен для заключения депозитных договоров.

7.4.3. Торгово-клиринговые счета, в состав которых входят Раздел Т0 и Счет обеспечения Т0, не могут использоваться для заключения Сделок в ходе дополнительной торговой сессии.

7.5. Торгово-клиринговые счета, в состав которых входят связанные Раздел Т0 и Раздел Т+, также являются связанными.

7.6. Для заключения сделок РЕПО с клиринговыми сертификатами участия Участник клиринга, за исключением Участника клиринга категории «А», обязан зарегистрировать Торгово-клиринговый счет имущественного пула, в состав которого входят субсчет депо имущественного пула и Расчетный код имущественного пула.

7.6.1. Один субсчет депо имущественного пула может входить в состав только одного Торгово-клирингового счета имущественного пула.

7.6.2. Один Расчетный код имущественного пула может входить в состав только одного Торгово-клирингового счета имущественного пула.

7.7. Помимо информации, указанной в общей части Правил клиринга, при осуществлении клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов на клиринговых регистрах Клиринговый центр учитывает:

- информацию о денежных средствах, внесенных для обеспечения исполнения и исполнения обязательств по сделкам, за исключением Сделок Т+, в разрезе валют и Счетов обеспечения Т0;
- информацию о ценных бумагах, внесенных для обеспечения исполнения и исполнения обязательств по сделкам, за исключением Сделок Т+, в разрезе кодов ценных бумаг и Торгово-клиринговых счетов, в состав которых входит Раздел Т0;
- информацию о ценных бумагах, внесенных в соответствующий имущественный пул, в разрезе кодов ценных бумаг и Торгово-клиринговых счетов имущественного пула;
- информацию о денежных средствах, внесенных в соответствующий имущественный пул, в разрезе валют и Расчетных кодов имущественного пула;
- Единый лимит по Расчетному коду в разрезе Расчетных кодов;

- Единый лимит по пулу в разрезе Расчетных кодов имущественного пула;
- входящее значение номинальной стоимости выданных клиринговых сертификатов участия, поручение на выдачу которых исполнено Расчетным депозитарием (I); учитывается в разрезе Расчетных кодов имущественного пула;
- номинальную стоимость клиринговых сертификатов участия, подлежащих выдаче в ходе ближайшего взаимодействия с Расчетным депозитарием (C); учитывается в разрезе Расчетных кодов имущественного пула;
- номинальную стоимость клиринговых сертификатов участия, подлежащих погашению в ходе ближайшего взаимодействия с Расчетным депозитарием (D); учитывается в разрезе Расчетных кодов имущественного пула;
- текущее значение номинальной стоимости выданных клиринговых сертификатов участия, равное I + C - D; учитывается в разрезе Расчетных кодов имущественного пула;
- информацию об обязанностях и требованиях Участников клиринга по каждому допущенному к клирингу обязательству по сделке;
- Нетто-обязательство / Нетто-требование Участников клиринга по денежным средствам / ценным бумагам по сделкам клирингового пула в разрезе Расчетных кодов Участников клиринга (Счетов обеспечения Т0) / Торгово-клиринговых счетов, валют / кодов ценных бумаг;
- Нетто-обязательство / Нетто-требование Участников клиринга по денежным средствам / ценным бумагам, рассчитанное по Сделкам Т+, в разрезе Расчетных кодов / Торгово-клиринговых счетов Т+, Дат исполнения, валют / кодов ценных бумаг;
- информацию о Маржинальных требованиях по пулу в разрезе Расчетных кодов имущественного пула (в случае наличия).

7.8. Порядок ведения клиринговых регистров определен в общей части Правил клиринга, а также в соответствующих статьях разделов IV и V Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, порядок ведения клиринговых регистров Счет обеспечения Т0 и Торгово-клиринговый счет Т0 приведен в приложении № 3 к Правилам клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

РАЗДЕЛ II. ТРЕБОВАНИЯ К УЧАСТНИКАМ КЛИРИНГА

Статья 8. Условия клирингового обслуживания. Порядок предоставления допуска к клиринговому обслуживанию

8.1. На фондовом рынке и рынке депозитов Участникам клиринга могут быть присвоены следующие категории Участников клиринга:

- Участники клиринга категории «А»;
- Участники клиринга категории «К»;
- Участники клиринга категории «О»;
- Участники клиринга категории «Б»;
- Участники клиринга категории «В».

8.1.1. К клирингу без предварительного обеспечения допускаются Участники клиринга всех категорий.

8.1.2. Участники клиринга категории «А» и «К» имеют допуск к клирингу с частичным обеспечением, к клирингу с полным обеспечением, к клирингу без предварительного обеспечения.

8.2. Допуск к клиринговому обслуживанию на фондовом рынке и рынке депозитов предоставляется Участнику клиринга, соответствующему требованиям, установленным для соответствующей категории Участников клиринга в общей части Правил клиринга, а также требованиям, указанным в пункте 8.3-8.4 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

8.3. Для допуска к клиринговому обслуживанию Участник клиринга категории «В» должен дополнительно соответствовать следующим требованиям:

8.3.1. иметь хотя бы один зарегистрированный в Клиринговом центре Торгово-клиринговый счет;

8.3.2. Участник клиринга - Некредитная организация, не являющийся профессиональным участником рынка ценных бумаг или лицом, осуществляющим иную лицензируемую деятельность на финансовом рынке, и Участник клиринга, являющийся Некредитной организацией – нерезидентом и не имеющий действующего специального разрешения на осуществление операций на финансовых рынках, выданного компетентным органом государства учреждения Участника клиринга, иметь собственные средства (капитал) не менее, чем 1 000 000 000 (один миллиард) российских рублей.

8.4. Для допуска к клиринговому обслуживанию с категорией «Б» Участник клиринга - Некредитная организация, не являющийся профессиональным участником рынка ценных бумаг или лицом, осуществляющим иную лицензируемую деятельность на финансовом рынке, и Участник клиринга, являющийся Некредитной организацией – Нерезидентом и не имеющий действующего специального разрешения на осуществление операций на финансовых рынках, выданного компетентным органом государства учреждения Участника клиринга, должен дополнительно соответствовать следующим требованиям:

8.4.1. иметь собственные средства (капитал) не менее, чем 10 000 000 000 (десять миллиардов) российских рублей.

8.5. К заключению Внебиржевых сделок с ценными бумагами допускаются Участники клиринга, допущенные к клиринговому обслуживанию на фондовом рынке и рынке депозитов.

Статья 9. Особенности приостановления допуска к клиринговому обслуживанию

9.1. Клиринговый центр вправе приостановить допуск к клиринговому обслуживанию Участника клиринга категории «О», «Б» или категории «В» по основаниям, предусмотренным общей частью Правил клиринга, а также по следующим основаниям:

9.1.1. при отсутствии хотя бы одного зарегистрированного Торгово-клирингового счета;

9.1.2. при несоответствии размера собственных средств (капитала) Участника клиринга - Некредитной организации, не являющегося профессиональным участником рынка ценных бумаг или лицом, осуществляющим иную лицензируемую деятельность на финансовом рынке, или Участника клиринга, являющегося Некредитной организацией – Нерезидентом и не имеющего действующего специального разрешения на осуществление операций на финансовых рынках, выданного компетентным органом государства учреждения Участника клиринга, требованию, установленному подпунктом 8.3.2 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов;

9.1.3. в случае если объем обязательств Клирингового центра по возврату депозитов Участнику клиринга по всем заключенным с таким Участником клиринга депозитным договорам превысит 1 000 000 000 000 (один триллион) российских рублей;

9.1.4. при неоднократном (два и более раза), в течение трех календарных месяцев, неисполнении Участником клиринга сделок, заключенных без участия Центрального контрагента на основании адресных заявок.

9.2. Клиринговый центр вправе установить Участнику клиринга категории «Б» категорию «В» по основаниям, предусмотренным общей частью Правил клиринга, а также в следующих случаях:

9.2.1. при невыполнении Участником клиринга - Некредитной организацией, не являющимся профессиональным участником рынка ценных бумаг или лицом, осуществляющим иную лицензируемую деятельность на финансовом рынке, и Участником клиринга, являющимся Некредитной организацией – Нерезидентом и не имеющим действующего специального разрешения на осуществление операций на финансовых рынках, выданного компетентным органом государства учреждения Участника клиринга, любого из требований, предусмотренных пунктом 8.4 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

9.3. Приостановление клирингового обслуживания Участника клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов означает невозможность Участнику клиринга становиться стороной по сделкам, заключаемым на фондовом рынке и рынке депозитов Участниками торгов (за исключением Клирингового центра), за

исключением заключения Участником клиринга депозитных договоров на основании заявок на заключение депозитного договора, внесенных в реестр предложений до момента приостановления допуска к клиринговому обслуживанию Участника клиринга, а также невозможность подачи таким Участником клиринга Предложений на заключение Внебиржевых сделок в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

Статья 10. Требования к Держателям. Порядок получения (лишения) статуса Держателя

10.1. Для получения статуса Держателя юридические лица, являющиеся Участниками клиринга, предоставляют Клиринговому центру Заявление о предоставлении статуса Держателя.

10.2. Для получения статуса Держателя юридические лица – Резиденты должны иметь действующую лицензию профессионального участника рынка ценных бумаг на осуществление депозитарной деятельности, выданной уполномоченным органом.

Для получения статуса Держателя юридические лица – Нерезиденты должны иметь в соответствии с их личным законом право осуществлять учет и переход прав на ценные бумаги, и соответствовать требованиям, установленным законодательством Российской Федерации для открытия счета депо иностранного номинального держателя.

10.3. Для получения статуса Держателя юридические лица, не являющиеся Участниками клиринга, помимо документов, указанных в пункте 10.1 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, предоставляют Клиринговому центру:

- юридические лица - Резиденты - документы, указанные в разделе I приложения № 1 к Правилам клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов;
- юридические лица - Нерезиденты - документы, указанные в разделе II приложения № 1 к Правилам клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

Юридические лица, не являющиеся Участниками клиринга, для получения / поддержания статуса Держателя обязаны выполнить условия для получения в соответствии с Порядком ЭДО отчетных документов по итогам клиринга в форме электронных документов.

10.4. Решение о предоставлении (приостановлении/лишении) юридическому лицу статуса Держателя принимается Клиринговым центром.

10.5. Юридическому лицу / Участнику клиринга приостанавливается статус Держателя в случае аннулирования Банком России лицензии профессионального участника рынка ценных бумаг на осуществление депозитарной деятельности, если в решении Банка России указан срок для прекращения обязательств, связанных с осуществлением им депозитарной деятельности.

10.6. Юридическое лицо / Участник клиринга может быть лишен статуса Держателя по любому из следующих оснований:

10.6.1. в случае аннулирования или приостановления действия лицензии профессионального участника рынка ценных бумаг на осуществление депозитарной деятельности;

10.6.2. в случае отзыва (аннулирования) Банком России лицензии на осуществление банковских операций (для Кредитных организаций);

10.6.3. при невыполнении условий для получения в соответствии с Порядком ЭДО отчетных документов по итогам клиринга в форме электронных документов;

10.6.4. нарушения Держателем требований по представлению документов, указанных в пункте 10.7 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов;

10.6.5. письма Держателя о лишении его статуса Держателя;

10.6.6. при применении к Держателю санкций уполномоченных органов за нарушение законодательства Российской Федерации, в том числе при применении административных наказаний;

10.6.7. в случае назначения временной администрации или принятия арбитражным судом решения о введении в отношении Держателя одной из процедур банкротства;

10.6.8. ликвидации Держателя, а также в случае реорганизации Держателя при условии, что деятельность Держателя в результате реорганизации прекращается;

10.6.9. неоднократного (два и более) нарушения Держателем установленных Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов требований;

10.6.10. в случае получения от иностранного налогового органа уведомления о невыполнении Держателем требований законодательства иностранного государства;

10.6.11. в случае наличия риска потери деловой репутации Клирингового центра в связи с сохранением статуса Держателя;

10.6.12. по иным основаниям.

10.7. В случае изменения сведений, содержащихся в Анкете юридического лица или в иных ранее предоставленных Клиринговому центру документах, Держатель обязан в течение 5 (пяти) рабочих дней с даты вступления в силу указанных изменений предоставить Клиринговому центру Анкету юридического лица с обновленной информацией или письмо, содержащее информацию о таких изменениях, с приложением документов, подтверждающих изменения, в форме электронного документа или документа в бумажной форме.

10.8. Форматы предоставления Держателем Анкеты юридического лица определены Порядком предоставления информации и отчетности.

10.9. Клиринговый центр извещает юридическое лицо / Участника клиринга о получении им статуса Держателя, а также о приостановлении/лишении его статуса Держателя путем размещения соответствующей информации на Сайте Клирингового центра в течение 3 (трех) рабочих дней со дня принятия соответствующего решения.

Статья 11. Порядок открытия и закрытия Торгово-клиринговых счетов Участника клиринга

11.1. На фондовом рынке и рынке депозитов необходимо открытие Торгово-клиринговых счетов Участника клиринга, а также возможно открытие Торгово-клиринговых счетов 2-ого уровня и Торгово-клиринговых счетов 3-ого уровня.

11.2. Открытие Торгово-клирингового счета Участника клиринга осуществляется на основании Запроса на открытие Торгово-клирингового счета, за исключением Торгово-клирингового счета, предназначенного для заключения депозитных договоров, и Торгово-клирингового счета имущественного пула.

11.2.1. Запрос на открытие Торгово-клирингового счета должен содержать указание на открытый Расчетный код Участника клиринга, который будет входить в состав открываемого Торгово-клирингового счета Участника клиринга.

11.2.2. Запрос на открытие Торгово-клирингового счета должен содержать указание на Раздел, который будет входить в состав открываемого Торгово-клирингового счета Участника клиринга.

11.2.3. На основании Запроса на открытие Торгово-клирингового счета, содержащего указание на необходимость открытия нового Расчетного кода Участника клиринга, открывается Расчетный код Участника клиринга с типом, соответствующим типу Раздела, входящему в состав Торгово-клирингового счета совместно с таким Расчетным кодом.

11.2.4. Запрос на открытие Торгово-клирингового счета может содержать иную информацию, состав которой установлен формой и/или форматом Запроса на открытие Торгово-клирингового счета.

11.2.5. Клиринговый центр вправе отказать в регистрации Торгово-клирингового счета Участника клиринга, в состав которого входит Раздел торгового счета депо Держателя, в случае, если по заключению Клирингового центра регистрация такого Торгово-клирингового счета Участника клиринга может повлечь увеличение принимаемых Клиринговым центром рисков и/или нарушение правил и порядка внутреннего контроля, осуществляемого Клиринговым центром в соответствии с нормативными актами Банка России.

11.3. Открытие Торгово-клирингового счета Участника клиринга, предназначенного для заключения депозитных договоров, осуществляется на основании Запроса на открытие Расчетного кода, предоставляемого Участником клиринга Клиринговому центру в соответствии с общей частью Правил клиринга, и содержащего признак, указывающий на необходимость открытия Торгово-клирингового счета Участника клиринга, предназначенного для заключения депозитных договоров.

11.4. Участник клиринга категории «О» или «Б» вправе с использованием Клиринговой системы установить для Торгово-клирингового счета Т+ признак «запрет коротких продаж» и/или признак «запрет необеспеченных покупок».

По Сделкам Т+, заключенным с указанием Торгово-клирингового счета Т+ с признаком «запрет коротких продаж», осуществляется клиринг с полным обеспечением по ценным бумагам.

По Сделкам Т+, заключенным с указанием Торгово-клирингового счета Т+ с признаком «запрет необеспеченных покупок», осуществляется клиринг с полным обеспечением по денежным средствам.

11.4.1. Для Торгово-клирингового счета Т+ Участник клиринга категории «О» или «Б» вправе с использованием Клиринговой системы установить ограничение на размер Нетто-обязательства по ценной бумаге. Соблюдение указанного ограничения проверяется при подаче заявки на заключение Сделки Т+ с учетом обязательств и требований по Сделкам Т+, которые могут быть заключены на основании такой заявки.

11.5. Участник клиринга вправе с использованием Клиринговой системы установить для Торгово-клирингового счета 2-го уровня признак «запрет коротких продаж» и/или признак «запрет необеспеченных покупок».

11.6. Участник торгов, заключивший с Клиринговым центром договор о ведении клиринговых регистров, предусмотренный общей частью Правил клиринга, вправе с использованием Клиринговой системы установить для Торгово-клирингового счета 3-го уровня признак «запрет коротких продаж» и/или признак «запрет необеспеченных покупок».

11.7. Клиринговый центр посредством Системы торгов передает Бирже информацию:

- о зарегистрированных Торгово-клиринговых счетах Участников клиринга, Торгово-клиринговых счетах 2-го и 3-го уровней;
- об Участниках торгов, имеющих право подавать заявки с указанием Торгово-клиринговых счетов 2-го уровня;
- о зарегистрированных Обособленных клиентах;
- иную информацию, предусмотренную Правилами торгов на фондовом рынке и рынке депозитов.

11.8. Закрытие Торгово-клирингового счета Участника клиринга осуществляется на основании Запроса на закрытие Торгово-клирингового счета, предоставленного Участником клиринга Клиринговому центру.

11.8.1. Клиринговый центр осуществляет закрытие Торгово-клирингового счета Участника клиринга при соблюдении следующих условий:

- отсутствуют неисполненные обязательства и / или требования, учитываемые по Расчетному коду и / или по Разделу, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в Запросе на закрытие Торгово-клирингового счета;
- отсутствует Обеспечение в ценных бумагах, учитываемое по Разделу, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в Запросе на закрытие Торгово-клирингового счета;
- значение Единого лимита по Расчетному коду, входящему с состав указанного в Запросе на закрытие Торгово-клирингового счета после закрытия указанного Торгово-клирингового счета, не станет отрицательным, или, если Единый лимит по такому Расчетному коду был отрицательным до закрытия указанного Торгово-клирингового счета, при условии, что Единый лимит по такому Расчетному коду, после закрытия указанного Торгово-

клирингового счета, не станет меньше, чем Единый лимит по этому Расчетному коду, рассчитанный до закрытия указанного Торгово-клирингового счета.

11.9. Запрос на открытие Торгово-клирингового счета, содержащий указание на необходимость изменения Расчетного кода Участника клиринга, входящего в состав Торгово-клирингового счета Участника клиринга, исполняется при условии, что Единый лимит по Расчетному коду Участника клиринга, входящему в состав Торгово-клирингового счета до исполнения указанного запроса, и Единый лимит по Расчетному коду Участника клиринга, входящему в состав Торгово-клирингового счета после исполнения указанного запроса, не станет отрицательным.

Статья 12. Порядок открытия Торгово-клиринговых счетов имущественного пула

12.1. Открытие Торгово-клирингового счета имущественного пула осуществляется на основании Запроса на открытие Расчетного кода, предоставляемого Участником клиринга Клиринговому центру.

12.1.1. Для открытия Торгово-клирингового счета имущественного пула в Запросе на открытие Расчетного кода Участник клиринга должен указать:

- признак, определяющий соответствующий имущественный пул;
- Торгово-клиринговый счет Т+, в состав которого входит Раздел Т+, на который будут зачисляться выдаваемые клиринговые сертификаты участия.

12.2. На основании Запроса на открытие Расчетного кода, полученного от Участника клиринга и содержащего информацию, предусмотренную подпунктом 12.1.1 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, Клиринговый центр:

12.2.1. открывает Участнику клиринга Расчетный код имущественного пула с типом, соответствующим типу Расчетного кода, входящего в состав Торгово-клирингового счета Т+, указанного в Запросе на открытие Расчетного кода;

12.2.2. для открытого в соответствии с подпунктом 12.2.1 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов Расчетного кода имущественного пула открывает один Счет обеспечения в российских рублях и по одному Счету обеспечения в каждой иностранной валюте, принимаемой в соответствующий имущественный пул;

12.2.3. открывает Торгово-клиринговый счет имущественного пула, в состав которого входит открытый в соответствии с подпунктом 12.2.1 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов Расчетный код имущественного пула;

12.2.4. устанавливает соответствие между открытым Торгово-клиринговым счетом имущественного пула и Торгово-клиринговым счетом Т+, указанным в Запросе на открытие Расчетного кода;

12.2.5. направляет Расчетному депозитарию поручение на открытие субсчета депо соответствующего имущественного пула для депонента, которому открыт Раздел Т+, входящий в состав Торгово-клирингового счета Т+, указанного в Запросе на открытие Расчетного кода, с типом, соответствующим типу указанного Раздела Т+;

12.2.6. после получения от Расчетного депозитария информации об открытии субсчета депо имущественного пула в составе списка Разделов / субсчетов депо,

направляемого в соответствии с общей частью Правил клиринга, включает в состав соответствующего Торгово-клирингового счета имущественного пула указанный субсчет депо имущественного пула.

12.3. Под каждый из имущественных пулов, формируемых Клиринговым центром, Участнику клиринга открываются отдельные субсчета депо имущественного пула, Расчетные коды имущественного пула и Торгово-клиринговые счета имущественного пула.

12.4. Торгово-клиринговый счет имущественного пула может указываться в заявке на продажу ценных бумаг / иностранной валюты из имущественного пула. По такой сделке будет осуществляться клиринг с полным обеспечением по ценным бумагам / иностранной валюте.

Статья 13. Особенности регистрации Обособленных клиентов

13.1. Помимо отдельного клиентского Расчетного кода Участник клиринга должен открыть для Обособленного клиента отдельный Раздел и отдельный Торгово-клиринговый счет, в состав которого входит такой Раздел и такой Расчетный код, а для Обособленных клиентов – владельцев клиринговых сертификатов участия открыть отдельный Торгово-клиринговый счет имущественного пула / отдельные Торгово-клиринговые счета имущественного пула.

13.2. Участник клиринга не вправе указывать Расчетный код, открытый для Обособленного клиента и входящий в состав Торгово-клиринговых счетов для Обособленного клиента, при регистрации иных Торгово-клиринговых счетов.

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

Статья 14. Перечень мер, направленных на управление рисками при осуществлении клиринга

14.1. В целях снижения рисков, связанных с осуществлением клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, Клиринговый центр применяет меры, предусмотренные общей частью Правил клиринга.

14.2. Гарантийный фонд фондового рынка и рынка депозитов формируется Клиринговым центром за счет взносов всех Участников клиринга категории «О» и «Б», допущенных к клирингу на фондовом рынке и рынке депозитов.

14.2.1. Для Участников клиринга категории «О» и «Б» на фондовом рынке и рынке депозитов минимальный размер взноса в Гарантийный фонд каждого Участника клиринга составляет 10 000 000 (десять миллионов) российских рублей.

14.2.2. Для Участников клиринга категории «Б» на рынке депозитов минимальный размер взноса в Гарантийный фонд каждого Участника клиринга составляет 1 000 000 (один миллион) российских рублей.

14.3. Обеспечение под стресс обязаны вносить Участники клиринга категории «О» и «Б».

Порядок определения размера Обеспечения под стресс Участника клиринга установлен Методикой определения размера Обеспечения под стресс.

14.4. При неисполнении Участником клиринга Маржинального требования по фондам и/или Маржинального требования по обеспечению под стресс, порядок выставления и исполнения которых определен общей частью Правил клиринга:

- Участнику клиринга категории «Б» устанавливается категория «В»;
- Участнику клиринга категории «О» по всем Торгово-клиринговым счетам Участника клиринга устанавливается признак «запрет необеспеченных покупок» и признак «запрет коротких продаж».

14.5. При использовании взноса Недобросовестного участника клиринга в Гарантийный фонд фондового рынка и рынка депозитов и/или Обеспечения под стресс на фондовом рынке и рынке депозитов:

- Участнику клиринга категории «Б» устанавливается категория «В»;
- Участнику клиринга категории «О» по всем Торгово-клиринговым счетам Участника клиринга устанавливается признак «запрет необеспеченных покупок» и признак «запрет коротких продаж».

14.6. В случае возмещения Недобросовестным участником клиринга средств Гарантийного фонда фондового рынка и рынка депозитов и Обеспечения под стресс на фондовом рынке и рынке депозитов в течение 1 (одного) Расчетного дня после направления Клиринговым центром такому Участнику клиринга

Маржинального требования по фонду и/или Маржинального требования по Обеспечению Клиринговый центр вправе:

- установить Участнику клиринга категории «В» категорию «Б»;
- снять Участнику клиринга категории «О» признак «запрет коротких продаж» и признак «запрет необеспеченных покупок».

14.7. На фондовом рынке и рынке депозитов контроль достаточности Обеспечения осуществляется с использованием Единого лимита по Расчетному коду.

14.8. Клиринговый центр вправе с использованием Клиринговой системы установить ограничение на минимальное допустимое отрицательное значение Единого лимита по Расчетному коду, рассчитанного без учета Обеспечения Участника клиринга.

14.9. Участник клиринга вправе с использованием Клиринговой системы установить ограничение на минимальное допустимое значение, в том числе отрицательное, Единого лимита по Расчетному коду, рассчитанного без учета Обеспечения Участника клиринга.

Статья 15. Перечень мер, направленных на управление рисками по операциям с клиринговыми сертификатами участия

15.1. В целях снижения рисков, связанных с выдачей и обращением клиринговых сертификатов участия, Клиринговый центр кроме мер, предусмотренных статьей 14 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов:

- не реже, чем каждый Расчетный день, осуществляет переоценку стоимости имущества, внесенного каждым Участником клиринга в каждый из имущественных пулов, и контроль достаточности указанного имущества для обеспечения исполнения обязательств Участника клиринга по договору об имущественном пуле, в случае недостаточности – предъявляет Участнику клиринга Маржинальное требование по пулу;
- при возврате имущества, внесенного в имущественный пул, осуществляет контроль достаточности указанного имущества для обеспечения исполнения обязательств Участника клиринга по договору об имущественном пуле.

15.2. Порядок расчета стоимости имущества, внесенного в имущественный пул, определен в статье 16 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

Порядок выставления и исполнения Маржинального требования по пулу определен в статье 26 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

Порядок возврата имущества, внесенного в имущественный пул, определен в статье 24 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

Статья 16. Единый лимит по пулу

16.1. Единый лимит по пулу рассчитывается Клиринговым центром по Расчетному коду имущественного пула при внесении имущества в имущественный пул, при возврате имущества из имущественного пула, при подаче заявок на заключение Сделок Т+ с указанием Торгово-клирингового счета имущественного пула, при

заключении Сделок Т+ или исполнении / прекращении обязательств по Сделкам Т+, заключенных с указанием Торгово-клирингового счета имущественного пула, а также при изменении базовых риск-параметров.

16.2. Единый лимит по пулу используется для контроля за соответствием стоимости имущества, внесенного в соответствующий имущественный пул, номинальной стоимости выданных клиринговых сертификатов участия при выполнении операций, указанных в пункте 16.1 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, а также иных операций, предусмотренных Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов. Указанный контроль осуществляется, исходя из анализа изменения значения Единого лимита по пулу до и после проведения операции.

16.3. Единый лимит по пулу по Расчетному коду имущественного пула рассчитывается с учетом:

- российских рублей и иностранной валюты, внесенных в имущественный пул и учитываемых по Расчетному коду имущественного пула (учитываются со знаком «плюс»);
- ценных бумаг, внесенных в имущественный пул и учитываемых по Торгово-клиринговому счету имущественного пула (учитываются со знаком «плюс»);
- текущего значения номинальной стоимости выданных клиринговых сертификатов участия, учитываемого по Расчетному коду имущественного пула (отражается в Клиринговой системе со знаком «плюс», при расчете Единого лимита по пулу вычитается из рассчитываемого значения);
- Нетто-обязательств Участника клиринга в российских рублях / иностранной валюте, рассчитанных по Сделкам, учитываемых по Расчетному коду имущественного пула, по всем Датам исполнения (учитываются со знаком «минус»);
- Нетто-требований Участника клиринга в российских рублях / иностранной валюте, рассчитанных по Сделкам, учитываемых по Расчетному коду имущественного пула, по всем Датам исполнения (учитываются со знаком «плюс»);
- Нетто-обязательств Участника клиринга в ценных бумагах, рассчитанных по Сделкам, учитываемых по Торгово-клиринговому счету имущественного пула, по всем Датам исполнения (учитываются со знаком «минус»);
- Нетто-требований Участника клиринга в ценных бумагах, рассчитанных по Сделкам, учитываемых по Торгово-клиринговому счету имущественного пула, по всем Датам исполнения (учитываются со знаком «плюс»);
- обязательств / требований, которые могут возникнуть в случае заключения на основании зарегистрированных заявок, поданных с указанием Торгово-клирингового счета имущественного пула, Сделок, стороной по которым будет являться Участник клиринга.

16.4. Для расчета Единого лимита по пулу, Клиринговый центр использует риск-параметры, перечень, порядок расчета и изменения которых определен в методиках определения риск-параметров соответствующих биржевых рынков.

16.5. Если по Торгово-клиринговому счету Т+ Участника клиринга Участником клиринга установлены индивидуальные Верхние и Нижние границы диапазона оценки рыночных рисков и/или Верхние и Нижние границы диапазона оценки процентных рисков, такие же риск-параметры применяются для Торгово-клирингового счета имущественного пула, соответствующего такому Торгово-клиринговому счету Т+.

16.6. Единый лимит по пулу рассчитывается Клиринговым центром исходя из оценки в российских рублях максимально возможного уменьшения в течение срока, необходимого для прекращения обязательств по договору об имущественном пуле в случае неисполнения Участником клиринга Маржинального требования по пулу, общей стоимости активов и обязательств, указанных в пункте 16.3 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, в связи с изменением риск-параметров.

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 пулу определены в документе «Принципы расчета Единого лимита», раскрываемом на Сайте Клирингового центра.

16.7. Если Единый лимит по пулу по Расчетному коду имущественного пула, рассчитанный в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, является неотрицательным, стоимость имущества, внесенного в имущественный пул и учитываемого по такому Расчетному коду имущественного пула, является соответствующей текущему значению номинальной стоимости выданных клиринговых сертификатов участия, учитываемой по тому же Расчетному коду имущественного пула.

16.7.1. При превышении стоимости имущества, внесенного в соответствующий имущественный пул, текущего значения номинальной стоимости выданных клиринговых сертификатов участия Клиринговый центр выдает Участнику пула дополнительные клиринговые сертификаты участия в порядке, определенном статьей 23 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

16.7.2. Если Единый лимит по пулу по Расчетному коду имущественного пула, рассчитанный в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, является отрицательным, Клиринговый центр вправе погасить клиринговые сертификаты участия, при соблюдении условий и в порядке, указанном в статье 24 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, и/или предпринимает действия, предусмотренные статьей 26 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

РАЗДЕЛ IV. ПОРЯДОК И УСЛОВИЯ ДОПУСКА ОБЯЗАТЕЛЬСТВ К КЛИРИНГУ

ПОДРАЗДЕЛ IV-I. ПОРЯДОК ЗАКЛЮЧЕНИЯ ВНЕБИРЖЕВЫХ СДЕЛОК С ЦЕННЫМИ БУМАГАМИ

Статья 17. Возможность заключения Внебиржевых сделок с ценными бумагами

17.1. Клиринговый центр составляет и утверждает список предметов обязательств из Внебиржевых сделок с ценными бумагами (далее – Список). Список раскрывается на Сайте Клирингового центра.

17.2. Условия Внебиржевых сделок с ценными бумагами соответствуют условиям сделок купли-продажи ценных бумаг с соответствующим кодом расчетов, определенным Правилами торгов на фондовом рынке и рынке депозитов, порядок заключения и исполнения Внебиржевых сделок с ценными бумагами определен Правилами клиринга.

17.3. Клиринговый центр принимает решение о ценных бумагах, с которыми возможно заключение Внебиржевых сделок с ценными бумагами.

17.4. Информация о ценных бумагах, с которыми возможно заключение Внебиржевых сделок с ценными бумагами, раскрывается на Сайте Клирингового центра.

17.5. С момента вступления в силу Списка и решения, указанного в пункте 17.3 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, допускается заключение Внебиржевых сделок с ценными бумагами, отвечающим условиям, указанным в решении, принятом в соответствии с пунктом 17.3 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, и осуществление клиринга по Внебиржевым сделкам с указанными ценными бумагами на основании Правил клиринга.

17.6. Клиринговый центр вправе установить Верхнюю и Нижнюю границу ценового коридора для ценной бумаги, с которой возможно заключение Внебиржевых сделок с ценными бумагами.

Статья 18. Порядок заключения Внебиржевых сделок с ценными бумагами

18.1. Участники клиринга вправе заключать Внебиржевые сделки с ценными бумагами в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов:

- от своего имени и за свой счет;
- от своего имени и за счет своего клиента.

18.2. При заключении Внебиржевых сделок с ценными бумагами с Участниками клиринга Клиринговый центр осуществляет функции центрального контрагента.

18.3. В целях заключения Внебиржевой сделки с ценными бумагами Участник клиринга подает в Клиринговую систему Предложение, являющееся офертой на заключение Внебиржевой сделки с ценными бумагами. Предложение Участника клиринга адресовано Клиринговому центру.

18.4. Предложения подаются Участниками клиринга с использованием Подсистемы индикации интереса и формирования котировок инструментов Информационной системы MOEX Board Биржи (далее для целей настоящей статьи – OTC-система) в соответствии с Правилами клиринга и Правилами Информационной системы MOEX Board Публичного акционерного общества «Московская Биржа ММВБ-РТС». Предложение, подаваемое с использованием OTC-системы, считается поданным в Клиринговую систему с момента регистрации в Клиринговой системе.

18.5. Предложение формируется как электронный документ, подписанный АСП Участника клиринга. Такие электронные документы, подписанные АСП Участника клиринга, признаются электронными документами, равнозначными документам на бумажном носителе, подписанным собственноручной подписью. Порядок использования АСП определен общей частью Правил клиринга.

18.6. Предложения могут подаваться в срок, установленный Временным регламентом на фондовом рынке и рынке депозитов.

18.6.1. Срок действия Предложения ограничен временем подачи Предложений и заключения Внебиржевых сделок с ценными бумагами, установленным Временным регламентом на фондовом рынке и рынке депозитов.

18.7. Предложение, подаваемое Участником клиринга, должно содержать:

- наименование (код) ценной бумаги;
- количество ценных бумаг;
- цену за одну ценную бумагу;
- код расчетов;
- Торгово-клиринговый счет 1-го, 2-го или 3-го уровня.

18.8. Предложение, подаваемое Участником клиринга, может содержать указание на Участника клиринга, Предложение которого может быть признано Предложением с совпадающими условиями, и/или иные условия Внебиржевой сделки с ценными бумагами, предусмотренные Правилами Информационной системы MOEX Board Публичного акционерного общества «Московская Биржа ММВБ-РТС».

18.9. После того, как информация о поданном Участником клиринга Предложении, направленном на заключение Внебиржевой сделки с ценными бумагами, стала доступной Клиринговому центру посредством Клиринговой системы, Клиринговый центр осуществляет проверку возможности регистрации такого Предложения следующим образом:

18.9.1. Клиринговый центр проверяет, что Предложение подано в отношении ценной бумаги, отвечающей условиям, указанным в решении, принятом в соответствии с пунктом 17.3 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов;

18.9.2. Клиринговый центр проверяет соответствие условий, указанных в Предложении, требованиям, установленным Правилами Информационной системы MOEX Board Публичного акционерного общества «Московская Биржа ММВБ-РТС» для Внебиржевой сделки с ценными бумагами с соответствующим кодом расчетов;

18.9.3. Клиринговый центр проверяет, что значение цены, указанной в Предложении, больше либо равно Нижней границе ценового коридора и меньше либо равно

Верхней границе ценового коридора, установленных Клиринговым центром в соответствии с пунктом 17.6 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов для ценной бумаги, по которой подано Предложение (в случае если такие границы ценового коридора установлены Клиринговым центром).

18.9.4. Клиринговый центр выполняет проверку прохождения Предложением Процедуры контроля обеспечения в порядке, аналогичном порядку, установленному статьей 20 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов для заявок на заключение сделок с соответствующим кодом расчетов.

18.10. При положительном результате всех проверок, указанных в пункте 18.9 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, Клиринговый центр регистрирует в Клиринговой системе полученное Предложение. При отрицательном результате хотя бы одной из указанных проверок, Клиринговый центр направляет Участнику клиринга отказ в регистрации Предложения.

18.10.1. Клиринговый центр может направить Участнику клиринга отказ в регистрации Предложения в иных случаях, установленных Правилами клиринга.

18.10.2. При регистрации в Клиринговой системе полученного Предложения, Клиринговый центр начинает учитывать значения Единого лимита по Расчетному коду, Единого лимита по Расчетному коду 2-го уровня и/или Единого лимита по Расчетному коду 3-го уровня, рассчитанные при проверке возможности регистрации Предложения, в качестве новых значений Единого лимита по таким Расчетным кодам соответствующего уровня.

18.11. Участник клиринга имеет право отозвать поданное в Клиринговую систему Предложение до момента заключения Внебиржевой сделки с ценными бумагами на основании такого Предложения.

18.11.1. При отзыве Предложения Участником клиринга Клиринговый центр рассчитывает Единый лимит по Расчетному коду, Единый лимит по Расчетному коду 2-го уровня и/или Единый лимит по Расчетному коду 3-го уровня, входящему в состав Торгово-клирингового счета 1-го, 2-го или 3-го уровня, указанному в Предложении, и/или соответствующему Торгово-клиринговому счету 2-го или 3-го уровня, указанному в Предложении, без учета такого Предложения.

18.12. В случаях, установленных Правилами клиринга, Клиринговый центр вправе удалить из Клиринговой системы Предложения, поданные Участником клиринга.

18.13. Немедленно после регистрации в Клиринговой системе Предложения, поданного Участником клиринга, Клиринговый центр осуществляет проверку наличия Предложений Участников клиринга, имеющих совпадающие условия.

18.14. Предложениями, имеющими совпадающие условия, являются Предложения противоположной направленности со следующими одинаковыми условиями:

- наименование (код) ценной бумаги;
- количество ценных бумаг;
- цена за одну ценную бумагу;
- код расчетов;
- Предложение подано Участником клиринга, указанным в качестве Участника клиринга, Предложение которого может быть признано Предложением с

совпадающими условиями (в случае указания).

18.15. При наличии Предложений, поданных Участниками клиринга и имеющих совпадающие условия, акцептом Предложений (оферт) со стороны Клирингового центра является внесение в реестр Внебиржевых сделок двух Внебиржевых сделок с ценными бумагами с данными Участниками клиринга. Момент отображения в Клиринговой системе информации из реестра Внебиржевых сделок о двух Внебиржевых сделках с ценными бумагами с данными Участниками клиринга считается моментом получения такими Участниками клиринга – оферентами акцепта Клирингового центра на заключение Внебиржевой сделки с ценными бумагами на условиях, соответствующих условиям Предложений, имеющих совпадающие условия, является моментом достижения между Участником клиринга и Клиринговым центром соглашения о существенных условиях сделки, и моментом заключения Внебиржевых сделок с ценными бумагами между Участниками клиринга и Клиринговым центром.

Местом заключения такой сделки является город Москва Российской Федерации.

18.15.1. Информация о заключении Внебиржевых сделок с ценными бумагами передается Клиринговым центром в ОТС-систему.

18.16. При заключении Внебиржевой сделки с ценными бумагами с Участником клиринга Клиринговый центр:

- присваивает заключенной Внебиржевой сделке с ценными бумагами номер;
- рассчитывает Единый лимит по Расчетному коду, Единый лимит по Расчетному коду 2-го уровня и/или Единый лимит по Расчетному коду 3-го уровня, входящему в состав Торгово-клирингового счета 1-го, 2-го или 3-го уровня, указанного в Предложении, и/или соответствующему Торгово-клиринговому счету 2-го или 3-го уровня, указанному в Предложении, на основании которого заключена Внебиржевая сделка с ценными бумагами, без учета такого Предложения и с учетом заключенной Внебиржевой сделки с ценными бумагами;
- допускает к клирингу обязательства по заключенной Внебиржевой сделке с ценными бумагами;
- по Внебиржевой сделке с ценными бумагами, заключенной с указанием Торгово-клирингового счета Участника клиринга, изменяет с учетом заключенной Внебиржевой сделки с ценными бумагами Нетто-обязательство и/или Нетто-требование Участника клиринга по ценным бумагам / денежным средствам, учитываемое по Торгово-клиринговому счету, указанному в Предложении / Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета Участника клиринга, указанного в Предложении, на основании которого заключена Внебиржевая сделка с ценными бумагами, с Датами исполнения, соответствующими Дате (Датам) исполнения обязательств по заключенной Внебиржевой сделке с ценными бумагами;
- по Внебиржевой сделке с ценными бумагами, заключенной с указанием Торгово-клирингового счета 2-го уровня, изменяет с учетом заключенной Внебиржевой сделки с ценными бумагами Нетто-обязательство и/или Нетто-требование по ценным бумагам / денежным средствам, учитываемое по Торгово-клиринговому счету 2-го уровня, указанному в Предложении / Расчетному коду 2-го уровня, входящему в состав Торгово-клирингового

счета 2-го уровня, указанного в Предложении, и Нетто-обязательство и/или Нетто-требование по ценным бумагам / денежным средствам, учитываемое по Торгово-клиринговому счету Участника клиринга, соответствующему Торгово-клиринговому счету 2-го уровня, указанному в Предложении / Расчетному коду, соответствующему Торгово-клиринговому счету 2-го уровня, указанному в Предложении, на основании которого заключена Внебиржевая сделка с ценными бумагами, с Датами исполнения, соответствующими Дате (Датам) исполнения обязательств по заключенной Внебиржевой сделке с ценными бумагами;

- по Внебиржевой сделке с ценными бумагами, заключенной с указанием Торгово-клирингового счета 3-го уровня, изменяет с учетом заключенной Внебиржевой сделки с ценными бумагами Нетто-обязательство и/или Нетто-требование по ценным бумагам / денежным средствам, учитываемое по Торгово-клиринговому счету 3-го уровня, указанному в Предложении / Расчетному коду 3-го уровня, входящему в состав Торгово-клирингового счета 3-го уровня, указанного в Предложении, и Нетто-обязательство и/или Нетто-требование по ценным бумагам / денежным средствам, учитываемое по Торгово-клиринговому счету Участника клиринга / Торгово-клиринговому счету 2-го уровня, соответствующему Торгово-клиринговому счету 3-го уровня, указанному в Предложении / Расчетному коду / Расчетному коду 2-го уровня, соответствующему Торгово-клиринговому счету 3-го уровня, указанному в Предложении, на основании которого заключена Внебиржевая сделка с ценными бумагами, с Датами исполнения, соответствующими Дате (Датам) исполнения обязательств по заключенной Внебиржевой сделке с ценными бумагами.

18.17. Клиринговый центр ведет реестр Предложений, поданных Участниками клиринга и Клиринговым центром, и реестр Внебиржевых сделок с ценными бумагами, заключенных с Участниками клиринга.

ПОДРАЗДЕЛ IV-II. ПОРЯДОК ВЗАИМОДЕЙСТВИЯ С БИРЖЕЙ ПРИ ЗАКЛЮЧЕНИИ СДЕЛОК

Статья 19. Порядок взаимодействия с Биржей при подаче заявок и заключении сделок, допуске к клирингу обязательств по биржевым сделкам и обязательств по внесению компенсационных взносов

19.1. При подаче Участником торгов заявки, Биржа с использованием Системы торгов направляет Клиринговому центру информацию о поданной заявке.

19.2. Немедленно после получения информации о поданной заявке Клиринговый центр проверяет возможность регистрации заявки в Системе торгов.

Регистрация заявки в Системе торгов является возможной при выполнении одновременно следующих условий:

1) активного состояния[1] в Клиринговой системе Торгово-клирингового счета, указанного в заявке;
2) для заявок на заключение сделок с кодом расчетов Yn, если значение цены, указанной в заявке, больше либо равно Нижней границе ценового коридора и меньше либо равно Верхней границе ценового коридора, установленных Клиринговым центром для ценной бумаги, по которой подана заявка;
3) для заявок на заключение сделок РЕПО с кодом расчетов T0/Yn, Ym/Yn, если значение ставки РЕПО, указанной в заявке, больше либо равно Нижней границе коридора ставок РЕПО и меньше либо равно Верхней границе коридора ставок РЕПО, установленных Клиринговым центром для ценной бумаги, по которой подана заявка;
4) прохождения заявкой Процедуры контроля обеспечения в соответствии со статьей 20 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, за исключением заявок на заключение сделок с кодом расчетов K0.

19.3. Процедура контроля обеспечения по сделкам с кодом расчетов T0, Z0, Rb, X0, Bn, B0-B30, Sn, K0 осуществляется по Торгово-клиринговому счету, указанному в заявке на заключение сделки, или по Расчетному коду / Счету обеспечения T0, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в заявке на заключение сделки.

19.3.1. Процедура контроля обеспечения по сделкам с кодом расчетом Yn, T0/Yn, Ym/Yn осуществляется по следующим Торгово-клиринговому счету T+ / Торгово-клиринговому счету имущественного пула и Расчетному коду:

- в случае если в заявке на заключение сделки указан Торгово-клиринговый счет T+, то по Торгово-клиринговому счету T+, указанному в заявке, и Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета T+, указанного в заявке;

[1] Активное состояние торгово-клирингового счета в Клиринговой системе определяется в соответствии с Регламентом клиринга («А» - торгово-клиринговый счет, по которому проводятся операции).

- в случае если в заявке на заключение сделки указан Торгово-клиринговый счет, в состав которого входят Раздел Т0 и/или Счет обеспечения Т0, то по Торгово-клиринговому счету Т+, связанному с Торгово-клиринговым счетом, указанным в заявке, и по Расчетному коду, входящему в состав такого Торгово-клирингового счета Т+;
- в случае если в заявке на заключение сделки указан Торгово-клиринговый счет имущественного пула, то по такому Торгово-клиринговому счету имущественного пула и по Расчетному коду, входящему в состав такого Торгово-клиринговый счет имущественного пула;
- по заявке на заключение депозитного договора - по Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в заявке.

19.3.2. Контроль достаточности обеспечения для исполнения обязательств по уплате оборотных частей комиссионных вознаграждений при подаче заявки осуществляется по Расчетному коду для списания комиссионных вознаграждений, порядок определения которого установлен общей частью Правил клиринга.

19.4. При выполнении условий, указанных в пункте 19.2 настоящей статьи, Клиринговый центр с использованием Системы торгов направляет Бирже Отчет о возможности регистрации заявки, при невыполнении хотя бы одного из условий, указанных в пункте 19.2 настоящей статьи, - Отчет о невозможности регистрации заявки.

Отчет о невозможности регистрации заявки может быть направлен Клиринговым центром Бирже в иных случаях, установленных Правилами клиринга.

19.5. При снятии в Системе торгов заявки с любым кодом расчетов, за исключением кода расчетов К0, Биржа с использованием Системы торгов направляет Клиринговому центру Уведомление о снятии заявки.

19.5.1. После получения Уведомления о снятии заявки на заключение сделки с кодом расчетов Yn, T0/Yn, Ym/Yn, поданной Участником торгов, стороной которой будет являться Участник клиринга, Клиринговый центр рассчитывает Единый лимит по соответствующему Расчетному коду / Расчетному коду имущественного пула без учета отозванной заявки.

19.6. При регистрации в Системе торгов заявки, являющейся в соответствии с Правилами торгов на фондовом рынке и рынке депозитов допустимой встречной по отношению к ранее зарегистрированной в Системе торгов заявке на заключение сделок с Клиринговым центром, Клиринговый центр заключает сделку с каждым из Участников клиринга, указанным в заявке в качестве стороны по сделке (за исключением заявок на заключение сделок с кодом расчетов К0 и заявок на заключение депозитного договора).

19.7. Заключение сделок с кодом расчетов К0 осуществляется Клиринговым центром только по допустимым встречным заявкам, прошедшим Процедуру контроля обеспечения, с каждым из Участников клиринга, указанным в таких заявках в качестве стороны сделки.

Процедура контроля обеспечения по заявкам на заключение сделок с кодом расчетов К0 осуществляется на основании Запроса о возможности заключения сделок, полученного от Биржи, немедленно после его получения.

19.8. При регистрации в Системе торгов заявки на заключение сделки РЕПО с кодом расчетов Ym/Yn и заявки на заключение депозитного договора, являющихся в соответствии с Правилами торгов на фондовом рынке и рынке депозитов допустимыми встречными заявками, Клиринговый центр заключает сделку РЕПО с кодом расчетов Ym/Yn с Участником клиринга, указанным в заявке на заключение такой сделки РЕПО в качестве стороны по сделке, и принимает на себя обязательство по обеспечению условий для заключения депозитного договора, указанное в Правилах торгов на фондовом рынке и рынке депозитов. Заявки, по которым Клиринговый центр принял обязательства по обеспечению условий для заключения депозитного договора, вносятся Биржей в реестр предложений в порядке, установленном Правилами торгов на фондовом рынке и рынке депозитов.

19.8.1. Обязательство Клирингового центра по обеспечению условий для заключения депозитного договора заключается в обязанности Клирингового центра включить в соответствующий клиринговый пул обязательства по депозитному договору, заключенному в период с плановой даты заключения депозитного договора по следующий Расчетный день на условиях и в порядке, предусмотренном Правилами торгов на фондовом рынке и рынке депозитов.

19.9. После того, как информация о регистрации сделки стала доступной Клиринговому центру посредством Системы торгов, Клиринговый центр допускает к клирингу обязательства по заключенной сделке.

19.9.1. После того, как информация о регистрации сделки купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов Т0, К0, сделки РЕПО с кодом расчетов Т0/Yn стала доступной Клиринговому центру посредством Системы торгов, Клиринговый центр также:

- включает в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов по сделкам с центральным контрагентом с ближайшим временем исполнения обязательства/требования Участников клиринга по оплате и передаче ценных бумаг по заключенной сделке с кодом расчетов Т0, К0 / первой части заключенной сделки РЕПО с кодом расчетов Т0/Yn;
- рассчитывает Единый лимит по соответствующему Расчетному коду / Расчетному коду имущественного пула без учета заявки (части заявки), на основании которой была заключена указанная сделка, и с учетом указанной заключенной сделки (для сделок, заключенных на основании заявок, поданных с указанием Торгово-клирингового счета Т+ / Торгово-клирингового счета имущественного пула).

19.9.2. После того, как информация о регистрации сделки РЕПО с кодом расчетов Rb стала доступной Клиринговому центру посредством Системы торгов, Клиринговый центр также:

- включает в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов с ближайшим временем исполнения обязательства / требования Участников клиринга по оплате и передаче ценных бумаг по первой части заключенной сделки РЕПО.

19.9.3. После того, как информация о регистрации сделки с кодом расчетов Yn, Nn, T0/Yn, Ym/Yn стала доступной Клиринговому центру посредством Системы торгов, Клиринговый центр также:

- рассчитывает Единый лимит по соответствующему Расчетному коду / Расчетному коду имущественного пула без учета заявки (части заявки), на основании которой была заключена указанная сделка, и с учетом указанной заключенной сделки;
- изменяет с учетом заключенной сделки Нетто-обязательство и/или Нетто-требование Участника клиринга по денежным средствам в российских рублях / иностранной валюте и по ценным бумагам с Датами исполнения, соответствующими Дате (Датам) исполнения обязательств по заключенной сделке с кодом расчетов Yn, Ym/Yn, по второй части заключенной сделки РЕПО с кодом расчетов T0/Yn, по соответствующему Расчетному коду (для денежных средств) и/или по соответствующему Торгово-клиринговому счету T+ / Торгово-клиринговому счету имущественного пула (для ценных бумаг).

19.9.4. После того, как информация о внесении в реестр предложений заявки на заключение депозитного договора стала доступной Клиринговому центру посредством Системы торгов, Клиринговый центр также:

- рассчитывает Единый лимит по соответствующему Расчетному коду без учета поданной заявки (части заявки) на заключение депозитного договора, и с учетом заявки (части заявки) на заключение депозитного договора, внесенной в реестр предложений;
- изменяет с учетом заявки (части заявки) на заключение депозитного договора, внесенной в реестр предложений, Нетто-обязательство и/или Нетто-требование Участника клиринга по денежным средствам в российских рублях с Датами исполнения, соответствующими плановой дате заключения депозитного договора и дате возврата депозита, указанным в такой заявке, по соответствующему Расчетному коду.

19.10. После того, как информация о регистрации сделки с кодом расчетов Z0, X0 стала доступной Клиринговому центру посредством Системы торгов, Клиринговый центр также:

- включает в Клиринговый пул для расчетов в ходе торгов обязательства/требования Участников клиринга по оплате и передаче ценных бумаг по заключенной сделке (первой части заключенной сделки РЕПО) с кодом расчетов Z0, X0;
- рассчитывает Единый лимит по соответствующему Расчетному коду без учета заявки (части заявки), на основании которой была заключена указанная сделка, и с учетом указанной заключенной сделки (для сделок, заключенных на основании заявок, поданных с указанием Торгово-клирингового счета T+);
- осуществляет взаимодействия с Расчетным депозитарием с целью проведения расчетов в ходе торгов по заключенной сделке (первой части заключенной сделки РЕПО) с кодом расчетов Z0, X0. Взаимодействие с Расчетным депозитарием с целью проведения расчетов по сделке с кодом расчетов X0 осуществляется с учетом требования, установленного подпунктом 44.3.1 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

Статья 20. Процедура контроля обеспечения по сделкам

20.1. Процедура контроля обеспечения, осуществляемая при подаче заявок на заключение биржевых сделок, за исключением заявок, дата активации которых не наступила, считается пройденной в следующих случаях:

20.1.1. Для заявки на покупку ценных бумаг с кодом расчетов T0, Z0, Rb, X0, Процедура контроля обеспечения по которой осуществляется по Счету обеспечения T0, в случае, если сумма сделки, которая может быть заключена на основании поданной заявки, включая НКД, не превышает суммы денежных средств, учитываемых по такому Счету обеспечения T0.

Для заявок на заключение сделок РЕПО, проверка, указанная в настоящем подпункте Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, осуществляется для первой части сделки РЕПО.

20.1.2. Для заявки на покупку ценных бумаг с кодом расчетов T0, Z0, Rb, X0, Процедура контроля обеспечения по которой осуществляется по Расчетному коду, соответствующему Счету обеспечения, в случае если сумма сделки, которая может быть заключена на основании поданной заявки, включая НКД, не превышает максимального из двух значений: (1) значения Обеспечения в соответствующей валюте, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, уменьшенного на сумму обязательства с отложенным исполнением в такой валюте, определенного в соответствии с общей частью Правил клиринга; (2) суммы (с учетом знака) значения Обеспечения, уменьшенного на сумму обязательства с отложенным исполнением в такой валюте, определенного в соответствии с общей частью Правил клиринга, и Нетто-обязательства / Нетто-требования по денежным средствам в соответствующей валюте с текущей Датой исполнения, рассчитанного по Сделкам T+, учитываемых по соответствующему Расчетному коду.

Для заявок на заключение сделок РЕПО, проверка, указанная в настоящем подпункте Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, осуществляется для первой части сделки РЕПО.

20.1.3. Для заявки на продажу ценных бумаг с кодом расчетов T0, Rb в случае, если количество ценных бумаг, указанное в заявке, не превышает количества ценных бумаг, учитываемого по соответствующему Торгово-клиринговому счету.

Для заявок на заключение сделок РЕПО, проверка, указанная в настоящем подпункте Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, осуществляется для первой части сделки РЕПО.

20.1.4. Для заявки на продажу ценных бумаг с кодом расчетов Z0, X0 в случае, если количество ценных бумаг, указанное в заявке, не превышает количества ценных бумаг, учитываемого по соответствующему Торгово-клиринговому счету, и количества ценных бумаг, учитываемых на соответствующем Разделе T0 или Разделе T+ по информации, полученной от Расчетного депозитария.

20.1.5. Для заявок на покупку или продажу ценных бумаг с кодом расчетов T0, Rb, Z0, X0 на заключение сделки, Процедура контроля обеспечения по которой осуществляется по Расчетному коду, соответствующему Счету обеспечения, или по Торгово-клиринговому счету T+, дополнительно к условиям, указанным в подпунктах 20.1.1-20.1.4 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, проверяется достаточность Единого лимита по такому Расчетному коду для подачи

заявки и достаточность Единого лимита по Расчетному коду для исполнения обязательств по уплате оборотных частей комиссионных вознаграждений в соответствии с подпунктом 20.1.9 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов. При этом сумма операции, в отношении которой осуществляется указанная проверка, определяется в соответствии с подпунктами 20.1.1-20.1.4 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

20.1.6. Для заявок на покупку или продажу ценных бумаг с кодом расчетов T0, Rb, Z0, X0 на заключение сделки, Процедура контроля обеспечения по которой осуществляется по Расчетному коду Единого пула, соответствующему Счету обеспечения, или по Торгово-клиринговому счету T+, в состав которого входит Расчетный код Единого пула, дополнительно к условиям, указанным в подпунктах 20.1.1-20.1.5 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, в случае положительного результата дополнительной проверки Единого лимита, указанной в общей части Правил клиринга.

Для заявок на заключение сделок РЕПО, проверка, указанная в настоящем подпункте Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, осуществляется для первой части сделки РЕПО.

20.1.7. Для заявки на покупку или на продажу с кодом расчетов Yn, Ym/Yn, для заявки на заключение депозитного договора с кодом расчетов Ym/Yn, в случае достаточности Единого лимита по соответствующему Расчетному коду / Расчетному коду имущественного пула для подачи заявки и достаточности Единого лимита по Расчетному коду для исполнения обязательств по уплате оборотных частей комиссионных вознаграждений в соответствии с подпунктом 20.1.9 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

20.1.8. Для заявки на покупку или продажу ценных бумаг с кодом расчетов T0/Yn в случае прохождения проверки в соответствии с подпунктом 20.1.1, 20.1.2 или 20.1.3 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов и проверки в соответствии с подпунктом 20.1.7 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

20.1.9. Единый лимит по Расчетному коду / Расчетному коду имущественного пула является достаточным для подачи заявки при условии, что значение Единого лимита по Расчетному коду / Расчетному коду имущественного пула с учетом обязательств по Сделке и обязательств по уплате оборотных частей комиссионных вознаграждений по Сделке, которая может быть заключена на основании поданной заявки, не станет отрицательным, или, если Единый лимит по такому Расчетному коду / Расчетному коду имущественного пула был отрицательным до момента подачи заявки, при условии, что Единый лимит по такому Расчетному коду / Расчетному коду имущественного пула, рассчитанный с учетом обязательств по Сделке, которая может быть заключена на основании поданной заявки, не станет меньше, чем Единый лимит по этому Расчетному коду / Расчетному коду имущественного пула, рассчитанный до момента подачи заявки.

Единый лимит по Расчетному коду является достаточным для исполнения обязательств по уплате оборотных частей комиссионных вознаграждений по Сделке, которая может быть заключена на основании поданной заявки, при условии, что значение Единого лимита по Расчетному коду с учетом указанных обязательств не станет отрицательным.

Проверка достаточности Единого лимита по Расчетному коду для исполнения обязательств по уплате оборотных частей комиссионных вознаграждений не

осуществляется при подаче заявок, приводящих к увеличению Единого лимита по Расчетному коду.

20.1.10. Для заявки на покупку ценных бумаг с кодом расчетов Yn, T0/Yn, Ym/Yn и для заявки на заключение депозитного договора с кодом расчетов Ym/Yn на заключение Сделки Т+, по которой должен осуществляться клиринг с полным обеспечением по денежным средствам, дополнительно к проверке условий, указанных в подпункте 20.1.7 или подпункте 20.1.8 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, и для заявки на покупку ценных бумаг с кодом расчетов T0, Rb, Z0, X0 на заключение сделки, Процедура контроля обеспечения по которой осуществляется по Расчетному коду, соответствующему Счету обеспечения, дополнительно к проверке условий, указанных в подпунктах 20.1.1 и 20.1.5 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, Клиринговый центр проверяет, что значения в валюте, в которой проводятся расчеты по Сделке, рассчитанные в соответствии с общей частью Правил клиринга для проверки возможности исполнения операции, проводимой по Торгово-клиринговому счету Участника клиринга при наличии признака «запрет необеспеченных покупок» / «запрет коротких продаж», и/или Участника клиринга категории «В», с учетом обязательства в соответствующей валюте по Сделке, которая может быть заключена на основании поданной заявки, для каждой Даты исполнения не станут отрицательными.

20.1.11. Для заявки на продажу ценных бумаг с кодом расчетов Yn, T0/Yn, Ym/Yn на заключение Сделки Т+, по которой должен осуществляться клиринг с полным обеспечением по ценным бумагам, дополнительно к проверке условий, указанных в подпункте 20.1.7 или подпункте 20.1.8 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, и для заявки на продажу ценных бумаг с кодом расчетов T0, Rb, Z0, X0 на заключение сделки, Процедура контроля обеспечения по которой осуществляется по Торгово-клиринговому счету Т+, дополнительно к проверке условий, указанных в подпунктах 20.1.3-20.1.4 и подпункте 20.1.5 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, Клиринговый центр проверяет, что значения в ценных бумагах, рассчитанные в соответствии с общей частью Правил клиринга для проверки возможности исполнения операции, проводимой по Торгово-клиринговому счету Участника клиринга при наличии признака «запрет необеспеченных покупок» / «запрет коротких продаж», и/или Участника клиринга категории «В», и/или ценных бумаг с признаком «запрет коротких продаж», с учетом обязательства в соответствующих ценных бумагах по Сделке, которая может быть заключена на основании поданной заявки, для каждой Даты исполнения не станут отрицательными:

20.1.12. Для заявки на покупку ценных бумаг с кодом расчетов T0, Rb, Z0, X0 на заключение сделок с расчетами в российских рублях и заявки на покупку или продажу ценных бумаг с кодом расчетов T0, Rb, Z0, X0 на заключение сделок с расчетами в иностранной валюте, дополнительно к проверке условий, указанных в подпунктах 20.1.1-20.1.5 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, а также для заявки на покупку или на продажу с кодом расчетов Bn, B0-B30 или Sn, Процедура контроля обеспечения по которым осуществляется по Счету обеспечения T0, проверяется наличие денежных средств, учитываемых по такому Счету обеспечения T0, необходимых для исполнения обязательства по уплате комиссионного вознаграждения по сделке, которая может быть заключена на основании поданной заявки.

20.1.13. Для заявок с кодом расчетов T0, Z0, Rb, X0, Bn, B0-B30 или Sn проверки, указанные в подпунктах 20.1.1-20.1.5, Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, осуществляются с учетом Ограничительного лимита, установленного по соответствующему Счету обеспечения Т0 / Торгово-клиринговому счету.

20.1.14. Проверки, указанные в подпунктах 20.1.1-20.1.12 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, осуществляются с учетом поданной заявки, по которой осуществляется проверка, а также с учетом иных поданных заявок такой же направленности, а также зарегистрированных и не обеспеченных средствами под расчеты Отчетов на исполнение (Специальных отчетов на исполнение, Срочных отчетов на исполнение) такой же направленности, приводящих к изменению информации о денежных средствах / ценных бумагах, учитываемых по тому же клиринговому регистру, что и проверяемая заявка.

20.1.15. Для заявок на покупку ценных бумаг, поданных Участником клиринга категории «А», проверки, указанные в подпунктах 20.1.1, 20.1.5-20.1.8, 20.1.12, 20.1.13 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, не осуществляются.

Для заявок на продажу ценных бумаг, поданных Участником клиринга категории «А», проверка, указанная в подпункте 20.1.3 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, осуществляется только в случае принятия Участником клиринга категории «А» на себя обязательств по внесению индивидуального клирингового обеспечения в ценных бумагах.

20.1.16. Для заявок на заключение депозитного договора, поданных Участником клиринга категории «К», проверки, предусмотренные настоящей статьей Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, не осуществляются.

20.2. В случае прохождения заявки на покупку или на продажу Процедуры контроля обеспечения, в ходе которой осуществлялась проверка достаточности Единого лимита по Расчетному коду / Расчетному коду имущественного пула, Клиринговый центр начинает учитывать значение Единого лимита по соответствующему Расчетному коду / Расчетному коду имущественного пула, рассчитанное в соответствии с подпунктом 20.1.9 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, в качестве нового значения Единого лимита по Расчетному коду / Расчетному коду имущественного пула, в случае непрохождения – Клиринговый центр не изменяет учитываемое значение Единого лимита по Расчетному коду / Расчетному коду имущественного пула.

20.3. Для заявок с отложенной датой активации Процедура контроля обеспечения в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов осуществляется в дату активации во время, установленное Временным регламентом на фондовом рынке и рынке депозитов (далее – основная Процедура контроля обеспечения).

20.4. Для заявок с отложенной датой активации на условиях «Частичное обеспечение/отступное» осуществляется дополнительная Процедура контроля обеспечения при подаче такой заявки или в иной момент, установленный решением Биржи. Указанная процедура считается пройденной при соблюдении следующих условий:

- для заявок на покупку: сумма частичного обеспечения в денежных средствах,

рассчитанная как произведение размера ставки частичного обеспечения и объема заявки, включающего НКД, не превышает суммы Обеспечения, учитываемого по соответствующему Расчетному коду;

- для заявок на продажу: при условии достаточности Единого лимита по соответствующему Расчетному коду с учетом суммы частичного обеспечения в денежных средствах, рассчитанной как произведение размера ставки частичного обеспечения и объема заявки;
- при условии достаточности Единого лимита по Расчетному коду для исполнения обязательств по уплате оборотных частей комиссионных вознаграждений в соответствии с подпунктом 20.1.9 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов;
- при выполнении условия, указанного в подпункте 20.1.10 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, для указанной суммы частичного обеспечения.

Информацию о размере ставки частичного обеспечения Клиринговый центр получает от Биржи посредством Системы торгов.

20.4.1. В случае непрохождения заявки с отложенной датой активации на условиях «Частичное обеспечение/отступное» основной Процедуры контроля обеспечения Клиринговый центр включает в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов с ближайшим временем исполнения обязательство по уплате / требования по получению отступного за отказ от исполнения обязательств по заключению сделки на основании заявки с отложенной датой активации на условиях «Частичное обеспечение/отступное», величина которого определяется в соответствии с пунктом 27.17 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов (далее – отступное за отказ от заключения сделки).

20.5. Процедура контроля обеспечения, осуществляемая при заключении биржевых сделок с ценными бумагами с кодом расчетов К0, считается пройденной в следующих случаях:

20.5.1. Для сделки, заключенной на основании заявки на покупку, в случае если сумма сделки, включая НКД, не превышает суммы денежных средств, учитываемых по соответствующему Расчетному коду, а также в случае прохождения соответствующих проверок, указанных в подпунктах 20.1.5, 20.1.10, 20.1.12, 20.1.13 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

20.5.2. Для сделки, заключенной на основании заявки на продажу, в случае если количество ценных бумаг в сделке не превышает количества ценных бумаг, учитываемого по соответствующему Торгово-клиринговому счету, а также в случае прохождения соответствующих проверок, указанных в подпунктах 20.1.5, 20.1.11, 20.1.12, 20.1.13 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

ПОДРАЗДЕЛ IV-III. ОСОБЕННОСТИ ОПРЕДЕЛЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ ПО СДЕЛКАМ

Статья 21. Особенности определения обязательств по сделкам РЕПО и порядок определения обязательств по уплате компенсационного взноса

21.1. Если решением Клирингового центра не определен иной порядок и срок изменения Суммы РЕПО при начислении в течение срока сделки РЕПО купонного (процентного) дохода по облигациям и/или погашения части основного долга (проведения амортизационной выплаты) по облигациям, то при выплате в течение срока сделки РЕПО, заключенной без участия центрального контрагента, купонного (процентного) дохода по облигациям и/или погашения части основного долга (проведения амортизационной выплаты) по облигациям, Сумма РЕПО уменьшается на величину уплаченного купонного (процентного) дохода и/или на величину погашенной части основного долга (амортизационной выплаты) с даты получения Клиринговым центром от Платежного агента по облигациям, в сроки и в порядке определенным соглашением с Платежным агентом по облигациям, информации о проведении выплаты начисленного купонного (процентного) дохода и/или погашенной части основного долга (проведения амортизационной выплаты).

21.1.1. Если у Клирингового центра отсутствует соглашение с Платежным агентом по облигациям, предусматривающее передачу информации о выплатах доходов по облигациям, то уменьшение Суммы РЕПО проводится в плановую дату выплаты.

Если плановая дата выплаты купонного (процентного) дохода по облигациям и/или погашения части основного долга (проведения амортизационной выплаты) по облигациям, учет выплат по которым производится согласно плановым датам, приходится на нерабочий день, уменьшение Суммы РЕПО проводится в первый рабочий день после плановой даты выплаты (если решением Клирингового центра не предусмотрено иное).

21.1.2. При отсутствии в течение срока сделки РЕПО по сделке выплат купонных (процентных) доходов и погашения части основного долга (проведение амортизационной выплаты) Сумма РЕПО остается неизменной (за исключением случая внесения компенсационных взносов в денежной форме).

21.1.3. В случае получения Клиринговым центром информации о проведении выплаты купонного (процентного) дохода по облигациям и/или погашения части основного долга (проведения амортизационной выплаты) в дату, отличную от фактической даты проведения выплаты купонного (процентного) дохода по облигациям и/или погашения части основного долга (проведения амортизационной выплаты), урегулирование взаимоотношений, связанных с уменьшением (неуменьшением) Суммы РЕПО осуществляется в порядке, установленном соглашением, заключенным между Участниками клиринга, являющимися сторонами по сделке РЕПО.

21.1.4. Если решением Клирингового центра не определено иное, Сумма РЕПО в сделках РЕПО, заключенных с облигациями в Режимах торгов, определенных решением Биржей, уменьшается на величину начисленного купонного (процентного) дохода и/или на величину погашенной части основного долга (амортизационной выплаты) исходя из кросс-курса на дату начала следующего купонного периода по

облигациям, определенной эмиссионными документами (на дату получения от Платежного агента информации о выплате такого дохода, в случае получения Клиринговым центром соответствующей информации в порядке, определенным соглашением с Платежным агентом).

21.2. Если решением Клирингового центра или Правилами клиринга не предусмотрено иное, Участник клиринга - покупатель по первой части РЕПО обязан передать Участнику клиринга - продавцу по первой части РЕПО любые дивиденды, проценты или иное распределение на ценные бумаги, в отношении которых заключена сделка РЕПО, в течение 30 (тридцати) календарных дней, следующих за днем выплаты/передачи эмитентом таких дивидендов, процентов или иного распределения на ценные бумаги, в отношении которых заключена сделка РЕПО, если список лиц, имеющих право на их получение, определяется в период после исполнения обязательств по передаче ценных бумаг по первой части сделки РЕПО и до исполнения обязательств по передаче ценных бумаг по второй части сделки РЕПО. Стороны вправе дополнительным соглашением установить иной срок и (или) порядок передачи таких дивидендов, процентов или иного распределение на ценные бумаги, в отношении которых заключена сделка РЕПО, переданного эмитентом в неденежном виде.

21.3. По сделкам РЕПО, являющимися Сделками Т+, Участник клиринга - покупатель по первой части РЕПО обязан передать Участнику клиринга - продавцу по первой части РЕПО Доход на ценные бумаги, в отношении которых заключена сделка РЕПО, в порядке и сроки, определенные статьей 45 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, если список лиц, имеющих право на получение дивидендов, процентов или иного распределения, определяется в период после исполнения обязательств по передаче ценных бумаг по первой части сделки РЕПО и до исполнения обязательств по передаче ценных бумаг по второй части сделки РЕПО.

21.4. Для сделок РЕПО, заключенных без участия центрального контрагента, действуют следующие условия:

21.4.1. В случае уплаты Участником клиринга - продавцом по первой части сделки РЕПО Участнику клиринга - покупателю по первой части сделки РЕПО компенсационных взносов в денежной форме сумма РЕПО уменьшается на величину таких компенсационных взносов в дату их внесения. В случае отсутствия в течение срока РЕПО по сделке РЕПО компенсационных взносов в денежной форме (или в случае отказа от получения компенсационных взносов в соответствии с пунктом 30.7 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов) сумма РЕПО остается неизменной (за исключением случаев выплат купонных (процентных) доходов и погашения части основного долга (проведение амортизационной выплаты) по облигациям).

21.4.2. В случае внесения Участником клиринга - покупателем по первой части сделки РЕПО Участнику клиринга - продавцу по первой части сделки РЕПО компенсационных взносов в форме ценных бумаг, текущее количество ценных бумаг по сделке РЕПО (обязательство по второй части сделки РЕПО для покупателя перед продавцом по первой части сделки РЕПО) уменьшается на количество ценных бумаг, составляющих величину таких компенсационных взносов (на дату их внесения). Если внесения компенсационных взносов в форме

ценных бумаг не требуется, то текущее количество ценных бумаг по сделке РЕПО остается неизменным.

21.4.3. Если решением Клирингового центра не установлено иное, каждый Расчетный день, начиная с фактической даты исполнения обязательств по первой части сделки РЕПО (не включая эту дату) до фактической даты исполнения обязательств по второй части этой сделки РЕПО или до Даты прекращения исполнения этой сделки РЕПО (включая эту дату) в Клиринговой системе рассчитывается доход по сделке РЕПО и стоимость обратного выкупа по следующим формулам:

$$I_j = I_i + S_i * \frac{R_i}{100} * \left(\frac{T'_{365}}{365} + \frac{T'_{366}}{366} \right)$$

, где:

I_j - доход по сделке РЕПО в j-ый день;

I_i - доход по сделке РЕПО в i-ый день;

S_i - Сумма РЕПО в i-ый день;

R_i - Ставка РЕПО в i-ый день;

T'_{365} - фактическое число календарных дней между i-ым днем и текущим днем (j-ый день), приходящееся на календарный год, состоящий из 365 дней;

T'_{366} - фактическое число календарных дней между i-ым днем и текущим днем (j-ый день), приходящееся на календарный год, состоящий из 366 дней;

$S_{II}^j = S_j + I_j$, где

S_{II}^j - стоимость обратного выкупа в j-ый день:

S_j - Сумма РЕПО на конец текущего (j-ого) дня;

i-ый день – Дата исполнения обязательств по первой части сделки РЕПО либо дата последнего изменения перед текущим Расчетным (j-ым) днем следующих условий по сделке РЕПО: Сумма РЕПО и/или Ставка РЕПО;

Для внутридневных сделок РЕПО срок между датой заключения сделки и Датой исполнения принимается равным 1 (единице) для целей расчета стоимости обратного выкупа.

Для сделок РЕПО, заключенных в Режимах торгов «РЕПО с Банком России: Аукцион РЕПО», «РЕПО с Банком России: фикс.ставка» и «Аукцион РЕПО с Банком России: плавающая ставка», с Даты исполнения обязательств по второй части этой сделки РЕПО до фактической даты исполнения обязательств по второй части этой сделки РЕПО или до Даты прекращения исполнения этой сделки РЕПО доход по сделке РЕПО не рассчитывается.

Информация о рассчитанном размере дохода по сделке РЕПО с плавающей ставкой РЕПО, размере индикативной ставки, а также величине отклонения от индикативной ставки предоставляется Участникам клиринга в отчете, направляемом Клиринговым центром.

21.4.4. Размер НКД по сделке РЕПО на текущий j-ый день (раскрывается в Клиринговой системе информационно):

$A_{II}^{j} = N_j * A_{tj} * e_j / r_j + A_j$, где

N_j - количество ценных бумаг по сделке РЕПО текущего (j-ого) дня;

A_{tj} - размер НКД в j-ый день (при условии его расчета для данной ценной бумаги);

e_j - официальный курс иностранной валюты, в которой выражена номинальная стоимость ценной бумаги, по отношению к российскому рублю, устанавливаемый Банком России на день j. Для ценных бумаг, номинальная стоимость которых выражена в российских рублях, e_j принимается равным 1;

r_j - официальный курс иностранной валюты, в которой заключена сделка РЕПО с ценными бумагами, по отношению к российскому рублю, устанавливаемый Банком России на день j. Для сделок РЕПО с ценными бумагами, заключенных с расчетами в российских рублях, r_j принимается равным 1;

A_j - сумма НКД, рассчитанная на текущий день, по уплаченным бумагами компенсационным взносам (при условии его расчета для данной ценной бумаги):

$A_j = \sum_{i=0}^{j} (M_{oi} * A_{ti}) * e_i / r_i$, где

M_{oi} - компенсационный взнос в форме ценных бумаг в i-ый день;

A_{ti} - размер НКД в i-ый день (при условии его расчета для данной ценной бумаги);

e_i - официальный курс иностранной валюты, в которой выражена номинальная стоимость ценной бумаги, по отношению к российскому рублю, устанавливаемый Банком России на день i. Для ценных бумаг, номинальная стоимость которых выражена в российских рублях, e_j принимается равным 1;

r_i - официальный курс иностранной валюты, в которой заключена сделка РЕПО с ценными бумагами, по отношению к российскому рублю, устанавливаемый Банком России на день i. Для сделок РЕПО с ценными бумагами, заключенных с расчетами в российских рублях, r_j принимается равным 1.

21.5. Определение обязательств по внесению компенсационных взносов по сделкам РЕПО, заключенным без участия центрального контрагента в Режимах торгов, определенных решением Биржи, осуществляется в следующем порядке:

21.5.1. Если решением Клирингового центра не установлено иное, каждый день, в который проводятся торги, при условии проведения торгов по ценной бумаге, по которой заключена данная сделка РЕПО, начиная с Даты исполнения обязательств по первой части сделки РЕПО, условиями которой заданы максимальные и/или минимальные предельные значения дисконта, до Даты исполнения обязательств по второй части этой сделки РЕПО, или до Даты прекращения исполнения этой сделки РЕПО, в Клиринговой системе после расчета расчетной цены рассчитывается текущее значение дисконта :

$$Dt = \left(1 - \frac{\left(S_j + I_j\right)}{C_j}\right) * 100\%$$

, где

Dt - текущее значение дисконта;

S_j - Сумма РЕПО на начало текущего (j-ого) дня;

I_j - доход по сделке РЕПО в j-ый день;

$C_j = N_j * \left(P_j + At_j\right) * e_j / r_j$, где

C_j - рыночная стоимость ценных бумаг по сделке РЕПО текущего (j-го) дня;

N_j - количество ценных бумаг по сделке РЕПО текущего (j-ого) дня;

P_j - расчетная цена по одной ценной бумаге, определенная на начало текущего торгового дня, методика определения которой устанавливается Клиринговым центром, за исключением клиринговых сертификатов участия, по которым расчётная цена для сделок РЕПО устанавливается равной номинальной стоимости;

At_j - НКД по одной ценной бумаге текущего (j-го) дня (при условии его расчета для данной ценной бумаги);

e_j - официальный курс иностранной валюты, в которой выражена номинальная стоимость ценной бумаги, по отношению к российскому рублю, устанавливаемый Банком России на день j. Для ценных бумаг, номинальная стоимость которых выражена в российских рублях, e_j принимается равным 1;

r_j - официальный курс иностранной валюты, в которой заключена сделка РЕПО с ценными бумагами, по отношению к российскому рублю, устанавливаемый Банком России на день j. Для сделок РЕПО с ценными бумагами, заключенными с расчетами в российских рублях, r_j принимается равным 1.

В случае если расчетная цена не установлена, то расчет текущего значения дисконта не производится.

21.5.2. Если решением Клирингового центра не установлено иное, в Режимах торгов «РЕПО с Банком России: Аукцион РЕПО», «РЕПО с Банком России: фикс.ставка» и «Аукцион РЕПО с Банком России: плавающая ставка» каждый день, в который проводятся торги, при условии проведения торгов по ценной бумаге, по которой

заключена данная сделка РЕПО, начиная с Даты исполнения обязательств по первой части сделки РЕПО до Даты исполнения обязательств по второй части этой сделки РЕПО, или до Даты прекращения исполнения этой сделки РЕПО, в Клиринговой системе после расчета расчетной цены дополнительно к значениям, рассчитываемым в соответствии с пунктом 21.5.1 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, рассчитывается текущий дефицит маржи:

$$Ds = (S_j + I_j) - \left(1 - \frac{Dn}{100\%}\right) * N_j * (P_j + At_j) * e_j / r_j$$, где

Ds – текущий дефицит маржи;

S_j – Сумма РЕПО на начало текущего (j-ого) дня;

I_j – доход по сделке РЕПО в j-ый день;

N_j – количество ценных бумаг по сделке РЕПО текущего (j-ого) дня;

P_j – расчетная цена по одной ценной бумаге, определенная на начало текущего торгового дня, методика определения которой устанавливается Клиринговым центром, за исключением клиринговых сертификатов участия, по которым расчётная цена для сделок РЕПО устанавливается равной номинальной стоимости;

At_j – НКД по одной ценной бумаге текущего (j-го) дня (при условии его расчета для данной ценной бумаги);

e_j – официальный курс иностранной валюты, в которой выражена номинальная стоимость ценной бумаги, по отношению к российскому рублю, устанавливаемый Банком России на день j. Для ценных бумаг, номинальная стоимость которых выражена в российских рублях, e_j принимается равным 1;

r_j – официальный курс иностранной валюты, в которой заключена сделка РЕПО с ценными бумагами, по отношению к российскому рублю, устанавливаемый Банком России на день j. Для сделок РЕПО с ценными бумагами, заключенными с расчетами в российских рублях, r_j принимается равным 1;

В случае если расчетная цена по ценной бумаге не определена, то расчет текущего дефицита маржи не производится.

21.5.3. При превышении текущим значением дисконта величины максимального предельного значения дисконта у Участника клиринга - покупателя по первой части сделки РЕПО возникает обязательство по внесению в следующий Расчетный день компенсационного взноса в форме ценных бумаг (путем частичной предварительной поставки ценных бумаг по второй части сделки РЕПО). Если текущее значение дисконта становится меньше минимального предельного значения дисконта, у Участника клиринга - продавца по первой части сделки РЕПО возникает обязательство в следующий Расчетный день по внесению компенсационного взноса в денежной форме (путем частичной предварительной оплаты по второй части сделки РЕПО). Дополнительно в Режимах торгов «РЕПО с Банком России: Аукцион РЕПО», «РЕПО с Банком России: фикс.ставка» и

«Аукцион РЕПО с Банком России: плавающая ставка» Банком России определяется размер допустимого уровня переоценки в валюте расчетов по сделке РЕПО. В случае если значение текущего дефицита маржи меньше отрицательного значения допустимого уровня переоценки у Участника клиринга - покупателя по первой части сделки РЕПО возникает обязательство по внесению в следующий Расчетный день компенсационного взноса в форме ценных бумаг (путем частичной предварительной поставки ценных бумаг по второй части сделки РЕПО). При превышении значением текущего дефицита маржи допустимого уровня переоценки у Участника клиринга - продавца по первой части сделки РЕПО возникает обязательство в следующий Расчетный день по внесению компенсационного взноса в денежной форме (путем частичной предварительной оплаты по второй части сделки РЕПО). В случае одновременного возникновения более одного обязательства по внесению компенсационного взноса по одной сделке РЕПО, взимается только один компенсационный взнос.

21.5.4. Если решением Клирингового центра не определено иное, размер компенсационного взноса в денежной форме по сделке РЕПО, подлежащего внесению в текущий j-й день, $Md(j)$ рассчитывается по формуле:

$$Md(j) = (S_j + I_j) - C_j * \left(1 - \frac{Dn}{100\%}\right)$$, где

S_j – Сумма РЕПО на начало текущего (j-ого) дня;

I_j – доход по сделке РЕПО в j-ый день;

C_j – рыночная стоимость ценных бумаг по сделке РЕПО текущего (j-го) дня;

Dn – начальное значение дисконта.

21.5.5. Если решением Клирингового центра не определено иное, размер компенсационного взноса в форме ценных бумаг по сделке РЕПО, подлежащего внесению в текущий j-й день, *Mo(j)* рассчитывается по формуле:

$$Mo(j) = N_j - \text{int}\left\{\frac{(S_j + I_j)}{\left(1 - \frac{Dn}{100\%}\right) * (P_j + At_j) * e_j / r_j}\right\}$$, где

N_j – количество ценных бумаг по сделке РЕПО на начало текущего (j-ого) дня;

S_j – Сумма РЕПО на начало текущего (j-ого) дня;

I_j – доход по сделке РЕПО в j-ый день;

Dn – начальное значение дисконта;

At_j – НКД по одной ценной бумаге текущего (j-го) дня (при условии его расчета для данной ценной бумаги);

P_j – расчетная цена по одной ценной бумаге, определенная на начало текущего торгового дня, методика определения которой устанавливается Клиринговым центром, за исключением клиринговых сертификатов участия, по которым расчётная цена для сделок РЕПО устанавливается равной номинальной стоимости;

int{X} – функция выделения целой части значения X;

e_j – официальный курс иностранной валюты, в которой выражена номинальная стоимость ценной бумаги, по отношению к российскому рублю, устанавливаемый Банком России на день j. Для ценных бумаг, номинальная стоимость которых выражена в российских рублях, e_j принимается равным 1;

r_j – официальный курс иностранной валюты, в которой заключена сделка РЕПО с ценными бумагами, по отношению к российскому рублю, устанавливаемый Банком России на день j. Для сделок РЕПО с ценными бумагами, заключенных с расчетами в российских рублях, r_j принимается равным 1.

21.5.6. Порядок подачи поручений на внесение компенсационных взносов определен в статье 30 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, порядок исполнения обязательств по внесению компенсационных взносов – в разделе V-III Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

21.6. В случае если в Дату внесения компенсационного взноса Участник клиринга отказался от получения компенсационного взноса в соответствии с пунктом 30.7 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, то Участник клиринга – контрагент по сделке освобождается от уплаты компенсационного взноса. В случае если в Дату внесения компенсационного взноса компенсационный взнос не был внесен, и Участник клиринга не отказался от получения компенсационного взноса в соответствии с пунктом 30.7 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, то обязательство по уплате компенсационного взноса считается неисполненным и срок его исполнения не подлежит пролонгации. В этом случае Датой исполнения обязательств по второй части соответствующей сделки РЕПО является первый Расчетный день, следующий за Датой внесения компенсационного взноса, в которую обязательство по внесению компенсационного взноса не было исполнено. Обязательства по второй части соответствующей сделки РЕПО должны быть исполнены обеими ее сторонами досрочно (до Даты исполнения обязательств по второй части сделки РЕПО, определенной при ее заключении), а именно, в первый Расчетный день, следующий за Датой внесения компенсационного взноса, в которую обязательство по внесению компенсационного взноса не было исполнено (исходя из рассчитанных в Клиринговой системе на соответствующую дату параметров сделки РЕПО).

21.7. Решением Клирингового центра может быть предусмотрено, что если величина рассчитанного Клиринговым центром компенсационного взноса в форме ценных бумаг по сделке РЕПО, подлежащего внесению в текущий Расчетный день, равна количеству ценных бумаг по такой сделке РЕПО, такой компенсационный взнос не подлежит внесению.

21.8. Решением Клирингового центра может быть предусмотрено, что если текущее значение Суммы РЕПО по сделке РЕПО с облигациями меньше производимой в

текущий день выплаты дохода по облигации (купонный доход и амортизационная выплата), то сумма РЕПО не уменьшается на величину выплаченного дохода. Такой доход по облигации должен быть передан Участником клиринга - покупателем по первой части РЕПО Участнику клиринга - продавцу по первой части РЕПО в валюте выплаченного эмитентом ценных бумаг дохода, в срок, определенный пунктом 21.2 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

21.9. Если решением Клирингового центра не установлено иное, каждый Расчетный день, начиная с фактической даты исполнения обязательств по первой части сделки РЕПО, являющейся Сделкой Т+ (не включая эту дату), до фактической даты исполнения обязательств по второй части этой сделки РЕПО, или до Даты прекращения исполнения этой сделки РЕПО (включая эту дату), в Клиринговой системе рассчитывается доход по сделке РЕПО и стоимость обратного выкупа по следующим формулам:

$$I_j = S * \frac{R}{100} * \left(\frac{T'_{365}}{365} + \frac{T'_{366}}{366} \right)$$

, где I_j - доход по сделке РЕПО в j-ый день;

S – Сумма РЕПО;

R – Ставка РЕПО;

T'_{365} – фактическое число календарных дней между Датой исполнения обязательств по первой части сделки РЕПО и текущим днем (j-ый день), приходящееся на календарный год, состоящий из 365 дней;

T'_{366} – фактическое число календарных дней между Датой исполнения обязательств по первой части сделки РЕПО и текущим днем (j-ый день), приходящееся на календарный год, состоящий из 366 дней;

$S_{II}^{j} = S + I_j$,

где S_{II}^{j} – стоимость обратного выкупа в j-ый день.

Для сделок РЕПО, в которых Дата исполнения обязательств по первой части сделки РЕПО совпадает с Датой исполнения обязательств по второй части сделки РЕПО, фактическое число календарных дней между Датой исполнения обязательств по первой части сделки РЕПО и Датой исполнения обязательств по второй части сделки РЕПО принимается равным 1 (единице) для целей расчета дохода по сделке РЕПО и стоимости обратного выкупа.

21.9.1. Размер НКД по сделке РЕПО на текущий j-ый день (раскрывается в Клиринговой системе информационно):

$A_{II}^{j} = N_j * At_j * e_j$, где

At_j – НКД по одной ценной бумаге текущего (j-го) дня (при условии его расчета Биржей для данной ценной бумаги),

N_j – количество ценных бумаг в сделке,

e_j – официальный курс иностранной валюты, в которой выражена номинальная стоимость ценной бумаги, по отношению к российскому рублю, устанавливаемый Банком России на день j. Для ценных бумаг, номинальная стоимость которых выражена в российских рублях, e_j принимается равным 1.

Статья 22. Особенности определения обязательств по депозитным договорам

22.1. Если решением Клирингового центра не установлено иное, каждый Расчетный день, начиная с даты заключения депозитного договора (не включая эту дату) до даты возврата депозита (включая эту дату), в Клиринговой системе рассчитывается:

I_j – доход по депозиту в j-ый день;

$I_j = S * \frac{R}{100} * \left(\frac{T'_{365}}{365} + \frac{T'_{366}}{366} \right)$, где:

S – размер обязательства Клирингового центра по возврату суммы депозита в j-ый день;

R – процентная ставка;

S_{II}^{j} – сумма возврата депозита в j-ый день:

$S_{II}^{j} = S + I_j$,

T'_{365} – фактическое число календарных дней между i-ым днем и текущим днем (j-ый день), приходящееся на календарный год, состоящий из 365 дней;

T'_{366} – фактическое число календарных дней между i-ым днем и текущим днем (j-ый день), приходящееся на календарный год, состоящий из 366 дней.

22.2. В случае исполнения Заявления на изменение суммы депозита доход по депозиту пересчитывается Клиринговым центром с учетом изменения процентной ставки в соответствии с пунктом 35.15 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

22.3. В случае обращения взыскания на денежные средства Участника клиринга на рынке депозитов Клиринговый центр в день, когда Клиринговый центр получил документ или копию документа, являющегося основанием для указанного

обращения взыскания, уведомляет Участника клиринга о необходимости внесения денежных средств в размере, необходимом для исполнения взыскания. Указанное уведомление направляется Участнику клиринга с использованием ЭДО.

22.4. В следующий за днем уведомления Расчетный день (если следующий Расчетный день является следующим календарным днем) или в день уведомления (если следующий Расчетный день не является следующим календарным днем) во время, определенное Временным регламентом, являющимся приложением к общей части Правил клиринга, как время первого в течение Расчетного дня исполнения Итоговых нетто-обязательств Участника клиринга по денежным средствам в соответствующей валюте, Клиринговый центр исполняет документ об обращении взыскания.

22.4.1. Для исполнения документа об обращении взыскания Клиринговый центр использует Обеспечение Участника клиринга, учитываемое по собственным Расчетным кодам Участника клиринга в размере, для которого выполняются условия возврата Обеспечения, предусмотренные общей частью Правил клиринга (далее – свободное обеспечение).

22.4.2. При недостаточности свободного обеспечения для исполнения документа об обращении взыскания, обязательство (обязательства) по возврату суммы депозита, на которую был заключен депозитный договор (депозитные договоры), по заключенному (заключенным) с таким Участником клиринга депозитному договору (депозитным договорам), прекращается возникновением обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга Обеспечения в соответствующей валюте. Указанное обязательство (обязательства) по возврату суммы депозита прекращается полностью или в части, равной разнице между суммой взыскания, расходов по совершению исполнительных действий, исполнительского сбора и суммой свободного обеспечения. При этом размер Обеспечения Участника клиринга в соответствующей валюте, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, увеличивается на размер прекращенного обязательства по возврату суммы депозита. После выполнения действий, указанных в настоящем подпункте, Клиринговый центр исполняет документ об обращении взыскания.

22.4.3. В случае прекращения обязательства (обязательств) по возврату суммы депозита в соответствии с подпунктом 22.4.2 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, Клиринговый центр пересчитывает размер ранее рассчитанного дохода по депозиту: доход по депозиту для прекращенной части депозита с даты заключения депозитного договора (не включая эту дату) до дня, указанного в пункте 22.4 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов (включая этот день), рассчитывается в соответствии с процентной ставкой равной 0,01% годовых, доход по депозиту для непрекращенной суммы депозита рассчитывается в соответствии с процентной ставкой депозитного договора.

22.4.4. Начиная со дня, следующего за днем, указанным в пункте 22.4 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, при расчете дохода по депозиту сумма депозита принимается равной величине, равной сумме депозита, уменьшенной на размер прекращенного обязательства по возврату депозитов.

22.5. Клиринговый центр вправе изменить размер обязательства (обязательств) по возврату суммы депозита, на которую был заключен депозитный договор

(депозитные договоры), по заключенному (заключенным) с таким Участником клиринга депозитному договору (депозитным договорам), полностью или в части, необходимой для исполнения документа об обращении взыскания, расходов по совершению исполнительных действий и исполнительского сбора, в том числе при наличии свободного обеспечения.

22.5.1. В случае изменения размера обязательства (обязательств) по возврату суммы депозита в соответствии с пунктом 22.5 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов:

- в случае если сумма, необходимая для исполнения документа об обращении взыскания, расходов по совершению исполнительных действий и исполнительского сбора, меньше суммы депозита, во время, определенное Временным регламентом, являющимся приложением к общей части Правил клиринга, как время первого в течение Расчетного дня исполнения Итоговых нетто-обязательств Участника клиринга по денежным средствам в соответствующей валюте, размер обязательства (обязательств) по возврату суммы депозита уменьшается с одновременным возникновением обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга Обеспечения в соответствующей валюте. Указанный размер обязательства (обязательств) по возврату суммы депозита уменьшается на сумму, необходимую для исполнения документа об обращении взыскания, расходов по совершению исполнительных действий и исполнительского сбора. При этом размер Обеспечения Участника клиринга в соответствующей валюте, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, увеличивается на размер, на который изменилось обязательство по возврату суммы депозита;
- в случае если сумма, необходимая для исполнения документа об обращении взыскания, расходов по совершению исполнительных действий и исполнительского сбора, равна или превышает сумму депозита, во время, определенное Временным регламентом, являющимся приложением к общей части Правил клиринга, как время первого в течение Расчетного дня исполнения Итоговых нетто-обязательств Участника клиринга по денежным средствам в соответствующей валюте, обязательство (обязательства) по возврату суммы депозита прекращается (прекращаются) возникновением обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга Обеспечения в соответствующей валюте. Указанное обязательство (обязательства) по возврату суммы депозита прекращается полностью. При этом размер Обеспечения Участника клиринга в соответствующей валюте, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, увеличивается на размер прекращенного обязательства по возврату суммы депозита;
- Клиринговый центр исполняет документ об обращении взыскания.

22.5.2. Наличие у Участника клиринга свободного обеспечения считается согласием Участника клиринга восполнить депозит (депозиты), размер обязательства по возврату суммы которого был уменьшен.

22.5.3. При наличии у Участника клиринга свободного обеспечения Клиринговый центр восполняет депозит (депозиты) в размере минимального из двух значений: (1) размера свободного обеспечения; (2) размера, на который было уменьшено обязательство (обязательства) по возврату суммы депозита в соответствии с пунктом 22.5 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

22.5.4. В случае уменьшения размера обязательства (обязательств) по возврату суммы депозита в соответствии с пунктом 22.5 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, Клиринговый центр пересчитывает размер ранее рассчитанного дохода по депозиту: доход по части депозита, равной разнице между суммой, на который было уменьшено обязательство по возврату депозита, и суммой, на которую был восполнен депозит (депозиты), с даты заключения депозитного договора (не включая эту дату) до дня, указанного в пункте 22.4 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов (включая этот день), рассчитывается в соответствии с процентной ставкой равной 0,01% годовых, доход по депозиту для непрекращенной суммы депозита и восполненной части депозита рассчитывается в соответствии с процентной ставкой депозитного договора.

22.5.5. В случае прекращения обязательства (обязательств) по возврату суммы депозита полностью в соответствии с пунктом 22.5 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, Клиринговый центр пересчитывает размер ранее рассчитанного дохода по депозиту с даты заключения депозитного договора (не включая эту дату) до дня, указанного в пункте 22.4 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов (включая этот день), в соответствии с процентной ставкой, равной 0,01% годовых.

22.5.6. Начиная со дня, указанного в пункте 22.4 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, при расчете дохода по депозиту сумма депозита принимается равной величине, равной сумме депозита, уменьшенной на разницу между размером, на который было уменьшено обязательство по возврату депозита, и суммой, на которую был восполнен депозит.

22.6. Выбор депозитного договора (депозитных договоров), обязательство по которому прекращается полностью или в части, необходимой для исполнения документа об обращении взыскания, осуществляется Клиринговым центром в порядке убывания даты и времени заключения депозитного договора.

22.7. При обращении взыскания на денежные средства Участника клиринга в иностранной валюте, размещенные в депозит, Клиринговый центр продает иностранную валюту по курсу не ниже Нижней границы ценового коридора.

22.8. В случае наложения ареста на денежные средства Участника клиринга, размещенные в депозит, условия депозитного договора не меняются. В дату возврата депозита Клиринговый центр устанавливает ограничение на списание и иное использование денежных средств, составляющих Обеспечение Участника клиринга и полученных Участником клиринга в результате исполнения Клиринговым центром обязательств по возврату Участнику клиринга депозитов, в сумме, указанной в документе, являющемся основанием для наложения ареста.

РАЗДЕЛ V. ПОРЯДОК ПРОВЕДЕНИЯ КЛИРИНГА

ПОДРАЗДЕЛ V-I. ПОРЯДОК ВЫДАЧИ И ПОГАШЕНИЯ КЛИРИНГОВЫХ СЕРТИФИКАТОВ УЧАСТИЯ

Статья 23. Порядок внесения имущества в имущественный пул. Порядок выдачи клиринговых сертификатов участия

23.1. Клиринговый центр выдает клиринговые сертификаты участия на имущество, внесенное в соответствующий имущественный пул.

23.2. Внесение российских рублей и иностранной валюты в имущественный пул возможно следующими способами:

1) путем перечисления денежных средств на соответствующий клиринговый банковский счет Клирингового центра по реквизитам, размещенным на Сайте Клирингового центра, с обязательным указанием в назначении платежа Расчетного кода имущественного пула;
2) путем исполнения распоряжения на перевод денежных средств, поданного Участником клиринга с использованием Клиринговой системы;
3) путем исполнения Запроса на перевод обеспечения.

23.3. Внесение ценных бумаг в имущественный пул возможно двумя способами:

1) путем исполнения распоряжения на перевод ценных бумаг (за исключением клиринговых сертификатов участия), поданного Участником клиринга с использованием Клиринговой системы;
2) в результате исполнения Запроса на подбор ценных бумаг, поданного Участником клиринга с использованием Клиринговой системы.

23.4. Клиринговый центр учитывает в Клиринговой системе денежные средства, перечисленные на соответствующий клиринговый банковский счет Клирингового центра, по Расчетному коду имущественного пула, указанному в назначении платежа, и увеличивает Единый лимит по пулу по такому Расчетному коду имущественного пула с учетом перечисленной суммы денежных средств.

23.4.1. Если Расчетный код имущественного пула, указанный в назначении платежа, не найден среди зарегистрированных Клиринговым центром Расчетных кодов имущественного пула, Клиринговый центр вправе запросить у Участника клиринга уточнение назначения платежа. В случае получения от Участника клиринга или от банка плательщика уточнения назначения платежа, учет денежных средств в соответствии с пунктом 23.4 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, осуществляется Клиринговым центром после получения от Участника клиринга / банка плательщика такого уточнения назначения платежа с правильно указанным Расчетным кодом имущественного пула.

23.4.2. 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

имущественного пула в назначении платежа, Участник клиринга / банк плательщика не предоставит Клиринговому центру уточнение назначения платежа с правильно указанным Расчетным кодом имущественного пула, Клиринговый центр возвращает указанные денежные средства по реквизитам плательщика.

23.4.3. Денежные средства, зачисленные на соответствующий клиринговый банковский счет Клирингового центра позднее времени, установленного Временным регламентом на фондовом рынке и рынке депозитов, учитываются Клиринговым центром в следующем Расчетном дне.

23.5. После перечисления денежных средств на клиринговый банковский счет Клирингового центра, открытый в Расчетной организации, и учета их в качестве имущества, внесенного в имущественный пул, у Клирингового центра возникает обязательство вернуть имущество из имущественного пула Участнику клиринга. Указанное обязательство исполняется с учетом условий, определенных статьей 24 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

23.5.1. Клиринговый центр вправе осуществить в любое время зачет денежных требований Участника клиринга по возврату ему денежных средств, внесенных в имущественный пул и учитываемых по Расчетному коду имущественного пула, с денежными требованиями Клирингового центра к этому Участнику клиринга, учитываемыми по такому Расчетному коду имущественного пула.

23.6. Порядок подачи и исполнения распоряжений на перевод денежных средств / ценных бумаг определен общей частью Правил клиринга с учетом следующих особенностей:

23.6.1. В распоряжении на перевод денежных средств / ценных бумаг, подаваемом с целью внесения имущества в имущественный пул, в качестве Торгово-клирингового счета, по которому осуществляется увеличение денежных средств / ценных бумаг, должен быть указан Торгово-клиринговый счет имущественного пула.

23.6.2. Участник клиринга вправе предоставить Клиринговому центру Запрос об ограничении Торгово-клиринговых счетов для внесения и выдачи имущества.

Указанный запрос может содержать указание на один из следующих способов ограничения Торгово-клиринговых счетов для внесения / выдачи ценных бумаг в имущественный пул / из имущественного пула:

1) ограничение для всех Торгово-клиринговых счетов.

В случае выбора указанного способа ограничений при подаче распоряжений на перевод ценных бумаг на Торгово-клиринговый счет имущественного пула / с Торгово-клирингового счета имущественного пула в качестве Торгово-клирингового счета, по которому осуществляется уменьшение / увеличение ценных бумаг, может быть указан только Торгово-клиринговый счет Т+, соответствующий Торгово-клиринговому счету имущественного пула, указанному в распоряжении.

2) ограничение для Торгово-клиринговых счетов, в состав которых входят субсчета депо, открытые номинальному держателю, иностранному номинальному держателю или доверительному управляющему.

В случае выбора указанного способа ограничений при подаче распоряжений на перевод ценных бумаг на Торгово-клиринговый счет имущественного пула

/ с Торгово-клирингового счета имущественного пула, в состав которого входит субсчет депо, открытый номинальному держателю, иностранному номинальному держателю или доверительному управляющему, в качестве Торгово-клирингового счета, по которому осуществляется уменьшение / увеличение денежных средств / ценных бумаг, может быть указан только Торгово-клиринговый счет Т+, соответствующий Торгово-клиринговому счету имущественного пула, указанному в распоряжении, при подаче распоряжений на перевод ценных бумаг на Торгово-клиринговый счет имущественного пула / с Торгово-клирингового счета имущественного пула, в состав которого входит субсчет депо, открытый владельцу ценных бумаг, которым является Участника клиринга, в качестве Торгово-клирингового счета, по которому осуществляется уменьшение / увеличение ценных бумаг, может быть указан только Торгово-клиринговый счет, в состав которого входит Раздел, открытый на торговых счетах депо владельца Участника клиринга.

Указанное заявление действует, начиная с Расчетного дня, следующего за датой предоставления указанного заявления, и до его отмены Участником клиринга.

Если Участник клиринга не предоставил Запрос об ограничении Торгово-клиринговых счетов для внесения и выдачи имущества, действует ограничение, указанное в пункте 1) настоящего подпункта.

23.6.3. Распоряжение на перевод ценных бумаг / иностранной валюты, не принимаемых в соответствующий имущественный пул, не исполняется Клиринговым центром.

23.6.4. Распоряжение на перевод ценных бумаг, эмитентом которых является Участник клиринга или связанное с ним лицо, на Торгово-клиринговый счет имущественного пула, в состав которого входит субсчет депо имущественного пула, открытый владельцу ценных бумаг, которым является такой Участник клиринга, не исполняется Клиринговым центром.

23.6.5. Распоряжение на перевод ценных бумаг на Торгово-клиринговый счет имущественного пула, в состав которого входит субсчет депо имущественного пула, открытый иностранному номинальному держателю, для которого установлены ограничения на зачисление таких ценных бумаг на его счета депо, не исполняется Клиринговым центром.

23.6.6. После увеличения суммы денежных средств / количества ценных бумаг, учитываемых по Расчетному коду имущественного пула / Торгово-клиринговому счету имущественного пула значение Единого лимита по пулу по Расчетному коду имущественного пула, входящему в состав Торгово-клирингового счета имущественного пула, указанного в распоряжении, увеличивается с учетом переведенной суммы денежных средств / количества ценных бумаг.

23.7. Порядок подачи и исполнения Запросов на подбор ценных бумаг с целью их внесения в имущественный пул определен общей частью Правил клиринга.

23.7.1. После увеличения количества ценных бумаг, учитываемых по Торгово-клиринговому счету имущественного пула, значение Единого лимита по пулу по Расчетному коду имущественного пула, входящему в состав такого Торгово-клирингового счета имущественного пула, увеличивается с учетом зачисленного количества ценных бумаг.

23.8. Порядок исполнения Запроса на перевод обеспечения определен общей частью Правил клиринга.

23.9. Имущество, внесенное в имущественный пул, используется в следующей очередности:

1) для обеспечения исполнения обязательств по договору об имущественном пуле;
2) для обеспечения исполнения обязательств по сделкам РЕПО с клиринговыми сертификатами участия при проведении ликвидационного неттинга в отношении Участника клиринга, клиента Участника клиринга или Клирингового центра в соответствии с общей частью Правил клиринга;
3) для обеспечения исполнения обязательств Участника клиринга по Сделкам, в том числе по сделкам РЕПО с клиринговыми сертификатами участия (за исключением случая, указанного в подпункте 2) настоящего пункта);
4) для исполнения обязательств по Сделкам, заключенных с указанием Торгово-клирингового счета имущественного пула;
5) для исполнения обязательств по Сделкам, заключенных с указанием Торгово-клирингового счета Т+, соответствующего Торгово-клиринговому счету имущественного пула, и иных обязательств, учитываемых по такому Торгово-клиринговому счету Т+.

23.10. Незамедлительно после увеличения в Клиринговой системе положительного значения Единого лимита по пулу по Расчетному коду имущественного пула в соответствии с пунктом 23.4, подпунктом 23.6.6, пунктом 26.3 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов Клиринговый центр:

- увеличивает номинальную стоимость клиринговых сертификатов участия, подлежащих выдаче в ходе ближайшего взаимодействия с Расчетным депозитарием, учитываемую по Расчетному коду имущественного пула, на номинальную стоимость выдаваемых клиринговых сертификатов участия, определенную в соответствии с подпунктом 23.10.2 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов;
- увеличивает плановое значение позиции по ценной бумаге клиринговый сертификат участия, учитываемой по Торгово-клиринговому счету Т+, соответствующему Торгово-клиринговому счету имущественного пула, в состав которого входит указанный Расчетный код имущественного пула, на количество выдаваемых клиринговых сертификатов участия, определенное в соответствии с подпунктом 23.10.1 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, и учитывает указанные клиринговые сертификаты участия в качестве Обеспечения Участника клиринга;
- учитывает новое значение Единого лимита по пулу по Расчетному коду имущественного пула;
- допускает к клирингу обязательства по клиринговым сертификатам участия, учтенные по Расчетному коду имущественного пула.

23.10.1. Количество выдаваемых клиринговых сертификатов участия соответствует положительному значению Единого лимита по пулу по Расчетному коду имущественного пула (без учета копеек).

23.10.2. Номинальная стоимость выдаваемых клиринговых сертификатов участия равна произведению количества выдаваемых клиринговых сертификатов участия на номинальную стоимость одного клирингового сертификата участия.

23.11. Поручение на выдачу клиринговых сертификатов участия включается в состав распоряжения на проведение операций по Разделам / субсчетам депо, направляемого Клиринговым центром Расчетному депозитарию в соответствии с пунктом 44.4 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, или в состав согласия на списание ценных бумаг с Разделов, направляемого Клиринговым центром Расчетному депозитарию в соответствии с пунктом 44.2 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

23.12. После исполнения Расчетным депозитарием поручения Клирингового центра на выдачу клиринговых сертификатов участия клиринговые сертификаты участия, зачисленные на Раздел Т+, становятся индивидуальным клиринговым обеспечением.

23.13. Информация о количестве ценных бумаг / сумме денежных средств, внесенных Участником клиринга в имущественный пул, предоставляется Участнику клиринга в составе Отчета об имуществе, внесенном в имущественные пулы.

Статья 24. Порядок выдачи имущества из имущественного пула. Порядок погашения клиринговых сертификатов участия

24.1. Погашение клиринговых сертификатов участия осуществляется при выдаче имущества из имущественного пула по инициативе Участника пула при соблюдении условий, установленных настоящей статьей Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, а также в иных случаях, установленных Правилами клиринга.

24.2. Выдача ценных бумаг из имущественного пула осуществляется на основании распоряжений на перевод ценных бумаг, поданных Участниками пула с использованием Клиринговой системы.

24.3. Выдача денежных средств из имущественного пула осуществляется на основании:

1) Запроса на возврат обеспечения;
2) Запроса на перевод обеспечения;
3) распоряжений на перевод денежных средств, поданных Участниками пула с использованием Клиринговой системы.

24.4. Распоряжение на перевод денежных средств / ценных бумаг, подаваемое Участником пула с использованием Клиринговой системы в целях выдачи имущества из имущественного пула, должно содержать указание на Торгово-клиринговый счет имущественного пула в качестве Торгово-клирингового счета, по которому осуществляется уменьшение денежных средств / ценных бумаг.

Порядок подачи и исполнения распоряжения на перевод денежных средств / ценных бумаг соответствует порядку, определенному общей частью Правил клиринга, с учетом особенности, установленной подпунктом 23.6.2 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, а также особенностей,

установленных настоящей статьей Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

24.5. Запрос на возврат обеспечения, подаваемый Участником пула в целях выдачи имущества из имущественного пула, должен содержать указание на Расчетный код имущественного пула.

Порядок подачи и исполнения Запроса на возврат обеспечения соответствует порядку, определенному общей частью Правил клиринга, с учетом особенностей, установленных настоящей статьей Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

24.6. Если ценная бумага / валюта принимается в соответствующий имущественный пул, то выдача данного имущества из имущественного пула осуществляется только в случае погашения соответствующего количества клиринговых сертификатов участия, за исключением случая, указанного в пункте 4.6 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, а также случаев проведения ликвидационного неттинга в отношении Участника клиринга, клиента Участника клиринга или Клирингового центра в соответствии с общей частью Правил клиринга.

24.7. Погашение клиринговых сертификатов участия при выдаче имущества из имущественного пула осуществляется при соблюдении следующих условий:

1) количество ценных бумаг клиринговый сертификат участия, учитываемое по Торгово-клиринговому счету Т+, соответствующему Торгово-клиринговому счету имущественного пула, после погашения клиринговых сертификатов участия не становится отрицательным;
2) положительный Единый лимит по Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета Т+, соответствующего Торгово-клиринговому счету имущественного пула, не становится отрицательным после погашения клиринговых сертификатов участия, или
3) отрицательный Единый лимит по Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета Т+, соответствующего Торгово-клиринговому счету имущественного пула, не уменьшается после погашения клиринговых сертификатов участия;
4) при выдаче денежных средств из имущественного пула, возвращаемая сумма денежных средств не превышает максимального из двух значений: (1) суммы денежных средств в соответствующей валюте, учитываемой по Расчетному коду имущественного пула; (2) суммы (с учетом знака) денежных средств в соответствующей валюте, учитываемой по Расчетному коду имущественного пула, и Нетто-обязательства / Нетто-требования по денежным средствам в соответствующей валюте с текущей Датой исполнения, рассчитанного по Сделкам Т+ и учитываемого по Расчетному коду имущественного пула;
5) значения, рассчитанные без учета возвращаемой суммы денежных средств / количества ценных бумаг в соответствии с общей частью Правил клиринга для проверки возможности исполнения операции, проводимой по Торгово-клиринговому счету Участника клиринга при наличии признака «запрет необеспеченных покупок» / «запрет коротких продаж», и/или Участника клиринга категории «В», и/или ценных бумаг с признаком «запрет коротких продаж», для каждой Даты исполнения или для каждой Даты исполнения,

приходящейся на период действия (в случае если Клиринговым центром установлен период действия признака «запрет коротких продаж» по ценной бумаге), не станут отрицательными.

Если выдача имущества из имущественного пула осуществляется на основании распоряжения на перевод денежных средств / ценных бумаг, поданного Участником пула с использованием Клиринговой системы / сформированного Клиринговым центром в Клиринговой системе, путем зачисления на Торгово-клиринговый счет Т+, соответствующий Торгово-клиринговому счету имущественного пула, то проверки, указанные в подпунктах 2), 3) настоящего пункта Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, проводятся с учетом того, что при расчете Единого лимита по Расчетному коду, входящему в состав такого Торгово-клирингового счета Т+, будут учтены ценные бумаги / денежные средства, учтенные по Торгово-клиринговому счету Т+ / Расчетному коду в результате исполнения указанного распоряжения, и погашение клиринговых сертификатов участия по Расчетному коду имущественного пула, которое будет выполнено в результате такой выдачи имущества.

24.8. Погашение клиринговых сертификатов участия, проводимое при отрицательном значении Единого лимита по пулу по Расчетному коду имущественного пула, осуществляется при условии, что количество ценных бумаг клиринговый сертификат участия, учитываемое по Торгово-клиринговому счету Т+, соответствующему Торгово-клиринговому счету имущественного пула, в состав которого входит такой Расчетный код имущественного пула, после погашения клиринговых сертификатов участия не становится отрицательным.

24.9. При соблюдении условий погашения клиринговых сертификатов участия, указанных в пункте 24.7 или 24.8 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, Клиринговый центр незамедлительно:

- увеличивает номинальную стоимость клиринговых сертификатов участия, подлежащих погашению в ходе ближайшего взаимодействия с Расчетным депозитарием, учитываемую по Расчетному коду имущественного пула, на номинальную стоимость погашаемых клиринговых сертификатов участия, определенную в соответствии с подпунктом 24.9.2 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов;
- уменьшает количество ценных бумаг клиринговый сертификат участия, учитываемых по Торгово-клиринговому счету Т+, соответствующему Торгово-клиринговому счету имущественного пула, в состав которого входит указанный Расчетный код имущественного пула, на количество погашаемых клиринговых сертификатов участия, определенное в соответствии с подпунктом 24.9.1 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов;
- учитывает новое значение Единого лимита по пулу по Расчетному коду имущественного пула.

24.9.1. Количество погашаемых клиринговых сертификатов участия соответствует абсолютной величине отрицательного значения Единого лимита по пулу по Расчетному коду имущественного пула, округленного до ближайшего меньшего целого значения российских рублей.

24.9.2. Номинальная стоимость погашаемых клиринговых сертификатов участия равна произведению количества погашаемых клиринговых сертификатов участия на номинальную стоимость одного клирингового сертификата участия.

24.10. Поручение на погашение клиринговых сертификатов участия включается в состав распоряжения на проведение операций по Разделам / субсчетам депо, направляемого Клиринговым центром Расчетному депозитарию в соответствии с пунктом 44.4 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

24.11. Порядок исполнения Запроса на перевод обеспечения определен общей частью Правил клиринга.

24.12. Сроки подачи и исполнения запросов / распоряжений с целью выдачи имущества из имущественного пула установлены Временным регламентом на фондовом рынке и рынке депозитов.

Статья 25. Порядок замены имущества в имущественном пуле

25.1. При невозможности выдачи имущества из имущественного пула по причине несоблюдения условий погашения клиринговых сертификатов участия, предусмотренных пунктом 24.7 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, Участник пула вправе заменить ранее переданное в пул имущество на другое имущество.

25.2. Для осуществления такой замены Участник пула обязан внести другое имущество в имущественный пул в порядке, установленном статьей 23 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, в том числе, путем подачи Запроса на подбор ценных бумаг, при этом стоимость вносимого имущества должна соответствовать стоимости имущества, подлежащего замене.

После внесения другого имущества в имущественный пул, Участник пула вправе обратиться к Клиринговому центру за выдачей соответствующего имущества в порядке, установленном статьей 24 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

25.3. Участник клиринга вправе использовать имущество, внесенное с имущественный пул, для исполнения обязательств по Сделкам в порядке, определенном общей частью Правил клиринга.

ПОДРАЗДЕЛ V-II. КЛИРИНГОВЫЕ СЕССИИ

Статья 26. Особенности проведения клиринговой сессии mark-to-market. Порядок возникновения и исполнения Маржинальных требований по пулу

26.1. В ходе клиринговой сессии mark-to-market, проводимой каждый Расчетный день в срок, установленный Временным регламентом, являющимся приложением к общей части Правил клиринга, Клиринговый центр кроме действий, указанных в общей части Правил клиринга, выполняет следующие действия:

- для каждого Участника клиринга рассчитывает и устанавливает новые значения Единых лимитов по Расчетному коду, Единых лимитов по Расчетному коду 2-го уровня;
- для каждого Участника торгов, заключившего с Клиринговым центром договор о ведении клиринговых регистров, предусмотренный общей частью Правил клиринга, рассчитывает и устанавливает новые значения Единых лимитов по Расчетному коду 3-го уровня;
- для каждого Участника пула рассчитывает значения Единого лимита по пулу по каждому Расчетному коду имущественного пула в соответствии со статьей 16 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов;
- осуществляет выдачу / погашение клиринговых сертификатов участия в связи с изменением стоимости имущества, внесенного в соответствующий имущественный пул, вызванной изменением базовых риск-параметров;
- определяет Участников пула, у которых возникли Маржинальные требования по пулу.

26.2. При принятии Клиринговым центром решения об исключении ценной бумаги из перечня ценных бумаг, принимаемых в имущественный пул, или решения об исключении денежных средств в иностранной валюте из перечня имущества, которое может быть внесено в определенный имущественный пул, или при введении ограничения на зачисление ценных бумаг на субсчет депо имущественного пула, открытый иностранному номинальному держателю, начиная с клиринговой сессии mark-to-market, проводимой в Расчетный день, установленный указанным решением / в Расчетный день введения указанного ограничения, при расчете Единого лимита по пулу по всем / соответствующим Расчетным кодам имущественного пула такая ценная бумага / иностранная валюта учитывается с Нижней границей диапазона оценки рыночных рисков равной нулю.

Выдача указанного имущества из имущественного пула Участнику пула осуществляется в порядке, установленном статьей 24 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

26.3. Если значение Единого лимита по пулу по Расчетному коду имущественного пула, рассчитанное в ходе клиринговой сессии mark-to-market, положительное, Клиринговый центр выдает Участнику пула клиринговые сертификаты участия в порядке, определенном пунктами 23.10-23.12 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

26.4. Если значение Единого лимита по пулу по Расчетному коду имущественного пула, рассчитанное в ходе клиринговой сессии mark-to-market, отрицательное, Клиринговый центр в порядке, установленном пунктами 24.8-24.10 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, погашает клиринговые сертификаты участия в количестве, указанном в подпункте 24.9.1 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, или в максимальном количестве, при котором условие, указанное в пункте 24.8 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, будет соблюдаться.

26.5. Если погашение клиринговых сертификатов участия невозможно или не привело к тому, что значение Единого лимита по пулу по Расчетному коду имущественного пула стало равным нулю, Клиринговый центр предъявляет Участнику пула Маржинальное требование по пулу.

Сумма Маржинального требования по пулу, учитываемого по Расчетному коду имущественного пула, равна абсолютному значению отрицательного Единого лимита по пулу по Расчетному коду имущественного пула, определенного по итогам клиринговой сессии mark-to-market и после погашения клиринговых сертификатов участия в соответствии с пунктом 26.4 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

Информация о Маржинальном требовании по пулу направляется Участнику пула в составе Отчета о Маржинальных требованиях.

26.6. Маржинальное требование по пулу должно быть исполнено Участником пула не позднее установленного Временным регламентом на фондовом рынке и рынке депозитов времени текущего Расчетного дня.

26.7. Маржинальное требование по пулу должно быть исполнено Участником пула путем внесения имущества в имущественный пул в порядке, установленном статьей 23 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

Маржинальное требование по пулу может быть также прекращено полностью или в части путем:

26.7.1. заключения Участником пула Сделок с указанием Торгово-клирингового счета Т+, соответствующего Торгово-клиринговому счету имущественного пула, в состав которого входит Расчетный код имущественного пула, по которому учитывается Маржинальное требование по пулу, приводящих к получению клиринговых сертификатов участия, которые погашаются при соблюдении условия, установленного пунктом 24.8 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов;

26.7.2. заключения Участником пула Сделок с указанием Торгово-клирингового счета имущественного пула, направленных на продажу имущества (ценных бумаг или иностранной валюты) из имущественного пула.

Процедура контроля обеспечения по заявкам на заключение таких Сделок осуществляется в соответствии со статьей 20 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

26.8. Маржинальное требование по пулу, учитываемое по Расчетному коду имущественного пула, считается прекращенным в момент времени, когда Единый

лимит по пулу по такому Расчетному коду имущественного пула станет неотрицательным.

26.9. После определения Маржинальных требований по пулу Клиринговый центр вправе направить Расчетному депозитарию Запрос на подбор ценных бумаг с целью исполнения Маржинальных требований (только для Участников клиринга, соответствующих требованиям, установленным общей частью Правил клиринга).

26.9.1. Запрос на подбор ценных бумаг направляется с указанием суммы Маржинального требования по пулу и субсчетов депо имущественного пула, входящих в состав Торгово-клиринговых счетов имущественного пула совместно с Расчетным кодом имущественного пула, по которому учитывается Маржинальное требование по пулу.

26.9.2. Запрос на подбор ценных бумаг направляется в сроки, установленные Временным регламентом, являющимся приложением к общей части Правил клиринга.

26.10. В случае неисполнения Участником пула Маржинального требования по пулу в срок, установленный Временным регламентом на фондовом рынке и рынке депозитов, Клиринговый центр устанавливает для такого Расчетного кода имущественного пула Режим урегулирования, порядок применения которого определен общей частью Правил клиринга, и осуществляет действия в следующей последовательности (каждое последующее действие выполняется в случае, если предыдущее действие не привело к прекращению Маржинального требования по пулу):

26.10.1. заключает от имени Участника пула закрывающие Сделки, направленные на продажу имущества (ценных бумаг или иностранной валюты) из имущественного пула, и заключает балансирующие сделки.

Порядок заключения закрывающих и балансирующих сделок определен общей частью Правил клиринга.

Выбор имущества, с которым заключаются указанные сделки, осуществляется Клиринговым центром.

Указанные сделки заключаются до момента прекращения Маржинального требования по пулу.

26.10.2. после исполнения Маржинального требования по пулу Клиринговый центр снимает Режим урегулирования для Расчетного кода имущественного пула, по которому учитывалось неисполненное Маржинальное требование по пулу, если отсутствуют иные основания для установления Режима урегулирования, предусмотренные Правилами клиринга.

26.11. Порядок подачи и исполнения Запросов на подбор ценных бумаг с целью их внесения в имущественный пул определен общей частью Правил клиринга.

26.12. Ценные бумаги, зачисленные на субсчет депо имущественного пула по итогам исполнения Расчетным депозитарием Запроса Клирингового центра на подбор ценных бумаг, вносятся в имущественный пул и учитываются при расчете Единого лимита по пулу по Расчетному коду имущественного пула, по которому учитывалось неисполненное Маржинальное требование по пулу.

Обязательства и требования по сделкам, заключенным в соответствии с подпунктом 26.10.1 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, учитываются при расчете Единого лимита по пулу по Расчетному коду имущественного пула, по которому учитывалось неисполненное Маржинальное требование по пулу.

26.13. После осуществления действий в соответствии с пунктами 26.9-26.12 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов Клиринговый центр осуществляет проверку исполнения Маржинального требования по пулу.

26.14. Если по итогам действий, осуществленных в соответствии с пунктами 26.9-26.12 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, Маржинальное требование по пулу осталось неисполненным, Клиринговый центр формирует в Клиринговой системе распоряжение на перевод денежных средств в российских рублях с Торгово-клирингового счета Т+, соответствующего Торгово-клиринговому счету имущественного пула, в состав которого входит Расчетный код имущественного пула, по которому учитывается неисполненное Маржинальное требование по пулу, на Торгово-клиринговый счет имущественного пула в сумме, необходимой для исполнения Маржинального требования по пулу.

Если денежных средств, учитываемых по указанному Расчетному коду, входящему в состав такого Торгово-клирингового счета Т+, недостаточно для исполнения указанного перевода, недостающая сумма денежных средств учитывается как денежное обязательство Участника пула перед Клиринговым центром по такому Расчетному коду.

Указанное денежное обязательство Участника пула включается в Единый клиринговый пул в соответствии с общей частью Правил клиринга.

26.15. В случае принятия Клиринговым центром решения об изменении риск-параметров в ходе торгов, Клиринговый центр рассчитывает новые значения Единого лимита по пулу по каждому Расчетному коду имущественного пула в соответствии со статьей 16 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов и осуществляет погашение клиринговых сертификатов участия в связи с изменением стоимости имущества, внесенного в соответствующий имущественный пул, в порядке, аналогичном порядку, указанному в пункте 26.4 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

Выставление Маржинальных требований по пулу в ходе торгов не осуществляется.

ПОДРАЗДЕЛ V-III. ПОРЯДОК ВКЛЮЧЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ В КЛИРИНГОВЫЙ ПУЛ

Статья 27. Общие требования к порядку исполнения обязательств по сделкам и обязательств по внесению компенсационных взносов

27.1. Для исполнения обязательств по сделкам / дополнительных обязательств, принятых при подачи заявки на заключение депозитного договора, Участники клиринга категории «О», «Б» и «В» обязаны обеспечивать наличие денежных средств / ценных бумаг, учитываемых по Расчетным кодам / Торгово-клиринговым счетам, по которым осуществлялась проверка достаточности обеспечения при подаче заявок на заключение соответствующих сделок, определяемых в соответствии со статьей 19 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

27.2. Участник клиринга категории «А» или «К» может заключать биржевые сделки без предварительного внесения индивидуального клирингового обеспечения в денежных средствах.

27.2.1. Для исполнения обязательств по заключенным Сделкам Т+ Участник клиринга категории «А» обязан внести денежные средства на клиринговый банковский или корреспондентский счет Клирингового центра по реквизитам, размещенным на Сайте Клирингового центра, с обязательным указанием в назначении платежа Расчетного кода Участника клиринга, и/или ценные бумаги на Разделы Т+ до установленного Временным регламентом, являющимся приложением к общей части Правил клиринга, времени исполнения Участниками клиринга Итоговых нетто-обязательств Участника клиринга по денежным средствам / Итоговых нетто-обязательств по ценным бумагам (для Сделок Т+).

27.2.2. Для исполнения обязательств по заключенным Сделкам Т+ Участник клиринга категории «К» обязан внести денежные средства на клиринговый банковский или корреспондентский счет Клирингового центра по реквизитам, размещенным на Сайте Клирингового центра, с обязательным указанием в назначении платежа Расчетного кода Участника клиринга до установленного Временным регламентом, являющимся приложением к общей части Правил клиринга, времени исполнения Участниками клиринга Итоговых нетто-обязательств Участника клиринга по денежным средствам (для Сделок Т+).

27.2.3. Для исполнения обязательств по денежным средствам по сделкам, за исключением Сделок Т+, Участник клиринга категории «А» обязан внести денежные средства на клиринговый банковский или корреспондентский счет Клирингового центра по реквизитам, размещенным на Сайте Клирингового центра, с обязательным указанием в назначении платежа Расчетного кода Участника клиринга, до установленного Временным регламентом на фондовом рынке и рынке депозитов момента окончания Процедуры контроля обеспечения по сделкам с расчетами в соответствующей валюте.

27.2.4. Денежные средства, перечисленные Участником клиринга категории «А» или «К» на клиринговый банковский или корреспондентский счет Клирингового центра, учитываются по Расчетному коду, указанному в назначении платежа.

27.3. Исполнение обязательств по сделкам купли-продажи с кодом расчетов T0, K0, первым частям сделок РЕПО с кодом расчетов Rb осуществляется в ходе первой и второй расчётной клиринговой сессии, время проведение которых установлено Временным регламентом, являющимся приложением к общей части Правил клиринга.

27.4. Обязательства по Сделкам T+ включаются в Единый клиринговый пул и исполняются в порядке, определенном общей частью Правил клиринга.

27.5. Участник клиринга вправе в Дату исполнения обязательств по сделкам купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов Yn (за исключением сделок, заключенных на основании заявок с указанием Торгово-клирингового счета имущественного пула), первой или второй части сделок РЕПО с кодом расчетов Ym/Yn (за исключением сделок РЕПО, которым соответствует депозитный договор или заявка на заключение депозитного договора, внесенная в реестр предложений), второй части сделок РЕПО с кодом расчетов T0/Yn, заключенным на основании адресных заявок, исполнить их досрочно, путем подачи в Клиринговую систему Отчета на исполнение, Специального отчета на исполнение или Срочного отчета на исполнение.

Порядок подачи и условия регистрации в Клиринговой системе Отчета на исполнение определены в статье 28 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, Специального и Срочного отчета на исполнение – в статье 32 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

27.6. Исполнение обязательств по сделкам купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов Bn, B0-B30, первым и вторым частям сделок РЕПО с кодом расчетов Sn, вторым частям сделок РЕПО с кодом расчетов Z0 или Rb осуществляется путем подачи Участником клиринга в Клиринговую систему Отчета на исполнение, Специального отчета на исполнение или Срочного отчета на исполнение.

27.7. Исполнение обязательства по внесению компенсационного взноса осуществляется путем подачи Участником клиринга в Клиринговую систему Поручения на внесение компенсационного взноса.

Исполнение обязательств по внесению компенсационного взноса не осуществляется в случае отказа контрагента от получения компенсационного взноса.

Порядок подачи и условия регистрации в Клиринговой системе Поручений на внесение компенсационных взносов и Поручений на отказ от компенсационных взносов определен в статье 30 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

Участник клиринга вправе для исполнения обязательств по внесению компенсационного взноса (компенсационных взносов) включить их в Специальный или Срочный отчет на исполнение.

Частичное исполнение обязательств по внесению компенсационных взносов не допускается.

27.8. Участник клиринга, имеющий обязательства по внесению компенсационных взносов и/или по сделкам купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов Bn, B0-

B30, первым и вторым частям сделок РЕПО с кодом расчетов Sn, вторым частям сделок РЕПО с кодом расчетов Z0 или Rb, Дата исполнения обязательств по которым наступила и которые были включены им в Специальный или Срочный отчет на исполнение, но не были обеспечены средствами под исполнение до момента окончания периода получения Клиринговым центром от Участников клиринга Специальных и Срочных отчетов на исполнение, обязан до момента окончания периода регистрации поручений зарегистрировать в Клиринговой системе Отчет на исполнение по каждой такой сделке (первой или второй части такой сделки РЕПО), и/или Поручение на внесение каждого такого компенсационного взноса.

27.9. На фондовом рынке и рынке депозитов Участник клиринга вправе заменить Торгово-клиринговый счет 1-го, 2-го и/или 3-го уровня, определяющий клиринговые регистры и набор счетов, по которым учитываются и должны исполняться обязательства по Сделке (Сделкам) за исключением Торгово-клирингового счета, предназначенного для заключения депозитных договоров.

Порядок и условия такой замены определены общей частью Правил клиринга.

27.10. Для исполнения обязательств по сделкам, Маржинальных требований и Маржинальных требований по пулу Участник клиринга / Клиринговый центр вправе с использованием WEB-сервиса Расчетного депозитария подать Запрос на подбор ценных бумаг. Порядок подачи и исполнения Запросов на подбор ценных бумаг определен общей частью Правил клиринга.

27.11. Участник клиринга вправе по согласованию с контрагентом отказаться от исполнения обязательств по сделке РЕПО с кодом расчетов Sn до момента исполнения первой части такой сделки РЕПО.

Порядок подачи и исполнения Поручений на отказ от исполнения сделки РЕПО определен в статье 31 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

27.12. Участник клиринга вправе по согласованию с контрагентом отказаться от исполнения обязательств по сделке купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов B0-B30, не обеспеченной средствами под исполнение.

Порядок подачи и исполнения Поручений на отказ от исполнения сделки купли-продажи ценных бумаг определен в статье 31 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

27.13. Если Правилами торгов на фондовом рынке и рынке депозитов не предусмотрено иного, то в случае если Дата исполнения обязательств по сделке приходится не на Расчетный день, то Датой исполнения обязательств по сделке считается первый следующий за этой датой Расчетный день. При этом обязательства по сделке пересчитываются с учетом такого изменения Даты исполнения, если решением Клирингового центра не установлено иное.

27.14. Участник клиринга вправе потребовать возврата части депозита до наступления Даты исполнения обязательств по возврату депозита и пополнить депозит до первоначальной суммы депозита в порядке и на условиях, определенных в статье 35 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

27.15. Участник клиринга вправе до Даты исполнения обязательств по второй части сделок РЕПО с кодом расчетов Ym/Yn (за исключением сделок РЕПО, которым соответствует депозитный договор или заявка на заключение депозитного договора, внесенная в реестр предложений), второй части сделок РЕПО с кодом расчетов T0/Yn, заключенным на основании адресных заявок, изменить Дату исполнения обязательств путем подачи в Клиринговую систему Поручения на изменение срока исполнения обязательств по сделке.

Порядок подачи и условия исполнения Поручений на изменение срока исполнения обязательств по сделке определены в статье 36 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

27.16. Участник клиринга соглашается с тем, что подача Участником торгов заявки на условиях «Частичное обеспечение/отступное» с указанием Участника клиринга в качестве стороны по договору купли-продажи в случае, если Правилами торгов на фондовом рынке и рынке депозитов, решением Биржи будет установлено, что заявки на покупку / продажу ценных бумаг в определенных Биржей Режимах торгов подаются на условиях «Частичное обеспечение/отступное», будет означать:

27.16.1. принятие Участником клиринга обязательств перед эмитентом / Заявителем по заключению соответствующего договора купли-продажи ценных бумаг;

27.16.2. принятие Участником клиринга обязательства обеспечить наличие денежных средств / ценных бумаг в сумме / количестве, достаточной (-ом) для заключения сделки по заявке в момент проведения Процедуры контроля обеспечения в соответствии с пунктом 20.3 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов;

27.16.3. принятие Участником клиринга обязательства обеспечить наличие денежных средств / ценных бумаг в сумме / количестве, необходимой (-ом) для проведения дополнительной Процедуры контроля обеспечения по заявке в соответствии с пунктом 20.4 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов в момент, установленный решением Биржи, а также согласие Участника клиринга с тем, что сумма частичного обеспечения становится доступной для распоряжения Участником клиринга в срок, определенный решением Биржи, но не позже Расчетного дня, следующего за днём, в котором была заключена сделка по поданной заявке.

Указанные в настоящему пункте обязательство возникают у Участника клиринга в момент регистрации соответствующей заявки Участника торгов в реестре заявок.

27.17. Участники клиринга, указанные в заявках в качестве сторон по договору купли-продажи ценных бумаг, соглашаются с тем, что отсутствие у Участника клиринга (потенциального покупателя в случае выставления заявки в Режиме «Размещение: Адресные заявки» и, соответственно, потенциального продавца в случае выставления заявки в Режиме «Выкуп: Адресные заявки») в момент активации денежных средств/ценных бумаг в сумме/количестве, достаточной (-ом) для заключения сделки, означает неисполнение таким Участником клиринга обязательства, указанного в подпункте 27.16.3 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов и отказ от обязательства по заключению договора, указанного подпункте 27.16.1. Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов Участники клиринга, указанные во встречных заявках в качестве сторон

по договору купли-продажи ценных бумаг, соглашаются с тем, что данное обязательство по заключению договора может быть прекращено предоставлением взамен исполнения отступного на следующих условиях:

- Участник клиринга, допустивший отказ от исполнения обязательства по заключению договора, взамен исполнения указанного обязательства предоставляет Участнику клиринга, указанному в заявке в качестве стороны по договору, отступное. Сумма отступного рассчитывается как произведение ставки отступного и объема заявки, включающего НКД (для заявок на покупку) и как произведение ставки отступного и объема заявки (для заявок на продажу). Ставка отступного устанавливается решением Клирингового центра;
- с момента предоставления отступного обязательства Участника клиринга, допустившего отказ от исполнения обязательства по заключению договора, указанные в пунктах 27.16.1 - 27.16.2 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов прекращаются полностью;
- моментом предоставления отступного является момент исполнения (прекращения) Итогового нетто-обязательства по денежным средствам, учитываемого по соответствующему Расчетному коду, определенному в Едином клиринговом пуле в соответствии с общей частью Правил клиринга;
- передача отступного осуществляется в соответствии с порядком, установленным Правилами клиринга.

27.18. В случаях если между датой заключения Сделки купли-продажи акций (включая эту дату) и Датой исполнения обязательств по Сделке купли-продажи акций (не включая эту дату) в отношении акций, с которыми заключена Сделка, происходят корпоративные действия, предусматривающие дробление или консолидацию акций, условия указанных Сделок в дату проведения корпоративного действия или в дату, в которую Клиринговый центр узнал о проведении корпоративного действия, после завершения расчетов по ценным бумагам по итогам клиринга в соответствии с пунктом 42.10 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов изменяются следующим образом:

27.18.1. В случае дробления акций:

- новое значение количества ценных бумаг в Сделке определяется как произведение количества ценных бумаг в Сделке до проведения корпоративного действия и коэффициента дробления;
- новое значение цены Сделки определяется как частное от деления суммы сделки и нового количества ценных бумаг в Сделки;
- сумма сделки не изменяется.

27.18.2. В случае консолидации акций:

- новое значение количества ценных бумаг в Сделке определяется как частное от деления количества ценных бумаг в Сделке до проведения корпоративного действия и коэффициента консолидации, округленное до ближайшего меньшего целого значения;
- новое значение цены Сделки определяется как произведение значения цены Сделки до проведения корпоративного действия и коэффициента консолидации;

- новое значение суммы сделки определяется как произведение нового значения количества ценных бумаг в Сделке и нового значения цены Сделки.

Статья 28. Порядок подачи и условия регистрации Отчетов на исполнение

28.1. Отчет на исполнение может быть подан по сделке купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов Bn, B0-B30, первой части сделки РЕПО с кодом расчетов Sn, второй части сделки РЕПО с кодом расчетов Sn, Z0 и Rb, а также по сделке купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов Yn (за исключением сделок, заключенных на основании заявок с указанием Торгово-клирингового счета имущественного пула), первой или второй части сделки РЕПО с кодом расчетов Ym/Yn (за исключением сделок РЕПО, которым соответствует депозитный договор или заявка на заключение депозитного договора, внесенная в реестр предложений), второй части сделки РЕПО с кодом расчетов T0/Yn, заключенным на основании адресных заявок.

28.2. Отчет на исполнение может быть подан Участником клиринга в Клиринговую систему в ходе периода регистрации поручений в следующие даты:

- по биржевой сделке с кодом расчетов B0 - с даты заключения до Даты прекращения исполнения;
- по биржевой сделке с кодом расчетов B01-B30, B01-Bn - с Расчетного дня, следующего за датой ее заключения, до Даты прекращения исполнения;
- по первой части сделки РЕПО с кодом расчетов Sn - с Даты исполнения первой части сделки РЕПО до Даты прекращения ее исполнения;
- по второй части сделки РЕПО с кодом расчетов Sn, Z0 и Rb - с Даты исполнения первой части сделки РЕПО до Даты прекращения исполнения второй части сделки РЕПО;
- по сделке купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов Yn, первой или второй части сделки РЕПО с кодом расчетов Ym/Yn, второй части сделки РЕПО с кодом расчетов T0/Yn, заключенным на основании адресных заявок, - в Дату исполнения.

28.3. Отчет на исполнение по второй части сделки РЕПО с кодом расчетов Sn, Z0 и Rb может быть подан Участником клиринга в Клиринговую систему при условии, что первая часть сделки РЕПО является обеспеченной средствами под исполнение.

Отчет на исполнение по второй части сделки РЕПО с кодом расчетов T0/Yn, Ym/Yn, заключенной на основании адресных заявок, может быть подан Участником клиринга в Клиринговую систему при условии исполнения первой части сделки РЕПО.

28.4. Отчет на исполнение, поданный Участником клиринга - покупателем, регистрируется в Клиринговой системе при прохождении в момент подачи Отчета на исполнение всех соответствующих проверок, предусмотренных статьей 29 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, в отношении обязательства данного Участника клиринга по денежным средствам, возникшего по данной сделке (первой или второй части сделки РЕПО) (с учетом НКД).

28.5. Отчет на исполнение, поданный Участником клиринга - продавцом, регистрируется в Клиринговой системе при прохождении в момент подачи Отчета на исполнение всех соответствующих проверок, предусмотренных статьей 29 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, в отношении обязательства данного Участника клиринга по ценным бумагам, возникшего по данной сделке (первой или второй части сделки РЕПО).

28.6. Отсутствие в Клиринговой системе зарегистрированного Отчета на исполнение по не обеспеченной средствами под исполнение сделке купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов Bn, B0-B30, первой части сделки РЕПО с кодом расчетов Sn, второй части сделки РЕПО с кодом расчетов Sn, Z0 и Rb в Дату ее исполнения по состоянию на момент окончания периода регистрации поручений признается нарушением со стороны Участника клиринга требований Правил клиринга, повлекшим неисполнение обязательств по данной сделке (первой или второй части сделки РЕПО) в Дату исполнения.

28.6.1. В случае если, в Дату исполнения второй части сделки РЕПО с кодом расчетов Sn, Z0 и Rb в Клиринговой системе Отчет на исполнение был зарегистрирован только одним Участником клиринга, такой Участник клиринга вправе не выставлять Отчет на исполнение по второй части сделки РЕПО с кодом расчетов Sn, Z0 и Rb после Даты ее исполнения в случаях, предусмотренных пунктом 28.2 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, и потребовать проведения Процедуры урегулирования взаимных требований по сделкам, заключенным без участия центрального контрагента, установленной статьей 40 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, в Дату исполнения после окончания периода регистрации поручений.

28.7. Участнику клиринга в Клиринговой системе раскрывается информация о регистрации Отчета на исполнение по сделке купли-продажи ценных бумаг, первой или второй части сделки РЕПО, поданного в Клиринговую систему его контрагентом / конечным контрагентом.

28.8. Участники клиринга вправе до окончания периода регистрации поручений отзывать зарегистрированные Отчеты на исполнение и подавать новые Отчеты на исполнение при условии, что сделки (первые или вторые части сделки РЕПО), по которым подан Отчет на исполнение, не являются обеспеченным средствами под исполнение в соответствии с пунктом 28.9 настоящей статьи Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

28.9. При условии регистрации в Клиринговой системе Отчетов на исполнение по сделке купли-продажи ценных бумаг (первой или второй части сделки РЕПО), поданных обоими Участниками клиринга - сторонами по данной сделке / конечными контрагентами по парным сделкам, данная сделка / сделки (первая или вторая часть сделки РЕПО) считается обеспеченной / обеспеченными средствами под исполнение, и обязательства по данной сделке / сделкам (первой или второй части сделки РЕПО) включаются в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов / в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов по сделкам с центральным контрагентом с ближайшим временем исполнения.

28.10. В случае если вторая часть биржевой сделки РЕПО становится обеспеченной средствами под исполнение до Даты исполнения, Клиринговый центр формирует и передает Бирже Отчет о досрочном исполнении сделок РЕПО.

28.11. Отчет на исполнение по Сделке Т+, не обеспеченной средствами под исполнение на ближайшее время исполнения Участниками клиринга Итоговых нетто-обязательств по ценным бумагам, установленное Временным регламентом, являющимся приложением к общей части Правил клиринга, исключается из Клиринговой системы и не подлежит исполнению. Исполнение (прекращение) обязательств по такой Сделке Т+ осуществляется в сроки, установленные Временным регламентом, являющимся приложением к общей части Правил клиринга, путем включения их в Единый клиринговый пул в порядке, определенном общей частью Правил клиринга.

Отчет на исполнение по сделке, не обеспеченной средствами под исполнение до окончания периода регистрации поручений, после его окончания исключается из Клиринговой системы и не подлежит исполнению.

Статья 29. Проверки, выполняемые при подаче Отчетов на исполнение, Специальных отчетов на исполнение, Срочных отчетов на исполнение, поручений на внесение компенсационных взносов, поручений на отказ от компенсационных взносов, Поручений на отказ от исполнения сделки РЕПО / Поручений на отказ от исполнения сделки купли-продажи ценных бумаг

29.1. Проверка достаточности денежных средств по Счету обеспечения Т0 считается пройденной при условии превышения (равенства) суммы денежных средств, учитываемой по соответствующему Счету обеспечения Т0, за вычетом соответствующего Ограничительного лимита, величины(е) обязательства Участника клиринга по денежным средствам, в отношении которого осуществляется проверка.

29.2. Проверка достаточности денежных средств по Расчетному коду, соответствующему Счету обеспечения, считается пройденной при соблюдении следующих условий:

- Единый лимит по Расчетному коду с учетом обязательства Участника клиринга по денежным средствам, в отношении которого осуществляется проверка, не станет отрицательным, или, если Единый лимит по такому Расчетному коду был отрицательным до момента проверки, - проверку того, что Единый лимит по такому Расчетному коду, рассчитанный с учетом указанного обязательства, не станет меньше, чем Единый лимит по этому Расчетному коду, рассчитанный до момента проверки;
- сумма обязательства Участника клиринга по денежным средствам, в отношении которого осуществляется проверка, не превышает максимального из двух значений: (1) значения Обеспечения в соответствующей валюте, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, уменьшенного на сумму обязательства с отложенным исполнением в такой валюте, определенного в соответствии с общей частью Правил клиринга; (2) суммы (с учетом знака) значения Обеспечения, уменьшенного на сумму обязательства

с отложенным исполнением в такой валюте, определенного в соответствии с общей частью Правил клиринга, и Нетто-обязательства / Нетто-требования в соответствующей валюте с текущей Датой исполнения, учитываемых по Расчетному коду.

- для Расчетного кода Участника клиринга с признаком «запрет необеспеченных покупок» и/или для Расчетного кода Участника клиринга категории «В», – значения в валюте, в которой проводятся расчеты по Сделке, рассчитанные в соответствии с общей частью Правил клиринга для проверки возможности исполнения операции, проводимой по Торгово-клиринговому счету Участника клиринга при наличии признака «запрет необеспеченных покупок» / «запрет коротких продаж», и/или Участника клиринга категории «В», с учетом обязательства Участника клиринга по денежным средствам, в отношении которого осуществляется проверка, для каждой Даты исполнения не станут отрицательными;
- для Расчетного кода Единого пула – в случае положительного результата дополнительной проверки Единого лимита, указанной в общей части Правил клиринга.

29.3. Проверка достаточности ценных бумаг по Торгово-клиринговому счету Т0 считается пройденной при условии превышения (равенства) количества ценных бумаг, учитываемых по соответствующему Торгово-клиринговому счету Т0, за вычетом соответствующего Ограничительного лимита, величины(е) обязательства Участника клиринга по ценным бумагам, в отношении которого осуществляется проверка.

29.4. Дополнительно к условию, указанному в пункте 29.3 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, проверка достаточности ценных бумаг по Торгово-клиринговому счету Т+ считается пройденной при соблюдении следующих условий:

- Единый лимит по Расчетному коду с учетом величины обязательства Участника клиринга по ценным бумагам, в отношении которого осуществляется проверка, не станет отрицательным, или, если Единый лимит по такому Расчетному коду был отрицательным до момента проверки, - проверку того, что Единый лимит по такому Расчетному коду, рассчитанный с учетом указанного обязательства, не станет меньше, чем Единый лимит по этому Расчетному коду, рассчитанный до момента проверки;
- для Торгово-клирингового счета Т+ с признаком «запрет коротких продаж», и/или для Участника клиринга категории «В», и/или ценных бумаг с признаком «запрет коротких продаж» – значения в ценных бумагах, рассчитанные в соответствии с общей частью Правил клиринга для проверки возможности исполнения операции, проводимой по Торгово-клиринговому счету Участника клиринга при наличии признака «запрет необеспеченных покупок» / «запрет коротких продаж», и/или Участника клиринга категории «В», и/или ценных бумаг с признаком «запрет коротких продаж», с учетом обязательства Участника клиринга по ценным бумагам, в отношении которого осуществляется проверка, для каждой Даты исполнения или для каждой Даты исполнения, приходящейся на период действия (в случае если Клиринговым центром установлен период действия признака «запрет

коротких продаж» по ценной бумаге), не станут отрицательными;

- для Торгово-клирингового счета Т+, в состав которого входит Расчетный код Единого пула, – в случае положительного результата дополнительной проверки Единого лимита, указанной в общей части Правил клиринга.

29.5. Проверки, указанные в настоящей статье Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, осуществляются с учетом положений подпункта 20.1.14 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

Статья 30. Порядок подачи и условия регистрации поручений на внесение компенсационных взносов и поручений на отказ от компенсационных взносов

30.1. Для исполнения обязательств по внесению компенсационного взноса Участник клиринга, имеющий такое обязательство, в Дату внесения компенсационного взноса формирует и подает в Клиринговую систему Поручение на внесение компенсационного взноса.

30.2. Поручение на внесение компенсационного взноса может быть подано в Клиринговую систему в ходе периода регистрации поручений в Дату внесения компенсационного взноса.

30.3. Поручение на внесение компенсационного взноса в виде денежных средств, поданное Участником клиринга, регистрируется в Клиринговой системе при прохождении в момент подачи Поручения всех соответствующих проверок, предусмотренных статьей 29 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, в отношении обязательства данного Участника клиринга по внесению компенсационного взноса.

30.4. Поручение на внесение компенсационного взноса в виде ценных бумаг, поданное Участником клиринга, регистрируется в Клиринговой системе при прохождении в момент подачи Поручения всех соответствующих проверок, предусмотренных статьей 29 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, в отношении обязательства данного Участника клиринга по внесению компенсационного взноса.

30.5. При условии регистрации в Клиринговой системе Поручения на внесение компенсационного взноса, поданного Участником клиринга, компенсационный взнос считается обеспеченным средствами под исполнение, и обязательства по внесению данного компенсационного взноса включаются в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов ближайшей расчетной клиринговой сессии.

30.6. Участнику клиринга в Клиринговой системе раскрывается информация о регистрации Поручения на внесение компенсационного взноса, поданного в Клиринговую систему его контрагентом по соответствующей сделке.

30.7. Участник клиринга вправе отказаться от получения компенсационного взноса. Для этого Участники клиринга, являющиеся контрагентами по биржевой сделке РЕПО, до окончания периода регистрации поручений в Дату внесения компенсационного взноса формируют и подают в Клиринговую систему Поручения на отказ от компенсационного взноса.

Поручение на отказ от компенсационного взноса может быть подано при условии, что компенсационный взнос не является обеспеченным средствами под исполнение в соответствии с пунктом 30.5 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

При регистрации в Клиринговой системе Поручений на отказ от компенсационного взноса со стороны каждого из Участников клиринга – контрагентов по биржевой сделке РЕПО, внесение компенсационного взноса по данной сделке не осуществляется и факт неисполнения обязательств по внесению компенсационного взноса со стороны Участника клиринга, имеющего обязательство по внесению компенсационного взноса, не регистрируется.

30.8. Участнику клиринга в Клиринговой системе раскрывается информация о регистрации Поручения на отказ от компенсационного взноса, поданного в Клиринговую систему его контрагентом.

30.9. Отзыв Участником клиринга ранее зарегистрированного в Клиринговой системе Поручения на отказ от компенсационного взноса возможен только до момента регистрации в Клиринговой системе Поручения на отказ от компенсационного взноса, поданного его контрагентом.

Статья 31. Порядок подачи и исполнения Поручений на отказ от исполнения сделки РЕПО / Поручений на отказ от исполнения сделки купли-продажи ценных бумаг

31.1. Поручение на отказ от исполнения сделки РЕПО с кодом расчетов Sn / Поручение на отказ от исполнения сделки купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов B0-B30 может быть подано в Клиринговую систему Участником клиринга, являющимся стороной по сделке, в ходе периода регистрации поручений с даты заключения сделки РЕПО / сделки купли-продажи ценных бумаг до Даты исполнения обязательств по первой части сделки РЕПО / сделке купли-продажи ценных бумаг.

31.2. Поручение на отказ от исполнения сделки РЕПО / Поручение на отказ от исполнения сделки купли-продажи ценных бумаг не может быть подано Участником клиринга, если обязательства по первой части сделки РЕПО / сделке купли-продажи ценных бумаг исполнены, или первая часть сделки РЕПО / сделка купли-продажи ценных бумаг является обеспеченной средствами под исполнение в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

31.3. Если по первой части сделки РЕПО / сделке купли-продажи ценных бумаг подан Отчет на исполнение (информация о первой части сделки РЕПО / сделке купли-продажи ценных бумаг включена в Специальный или Срочный отчет на исполнение), но первая часть сделки РЕПО / сделка купли-продажи ценных бумаг не является обеспеченной средствами под исполнение, то для подачи Поручения на отказ от исполнения сделки РЕПО / Поручения на отказ от исполнения сделки купли-продажи ценных бумаг необходимо сначала отозвать Отчет на исполнение (исключить информацию о первой части сделки РЕПО / сделке купли-продажи ценных бумаг из Специального или Срочного отчета на исполнение).

31.4. Поручение на отказ от исполнения сделки РЕПО / Поручение на отказ от исполнения сделки купли-продажи ценных бумаг содержит номер первой части сделки РЕПО / номер сделки купли-продажи ценных бумаг, от исполнения которой Участник клиринга желает отказаться, а также величину отступного за отказ от исполнения сделки РЕПО / сделки купли-продажи ценных бумаг.

31.4.1. Величина отступного может быть указана в процентах от суммы РЕПО / сделки купли-продажи ценных бумаг или как сумма отступного в той валюте, в которой проводятся расчеты по сделке РЕПО / сделке купли-продажи ценных бумаг.

31.4.2. В качестве величины отступного может быть указано отрицательное значение. Положительная величина отступного означает, что Участник клиринга, подавший Поручение на отказ от исполнения сделки РЕПО / Поручение на отказ от исполнения сделки купли-продажи ценных бумаг, обязан получить сумму отступного от контрагента по сделке, отрицательная – уплатить.

31.5. Поручение на отказ от исполнения сделки РЕПО / Поручение на отказ от исполнения сделки купли-продажи ценных бумаг, поданное Участником клиринга, обязанным уплатить отступное, регистрируется в Клиринговой системе при прохождении в момент подачи Поручения на отказ от исполнения сделки РЕПО / Поручения на отказ от исполнения сделки купли-продажи ценных бумаг всех соответствующих проверок, предусмотренных статьей 29 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, в отношении обязательства данного Участника клиринга по уплате отступного.

31.6. Участнику клиринга в Клиринговой системе раскрывается информация о регистрации Поручения на отказ от исполнения сделки РЕПО / Поручения на отказ от исполнения сделки купли-продажи ценных бумаг, поданного в Клиринговую систему его контрагентом по соответствующей сделке.

31.7. При условии регистрации в Клиринговой системе Поручений на отказ от исполнения сделки РЕПО / Поручений на отказ от исполнения сделки купли-продажи ценных бумаг, поданных обоими Участниками клиринга – сторонами по сделке:

- обязательство по уплате отступного считается обеспеченными средствами под исполнение, и включается в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов;
- обязательства по сделке РЕПО / сделке купли-продажи ценных бумаг считаются прекращенными выплатой отступного.

Статья 32. Порядок подачи и условия регистрации Специальных и Срочных отчетов на исполнение

32.1. Участник клиринга вправе включить в Специальный или Срочный отчет на исполнение:

- сделки купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов Bn, B0-B30;
- первые части сделок РЕПО с кодом расчетов Sn;
- вторые части сделок РЕПО с кодом расчетов Sn, Z0 и Rb;
- обязательства по внесению компенсационных взносов по биржевым сделкам

РЕПО;

- сделки купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов Yn, заключенные на основании адресных заявок (за исключением сделок, заключенных на основании заявок с указанием Торгово-клирингового счета имущественного пула);
- первые и вторые части сделок РЕПО с кодом расчетов Ym/Yn, заключенных на основании адресных заявок (за исключением сделок РЕПО, которым соответствует депозитный договор или заявка на заключение депозитного договора, внесенная в реестр предложений, и за исключением включения в Срочный отчет на исполнение сделок РЕПО с клиринговыми сертификатами участия);
- вторые части сделок РЕПО с кодом расчетов T0/Yn, заключенных на основании адресных заявок (за исключением включения в Срочный отчет на исполнение сделок РЕПО с клиринговыми сертификатами участия).

32.2. Специальный или Срочный отчет на исполнение может быть подан в Клиринговую систему в ходе периода регистрации поручений до установленного Временным регламентом на фондовом рынке и рынке депозитов момента окончания периода получения Клиринговым центром от Участников клиринга Специальных и Срочных отчетов на исполнение.

32.3. В Специальный или Срочный отчет на исполнение могут быть включены сделки и/или обязательства, возникшие из сделок, заключенных с одним контрагентом / парных сделок, заключенных с одним конечным контрагентом.

32.4. По всем сделкам и/или обязательствам, указанным в пункте 32.1 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов и включенным в Специальный или Срочный отчет на исполнение, Клиринговый центр для каждого Расчетного кода и Торгово-клирингового счета, по которым проводится Процедура контроля обеспечения по сделкам, включенным в Специальный или Срочный отчет на исполнение, рассчитывает нетто-обязательство (нетто-требование) Участника клиринга по денежным средствам или ценным бумагам.

32.4.1. Нетто-обязательство (нетто-требование) Участника клиринга по денежным средствам рассчитывается по формуле:

POS_VAL = ST - SO, где:

POS_VAL – нетто-обязательство (нетто-требование) Участника клиринга по денежным средствам;

ST – сумма требований, а SO – сумма обязательств Участника клиринга по денежным средствам по включенным в Специальный или Срочный отчет на исполнение сделкам и/или обязательствам.

Отрицательное значение POS_VAL означает нетто-обязательство Участника клиринга по денежным средствам, положительное значение POS_VAL – нетто-требование Участника клиринга по денежным средствам.

Нетто-обязательство (нетто-требование) Участника клиринга по денежным средствам, рассчитанное в соответствии с настоящим подпунктом Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов по обязательствам, включенным в Срочный

отчет на исполнение, является Нетто-обязательством (нетто-требованием) по денежным средствам по сделкам клирингового пула (для Клирингового пула для расчетов в ходе торгов).

32.4.2. Нетто-обязательство (нетто-требование) Участника клиринга по ценным бумагам, рассчитывается по формуле:

POS_C = STC - SOC, где:

POS_C – нетто-обязательство (нетто-требование) Участника клиринга по ценной бумаге;

STC – сумма требований, а SOC – сумма обязательств Участника клиринга по соответствующей ценной бумаге по включенным в Специальный или Срочный отчет на исполнение сделкам и/или обязательствам.

Отрицательное значение POS_C означает нетто-обязательство Участника клиринга по ценной бумаге, положительное значение POS_C – нетто-требование Участника клиринга по ценной бумаге.

Нетто-обязательство (нетто-требование) Участника клиринга по ценным бумагам, рассчитанное в соответствии с настоящим подпунктом Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов по обязательствам, включенным в Срочный отчет на исполнение, является Нетто-обязательством (нетто-требованием) по ценным бумагам по сделкам клирингового пула (для Клирингового пула для расчетов в ходе торгов).

32.5. Специальный или Срочный отчет на исполнение Участника клиринга, имеющего нетто-обязательство по денежным средствам, регистрируется в Клиринговой системе при прохождении в момент подачи Специального или Срочного отчета на исполнение всех соответствующих проверок, предусмотренных статьей 29 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, в отношении нетто-обязательства данного Участника клиринга по денежным средствам.

Специальный отчет на исполнение Участника клиринга, имеющего нетто-обязательство по ценным бумагам, регистрируется в Клиринговой системе при прохождении в момент подачи Специального отчета на исполнение всех соответствующих проверок, предусмотренных статьей 29 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, в отношении нетто-обязательства данного Участника клиринга по ценным бумагам.

Срочный отчет на исполнение Участника клиринга, имеющего нетто-обязательство по ценным бумагам, регистрируется в Клиринговой системе при прохождении в момент подачи Срочного отчета на исполнение всех соответствующих проверок, предусмотренных статьей 29 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, в отношении нетто-обязательства данного Участника клиринга по ценным бумагам, а также при условии непревышения в момент подачи Срочного отчета на исполнение данного нетто-обязательства по ценным бумагам меньшей из двух величин: количества ценных бумаг, учитываемых по соответствующему Торгово-клиринговому счету, за вычетом соответствующего Ограничительного лимита, и количества ценных бумаг, учитываемых на соответствующем Разделе по информации, полученной от Расчетного депозитария.

32.6. Участнику клиринга в Клиринговой системе раскрывается информация о регистрации Специального или Срочного отчета на исполнение, поданного в Клиринговую систему его контрагентом / конечным контрагентом.

32.7. Участники клиринга вправе до окончания периода регистрации поручений отзывать зарегистрированные Специальные или Срочные отчеты на исполнение и подавать новые Специальные или Срочные отчеты на исполнение при условии, что сделки и/или обязательства, включенные в Специальный или Срочный отчет на исполнение, еще не являются обеспеченными средствами под исполнение в соответствии с пунктом 32.9 / 32.10 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

32.8. Специальные и Срочные отчеты на исполнение, содержащие Сделки Т+ и не обеспеченные средствами под исполнение на ближайшее время исполнения Участниками клиринга Итоговых нетто-обязательств по ценным бумагам, установленное Временным регламентом, являющимся приложением к общей части Правил клиринга, исключаются из Клиринговой системы и не подлежат исполнению. Исполнение (прекращение) обязательств по Сделкам Т+, ранее включенным в такие отчеты, осуществляется в сроки, установленные Временным регламентом, являющимся приложением к общей части Правил клиринга, путем включения их в Единый клиринговый пул в порядке, определенном общей частью Правил клиринга.

Специальные и Срочные отчеты на исполнение, не обеспеченные средствами под исполнение до окончания периода регистрации поручений, после его окончания исключаются из Клиринговой системы и не подлежат исполнению.

32.9. При условии регистрации в Клиринговой системе Специальных отчетов на исполнение, поданных обоими Участниками клиринга - контрагентами / конечными контрагентами и содержащих одинаковый набор сделок / парных сделок и/или обязательств, указанные сделки и/или обязательства считаются обеспеченными средствами под исполнение, а обязательства (требования) Участников клиринга по денежным средствам или ценным бумагам по сделкам и/или обязательствам, включенным в такие Специальные отчеты на исполнение, включаются в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов / Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов по сделкам с центральным контрагентом с ближайшим временем исполнения.

32.10. При условии регистрации в Клиринговой системе Срочных отчетов на исполнение, поданных обоими Участниками клиринга - контрагентами / конечными контрагентами и содержащих одинаковый набор сделок / парных сделок и/или обязательств, указанные сделки и/или обязательства считаются обеспеченными средствами под исполнение, а нетто-обязательства (нетто-требования) Участников клиринга по денежным средствам или ценным бумагам, рассчитанные по сделкам и/или обязательствам, включенным в такие Срочные отчеты на исполнение, включаются в Клиринговый пул для расчетов в ходе торгов / Клиринговый пул для расчетов в ходе торгов по сделкам с центральным контрагентом.

Статья 33. Порядок определения и включения в клиринговый пул обязательств Участников клиринга по уплате Возмещения

33.1. Определение и учет обязательств и требований Участников клиринга по уплате Возмещения осуществляется в Клиринговой системе в российских рублях в отдельности по каждой биржевой сделке с ценными бумагами.

33.2. Обязательства и требования Участников клиринга по уплате Возмещения определяются в Клиринговой системе только по биржевым сделкам, в том числе по сделкам РЕПО, неисполненным до Даты прекращения исполнения, по которым только одним из Участников клиринга нарушены требования Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, повлекшим неисполнение обязательств по биржевой сделке с ценными бумагами в Дату исполнения.

Размер обязательств по уплате / требований по получению Участниками клиринга Возмещения определяются в Клиринговой системе в Дату прекращения исполнения этих сделок в соответствии со статьей 41 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, и допускаются к клирингу.

33.3. Обязательство Участника клиринга по уплате Возмещения подлежит исполнению начиная с Расчетного дня, следующего за Датой прекращения исполнения соответствующей биржевой сделки. При этом в Расчетный день, следующий за Датой прекращения исполнения биржевой сделки с ценными бумагами, величина обязательства по уплате Возмещения по этой сделке, учитываемая по Счету обеспечения Т0, включается в Ограничительный лимит по такому Счету обеспечения Т0.

В случае неисполнения обязательств по уплате Возмещения, учитываемого по Счету обеспечения Т0, значение Ограничительного лимита устанавливается в размере совокупных неисполненных обязательств Участника клиринга по уплате Возмещения ежедневно до тех пор, пока обязательства по уплате Возмещения учитываются в Клиринговой системе.

33.4. Учет обязательства Участника клиринга по уплате Возмещения может быть прекращен в Клиринговой системе (до удержания с этого Участника клиринга денежных средств в размере его обязательства по уплате Возмещения) на основании полученного от Участника клиринга уведомления об отказе от получения Фиксированного возмещения, в соответствии с пунктом 41.4 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

33.5. Обязательства Участника клиринга по уплате Возмещения исполняются после исполнения обязательств Участника клиринга по денежным средствам, определенных в соответствии со статьей 42 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, и обязательств Участника клиринга по уплате комиссионных вознаграждений и неустоек в соответствии со статьей 46 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

33.5.1. Возмещение по биржевым сделкам с ценными бумагами удерживается с Участников клиринга в порядке возрастания номеров сделок.

33.5.2. Возмещение по биржевой сделке с ценными бумагами может быть удержано только в полном объеме, частичное удержание Возмещения по биржевой сделке не допускается.

33.6. Обеспечение Участника клиринга в российских рублях является достаточным для исполнения обязательств по уплате Возмещения, учитываемых по Расчетному коду Участника клиринга, если размер Обеспечения Участника клиринга в российских рублях, учитываемого по такому Расчетному коду, не меньше, чем размер указанных обязательств.

33.6.1. Обязательства по уплате / требования по получению Возмещения, учитываемые по Расчетному коду Участника клиринга, для исполнения которых достаточно Обеспечения, включаются в Единый клиринговый пул и исполняются в порядке, определенном общей частью Правил клиринга.

33.7. Неисполненные обязательства по уплате Возмещения по сделкам РЕПО, учитываемые по Счету обеспечения Т0, учитываются в Клиринговой системе только в Расчетный день, следующий за Датой прекращения исполнения сделки, по иным сделкам - в течение 3 (трех) месяцев с Расчетного дня, следующего за Датой прекращения исполнения сделки, по которой возникли указанные обязательства по уплате Возмещения.

По истечении указанного срока обязательства по уплате Возмещения не подлежат исполнению в Клиринговой системе.

33.7.1. Прекращение учета обязательств по уплате Возмещения в Клиринговой системе не влечет прекращение указанных обязательств. Требования о надлежащем исполнении указанных обязательств могут быть предъявлены любой из сторон в соответствии с гражданским законодательством при условии соблюдения порядка разрешения споров, предусмотренного общей частью Правил клиринга.

Статья 34. Порядок включения в клиринговый пул и исполнения обязательств по депозитным договорам

34.1. В момент времени определенный Временным регламентом как время первого в течение Расчетного дня исполнения Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований по денежным средствам в соответствующей валюте Клиринговый центр включает в Клиринговый пул для расчетов по депозитам обязательства Клирингового центра по возврату Участникам клиринга депозитов с наступившей Датой исполнения.

34.2. Исполнение обязательств по возврату депозитов с наступившей Датой исполнения, проверка достаточности денежных средств для заключения депозитного договора и исполнение обязательств по внесению депозитов осуществляются в момент времени, определенный Временным регламентом как время первого в течение Расчетного дня исполнения Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований по денежным средствам в соответствующей валюте.

34.3. Заключение депозитных договоров осуществляется за счет Обеспечения, внесенного до времени, определенного Временным регламентом как время первого в течение Расчетного дня исполнения Итоговых нетто-обязательств / Итоговых

нетто-требований по денежным средствам в соответствующей валюте, и/или за счет Обеспечения, полученного Участником клиринга в результате исполнения Клиринговым центром обязательств по возврату Участнику клиринга депозитов с наступившей Датой исполнения, в порядке возрастания плановой даты заключения депозитного договора, а для заявок на заключение депозитных договоров с одинаковой плановой датой заключения депозитных договоров – в порядке возрастания даты и времени внесения заявки на заключение депозитного договора в реестр предложений.

34.4. Обязательство Клирингового центра по возврату Участнику клиринга депозита с наступившей Датой исполнения включает в себя обязательство по возврату суммы депозита и суммы процентов, рассчитанной в соответствии с условиями заключенного депозитного договора и/или статьей 35 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов (применяется в случае изменения Участником клиринга суммы депозита). Датой исполнения обязательств Клирингового центра по возврату Участнику клиринга депозита является дата возврата депозита, определенная в соответствии с условиями депозитного договора и Правилами торгов на фондовом рынке и рынке депозитов.

Документом, удостоверяющим возврат депозита, является Отчет о движении денежных средств, предоставляемый Клиринговым центром Участнику клиринга.

34.5. Обязательство Клирингового центра по возврату Участнику клиринга депозита в соответствующей валюте, учитываемое по Расчетному коду Участника клиринга, прекращается возникновением обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга Обеспечения в соответствующей валюте, учитываемого по тому же Расчетному коду. При этом размер Обеспечения Участника клиринга в соответствующей валюте, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, увеличивается на размер обязательства по возврату депозита.

34.6. Проверка достаточности денежных средств для заключения депозитного договора осуществляется в плановую дату заключения депозитного договора в соответствии с кодом расчетов, указанным в заявке на заключение депозитного договора, внесенной в реестр предложений, и в Расчетный день, следующий за указанной датой, в случае недостаточности в плановую дату заключения депозитного договора денежных средств для заключения депозитного договора в сумме депозита, указанной в заявке на заключение депозитного договора, внесенной в реестр предложений.

34.6.1. Сумма денежных средств Участника клиринга является достаточной для заключения депозитного договора, если сумма Обеспечения в денежных средствах, учитываемая по Расчетному коду (с учетом исполнения Клиринговым центром обязательств по возврату депозитов Участнику клиринга любой категории, кроме категории «К», Дата исполнения которых наступила, либо с учетом исполнения Клиринговым центром обязательств по возврату суммы депозита Участнику клиринга категории «К», Дата исполнения которых наступила) больше или равна сумме депозита, указанной в заявке на заключение депозитного договора, внесенной в реестр предложений, поданной с указанием Торгово-клирингового счета, в состав которого входит такой Расчетный код, и не достаточной – если меньше.

34.6.2. Депозитный договор заключается за счет денежных средств, учитываемых в качестве Обеспечения по Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в заявке на заключение депозитного договора, внесенной в реестр предложений, на максимальную сумму, не превышающую одновременно сумму депозита, указанную в заявке на заключение депозитного договора, внесенной в реестр предложений, и сумму Обеспечения в соответствующей валюте округленную до ближайшего меньшего целого числа, учитываемую по соответствующему Расчетному коду, учитывающую уменьшение на сумму определенных в текущую дату обязательств по уплате оборотных частей комиссионных вознаграждений по депозитным договорам (при заключении депозитного договора в российских рублях).

Документом, удостоверяющим внесение депозита, является Отчет о движении денежных средств, предоставляемый Клиринговым центром Участнику клиринга.

34.6.3. Депозитный договор на сумму, равную разности суммы депозита, указанной в заявке на заключение депозитного договора, внесенной в реестр предложений, и суммы депозитных договоров, заключенных на основании такой заявки, может быть заключен в следующий Расчетный день (за исключением депозитных договоров со сроком 1 день).

За обеспечение возможности заключения депозитного договора в следующий Расчетный день Клиринговый центр взимает с Участника клиринга комиссионное вознаграждение, установленное Тарифами Клирингового центра. Указанное комиссионное вознаграждение определяется в плановую дату заключения депозитного договора и учитывается по Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в заявке на заключение депозитного договора, внесенной в реестр предложений. Обязательства по уплате указанного комиссионного вознаграждения включаются в Единый клиринговый пул и исполняются в порядке, установленном общей частью Правил клиринга.

34.7. Участник клиринга вправе предоставить Клиринговому центру Заявление об объединении заявок на заключение депозитных договоров.

34.7.1. В Заявлении об объединении заявок на заключение депозитных договоров должен быть указан Расчетный код Участника клиринга.

34.8. В случае предоставления Участником клиринга Клиринговому центру Заявления об объединении заявок на заключение депозитных договоров и при наличии в реестре предложений безадресных заявок на заключение депозитных договоров, имеющих следующие одинаковые условия:

- Торгово-клиринговый счет Участника клиринга, в состав которого входит Расчетный код Участника клиринга, указанный в Заявлении об объединении заявок на заключение депозитных договоров;
- валюта депозита;
- наименование и код ценной бумаги, заявка на заключение сделки РЕПО с которой может быть признана допустимой встречной;
- краткий код клиента (если был указан в заявке);
- плановая дата заключения депозитного договора или Расчетный день, следующий за указанной датой;
- дата возврата депозита;

- совпадение значений поля «Примечание»,

на основании таких заявок Клиринговый центр заключает один депозитный договор на указанных одинаковых условиях, а также следующих условиях:

34.8.1. сумма депозита равна максимальной сумме, не превышающей одновременно суммы депозитов, указанных в таких заявках, и сумму Обеспечения в соответствующей валюте, округленную до ближайшего меньшего целого числа, учитываемую по соответствующему Расчетному коду, учитывающую уменьшение на сумму определенных в текущую дату обязательств по уплате оборотных частей комиссионных вознаграждений по депозитным договорам (при заключении депозитного договора в российских рублях). Заявки на заключение депозитных договоров, по которым заключается депозитный договор, определяются в порядке возрастания даты и времени включения заявок в реестр предложений;

34.8.2. сумма возврата по депозиту определяется как сумма всех сумм возврата в заявках на заключение депозитных договоров, по которым заключается депозитный договор (с учетом частичного исполнения заявок);

34.8.3. процентная ставка депозита рассчитывается по следующей формуле и округляется по правилам математического округления с точностью до 7 знаков после запятой:

$$R = \frac{S_2 - S_1}{S_1 \times \left(\frac{T_{365}}{365} + \frac{T_{366}}{366}\right)} \times 100$$, где

R – процентная ставка депозита;
S_1 – сумма депозита, определенная в соответствии с подпунктом 34.8.1 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов;
S_2 – сумма возврата, определенная в соответствии с подпунктом 34.8.2 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов;
T_{365} – число дней между фактической датой заключения депозитного договора (не включая эту дату) и датой возврата депозита (включая эту дату), приходящихся на календарный год, состоящий из 365 дней;
T_{366} – число дней между фактической датой заключения депозитного договора (не включая эту дату) и датой возврата депозита (включая эту дату), приходящихся на календарный год, состоящий из 366 дней.

34.9. В случае непредоставления Участником клиринга Обеспечения в сумме депозита, указанной в заявке на заключение депозитного договора, внесенной в реестр предложений, в плановую дату заключения депозитного договора (для всех депозитных договоров) и в Расчетный день, следующий за указанной датой (для всех депозитных договоров, за исключением депозитных договоров со сроком 1 день), Клиринговый центр заключает балансирующие сделки РЕПО в порядке, определенном общей частью Правил клиринга.

34.10. Участник клиринга любой категории, кроме категории «К», обязан уплатить Клиринговому центру отступное в случае непредоставления Участником клиринга Обеспечения в сумме депозита, указанной в заявке на заключение депозитного договора, внесенной в реестр предложений, в плановую дату заключения депозитного договора в соответствии с кодом расчетов, указанным в заявке на заключение депозитного договора, внесенной в реестр предложений (для

депозитных договоров со сроком 1 день), и в Расчетный день, следующий за указанной датой (для всех депозитных договоров, за исключением депозитных договоров со сроком 1 день)).

34.10.1. Сумма отступного рассчитывается по формуле:

Penalty = ROUND (VAL_OBL × C × S × max((max(R1;R2)-R0);0) / 365;2), где

Penalty – сумма отступного, в российских рублях,

VAL_OBL – величина, равная разности сумм депозита, указанных в заявках на заключение депозитного договора, внесенных в реестр предложений, для заключения которых не достаточно денежных средств, и сумм депозитных договоров, заключенных на основании таких заявок в плановую дату заключения депозитного договора, или в Расчетный день, следующий за указанной датой (для случая, указанного в подпункте 34.10 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов);

C – курс иностранной валюты к российскому рублю, установленный Банком России на дату определения отступного;

S – для всех депозитных договоров, за исключением депозитных договоров со сроком 1 день: срок депозитного договора в календарных днях, уменьшенный на количество календарных дней между плановой датой заключения депозитного договора (включая эту дату) и следующим Расчетным днем (не включая эту дату). Для депозитных договоров со сроком 1 день: срок депозитного договора в календарных днях;

R1 – ставка отступного, равная ставке, установленной Клиринговым центром в соответствии с Методикой определения риск-параметров валютного рынка и рынка драгоценных металлов и применяемая для случаев урегулирования обязательств по Сделкам с частичным обеспечением, для исполнения которых недостаточно денежных средств в соответствующей валюте;

R2 – ставка РЕПО / процентная ставка в балансирующей сделке, заключенной в соответствии с пунктом 34.9 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов;

R0 – процентная ставка, указанная в заявке на заключение депозитного договора, внесенной в реестр предложений;

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

Обязательство по уплате отступного, рассчитанное в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, учитывается по Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в заявке на заключение такого депозитного договора.

Обязательство по уплате отступного рассчитывается, определяется и взимается не позднее второго Расчетного дня, следующего за плановой датой заключения депозитного договора в соответствии с кодом расчетов, указанным в заявке на заключение депозитного договора, внесенной в реестр предложений.

Обязательства по уплате отступного включаются в Единый клиринговый пул и исполняются в порядке, установленном общей частью Правил клиринга.

34.10.2. После заключения депозитного договора Клиринговый центр:

- рассчитывает Единый лимит по соответствующему Расчетному коду без учета заявки (части заявки) на заключение депозитного договора, внесенной в реестр предложений;
- изменяет с учетом заключенного депозитного договора Нетто-обязательство и/или Нетто-требование Участника клиринга в соответствующей валюте с Датами исполнения, соответствующими дате заключения депозитного договора и дате возврата депозита, по соответствующему Расчетному коду;
- допускает к клирингу обязательства по заключенному депозитному договору;
- включает в Клиринговый пул для расчетов по депозитам обязательства по внесению депозитов.

34.11. По обязательствам по возврату депозитов с наступившей Датой исполнения, а также обязательствам по внесению депозитов по заключенным депозитным договорам Клиринговый центр изменяет суммы денежных средств Участников клиринга, учитываемых по соответствующим Расчетным кодам.

Статья 35. Возврат части депозита до наступления Даты исполнения обязательств по возврату депозита

35.1. Участник клиринга любой категории, кроме категории «К», вправе до Даты исполнения обязательства по возврату депозита уменьшить сумму депозита по заключенному депозитному договору.

35.2. Для возврата части депозита Участник клиринга с использованием Клиринговой системы направляет Клиринговому центру Заявление на изменение суммы депозита.

Заявление на изменение суммы депозита может быть подано во время торгов, в ходе которых возможна подача заявок на заключение депозитных договоров.

35.3. Заявление на изменение суммы депозита должно содержать:

- номер депозитного договора;
- наименование и код ценной бумаги, заявка на заключение сделки РЕПО с которой может быть признана допустимой встречной для заявки на заключение сделки РЕПО, заключаемой Клиринговым центром в соответствии с пунктом 35.10 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов в целях исполнения обязательства Клирингового центра по возврату суммы депозита при исполнении Заявления на изменение суммы депозита;
- плановая дата пополнения депозита (не указывается при изменении суммы депозита на весь срок депозитного договора);
- сумма денежных средств, на которую изменяется сумма депозита;

35.4. Участник клиринга категории «Б» вправе пополнить депозит, указав в качестве плановой даты пополнения депозита любой Расчетный день до Даты исполнения обязательства по возврату депозита. Пополнение депозита происходит на условиях

и в сумме, указанных в настоящей статье Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

Если плановая дата пополнения депозита не указана Участником клиринга в Заявлении на изменение суммы депозита, такой депозит считается непополняемым.

35.5. Участник клиринга категории «В» не вправе пополнить депозит. Плановая дата пополнения депозита в Заявлении на изменение суммы депозита не заполняется. При подаче Заявления на изменение суммы депозита Участником клиринга категории «В» считается, что сумма депозита изменена на весь срок депозитного договора.

35.6. Направление Участником клиринга Клиринговому центру Заявления на изменение суммы депозита является согласием Участника клиринга на:

- изменение процентной ставки по депозитному договору в соответствии с пунктом 35.15 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов;
- изменение условий депозита в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов;
- уплату комиссионных вознаграждений, предусмотренных настоящей статьей Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

35.7. Направление Участником клиринга Клиринговому центру Заявления на изменение суммы депозита с указанием плановой даты пополнения депозита является предложением Участника клиринга об изменении даты возврата депозита по депозитному договору, указанному в Заявлении на изменение суммы депозита, на дату, являющуюся Расчетным днем, следующим за плановой датой пополнения депозита, в случае, если в плановую дату пополнения депозита и/или в Расчетный день, следующий за плановой датой пополнения депозита, Участник клиринга не пополнил депозит на сумму денежных средств, указанную в Заявлении на изменение суммы депозита.

35.8. Направление Участником клиринга Клиринговому центру Заявления на изменение суммы депозита с указанием плановой даты пополнения депозита является поручением Клиринговому центру пополнить депозит за счет Обеспечения Участника клиринга и определить, какие депозиты пополнять.

35.9. Заявление на изменение суммы депозита исполняется в день его предоставления при выполнении условий, указанных в пункте 35.11 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов. Заявления на изменение суммы депозита, для которых за время торгов, в ходе которых возможна подача заявок на заключение депозитных договоров, не выполнились условия, указанные в пункте 35.11 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, аннулируются.

35.10. В целях исполнения обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга части суммы депозита при исполнении Заявления на изменение суммы депозита Клиринговый центр заключает сделку (сделки) РЕПО с клиринговыми сертификатами на следующих условиях:

- Датой исполнения обязательств по первой части сделки РЕПО является день исполнения Заявления на изменение суммы депозита;

- Датой исполнения обязательств по второй части сделки РЕПО является плановая дата пополнения депозита или Дата исполнения обязательства Клирингового центра по возврату депозита (в случае изменения суммы депозита на весь срок депозитного договора);
- Сумма РЕПО равна сумме денежных средств, указанной в Заявлении на изменение суммы депозита;
- предметом сделки РЕПО являются ценные бумаги, указанные в Заявлении на изменение суммы депозита.

35.11. Клиринговый центр исполняет Заявление на изменение суммы депозита при выполнении следующих условий:

35.11.1. наименование и код ценной бумаги, указанные в Заявлении на изменение суммы депозита, совпадают с наименованием и кодом ценной бумаги, указанными в заявке, на основании которой заключен депозитный договор, номер которого указан в Заявлении на изменение суммы депозита;

35.11.2. сумма денежных средств, указанная в Заявлении на изменение суммы депозита, меньше, чем размер обязательства Клирингового центра по возврату суммы депозита по депозитному договору, номер которого указан в Заявлении на изменение суммы депозита;

35.11.3. Единый лимит по Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в заявке на заключение депозитного договора, номер которого указан в Заявлении на изменение суммы депозита, рассчитанный с учетом изменения суммы депозита, не станет отрицательным;

35.11.4. Клиринговый центр заключил сделку РЕПО с клиринговыми сертификатами на условиях, указанных в пункте 35.10 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

35.12. Исполнение Клиринговым центром Заявления на изменение суммы депозита осуществляется в момент времени, определенный Временным регламентом как время первого в течение Расчетного дня исполнения Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований по денежным средствам в соответствующей валюте.

35.13. При исполнении Заявления на изменение суммы депозита обязательство Клирингового центра по возврату суммы депозита по депозитному договору, номер которого указан в Заявлении на изменение суммы депозита, прекращается в части, равной сумме денежных средств, указанной в Заявлении на изменение суммы депозита, возникновением обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга Обеспечения в соответствующей валюте в размере указанной суммы денежных средств. При этом размер Обеспечения Участника клиринга в соответствующей валюте, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, увеличивается на размер прекращенного обязательства по возврату суммы депозита.

35.14. Исполнение Клиринговым центром Заявления на изменение суммы депозита является согласием Клирингового центра с предложением Участника клиринга об изменении даты возврата депозита по депозитному договору, указанному в Заявлении на изменение суммы депозита, на дату, являющуюся Расчетным днем,

следующим за плановой датой пополнения депозита, в случае, если в плановую дату пополнения депозита и/или в Расчетный день, следующий за плановой датой пополнения депозита, Участник клиринга не пополнил депозит на сумму денежных средств, указанную в Заявлении на изменение суммы депозита.

35.15. В случае исполнения Клиринговым центром Заявления на изменение суммы депозита:

35.15.1. Для каждого дня с даты заключения депозитного договора, указанного в Заявлении на изменение суммы депозита (не включая эту дату), и до плановой даты пополнения депозита, указанной в Заявлении на изменение суммы депозита (включая эту дату), или до даты возврата депозита (в случае изменения суммы депозита на весь срок депозитного договора) (включая эту дату), процентная ставка равна:

$$R_d = \frac{\sum_i \left[\left(\frac{D_d^{365}{}_i}{365} + \frac{D_d^{366}{}_i}{366}\right) \cdot \frac{R_{d_i}}{100} \cdot V_{d_i}\right] - \left(\frac{D_c^{365}}{365} + \frac{D_c^{366}}{366}\right) \cdot \frac{R_c}{100} \cdot V_c}{\sum_i \left[\left(\frac{D_d^{365}{}_i}{365} + \frac{D_d^{366}{}_i}{366}\right) \cdot V_{d_i}\right] - \left(\frac{D_c^{365}}{365} + \frac{D_c^{366}}{366}\right) \cdot V_c} \cdot 100$$

где:

R_d – процентная ставка по депозитному договору (в % годовых) после исполнения Заявления на изменение суммы депозита;

R_{d_i} – процентная ставка по депозитному договору в i-ый день (в % годовых), действующая до исполнения Заявления на изменение суммы депозита;

R_c – Ставка РЕПО в сделке РЕПО с клиринговыми сертификатами, заключенной Клиринговым центром в целях исполнения обязательства Клирингового центра по возврату суммы депозита при исполнении Заявления на изменение суммы депозита;

$\sum_i$ – суммирование по дням от даты заключения депозитного договора до плановой даты пополнения, указанной в Заявлении на изменение суммы депозита, или до даты возврата депозита (в случае изменения суммы депозита на весь срок депозитного договора), включительно;

D_d^{365} – фактическое число календарных дней между текущим Расчетным днем и предыдущим Расчетным днем, приходящееся на календарный год, состоящий из 365 дней (в календарных днях);

D_d^{366} – фактическое число календарных дней между текущим Расчетным днем и предыдущим Расчетным днем, приходящееся на календарный год, состоящий из 366 дней (в календарных днях);

D_c^{365} – фактическое число календарных дней между датой изменения суммы депозита и плановой датой пополнения включительно, приходящийся на календарный год, состоящий из 365 дней (в календарных днях);

D_c^{366} – фактическое число календарных дней между датой изменения суммы депозита и плановой датой пополнения включительно, приходящийся на

календарный год, состоящий из 366 дней (в календарных днях);

V_d – обязательство Клирингового центра по возврату суммы депозита по депозитному договору в дату i до исполнения Заявления на изменение суммы депозита (в российских рублях или иностранной валюте);

V_c – сумма денежных средств, на которую уменьшается депозит (в российских рублях или иностранной валюте).

35.15.2. Для каждого дня с даты, следующей за плановой датой пополнения депозита, процентная ставка равна процентной ставке, действовавшей до исполнения Заявления на изменение суммы депозита.

35.16. В случае исполнения Клиринговым центром Заявления на изменение суммы депозита Участник клиринга вправе пополнить депозит в плановую дату пополнения депозита, указанную в таком Заявлении на изменение суммы депозита, на сумму, не превышающую сумму денежных средств, указанную в таком Заявлении на изменение суммы депозита.

35.17. Пополнение депозита осуществляется за счет Обеспечения, внесенного до времени, определенного Временным регламентом как время первого в течение Расчетного дня исполнения Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований по денежным средствам в соответствующей валюте, или за счет Обеспечения, полученного Участником клиринга в результате исполнения Клиринговым центром обязательств по возврату Участнику клиринга депозитов с наступившей Датой исполнения, в порядке возрастания плановой даты заключения депозитного договора, и до исполнения обязательств по внесению депозитов.

35.18. Проверка достаточности денежных средств для пополнения депозита осуществляется в плановую дату пополнения депозита, указанную в Заявлении на изменение суммы депозита, и в Расчетный день, следующий за указанной датой, в случае недостаточности в плановую дату пополнения депозита денежных средств для пополнения депозита в сумме денежных средств, указанной в Заявлении на изменение суммы депозита.

35.18.1. Сумма денежных средств Участника клиринга является достаточной для пополнения депозита, если сумма Обеспечения в денежных средствах, учитываемая по Расчетному коду (с учетом исполнения Клиринговым центром обязательств по возврату Участнику клиринга депозитов с наступившей Датой исполнения) больше или равна сумме денежных средств, указанной в Заявлении на изменение суммы депозита (в плановую дату пополнения депозита), или разности суммы денежных средств, указанной в Заявлении на изменение суммы депозита, и суммы, на которую депозит был пополнен в плановую дату пополнения депозита (в Расчетный день, следующий за плановой датой пополнения депозита), и не достаточной – если меньше.

35.18.2. Пополнение депозита осуществляется за счет денежных средств, учитываемых в качестве Обеспечения по Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в заявке на заключение депозитного договора, номер которого указан в Заявлении на изменение суммы депозита, на максимальную сумму, не превышающую одновременно сумму денежных средств, указанной в Заявлении на изменение суммы депозита, и сумму Обеспечения в

соответствующей валюте, округленную до ближайшего меньшего целого числа, учитываемую по соответствующему Расчетному коду, учитывающую уменьшение на сумму определенных в текущую дату обязательств по уплате оборотных частей комиссионных вознаграждений по депозитным договорам (при пополнении депозита в российских рублях).

35.18.3. Пополнение депозита на сумму, равную разности суммы денежных средств, указанной в Заявлении на изменение суммы депозита, и суммы, на которую депозит был пополнен в плановую дату пополнения депозита, возможно в Расчетный день, следующий за плановой датой пополнения депозита.

За обеспечение возможности пополнения депозита в следующий Расчетный день Клиринговый центр взимает с Участника клиринга комиссионное вознаграждение, установленное Тарифами Клирингового центра. Указанное комиссионное вознаграждение определяется в плановую дату пополнения депозита и учитывается по Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в заявке на заключение депозитного договора, номер которого указан в Заявлении на изменение суммы депозита. Обязательства по уплате указанного комиссионного вознаграждения включаются в Единый клиринговый пул и исполняются в порядке, установленном общей частью Правил клиринга.

35.19. При пополнении депозита обязательство Клирингового центра по возврату Участнику клиринга Обеспечения в соответствующей валюте уменьшается на сумму пополнения, обязательство Клирингового центра по возврату суммы депозита, увеличивается на сумму пополнения. При этом размер Обеспечения Участника клиринга в соответствующей валюте, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, уменьшается на сумму пополнения.

35.20. В случае, если в плановую дату пополнения депозита и/или в Расчетный день, следующий за плановой датой пополнения депозита, Участник клиринга не пополнил депозит на сумму денежных средств, указанную в Заявлении на изменение суммы депозита, дата возврата депозита по депозитному договору, указанному в Заявлении на изменение суммы депозита, изменяется на дату, являющуюся Расчетным днем, следующим за плановой датой пополнения депозита.

35.21. За обеспечение возможности изменения даты возврата депозита Клиринговый центр взимает с Участника клиринга комиссионное вознаграждение, установленное Тарифами Клирингового центра. Указанное комиссионное вознаграждение определяется в дату, являющуюся Расчетным днем, следующим за плановой датой пополнения депозита, и учитывается по Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в заявке на заключение депозитного договора, номер которого указан в Заявлении на изменение суммы депозита. Обязательства по уплате указанного комиссионного вознаграждения включаются в Единый клиринговый пул и исполняются в порядке, установленном общей частью Правил клиринга.

35.22. После изменения суммы депозита Клиринговый центр изменяет с учетом такого изменения суммы депозита Нетто-обязательство и/или Нетто-требование Участника клиринга в соответствующей валюте, учитываемые по соответствующему Расчетному коду, с Датами исполнения, соответствующими

дате исполнения Заявления на изменение суммы депозита, плановой дате пополнения депозита и/или дате возврата депозита.

35.23. Документом, удостоверяющим изменение суммы депозита, является Отчет о движении денежных средств, предоставляемый Клиринговым центром Участнику клиринга и содержащий информацию об изменении суммы депозита и размере суммы, на которую может быть пополнен депозит. Информация о процентной ставке по депозитному договору предоставляется Участнику клиринга в Выписке из реестра сделок, принятых в клиринг.

Статья 36. Порядок подачи и условия исполнения Поручений на изменение срока исполнения обязательств по сделке

36.1. Поручение на изменение срока исполнения обязательств по сделке может быть подано по второй части сделок РЕПО с кодом расчетов Ym/Yn (за исключением сделок РЕПО, которым соответствует депозитный договор или заявка на заключение депозитного договора, внесенная в реестр предложений), второй части сделок РЕПО с кодом расчетов T0/Yn, заключенным на основании адресных заявок.

36.2. Поручение на изменение срока исполнения обязательств по сделке по второй части сделки РЕПО с кодом расчетов T0/Yn, Ym/Yn может быть подано Участником клиринга в Клиринговую систему при условии исполнения первой части сделки РЕПО.

36.3. Поручение на изменение срока исполнения обязательств по сделке, поданное Участником клиринга, регистрируется в Клиринговой системе, при соблюдении следующих условий:

- Единый лимит по Расчетному коду, рассчитанный с учетом изменения Даты исполнения обязательств по сделке, не станет отрицательным, или, если Единый лимит по такому Расчетному коду был отрицательным до момента проверки, Единый лимит по такому Расчетному коду, рассчитанный с учетом изменения Даты исполнения обязательств по сделке, не станет меньше, чем Единый лимит по этому Расчетному коду, рассчитанный до момента проверки;
- Сумма денежных средств в валюте, в которой проводятся расчеты по сделке РЕПО / количество ценных бумаг являющихся предметом сделки РЕПО, рассчитанные в соответствии с общей частью Правил клиринга для проверки возможности исполнения операции, проводимой по Торгово-клиринговому счету Участника клиринга при наличии признака «запрет необеспеченных покупок» / «запрет коротких продаж», и/или Участника клиринга категории «В», и/или ценных бумаг с признаком «запрет коротких продаж», с учетом изменения Даты исполнения обязательств по сделке, для каждой Даты исполнения не станут отрицательными (для Торгово-клирингового счета Участника клиринга по которому установлен признак «запрет необеспеченных покупок» / «запрет коротких продаж», и/или Участника клиринга категории «В», и/или ценных бумаг с признаком «запрет коротких продаж»).

36.4. Участнику клиринга в Клиринговой системе раскрывается информация о регистрации Поручения на изменение срока исполнения обязательств по сделке, поданного в Клиринговую систему Участником клиринга - конечным контрагентом по парной сделке.

36.5. При регистрации в Клиринговой системе Поручений на изменение срока исполнения обязательств по сделке, поданных обоими Участниками клиринга - конечными контрагентами по парным сделкам, Дата исполнения обязательств по такой сделке меняется на текущую дату, при этом размер обязательства по второй части сделки РЕПО рассчитывается исходя из фактического срока сделки РЕПО.

36.6. Обязательства по сделкам, Дата исполнения которых была изменена, включаются в клиринговый пул, формируемый в такую Дату исполнения, и исполняются в порядке, установленном Правилами клиринга.

Статья 37. Особенности возврата Обеспечения Участникам клиринга категории «К»

37.1. Клиринговый центр в дату возврата депозита осуществляет возврат Обеспечения в денежных средствах Участнику клиринга категории «К» в сумме процентов по депозитным договорам, стороной по которым является Участник клиринга категории «К», в порядке, предусмотренном общей частью Правил клиринга, без подачи поручений / запросов Участником клиринга категории «К».

37.2. Постоянное поручение на возврат обеспечения, поданное Участником клиринга категории «К», исполняется в порядке, предусмотренном общей частью Правил клиринга, в сумме Нетто-требования по сделкам с наступившей Датой исполнения, за вычетом суммы процентов, указанной в пункте 37.1 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

ПОДРАЗДЕЛ V-IV. ПОРЯДОК ДЕЙСТВИЙ В СЛУЧАЯХ НЕИСПОЛНЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ

Статья 38. Порядок выкупа клиринговых сертификатов участия у Банка России

38.1. Требование (уведомление) о выкупе клиринговых сертификатов участия, направляемое Банком России Клиринговому центру, должно содержать:

- ИНН Участника клиринга / клиента Участника клиринга, являющегося продавцом по первой части договора репо с клиринговыми сертификатами участия, не исполнившим обязательства перед Банком России по второй части договора репо;
- код клиринговых сертификатов участия, предъявляемых к выкупу;
- количество клиринговых сертификатов участия, предъявляемых к выкупу.

38.2. В случае отзыва (аннулирования) Банком России у Участника клиринга – Кредитной организации лицензии на осуществление банковских операций, требование о выкупе клиринговых сертификатов участия считается предъявленным Банком России Клиринговому центру в дату отзыва (аннулирования) лицензии на осуществление банковских операций у Участника клиринга.

В случае отзыва (аннулирования) Банком России у клиента Участника клиринга – Кредитной организации лицензии на осуществление банковских операций, требование о выкупе клиринговых сертификатов участия считается предъявленным Банком России Клиринговому центру в дату отзыва (аннулирования) лицензии на осуществление банковских операций у клиента Участника клиринга в случае предоставления Участником клиринга Клиринговому центру Заявления о проведении ликвидационного неттинга в отношении клиента Участника клиринга в порядке, предусмотренном общей частью Правил клиринга, и принятия Клиринговым центром данного заявления к исполнению.

Уведомление о выкупе клиринговых сертификатов участия, содержащее информацию, предусмотренную пунктом 38.1 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, должно быть направлено Банком России Клиринговому центру в дату отзыва (аннулирования) Банком России у Участника клиринга / клиента Участника клиринга, являющегося Кредитной организацией, лицензии на осуществление банковских операций.

38.3. Клиринговый центр выкупает у Банка России клиринговые сертификаты участия и передает Банку России денежные средства в российских рублях в объеме номинальной стоимости клиринговых сертификатов участия, предъявленных к выкупу, не позднее Расчетного дня, следующего за днем предъявления требования о выкупе.

Клиринговые сертификаты участия, выкупленные у Банка России, зачисляются Расчетным депозитарием на торговый раздел казначейского счета депо Клирингового центра.

38.4. В случае недостаточности у Клирингового центра свободных собственных денежных средств для выкупа клиринговых сертификатов участия у Банка России,

Клиринговый центр заключает сделки своп с Уполномоченными участниками клиринга в соответствии с Правилами клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.

38.5. С даты заключения договора об имущественном пуле в случае выкупа Клиринговым центром у Банка России клиринговых сертификатов участия, переданных таким Участником клиринга / клиентом Участника клиринга Банку России по первой части договора репо, у Участника клиринга возникает обязательство перед Клиринговым центром уплатить денежные средства в сумме, равной номинальной стоимости клиринговых сертификатов участия, в отношении которых Участником клиринга / клиентом Участника клиринга не были исполнены обязательства перед Банком России по второй части договора репо и требование к Клиринговому центру по получению клиринговых сертификатов участия в количестве, равном полученному Клиринговым центром от Банка России.

38.5.1. В случае отзыва (аннулирования) Банком России у Участника клиринга – Кредитной организации лицензии на осуществление банковских операций срок исполнения обязательства по уплате денежных средств Клиринговому центру в сумме, равной номинальной стоимости клиринговых сертификатов участия, в отношении которых Участником клиринга не были исполнены обязательства перед Банком России по второй части договора репо, и срок исполнения требования к Клиринговому центру по получению клиринговых сертификатов участия в количестве, равном полученному Клиринговым центром от Банка России, считаются наступившими в дату, предшествующую дате отзыва (аннулирования) Банком России у Участника клиринга – Кредитной организации лицензии на осуществление банковских операций.

38.5.2. В случае отзыва (аннулирования) Банком России у клиента Участника клиринга, являющегося Кредитной организацией, лицензии на осуществление банковских операций и проведения вследствие этого Клиринговым центром ликвидационного неттинга в отношении такого клиента Участника клиринга в порядке, предусмотренном общей частью Правил клиринга, срок исполнения обязательства Участника клиринга по уплате денежных средств Клиринговому центру в сумме, равной номинальной стоимости клиринговых сертификатов участия, в отношении которых клиентом Участника клиринга не были исполнены обязательства перед Банком России по второй части договора репо, и срок исполнения требования к Клиринговому центру по получению клиринговых сертификатов участия в количестве, равном полученному Клиринговым центром от Банка России, считаются наступившими в дату, предшествующую дате отзыва (аннулирования) Банком России у клиента Участника клиринга, являющегося Кредитной организацией, лицензии на осуществление банковских операций.

38.6. Датой исполнения обязательства Участника клиринга уплатить Клиринговому центру денежные средства в сумме, равной номинальной стоимости клиринговых сертификатов участия, в отношении которых Участником клиринга / клиентом Участника клиринга не были исполнены обязательства перед Банком России по второй части договора репо, и Датой исполнения требования Участника клиринга к Клиринговому центру по получению клиринговых сертификатов участия в количестве, равном полученному Клиринговым центром от Банка России, является дата исполнения Клиринговым центром обязательства по выкупу клиринговых

сертификатов участия у Банка России, за исключением случаев, установленных подпунктами 38.5.1-38.5.2 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

38.6.1. Указанные обязательства и требования Участника клиринга, возникшие в связи с неисполнением Участником клиринга обязательств перед Банком России по второй части договора репо, учитываются по собственному Расчетному коду и по Торгово-клиринговому счету Т+ Участника клиринга, в состав которого входит такой собственный Расчетный код и который соответствует Торгово-клиринговому счету имущественного пула. Выбор Расчетного кода и Торгово-клирингового счета Т+ из нескольких Торгово-клиринговых счетов Т+, отвечающих указанным условиям, осуществляется Клиринговым центром.

38.6.2. Указанные обязательства и требования Участника клиринга, возникшие в связи с неисполнением клиентом Участника клиринга обязательств перед Банком России по второй части договора репо, при проведении ликвидационного неттинга в отношении клиента Участника клиринга учитываются по клиентскому Расчетному коду и по Торгово-клиринговому счету Т+ Участника клиринга, указанным Участником клиринга в Заявлении о проведении ликвидационного неттинга в отношении клиента Участника клиринга.

38.6.3. Указанные обязательства и требования Участника клиринга, возникшие в связи с неисполнением клиентом Участника клиринга обязательств перед Банком России по второй части договора репо, в случае если Участник клиринга не представил Клиринговому центру Заявление о проведении ликвидационного неттинга в отношении клиента Участника клиринга в порядке, предусмотренном общей частью Правил клиринга, или в случае непринятия Клиринговым центром данного заявления к исполнению, учитываются по клиентскому Расчетному коду и по Торгово-клиринговому счету Т+ Участника клиринга, указанным Участником клиринга Клиринговому центру. В случае непредоставления Участником клиринга указанной информации в течение 1 (одного) Расчетного дня с даты предъявления Банком России требования о выкупе клиринговых сертификатов участия клиента Участника клиринга, указанные обязательства и требования Участника клиринга учитываются по собственному Расчетному коду и по Торгово-клиринговому счету Т+ Участника клиринга, в состав которого входит такой собственный Расчетный код и который соответствует Торгово-клиринговому счету имущественного пула.

38.6.4. Клиринговый центр допускает к клирингу указанные обязательства и требования Участника клиринга и Клирингового центра.

38.6.5. Исполнение указанных обязательств, а также их урегулирование в случае неисполнения осуществляется в стандартном порядке, определенном общей частью Правил клиринга.

Статья 39. Порядок действий в случае неисполнения обязательств по сделкам, заключенным без участия центрального контрагента

39.1. Урегулирование взаимоотношений в случаях неисполнения или ненадлежащего исполнения обязательств по второй части сделки РЕПО, заключенной без участия центрального контрагента, а также урегулирование вопросов, связанных с выплатой любых дивидендов, процентов и иного распределения на ценные бумаги, в отношении которых заключена сделка РЕПО, осуществляется в порядке, установленном соглашением, заключенным между Участниками клиринга,

являющимися сторонами по сделке РЕПО, а при отсутствии такового – в соответствии с Процедурой урегулирования взаимных требований по сделкам, заключенным без участия центрального контрагента, установленной статье 40 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

39.2. При неисполнении Участником клиринга сделки, заключенной без участия центрального контрагента, в том числе, в Дату исполнения (за исключением случаев, предусмотренных пунктом 39.4 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов), к данному Участнику клиринга может применяться следующий вид ответственности:

39.2.1. наложение штрафа в размере 0,05% (ноль целых пяти сотых процента) от суммы неисполненного обязательства. Штраф уплачивается Клиринговому центру.

39.3. Решением Клирингового центра может быть предусмотрена уплата Участником клиринга, указанным в заявке в качестве стороны по сделке, неустойки (штрафа) за ненадлежащее выполнение обязанности по обеспечению наличия денежных средств (ценных бумаг) в количестве, достаточном для заключения сделки по заявке, поданной Участником торгов с указанием реквизита «дата активации», в момент проведения Процедуры контроля ее обеспечения, в случае, если решением Клирингового центра предусмотрена такая обязанность. При этом размер неустойки (штрафа), определяемый решением Клирингового центра, не может быть более 3% от объема необеспеченной надлежащим образом заявки с учетом суммы НКД. Неустойка (штраф) подлежит уплате в пользу Клирингового центра.

Обязательство по уплате штрафа, предусмотренного настоящим пунктом Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, учитывается по Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в заявке на заключение сделки.

39.4. При неисполнении Участником клиринга сделки в Режиме торгов «Размещение: Аукцион» при размещении (доразмещении) облигаций, Генеральным агентом эмитента по обслуживанию которых является Банк России, в Дату исполнения (далее – Неисполнение на Аукционе) к данному Участнику клиринга применяется следующий вид ответственности:

39.4.1. неустойка в размере, определенном эмитентом / заявителем. Неустойка уплачивается эмитенту / заявителю в соответствии с реквизитами, указанными эмитентом / заявителем. Неустойка учитывается по основному Расчетному коду для списания комиссионных вознаграждений, порядок определения которого установлен общей частью Правил клиринга.

39.5. В случае повторного в течение 3 месяцев Неисполнения на Аукционе, Клиринговый центр направляет Бирже соответствующее уведомление;

39.6. В случае Неисполнения на Аукционе три раза в течение 3 месяцев, Клиринговый центр направляет Бирже соответствующее уведомление.

39.7. Неисполнение сделки купли-продажи, либо первой части сделки РЕПО, заключенной без участия центрального контрагента, не является неисполнением обязательств по такой сделке в случае, если до Даты исполнения такой сделки (включая Дату исполнения) Участники клиринга – контрагенты по сделке

отказались от ее исполнения в соответствии со статьей 31 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

39.8. При неуплате Участником клиринга компенсационного взноса в размере и порядке, определенном в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, на данного Участника клиринга может быть наложен штраф в пользу Клирингового центра в размере 0,05% (ноль целых пяти сотых процента) от текущей суммы РЕПО по соответствующей сделке.

39.9. Неисполнение Участниками клиринга – контрагентами обязательств по сделке с кодами расчетов Bn, B0-B30, Yn или обязательств по первой и/или второй части сделки РЕПО в связи с приостановлением/прекращением торгов по ценной бумаге на Бирже, в том числе, в связи с конвертацией, объединением выпусков или досрочным погашением ценной бумаги, составляющей предмет обязательства Участника клиринга в соответствии с заключенной на Бирже сделкой, не является нарушением Правил клиринга, за которое установлены меры ответственности в соответствии с Правилами клиринга, если такое приостановление/прекращение торгов по ценной бумаге повлекло невозможность исполнения обязательств по заключенной сделке в порядке, установленном Правилами клиринга.

39.9.1. Порядок определения размера Фиксированного возмещения установлен статьей 41 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

39.9.2. Уплата Фиксированного возмещения Участником клиринга - контрагентом по сделке, не исполнившим своих обязательств по сделке, не освобождает такого Участника клиринга от исполнения всех обязательств по заключенной сделке, условия которой предусматривают уплату Фиксированного возмещения. При этом уплата Фиксированного возмещения Участником клиринга – контрагентом по сделке, не исполнившим своих обязательств по сделке, не освобождает такого Участника клиринга от возмещения убытков, причиненных неисполнением сделки Участнику клиринга, исполнившему свои обязательства по сделке, в размере, превышающем размер суммы Фиксированного возмещения, уплачиваемого Участнику клиринга, исполнившему свои обязательства по сделке.

39.9.3. В случае неисполнения одним из контрагентов сделки/части сделки РЕПО (за исключением Сделки Т+), обязательства по которой исполняются путем подачи Отчета на исполнение, по которой Правилами торгов на фондовом рынке и рынке депозитов не предусмотрено заполнения реквизита заявки/сделки «Фиксированное возмещение», урегулирование взаимных требований контрагентов, заключивших такую сделку, происходит в соответствии с Процедурой урегулирования взаимных требований по сделкам, заключенным без участия центрального контрагента, установленной статьей 40 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

Статья 40. Процедура урегулирования взаимных требований по сделкам, заключенным без участия центрального контрагента

40.1. Урегулирование вопросов, связанных с выплатой доходов по ценным бумагам, являющимся предметом сделки РЕПО.

40.1.1. В случае неисполнения эмитентом своих обязательств по выплате доходов (процентного или купонного дохода, частичного погашения части основного долга)

или иных выплат в виде денежных средств или другого имущества по ценным бумагам, являющимся предметом сделки РЕПО, Участник клиринга - покупатель по первой части сделки РЕПО имеет право на получение средств, уменьшивших Сумму РЕПО. Данное право может быть реализовано путем направления соответствующего заявления Участнику клиринга - продавцу по первой части сделки РЕПО. Возврат (выплата) излишне уплаченных сумм Участниками клиринга – сторонами по сделке РЕПО осуществляется в следующем порядке:

40.1.1.1. Участник клиринга - продавец по первой части сделки РЕПО осуществляет возврат излишне уплаченных сумм в срок не позднее 10 (десяти) рабочих дней со дня получения им соответствующего письменного заявления от Участника клиринга - покупателя по первой части сделки РЕПО.

40.1.1.2. В случае выплаты указанных доходов эмитентом после того, как они были перечислены Участником клиринга - продавцом по первой части сделки РЕПО Участнику клиринга - покупателю по первой части сделки РЕПО, Участник клиринга - покупатель по первой части сделки РЕПО в срок не позднее 3 (трёх) рабочих дней с даты получения доходов от эмитента обязан возвратить полученные доходы Участнику клиринга - продавцу по первой части сделки РЕПО.

40.1.2. В случае ненадлежащего исполнения Участником клиринга требований, предусмотренных подпунктом 40.1.1 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, такой Участник клиринга обязан уплатить Участнику клиринга - контрагенту по сделке РЕПО неустойку в размере двойной Ставки денежного рынка Московской Биржи RUSFAR, рассчитанной для 1 дня (overnight), действующей по состоянию на каждый день неисполнения указанных требований, начисленной на сумму подлежащих возврату (выплате) доходов за каждый день просрочки их возврата (выплаты).

40.2. Урегулирование вопросов, связанных с неисполнением или ненадлежащим исполнением обязательств по второй части сделок РЕПО (за исключением случая досрочного погашения облигаций, составляющих предмет обязательств по сделке РЕПО).

40.2.1. В случае неисполнения или ненадлежащего исполнения Участником клиринга (далее – Нарушившая сторона) обязательств по второй части сделки РЕПО другой Участник клиринга, являющийся стороной такой сделки РЕПО (далее – Ненарушившая сторона), вправе по своему выбору:

40.2.1.1. Требовать от Нарушившей стороны исполнения обязательств по сделке РЕПО. Процедура урегулирования, предусмотренная подпунктом 40.2.2 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, в этом случае не проводится. До направления уведомления о процедуре урегулирования в соответствии с подпунктом 40.2.2 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов Ненарушившая сторона признается требующей от Нарушившей стороны исполнения обязательств по сделке РЕПО.

40.2.1.2. Требовать проведения процедуры урегулирования взаимных требований в порядке, предусмотренном подпунктом 40.2.2 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

40.2.2. В случае принятия решения Ненарушившей стороной о проведении процедуры урегулирования взаимных требований согласно пункту 40.2.1.2 Правил клиринга

на фондовом рынке и рынке депозитов, Ненарушившая сторона в течение 25 (Двадцати пяти) календарных дней с Даты исполнения обязательств по второй части сделки РЕПО направляет Нарушившей стороне уведомление о процедуре урегулирования, содержащее:

(а) решение об урегулировании взаимных требований в соответствии с подпунктом 40.2.2 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов;

(б) информацию о размере остаточных обязательств по сделке РЕПО (включая расчет их суммы), определенных как разница между суммой денежных средств / стоимостью ценных бумаг, не переданных Нарушившей стороной по второй части сделки РЕПО, и стоимостью ценных бумаг / суммой денежных средств, не переданных Ненарушившей стороной по второй части сделки РЕПО.

40.2.2.1. Остаточные обязательства по сделке РЕПО определяются в денежном выражении.

40.2.2.2. Сумма остаточных обязательств перечисляется Участником клиринга, имеющим положительную величину остаточных обязательств по соответствующей сделке РЕПО.

40.2.2.3. Сумма остаточных обязательств по сделке РЕПО должна быть перечислена соответствующим Участником клиринга не позднее 4 (Четырех) рабочих дней с даты направления уведомления об урегулировании взаимных требований в соответствии с подпунктом 40.2.2 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, но в любом случае не позднее 30 (Тридцати) календарных дней с Даты исполнения обязательств по второй части соответствующей сделки РЕПО.

40.2.2.4. После направления уведомления о процедуре урегулирования исполнение обязательств в натуре не допускается, если иное не согласовано сторонами в письменной форме.

40.2.2.5. В сумму остаточных обязательств по сделке РЕПО Ненарушившая сторона вправе включить невыплаченное Нарушившей стороной Фиксированное возмещение.

40.2.2.6. Обязательство по уплате суммы, составляющей остаточные обязательства по сделке РЕПО, признается исполненным с момента зачисления соответствующих денежных средств в полном объеме на счет Участника клиринга – получателя суммы остаточных обязательств по сделке РЕПО, указанный в уведомлении о процедуре урегулирования. В случае если в уведомлении о процедуре урегулирования отсутствует информация о счете Участника клиринга - покупателя, обязательство по уплате суммы, составляющей остаточные обязательства по сделке РЕПО, признается исполненным с момента списания денежных средств в размере остаточных обязательств со счета Участника клиринга – плательщика в пользу Участника клиринга – получателя по известным Участнику клиринга – плательщику реквизитам.

40.2.2.7. Ненарушившая сторона вправе по своему усмотрению:

- Начиная с рабочего дня, следующего за Датой исполнения обязательств по второй части сделки РЕПО (или начиная с рабочего дня, являющегося Датой исполнения обязательств по второй части сделки РЕПО в случае если Участник клиринга потребовал проведения Процедуры урегулирования взаимных требований в соответствии с подпунктом 28.6.1 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов), но в срок, не превышающий 25 (Двадцати пяти) календарных дней с Даты исполнения обязательств по

второй части сделки РЕПО - осуществить продажу в полном объёме ценных бумаг, полученных по первой части сделки РЕПО от Нарушившей стороны, или покупку в полном объеме ценных бумаг, эквивалентных ценным бумагам, переданным по первой части сделки РЕПО Нарушившей стороне, и осуществить расчет суммы остаточных обязательств, или

- Отказаться от продажи/покупки ценных бумаг, полученных / переданных по первой части сделки РЕПО от Нарушившей стороны, и осуществить расчет суммы остаточных обязательств.

40.2.2.8. Для целей расчета остаточных обязательств по сделке РЕПО стоимость ценных бумаг, не переданных по второй части сделки РЕПО, определяется следующим образом по выбору Ненарушившей стороны:

- В случае реализации (приобретения) ценных бумаг – как фактическая стоимость реализованных ценных бумаг или как фактическая стоимость приобретенных ценных бумаг, эквивалентных ценным бумагам, переданным по первой части сделки РЕПО. При определении фактической стоимости реализации или приобретения ценных бумаг учитываются также расходы, понесенные Ненарушившей стороной в связи с заключением и (или) исполнением соответствующих сделок покупки или продажи.
- В случае отказа от реализации (приобретения) ценных бумаг Ненарушившая сторона вправе самостоятельно рассчитать величину остаточных обязательств, используя для определения стоимости ценных бумаг расчетную стоимость, определенную на основании среднего арифметического не менее чем 5 (Пяти) котировок Участников торгов, полученных Ненарушившей стороной не ранее, чем за 5 (Пять) рабочих дней до даты направления уведомления о процедуре урегулирования на объем ценных бумаг, соответствующий количеству ценных бумаг, не переданных по второй части сделки РЕПО. При этом Ненарушившая сторона самостоятельно определяет Участников торгов, котировки которых она использует для расчета остаточных обязательств. Также Ненарушившая сторона вправе рассчитать остаточные обязательства самостоятельно, используя в качестве расчетной стоимости ценных бумаг цену Ценового центра НФА на Дату исполнения обязательств по второй части соответствующей сделки РЕПО, либо расчетную цену ценных бумаг на день, следующий за Датой исполнения обязательств по второй части сделки РЕПО, либо, при её отсутствии – на дату ближайших торгов, состоявшихся в течение последних 12 месяцев до Даты исполнения обязательств по второй части данной сделки РЕПО.

  Ненарушившая сторона также вправе обратиться за расчетом остаточных обязательств по сделкам РЕПО (за исключением сделок РЕПО, заключенных в Режимах торгов «РЕПО с Банком России: Аукцион РЕПО», «РЕПО с Банком России: фикс.ставка» и «Аукцион РЕПО с Банком России: плавающая ставка») к Клиринговому центру. Клиринговый центр осуществляет расчет остаточных обязательств, используя в качестве расчетной стоимости ценных бумаг цену Ценового центра НФА на Дату исполнения обязательств по второй части соответствующей сделки РЕПО, а при ее отсутствии – расчетную цену ценных бумаг на день, следующий за Датой исполнения обязательств по второй части сделки РЕПО, либо, при её отсутствии – на дату ближайших торгов, состоявшихся в течении последних 12 месяцев до Даты

исполнения обязательств по второй части данной сделки РЕПО. По итогам расчета остаточных обязательств Клиринговый центр предоставляет Ненарушившей стороне Отчет о величине остаточных обязательств.

40.3. Урегулирование вопросов, связанных с неисполнением обязательств по второй части сделок РЕПО в случае досрочного погашения облигаций, составляющих предмет обязательств по сделке РЕПО.

40.3.1. В случае досрочного погашения облигаций, составляющих предмет обязательств по сделке РЕПО, и невозможности исполнения обязательств по сделке РЕПО в Клиринговой системе, в дату досрочного погашения обязательства по второй части сделки РЕПО прекращаются. На дату досрочного погашения Участники клиринга - контрагенты осуществляют расчет суммы остаточных обязательств путем определения разницы между стоимостью обратного выкупа по сделке РЕПО (с учетом уплаченных/полученных компенсационных взносов и выплат произведенных эмитентом в течение Срока РЕПО до даты досрочного погашения) и стоимостью ценных бумаг, определенной как сумма денежных средств, уплаченных эмитентом в счет досрочного погашения облигаций и иных выплат, произведенных эмитентом по облигациям в дату досрочного погашения. Участник клиринга вправе обратиться к Клиринговому центру за расчетом остаточных обязательств. Клиринговый центр вправе произвести расчет остаточных обязательств только в случае наличия у нее информации о величине выплат, произведенных эмитентом. По итогам расчета остаточных обязательств Клиринговый центр предоставляет Участнику клиринга Отчет о величине остаточных обязательств.

40.3.2. Сумма остаточных обязательств перечисляется соответствующим контрагентом по сделке РЕПО в течение 30 календарных дней с даты досрочного погашения.

40.4. Урегулирование вопросов, связанных с неисполнением обязательств по сделкам, обязательства по которым исполняются путем подачи Отчета на исполнение.

40.4.1. В случае неисполнения сделок, заключаемых на условиях отсроченного исполнения, по которым Правилами торгов на фондовом рынке и рынке депозитов не предусмотрено заполнения реквизита заявки/сделки «Фиксированное возмещение», Участник клиринга, который не исполнил свои обязательства, обязан уплатить Участнику клиринга - контрагенту по сделке неустойку в размере двойной Ставки денежного рынка Московской Биржи RUSFAR, рассчитанной для 1 дня (overnight), действующей на день неисполнения указанных требований, начисленной на сумму обязательств по сделке за каждый день просрочки исполнения, если иное не установлено двусторонними соглашениями сторон.

40.5. Урегулирование вопросов, связанных с выплатой доходов по ценным бумагам и неисполнением обязательств по второй части сделок РЕПО в случае возникновения обстоятельств непреодолимой силы.

40.5.1. В случае возникновения обстоятельств непреодолимой силы (чрезвычайные и непредотвратимые обстоятельства, возникающие после наступления Даты исполнения обязательств по сделкам), влияющих на способность выполнения Участником клиринга требований, предусмотренных пунктами 40.1-40.2 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов и/или пунктами 21.1-21.2 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, Участник клиринга обязан

проинформировать Участника клиринга - контрагента по сделке об их наступлении и прекращении в день их наступления и прекращения (в первый следующий рабочий день в случае их наступления и прекращения в нерабочий день) путем направления уведомления в письменной форме с приложением документов, подтверждающих наступление/прекращение таких обстоятельств, выданных компетентными государственными органами.

40.5.2. В качестве обстоятельств непреодолимой силы не могут рассматриваться аннулирование/приостановка лицензии профессионального участника рынка ценных бумаг, отзыв лицензии на осуществление банковских операций, назначение временной администрации или возбуждение процедуры банкротства.

40.5.3. Неисполнение требования, предусмотренного подпунктом 40.5.1 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, лишает Участника клиринга, нарушившего данное требование, права ссылаться на обстоятельства непреодолимой силы.

40.5.4. После прекращения действия обстоятельств непреодолимой силы Участники клиринга обязаны исполнить требования, предусмотренные пунктами 40.1-40.2 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов и/или пунктами 21.1-21.2 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

40.5.5. В случае если обстоятельства непреодолимой силы действуют только в отношении одного из Участников клиринга и длятся более 10 (Десяти) рабочих дней, другой Участник клиринга вправе отказаться от дальнейшего исполнения сделки/сделок РЕПО.

40.6. В Режимах торгов «РЕПО с Банком России: Аукцион РЕПО», «РЕПО с Банком России: фикс.ставка» и «Аукцион РЕПО с Банком России: плавающая ставка» урегулирование предусмотренных настоящей статьей Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов взаимных требований по сделкам осуществляется в соответствии с Генеральным соглашением, заключенным Банком России и Участников клиринга. В случае отсутствия в Генеральном соглашении порядка урегулирования определенных требований, урегулирование таких требований происходит в порядке, установленном настоящей статьей Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

Статья 41. Порядок определения размера Фиксированного возмещения

41.1. При неисполнении Участником клиринга обязательств (по уплате денежных средств или по поставке ценных бумаг) по сделке с кодом расчетов В0-В30 данный Участник торгов обязан уплатить Участнику клиринга - контрагенту по сделке Фиксированное возмещение. При этом Фиксированное возмещение рассчитывается как произведение ставки Фиксированного возмещения, указанной в адресной заявке, на объем данной сделки.

41.2. При неисполнении Участником клиринга обязательств (по уплате денежных средств или по поставке ценных бумаг) по первой или второй части сделки РЕПО, по сделке, заключенной без участия центрального контрагента, такой Участник клиринга обязан уплатить Участнику клиринга - контрагенту по сделке РЕПО Фиксированное возмещение. При этом Фиксированное возмещение рассчитывается как произведение ставки Фиксированного возмещения, указанной контрагентами в

адресных заявках, на основании которых была заключена данная сделка РЕПО, на сумму РЕПО текущего торгового дня.

41.3. Фиксированное возмещение по сделке, заключенной без участия центрального контрагента с расчетами в иностранной валюте, удерживается в российских рублях по курсу Банка России на Дату прекращения исполнения соответствующих сделок.

41.4. Участник клиринга имеет право отказаться от получения Фиксированного возмещения по сделке, заключенной без участия центрального контрагента, направив Клиринговому центру письменное уведомление до даты уплаты Фиксированного возмещения в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

41.5. В случае если оба Участника клиринга - контрагента по сделке, заключенной без участия центрального контрагента, не исполнили свои обязательства по данной сделке, то они не имеют взаимных обязательств по уплате Фиксированного возмещения друг другу по данной сделке.

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

Статья 42. Порядок исполнения обязательств и требований Участников клиринга и Клирингового центра, включенных в клиринговый пул

42.1. Клиринговый центр осуществляет определение и учет обязательств и требований по денежным средствам по каждому Расчетному коду Участника клиринга (Клирингового центра) / Счету обеспечения Т0 в соответствии с условиями заключенных им сделок, обязательства по которым включены в соответствующий клиринговый пул.

Клиринговый центр осуществляет определение и учет обязательств и требований по ценным бумагам по каждому Торгово-клиринговому счету Участника клиринга (Клирингового центра) в отношении каждой ценной бумаги в отдельности в соответствии с условиями заключенных им сделок, обязательства по которым включены в соответствующий клиринговый пул.

42.2. Исполнение обязательств по сделкам, включенным в Клиринговый пул для расчетов в ходе торгов / Клиринговый пул для расчетов в ходе торгов по сделкам с центральным контрагентом, осуществляется сразу после их включения в соответствующий клиринговый пул.

42.2.1. По обязательствам, включенным в Клиринговый пул для расчетов в ходе торгов по сделкам с центральным контрагентом на основании Срочного отчета на исполнение, проводится неттинг, по итогам которого определяются нетто-обязательства / нетто-требования Участников клиринга и Клирингового центра по денежным средствам и по ценным бумагам, которые затем включаются в Клиринговый пул для расчетов в ходе торгов.

42.2.2. По обязательствам, включенным в Клиринговый пул для расчетов в ходе торгов, проводится неттинг, по итогам которого определяются Нетто-обязательства / нетто-требования Участников клиринга и Клирингового центра по денежным средствам и по ценным бумагам по сделкам клирингового пула в соответствии с подпунктами 32.4.1 и 32.4.2 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

42.3. Исполнение обязательств по сделкам, включенным в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов и Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов по сделкам с центральным контрагентом, осуществляется в ходе расчетных клиринговых сессий, время проведение которых установлено Временным регламентом, являющимся приложением к общей части Правил клиринга.

Для каждой расчетной клиринговой сессии формируется отдельный Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов и отдельный Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов по сделкам с центральным контрагентом.

Время формирования Клирингового пула для расчетов по итогам торгов и Клирингового пула для расчетов по итогам торгов по сделкам с центральным контрагентом соответствует времени начала соответствующей расчетной клиринговой сессии, если Временным регламентом на фондовом рынке и рынке депозитов не установлено иное.

42.4. По обязательствам по сделкам с ценными бумагами с кодами расчетов T0, K0 и обязательствам по первым частям сделок РЕПО с кодом расчетов T0/Yn, а также обязательствам по иным Сделкам T+, включенным в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов по сделкам с центральным контрагентом, проводится неттинг, по итогам которого определяются нетто-обязательства / нетто-требования Участников клиринга и Клирингового центра по денежным средствам и по ценным бумагам, которые затем включаются в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов.

42.5. По обязательствам, включенным в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов, проводится неттинг, по итогам которого определяются Нетто-обязательства / нетто-требования Участников клиринга и Клирингового центра по денежным средствам и по ценным бумагам по сделкам клирингового пула.

42.5.1. Нетто-обязательство (нетто-требование) Участника клиринга (Клирингового центра) по денежным средствам по сделкам клирингового пула по каждому Расчетному коду / Счету обеспечения T0 рассчитывается по формуле:

POS_VAL = ST - SO, где:

POS_VAL – Нетто-обязательство (Нетто-требование) Участника клиринга (Клирингового центра) по денежным средствам по сделкам клирингового пула;

ST – сумма требований, а SO – сумма обязательств Участника клиринга (Клирингового центра) по денежным средствам по включенным в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов:

- нетто-обязательствам / нетто-требованиям, определенным по итогам неттинга обязательств по сделкам, включенным в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов по сделкам с центральным контрагентом, в соответствии с пунктом 42.4 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов;
- первым частям сделок РЕПО с кодом расчетов Rb;
- сделкам купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов Bn, B0-B30;
- первым частям сделок РЕПО с кодом расчетов Sn;
- вторым частям сделок РЕПО с кодом расчетов Sn, Z0 и Rb;
- обязательствам по внесению / требованиям по получению компенсационных взносов;
- обязательствам по уплате / требованиям по получению отступного за отказ от исполнения сделки РЕПО / сделки купли-продажи ценных бумаг;
- обязательствам по уплате / требованиям по получению отступного за отказ от заключения сделки;
- требованиям по зачислению денежных средств на Счет обеспечения T0 по распоряжениям на перевод денежных средств / Запросам на изменение параметров Торгово-клирингового счета;
- обязательствам по списанию денежных средств со Счета обеспечения T0 по распоряжениям на перевод денежных средств / Запросам на изменение параметров Торгово-клирингового счета.

Отрицательное значение POS_VAL означает наличие Нетто-обязательства Участника клиринга (Клирингового центра) по денежным средствам по сделкам клирингового пула, положительное значение POS_VAL – Нетто-требования

Участника клиринга (Клирингового центра) по денежным средствам по сделкам клирингового пула.

42.5.2. Нетто-обязательство (Нетто-требование) Участника клиринга (Клирингового центра) по ценным бумагам по сделкам клирингового пула по каждому Торгово-клиринговому счету депо и в отношении каждой ценной бумаги рассчитывается по формуле:

POS_C = STC - SOC, где:

POS_C – Нетто-обязательство (Нетто-требование) Участника клиринга (Клирингового центра) по ценной бумаге по сделкам клирингового пула;

STC – сумма требований, а SOC – сумма обязательств Участника клиринга (Клирингового центра) по соответствующей ценной бумаге по включенным в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов:

- нетто-обязательствам / нетто-требованиям, определенным по итогам неттинга обязательств по сделкам, включенным в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов по сделкам с центральным контрагентом, в соответствии с пунктом 42.4 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов;
- первым частям сделок РЕПО с кодом расчетов Rb;
- сделкам купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов Bn, B0-B30;
- первым частям сделок РЕПО с кодом расчетов Sn;
- вторым частям сделок РЕПО с кодом расчетов Sn, Z0 и Rb;
- обязательствам по внесению / требованиям по получению компенсационных взносов;
- требованиям по зачислению ценных бумаг на Торгово-клиринговый счет Т0 / Торгово-клиринговый счет Т+ / Торгово-клиринговый счет имущественного пула по распоряжениям на перевод ценных бумаг в ближайшую расчетную клиринговую сессию / Запросам на изменение параметров Торгово-клирингового счета;
- обязательствам по списанию ценных бумаг с Торгово-клирингового счета Т0 / Торгово-клирингового счета Т+ / Торгово-клирингового счета имущественного пула по распоряжениям на перевод ценных бумаг в ближайшую расчетную клиринговую сессию / Запросам на изменение параметров Торгово-клирингового счета;
- Итоговым нетто-обязательствам / Итоговым нетто-требованиям Участников клиринга по ценным бумагам, определенным в Едином клиринговом пуле в соответствии с общей частью Правил клиринга (только для Торгово-клиринговых счетов Т+ и Торгово-клиринговых счетов имущественного пула).

Отрицательное значение POS_C означает наличие Нетто-обязательства Участника клиринга (Клирингового центра) по ценной бумаге по сделкам клирингового пула, положительное значение POS_C – Нетто-требования Участника клиринга (Клирингового центра) по ценной бумаге по сделкам клирингового пула.

42.6. Нетто-обязательства (нетто-требования) Участников клиринга по ценным бумагам по сделкам клирингового пула, рассчитанные в соответствии с подпунктом 42.5.2 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, включаются в

распоряжение на проведение операций по Разделам / субсчетам депо, направляемое Клиринговым центром Расчетному депозитарию в соответствии с пунктом 44.4 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

42.7. Обязательства / требования по передаче ценных бумаг по сделкам купли-продажи с кодом расчетов Z0, X0 и первым частям сделок РЕПО с кодом расчетов Z0 или Нетто-обязательства (нетто-требования) Участников клиринга по ценным бумагам по сделкам клирингового пула, рассчитанные в соответствии с подпунктом 32.4.2 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов по обязательствам, включенным в Срочный отчет на исполнение, включаются в распоряжение на проведение операций по Разделам / субсчетам депо, направляемое Клиринговым центром Расчетному депозитарию в соответствии с пунктом 44.3 / 44.5 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

42.8. Обязательства по оплате ценных бумаг по сделкам купли-продажи с кодом расчетов Z0, X0 и первым частям сделок РЕПО с кодом расчетов Z0, Нетто-обязательства Участников клиринга по денежным средствам по сделкам клирингового пула, рассчитанные в соответствии с подпунктом 32.4.1 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов по обязательствам, включенным в Срочный отчет на исполнение, или в соответствии с подпунктом 42.5.1 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов в отношении Счета обеспечения Т0 или Расчетного кода, исполняются за счет денежных средств, учитываемых по тому же Счету обеспечения Т0 / Расчетному коду.

42.8.1. Клиринговый центр зачитывает Обязательство по оплате ценных бумаг, Нетто-обязательство Участника клиринга по денежным средствам по сделкам клирингового пула (или его часть), определенное в отношении Счета обеспечения Т0 / Расчетного кода, с требованием Участника клиринга по возврату денежных средств, учитываемых по тому же Счету обеспечения Т0 / Расчетному коду.

42.9. Требование по оплате ценных бумаг по сделкам купли-продажи с кодом расчетов Z0, X0 и первым частям сделок РЕПО с кодом расчетов Z0 или Нетто-требование Участника клиринга по денежным средствам, рассчитанные в соответствии с подпунктом 32.4.1 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов по обязательствам, включенным в Срочный отчет на исполнение, или в соответствии с подпунктом 42.5.1 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов в отношении Счета обеспечения Т0 / Расчетного кода, прекращается возникновением обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга денежных средств, учитываемых по тому же Счету обеспечения Т0 / Расчетному коду, в размере соответствующего требования / Нетто-требования Участника клиринга.

42.10. После исполнения (прекращения) Нетто-обязательств (нетто-требований) Участников клиринга по денежным средствам по сделкам клирингового пула в соответствии с пунктами 42.8 или 42.9 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов и направления в Расчетный депозитарий распоряжения на проведение операций по Разделам / субсчетам депо в соответствии с пунктом 44.3 или 44.4 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов обязательства Участников клиринга и Клирингового центра, включенные в соответствующий клиринговый пул, считаются прекращенными в соответствующем клиринговом пуле.

После получения от Расчетного депозитария отчета о проведении операций по Разделам / субсчетам депо в соответствии с пунктом 44.5 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов расчеты по ценным бумагам по итогам клиринга считаются завершенными.

42.11. Неисполненные обязательства и требования Участников клиринга по сделкам, за исключением Сделок Т+, учитываются в Клиринговой системе и являются допущенными к клирингу вплоть до Даты прекращения исполнения таких сделок.

С Даты прекращения исполнения обязательства Участников клиринга по сделкам исключаются из числа обязательств, допущенных к клирингу, и не подлежат исполнению в Клиринговой системе, неисполненные сделки исключаются из Клиринговой системы.

42.12. Исключение сделок из Клиринговой системы не влечет прекращение обязательств сторон по указанным сделкам. Требования о надлежащем исполнении таких сделок могут быть предъявлены любой из сторон в соответствии с гражданским законодательством при условии соблюдения порядка разрешения споров, предусмотренного общей частью Правил клиринга и Правилами торгов на фондовом рынке и рынке депозитов.

Обязательства и требования Участников клиринга по внесению компенсационных взносов учитываются в Клиринговой системе и являются допущенными к клирингу в Дату внесения компенсационных взносов. С даты, следующей за Датой внесения компенсационных взносов, обязательства Участников клиринга по компенсационным взносам не подлежат исполнению в Клиринговой системе.

ПОДРАЗДЕЛ V-VI. ОСОБЕННОСТИ ВЗАИМОДЕЙСТВИЯ С РАСЧЕТНОЙ ОРГАНИЗАЦИЕЙ И РАСЧЕТНЫМ ДЕПОЗИТАРИЕМ

Статья 43. Особенности взаимодействия с Расчетной организацией

43.1. Каждый Расчетный день до начала Торгов, Клиринговый центр направляет Расчетной организации запрос выписки по торговым банковским счетам, в ответ на который Расчетная организация передает Клиринговому центру выписку по торговым банковским счетам.

43.2. После получения от Расчетной организации выписки по торговым банковским счетам Клиринговый центр передает Расчетной организации распоряжение на перевод на клиринговый банковский счет Клирингового центра, открытый в Расчетной организации и предназначенный для учета индивидуального клирингового обеспечения, денежных средств с торговых банковских счетов в суммах, указанных в полученной от Расчетной организации выписки по торговым банковским счетам.

После получения от Расчетной организации отчета об исполнении указанного распоряжения Клиринговый центр учитывает переведенные денежные средства на Счетах обеспечения Т0, открытых к соответствующим торговым банковским счетам.

43.3. При увеличении в ходе торгов суммы денежных средств, учитываемых на торговом банковском счете, Расчетная организация передает Клиринговому центру информацию о таком увеличении, а Клиринговый центр учитывает это увеличение по Счету обеспечения Т0 и передает Расчетной организации распоряжение на перевод на клиринговый банковский счет Клирингового центра денежных средств с торгового банковского счета в сумме указанного увеличения.

43.4. В случае необходимости в ходе Торгов списания денежных средств с торгового банковского счета, Расчетная организация направляет Клиринговому центру запрос согласия Клирингового центра на списание денежных средств с торговых банковских счетов.

Клиринговый центр дает согласие на списание денежных средств с торгового банковского счета при условии, что сумма списания не превышает суммы денежных средств, учитываемой по соответствующему Счету обеспечения Т0, за вычетом соответствующего Ограничительного лимита, и направляет Расчетной организации распоряжение на перевод денежных средств с клирингового банковского счета на торговый банковский счет на сумму списания.

43.5. После окончания торгов Клиринговый центр направляет Расчетной организации распоряжение на проведение операций по торговым банковским счетам, содержащее распоряжения на перевод денежных средств с клирингового банковского счета на торговые банковские счета в суммах денежных средств, учитываемых по Счетам обеспечения Т0 после прекращения обязательств, включенных в последний в течение Расчетного дня Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов, увеличенных на сумму обязательств / нетто-обязательств по денежным средствам в отчетах на исполнение, не обеспеченных средствами под

исполнение на момент формирования последнего в течение Расчетного дня Клирингового пула для расчетов по итогам торгов.

43.6. После исполнения Расчетной организацией распоряжения на проведение операций по торговым банковским счетам, направленного Клиринговым центром в соответствии с пунктом 43.5 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, Клиринговый центр направляет Расчетной организации уведомление о согласии на проведение операций по торговым банковским счетам.

Направление Расчетной организации указанного уведомления означает согласие Клирингового центра на проведение любых операций по торговым банковским счетам до момента получения Расчетной организацией от Клирингового центра запроса выписки по торговым банковским счетам, за исключением торговых банковских счетов, в отношении которых Клиринговым центром от Расчетной организации получена информация об обращении взыскания или наложении ареста на имущество Участника клиринга, находящееся на торговом банковском счете.

Порядок действий Клирингового центра, включая порядок взаимодействия с Расчетной организацией при обращении взыскания или наложении ареста на имущество Участника клиринга, находящееся на торговом банковском счете, определен общей частью Правил клиринга.

43.7. При получении от Расчетной организации уведомления о приостановлении или прекращении участия Участника клиринга / клиента Участника клиринга в платежной системе Расчетной организации Клиринговый центр прекращает проведение операций по торговым банковским счетам такого Участника клиринга / клиента Участника клиринга с рабочего дня, следующего за днем получения от Расчетной организации указанного уведомления.

Статья 44. Особенности взаимодействия с Расчетным депозитарием

44.1. Учет ценных бумаг, внесенных Участником клиринга в имущественный пул, осуществляется на соответствующих субсчетах депо имущественного пула.

44.1.1. Списание / зачисление ценных бумаг с субсчетов / на субсчета депо имущественного пула осуществляется на основании распоряжений Клирингового центра.

44.1.2. Доходы и иные выплаты по ценным бумагам, учитываемым на субсчетах депо имущественного пула, перечисляются на соответствующий клиринговый счет Клирингового центра, предназначенный для внесения имущества в имущественный пул, в порядке, предусмотренном договором Клирингового центра с Расчетным депозитарием, в случае, если это предусмотрено внутренними документами Расчетного депозитария.

Доходы и иные выплаты по ценным бумагам в имущественном пуле, зачисленные на соответствующий клиринговый счет Клирингового центра, предназначенный для внесения имущества в имущественный пул, в соответствии с настоящим подпунктом Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, учитываются как имущество, внесенное Участником клиринга в имущественный пул.

44.2. Клиринговый центр дает согласие на списание клиринговых сертификатов участия с Раздела Т+ при условии, что количество ценных бумаг, подлежащих списанию, не превышает количества ценных бумаг, учитываемого по Торгово-клиринговому счету Т+, и в результате такого списания Единый лимит по Расчетному коду, к которому относится указанный Раздел Т+, не станет отрицательным. При этом согласие на списание клиринговых сертификатов участия в количестве превышения количества ценных бумаг, учитываемого по Торгово-клиринговому счету Т+, над количества ценных бумаг, учитываемых на Разделе Т+, входящем в состав такого Торгово-клирингового счета Т+, по информации, полученной от Расчетного депозитария, включает поручение Расчетному депозитарию на выдачу клиринговых сертификатов участия в количестве, равном такому превышению.

При согласии Клирингового центра на списание клиринговых сертификатов участия номинальная стоимость клиринговых сертификатов участия, подлежащих выдаче в ходе ближайшего взаимодействия с Расчетным депозитарием, уменьшается на количество клиринговых сертификатов участия, указанное в поручении на выдачу клиринговых сертификатов участия, направленном Расчетному депозитарию в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

44.3. Проведение расчетов по ценным бумагам в ходе торгов осуществляется Расчетным депозитарием на основании полученного от Клирингового центра распоряжения на проведение операций по Разделам / субсчетам депо, содержащего обязательства и требования Участника клиринга по передаче ценных бумаг по сделкам с кодом расчетов Z0 / X0, включенные в Клиринговый пул для расчетов в ходе торгов, и обязательства по списанию / зачислению ценных бумаг по распоряжениям на немедленный перевод ценных бумаг.

44.3.1. Распоряжение на проведение операций по Разделам / субсчетам депо, содержащее обязательства и требования Участника клиринга по передаче размещаемых ценных бумаг по сделкам размещения с кодом расчетов X0, направляется Клиринговым центром Расчетному депозитарию сразу после получения от Расчетного депозитария информации о зачислении всех размещаемых ценных бумаг на счет Расчетного депозитария в реестре.

44.4. Проведение расчетов по ценным бумагам по итогам торгов осуществляется Расчетным депозитарием на основании полученного от Клирингового центра распоряжения на проведение операций по Разделам / субсчетам депо, содержащего:

- поручение на выдачу клиринговых сертификатов участия в количестве, соответствующем номинальной стоимости клиринговых сертификатов участия, подлежащих выдаче в ходе ближайшего взаимодействия с Расчетным депозитарием, учитываемой по Расчетному коду имущественного пула;
- Нетто-обязательства и Нетто-требования Участника клиринга и Клирингового центра по ценным бумагам по сделкам клирингового пула, определенные на основании обязательств, включенных в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов;
- поручение на погашение клиринговых сертификатов участия в количестве, соответствующем номинальной стоимости клиринговых сертификатов участия, подлежащих погашению в ходе ближайшего взаимодействия с

Расчетным депозитарием, учитываемой по Расчетному коду имущественного пула.

44.4.1. Распоряжения на проведение операций по Разделам / субсчетам депо, содержащие Нетто-обязательства и Нетто-требования Участника клиринга и Клирингового центра по ценным бумагам по сделкам клирингового пула (за исключением клиринговых сертификатов участия) исполняются Расчетным депозитарием в корреспонденции с субсчетом депо Клирингового центра, открытым в рамках клирингового счета депо Клирингового центра, предназначенного для исполнения операций по ценным бумагам по Разделам / субсчетам депо по итогам клиринга.

44.4.2. Распоряжения на проведение операций по Разделам / субсчетам депо, содержащие Нетто-обязательства и Нетто-требования Участника клиринга и Клирингового центра по клиринговым сертификатам участия исполняются Расчетным депозитарием в корреспонденции с торговым разделом казначейского счета депо Клирингового центра.

44.4.3. Поручения на выдачу / погашение клиринговых сертификатов участия исполняются Расчетным депозитарием в корреспонденции с основным разделом счета места хранения.

44.5. Проведение расчетов по ценным бумагам в ходе торгов осуществляется Расчетным депозитарием на основании полученного от Клирингового центра распоряжения на проведение операций по Разделам / субсчетам депо, содержащего Нетто-обязательства и Нетто-требования Участника клиринга и Клирингового центра по ценным бумагам по сделкам клирингового пула, определенные на основании обязательств, включенных в Клиринговый пул для расчетов в ходе торгов.

Указанного распоряжение исполняется Расчетным депозитарием в корреспонденции с субсчетом депо Клирингового центра, открытым в рамках клирингового счета депо Клирингового центра, предназначенного для исполнения операций по ценным бумагам по Разделам / субсчетам депо по итогам клиринга.

44.6. После исполнения распоряжения на проведение операций по Разделам / субсчетам депо, полученного от Клирингового центра, Расчетный депозитарий направляет Клиринговому центру отчет о проведении операций по Разделам / субсчетам депо.

После получения отчета о проведении операций по Разделам / субсчетам депо по итогам торгов Клиринговый центр устанавливает равной нулю номинальную стоимость клиринговых сертификатов участия, подлежащих выдаче в ходе ближайшего взаимодействия с Расчетным депозитарием, и номинальную стоимость клиринговых сертификатов участия, подлежащих погашению в ходе ближайшего взаимодействия с Расчетным депозитарием.

44.7. Порядок действий Клирингового центра, включая порядок взаимодействия с Расчетным депозитарием при обращении взыскания или наложении ареста на имущество Участника клиринга, находящееся на торговом счете депо, определен общей частью Правил клиринга.

ПОДРАЗДЕЛ V-VII. ПОРЯДОК ПЕРЕДАЧИ ДОХОДА

Статья 45. Порядок передачи Доходов по сделкам РЕПО и сделкам купли-продажи ценных бумаг, заключенным с Клиринговым центром

45.1. Обязательства по передаче Дохода возникают:

- по сделке РЕПО, заключенной с Клиринговым центром, в том числе Сделке РЕПО Клирингового центра, с ценными бумагами, по которым принято решение о выплате Дохода, и список лиц, имеющих право на его получение, определяется в период после исполнения обязательств по передаче ценных бумаг по первой части сделки РЕПО и до исполнения обязательств по передаче ценных бумаг по второй части сделки РЕПО;
- по заключенной Клиринговым центром с Недобросовестным или Добросовестным участником клиринга в соответствии с общей частью Правил клиринга второй сделке купли-продажи ценных бумаг, по которым принято решение о выплате Дохода, и список лиц, имеющих право на его получение, определяется в период после исполнения обязательств по передаче ценных бумаг по первой сделке купли-продажи ценных бумаг и до исполнения обязательств по передаче ценных бумаг по второй сделке купли-продажи ценных бумаг;
- по сделке купли-продажи облигаций с кодом расчетов Yn, Nn, по которым принято решение о выплате Дохода, и Дата исполнения обязательств по которой приходится на период с даты определения списка лиц, имеющих право на получение Дохода, до даты окончания купонного периода и/или амортизации (по тому же купонному периоду), включая эту дату в случае, если дата окончания купона не совпадает с датой начала следующего купонного периода, либо не включая эту дату в случае, если дата окончания купона совпадает с датой начала следующего купонного периода(для облигаций, входящих в список, определенный решением Биржи).

Для целей определения Обязательства по передаче Дохода по облигациям в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, датой определения списка лиц, имеющих право на получение Дохода, является дата, определенная в соответствии с решением о выпуске соответствующих облигаций.

45.2. По сделке с акциями российских организаций, номинированными в российских рублях, размер обязательства по передаче / требования по получению Дохода в форме денежных средств рассчитывается по формуле:

Inc = ROUND((N × d – ROUND((N × d × T × max((D1 - D2);0) / D1);0)); 2), где	
Inc	размер обязательства по передаче / требования по получению Дохода по сделке (в российских рублях);
N	размер обязательства / требования Участника клиринга по ценным бумагам по сделке, указанной в пункте 45.1 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов (в штуках);
d	сумма начисления на одну акцию, установленная эмитентом ценных бумаг (в российских рублях);
T	налоговая ставка, установленная в отношении доходов от

	долевого участия в деятельности организаций, полученных в виде дивидендов юридическими и физическими лицами, являющимися налоговыми резидентами Российской Федерации;
D1	общая сумма дивидендов, подлежащая распределению российской организацией (эмитентом) в пользу всех получателей; (Д1)
D2	общая сумма дивидендов, полученных российской организацией (эмитентом) в текущем отчетном (налоговом) периоде и предыдущих отчетных (налоговых) периодах (за исключением дивидендов, указанных в подпункте 1 пункта 3 статьи 284 Налогового кодекса Российской Федерации) к моменту распределения дивидендов в пользу налогоплательщиков - получателей дивидендов, при условии, что указанные суммы дивидендов ранее не учитывались при определении налоговой базы, определяемой в отношении доходов, полученных российской организацией (эмитентом) в виде дивидендов. (Д2)

45.3. По сделке с акциями иностранных организаций, номинированными в иностранной валюте, размер обязательства по передаче / требования по получению Дохода в форме денежных средств рассчитывается по формуле:

Inc = ROUND((N × d - ROUND (N × d × T);0); 2), где	
Inc	размер обязательства по передаче / требования по получению Дохода по сделке (в валюте, в которой эмитентом объявлена выплата);
N	размер обязательства / требования Участника клиринга по ценным бумагам по сделке, указанной в пункте 45.1 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов (в штуках);
d	сумма начисления на одну акцию, установленная эмитентом ценных бумаг (в валюте, в которой эмитентом объявлена выплата);
T	налоговая ставка, примененная к доходам в виде дивидендов по ценным бумагам в соответствии с налоговым законодательством страны, резидентом которой является эмитент ценной бумаги.

45.4. В случае выплаты Дохода ценными бумагами, размер обязательства по передаче / требования по получению Дохода в форме ценных бумаг по сделке рассчитывается по формуле:

Inc = N × d, где	
Inc	размер обязательства по передаче / требования по получению Дохода по сделке (в штуках);
N	размер обязательства / требования Участника клиринга по ценным бумагам по сделке, указанной в пункте 45.1 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов (в штуках);
d	количество ценных бумаг, передаваемых эмитентом на одну акцию, установленное эмитентом ценных бумаг (в штуках).

45.5. По сделке с облигациями, номинированными в российских рублях, размер обязательства по передаче / требования по получению Дохода в форме денежных средств рассчитывается по формуле:

Inc = ROUND(N × (d + m); 2), где	
Inc	размер обязательства по передаче / требования по получению Дохода по сделке (в российских рублях);
N	размер обязательства / требования Участника клиринга по ценным бумагам по сделке, указанной в пункте 45.1 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов (в штуках);
d	размер начисленного купона на одну облигацию, установленный эмитентом ценных бумаг (в российских рублях);
m	сумма номинальной стоимости облигации либо ее часть, выплачиваемая эмитентом при погашении, включая сумму премии за досрочное погашение, в случае ее выплаты эмитентом (досрочном, частичном или окончательном) (в российских рублях);

45.6. По сделке с облигациями, номинированными в иностранной валюте, размер обязательства по передаче / требования по получению Дохода в форме денежных средств рассчитывается по формуле:

Inc = ROUND ((N × d- ROUND(N × d × T;0) + N ×m); 2), где	
Inc	размер обязательства по передаче / требования по получению Дохода по сделке (в валюте, в которой эмитентом объявлена выплата);
N	размер обязательства / требования Участника клиринга по ценным бумагам по сделке, указанной в пункте 45.1 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов (в штуках);
d	размер начисленного купона на одну облигацию, установленный эмитентом ценных бумаг (в валюте, в которой эмитентом объявлена выплата);
T	налоговая ставка, примененная к доходам в виде НКД по ценным бумагам в соответствии с налоговым законодательством страны, резидентом которой является эмитент ценной бумаги.
m	сумма номинальной стоимости облигации либо ее часть, выплачиваемая эмитентом при погашении (досрочном, частичном или окончательном), включая сумму премии за досрочное погашение, в случае ее выплаты эмитентом (в валюте, в которой эмитентом объявлена выплата);

45.7. По сделке с ценным бумагами, за исключением ценных бумаг, указанных в пунктах 45.2-45.3, 45.5-45.6 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, размер обязательства по передаче / требования по получению Дохода в форме денежных средств рассчитывается по формуле:

Inc = ROUND((N × d - ROUND(N × d ×T;0) - N × f); 2), где	
Inc	размер обязательства по передаче / требования по получению Дохода по сделке (в валюте, в которой эмитентом объявлена выплата);
N	размер обязательства / требования Участника клиринга по ценным бумагам по сделке, указанной в пункте 45.1 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов (в штуках);
d	сумма начисления на одну ценную бумагу, установленная эмитентом ценных бумаг (в валюте, в которой эмитентом

	объявлена выплата);
T	налоговая ставка, примененная к соответствующему Доходу по соответствующей ценной бумаге в соответствии с налоговым законодательством страны, резидентом которой является эмитент ценной бумаги.
f	размер комиссионного вознаграждения и/или других удержаний эмитента ценных бумаг, уменьшающий сумму начисления на одну ценную бумагу, установленную эмитентом ценных бумаг.

45.8. Датой исполнения обязательств по передаче / требований по получению Дохода, определенных в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, является:

- Расчетный день, следующий за датой выплаты / передачи Расчетным депозитарием Дохода, по информации, полученной от Расчетного депозитария, в случае если Доход выплачивается / передается через Расчетный депозитарий, или
- Расчетный день, следующий за датой раскрытия эмитентом ценных бумаг информации о факте исполнения (полностью или частично) своих обязательств по выплате / передаче Дохода, в случае если Доход не выплачивается / не передается через Расчетный депозитарий.

45.9. Отчет об обязательствах по передаче / требованиях по получению Дохода, содержащий информацию об указанных обязательствах по каждой сделке, формируется Клиринговым центром и направляется Участникам клиринга в Дату исполнения указанных обязательств и требований.

45.10. В Дату исполнения обязательств по передаче / требований по получению Дохода, определенных в соответствии с пунктами 45.2-45.7 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, Клиринговый центр зачитывает встречные однородные обязательства по передаче и требования по получению Дохода по сделке, определенные в отношении одного Торгово-клирингового счета Т+ Участника клиринга.

Обязательства по передаче / требования по получению Дохода, определенные после проведения зачета в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, учитываются в Клиринговой системе и являются обязательствами, подлежащими исполнению.

45.11. Клиринговый центр передает Доход Участнику клиринга, имеющему требование по получению Дохода в отношении одного или нескольких своих Торгово-клиринговых счетов Т+, в случае, если данный Участник клиринга не имеет не исполненных в установленный срок (просроченных) обязательств по передаче Дохода перед Клиринговым центром в отношении другого (других) своих Торгово-клиринговых счетов Т+.

45.12. Обязательства по передаче / требования по получению Дохода включаются в Единый клиринговый пул в порядке, установленном общей частью Правил клиринга.

45.13. Информация об исполненных обязательствах по передаче Дохода включается в Отчет о движении денежных средств.

РАЗДЕЛ VI. ПОРЯДОК ОПЛАТЫ УСЛУГ. ОТЧЕТЫ ПО ИТОГАМ КЛИРИНГА

Статья 46. Особенности оплаты услуг Клирингового центра, Биржи и Технического центра

46.1. На фондовом рынке и рынке депозитов Клиринговый центр взимает:

- комиссионное вознаграждение за клиринг в пользу Клирингового центра;
- комиссионное вознаграждение за операции с клиринговыми сертификатами участия в пользу Клирингового центра;
- комиссионное вознаграждение за клиринговые услуги по открытию и ведению Торгово-клирингового счета 3-го уровня;
- комиссионное вознаграждение в пользу Биржи за услуги по организации торгов на фондовом рынке и рынке депозитов;
- абонентскую плату в пользу Биржи;
- Дополнительное вознаграждение за предоставление ПАО Московская Биржа интегрированного технологического сервиса в пользу Технического центра (далее – Дополнительное вознаграждение).

46.1.1. В случаях, установленных Тарифами Клирингового центра, комиссионное вознаграждение за клиринг по сделкам РЕПО включает комиссионное вознаграждение за операции с клиринговыми сертификатами участия.

46.2. Участник клиринга вправе указать Клиринговому центру Идентификатор и наименование Участника торгов, не совпадающего в одном лице с Участником клиринга, в целях списания с указанного в заявлении Расчетного кода подлежащих уплате данным Участником торгов постоянных частей комиссионного вознаграждения Биржи, абонентской платы, комиссионного вознаграждения по тарифному плану «Размещения-фиксированный», а также комиссионного вознаграждения Клирингового центра за оказание Участнику торгов клиринговых услуг по открытию и/или ведению Торгово-клирингового счета 3-го уровня.

46.3. Удержание Клиринговым центром с Участника клиринга комиссионного вознаграждения по сделкам, заключенным с использованием Торгово-клирингового счета имущественного пула, осуществляется с Расчетного кода, входящего в состав Торгово-клирингового счета Т+, соответствующего Торгово-клиринговому счету имущественного пула, указанного в заявке на заключение сделки.

46.4. Оборотная часть комиссионного вознаграждения по биржевым сделкам, учитываемая по Счету обеспечения Т0, рассчитывается при подаче заявки на заключение сделки (при наступлении времени активации заявки в случае его наличия), на ее сумму уменьшается сумма денежных средств, учитываемая по такому Счету обеспечения Т0.

46.5. Премия предоставляется по итогам календарного месяца Участникам торгов / Участникам клиринга, выполнившим условия, необходимые для получения премии, предусмотренные Тарифами Клирингового центра и Тарифами Биржи, при

условии, что на дату выплаты премии допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию не приостановлен / не прекращен.

Информация о суммах премии, подлежащих перечислению Участнику торгов / Участнику клиринга, предоставляется Участнику торгов / Участнику клиринга в Отчете о премии.

Премия перечисляется Участнику торгов / Участнику клиринга Биржей и Клиринговым центром на основной Расчетный код для списания комиссионных вознаграждений, порядок выбора которого установлен общей частью Правил клиринга, не позднее третьего Расчетного дня месяца, следующего за месяцем оказания клиринговых услуг.

46.6. Абонентская плата, определенная в соответствии с Тарифами Биржи, определяется в первый Расчетный день календарного квартала, следующего за кварталом, за который взимается абонентская плата.

46.7. Комиссионное вознаграждение за предоставление по запросам Участников клиринга дубликатов отчетов по итогам клиринга, предусмотренных Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, определяется и взимается в день предоставления указанных дубликатов, и учитывается по Расчетному коду / Счету обеспечения Т0, указанному Участником клиринга в запросе на предоставление дубликатов отчетов по итогам клиринга.

46.8. Участник торгов / Участник клиринга вправе выбрать тарифный план «Размещения-фиксированный».

Выбор тарифного плана «Размещения-фиксированный» осуществляется на основании Запроса о выборе тарифного плана «Размещения-фиксированный» предоставленного Участником торгов / Участником клиринга.

Запрос предоставляется Участником торгов / Участником клиринга Клиринговому центру не позднее, чем за 10 (десять) рабочих дней до начала периода, состоящего из 3 (трех) последовательных календарных месяцев, с которого будет применяться тарифный план «Размещения-фиксированный».

Если в запросе не указано на необходимость пролонгации, период действия тарифного плана «Размещения-фиксированный» составляет 12 (двенадцать) календарных месяцев, начиная с первого числа месяца, указанного в запросе.

В случае выбора Участником торгов / Участником клиринга тарифного плана «Размещения-фиксированный» Участник торгов / Участник клиринга уплачивает Комиссионное вознаграждение Биржи и Клирингового центра по биржевым сделкам купли-продажи облигаций и/или еврооблигаций 2 (двух) эмитентов, указанных в Запросе Участника торгов / Участника клиринга о выборе тарифного плана «Размещения-фиксированный», в которых Участник торгов / Участник клиринга будет являться продавцом при осуществлении размещения или доразмещения (отчуждения первичным владельцем) в режимах торгов Режим основных торгов, Размещение: адресные заявки и Размещение: аукцион, а также в которых Участник торгов / Участник клиринга будет являться покупателем в режимах торгов Выкуп: адресные заявки, Выкуп: Аукцион, в пользу Биржи и Клирингового центра соответственно.

Иные виды комиссионного вознаграждения по указанным биржевым сделкам с Участника торгов / Участника клиринга, выбравшего тарифный план «Размещения-фиксированный», не взимаются.

Комиссионное вознаграждение по тарифному плану «Размещения-фиксированный» взимается с Участника торгов / Участнику клиринга в первый Расчетный день первого месяца из 3 (трех) последовательных календарных месяцев, за которые взимается указанное комиссионное вознаграждение, по окончании Торгов в данный Расчетный день.

46.9. Участникам торгов / Участникам клиринга, не выбравшим ни один из тарифных планов по сделкам купли-продажи облигаций федерального займа, устанавливается тарифный план 1, который, в случае первоначального допуска к торгам / клиринговому обслуживанию, устанавливается с даты допуска Участника торгов к торгам / Участника клиринга к клиринговому обслуживанию и действует до начала применения иного тарифного плана, выбранного Участником торгов / Участником клиринга.

46.10. Дополнительное вознаграждение, рассчитанное в отношении Участника торгов / Клиента в соответствии с Тарифами Технического центра, определяется в Расчетный день, в течение которого Участником торгов были поданы заявки на заключение сделок за свой счет или за счет указанного Клиента, и учитывается по Счету обеспечения Т0 / Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета, с указанием которого Участником торгов в течение данного Расчетного дня были поданы заявки на заключение сделок за свой счет или за счет указанного Клиента, если такой Торгово-клирингового счет – единственный, либо по основному Расчетному коду для списания комиссионных вознаграждений, порядок определения которого установлен общей частью Правил клиринга, если Участником торгов в течение данного Расчетного дня были поданы заявки на заключение сделок за свой счет или за счет указанного Клиента с указанием нескольких Торгово-клиринговых счетов.

46.11. Оборотная часть комиссионного вознаграждения за клиринг по депозитным договорам определяется в дату внесения заявки на заключение депозитного договора в реестр предложений.

46.12. Комиссионное вознаграждение за клиринговые услуги по открытию Торгово-клирингового счета 3-го уровня взимается с Участника торгов / Участника клиринга, на основании запроса которого открыт Торгово-клиринговый счет 3-го уровня, не позднее рабочего дня, следующего за днем открытия Торгово-клирингового счета 3-го уровня, и учитывается по основному Расчетному коду для списания комиссионных вознаграждений, порядок определения которого установлен общей частью Правил клиринга.

46.13. Комиссионное вознаграждение за клиринговые услуги по ведению Торгово-клирингового счета 3-го уровня взимается с Участника торгов / Участника клиринга, которому оказываются клиринговые услуги по ведению клиринговых регистров 3-го уровня, в первый рабочий день отчетного месяца за каждый открытый Торгово-клиринговый счет 3-го уровня и учитывается по основному

Расчетному коду для списания комиссионных вознаграждений, порядок определения которого установлен общей частью Правил клиринга.

46.14. Комиссионное вознаграждение Биржи по сделкам, клиринг по которым осуществляет иная клиринговая организация, рассчитывается при подаче заявки на заключение сделки, на его сумму уменьшается сумма денежных средств, учитываемая по основному Расчетному коду для списания комиссионных вознаграждений, порядок определения которого установлен общей частью Правил клиринга.

Клиринговый центр взимает комиссионное вознаграждение Биржи по сделкам, клиринг по которым осуществляет иная клиринговая организация, только с Участников клиринга, являющихся Участниками торгов.

46.15. Обязательства Участника торгов / Участника клиринга по уплате комиссионного вознаграждения, учитываемые по соответствующему Расчетному коду, включаются в состав Единого клирингового пула и исполняются в порядке, определенном общей частью Правил клиринга.

46.16. Обязательства Участника торгов / Участника клиринга по уплате комиссионного вознаграждения, учитываемые по соответствующему Счету обеспечения Т0, исполняются после исполнения обязательств Участника клиринга по денежным средствам, определенных в соответствии со статьей 42 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

Статья 47. Порядок представления информации и отчетов по итогам клиринга

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

- о сделках, стороной по которым является Участник клиринга;
- о размере Обеспечения в каждой валюте / каждом драгоценном металле, учитываемого по каждому Расчетному коду Участника клиринга;
- о размере Обеспечения в ценных бумагах, учитываемого по каждому Торгово-клиринговому счету Участника клиринга;
- о профилях активов в каждой валюте / каждом драгоценном металле, учитываемых по Расчетному коду Единого пула Участника клиринга, переданных / полученных из Клиринговой системы валютного рынка и рынка драгоценных металлов;
- о профилях активов в российских рублях / каждой ценной бумаге, учитываемых по Расчетному коду Единого пула / Торгово-клиринговому счету Участника клиринга, переданных / полученных из Клиринговой системы срочного рынка;
- о размере Единого лимита по Расчетному коду;
- о значении ограничения на минимальное допустимое отрицательное значение Единого лимита по Расчетному коду, рассчитанного без учета Обеспечения Участника клиринга, установленном Участником клиринга (по каждому Расчетному коду Участника клиринга) (в случае, если такое значение установлено);

- о значении Нетто-обязательства и/или Нетто-требования по денежным средствам / драгоценным металлам, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, в каждой валюте / каждом драгоценном металле и с каждой Датой исполнения (по каждому Расчетному коду Участника клиринга);
- о значении Нетто-обязательства и/или Нетто-требования по ценным бумагам, учитываемого по Торгово-клиринговому счету Участника клиринга, по каждому коду ценных бумаг и с каждой Датой исполнения (по каждому Торгово-клиринговому счету Участника клиринга);
- о размере Обеспечения в каждой валюте / каждом драгоценном металле, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, недостающего для исполнения Нетто-обязательства Участника клиринга в соответствующей валюте / соответствующем драгоценном металле, учитываемого по тому же Расчетному коду Участника клиринга, с наступившей Датой исполнения (по каждому Расчетному коду Участника клиринга);
- о размере Обеспечения в ценных бумагах, учитываемого по Торгово-клиринговому счету Участника клиринга, недостающего для исполнения Нетто-обязательства Участника клиринга в таких ценных бумагах, учитываемого по тому же Торгово-клиринговому счету Участника клиринга, с наступившей Датой исполнения (по каждому Торгово-клиринговому счету Участника клиринга);
- о наличии / отсутствии Маржинального требования, о сумме Маржинального требования в российских рублях (в случае наличия) (по каждому Расчетному коду Участника клиринга);
- о наличии / отсутствии Маржинального требования по пулу, о сумме Маржинального требования по пулу в российских рублях (в случае наличия) (по каждому Расчетному коду Участника клиринга);
- о наличии / отсутствии Задолженности Участника клиринга перед Клиринговым центром, о сумме Задолженности Участника клиринга (в случае наличия) (по каждому Расчетному коду Участника клиринга).

47.2. Кроме отчетов, предусмотренных общей частью Правил клиринга, Клиринговый центр формирует следующие отчеты по итогам клиринга для Участников клиринга:

- Выписка из реестра Внебиржевых сделок с ценными бумагами;
- Выписка из реестра Предложений;
- Выписка из реестра сделок, принятых в клиринг, содержащая информацию об обязательствах по сделкам, допущенных к клирингу;
- Выписка из реестра неисполненных сделок;
- Выписка из протокола исполнения сделок и обязательств по внесению компенсационных взносов, содержащая информацию о допущенных к клирингу обязательствах по внесению компенсационных взносов;
- Отчет о комиссионных вознаграждениях;
- Отчет о торгово-клиринговых счетах Участника клиринга;
- Выписка из протокола внесения компенсационных взносов;
- Уведомление о замене Торгово-клирингового счета;

- Отчет об обязательствах по Сделкам Т+, содержащий информацию о допущенных к клирингу обязательствах по Сделкам Т+;
- Отчет об Обеспечении, содержащий информацию о размере Обеспечения Участника клиринга в денежных средствах и ценных бумагах и об изменении размера такого Обеспечения;
- Отчет об имуществе, внесенном в имущественные пулы;
- Отчет об обязательствах по передаче / требованиях по получению Дохода;
- Отчет о премии;
- Отчет о нормативной стоимости клиринговых сертификатов участия.

47.3. Для клиентов Участника клиринга Клиринговый центр формирует Выписку из реестра сделок, принятых в клиринг (по сделкам клиентов), содержащую информацию о допущенных к клирингу обязательствах по сделкам, заключенным за счет клиента Участника клиринга, для которого формируется отчет.

Указанный отчет направляется Участнику клиринга (для передачи их клиенту Участника клиринга) и/или уполномоченной им организации.

Для Держателей Клиринговый центр формирует Отчет о дополнительных торговых разделах, открытых для проведения операций Участниками клиринга, и иных реквизитах.

Указанный отчет направляется Держателям и/или уполномоченным ими организациям.

47.4. В случае предоставления Участником клиринга Клиринговому центру Заявления о предоставлении отчетов номинальному держателю, для Держателя / Участника клиринга, указанного в заявлении, Клиринговый центр формирует Выписку из реестра сделок, принятых в клиринг (для номинальных держателей), содержащую информацию о допущенных к клирингу обязательствах по сделкам, заключенным Участником клиринга с указанием Торгово-клиринговых счетов, в состав которых входят Разделы Держателя / Разделы, открытые на торговом счете депо номинального держателя Участника клиринга.

Указанный отчет направляется Держателю и/или уполномоченной им организации.

47.5. Отчеты в форме электронных документов направляются Участнику клиринга / Держателю ежедневно при условии совершения им (по его поручению / с использованием его торговых разделов (торговых банковских счетов)) операций в Клиринговой системе.

Отчет о дополнительных торговых разделах, открытых для проведения операций Участниками клиринга направляется Держателю дополнительно каждый первый Расчетный день месяца.

Отчет о торгово-клиринговых счетах Участника клиринга направляется Участнику клиринга ежедневно.

Отчеты о премии направляются Участникам клиринга, выполнившим условия, необходимые для получения премии по итогам календарного месяца, в первый Расчетный день месяца, следующего за отчетным.

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

- о сделках, заключенных Участником торгов с указанием Торгово-клирингового счета 2-го уровня, стороной по которым является Участник клиринга (по каждому Участнику торгов);
- о размере Обеспечения в каждой валюте / каждом драгоценном металле, информация о котором учитывается по каждому Расчетному коду 2-го уровня;
- о размере Обеспечения в ценных бумагах, информация о котором учитывается по каждому Торгово-клиринговому счету 2-го уровня;
- о профилях активов в каждой валюте / каждом драгоценном металле, учитываемых по Расчетному коду 2-го уровня, связанному с Расчетным кодом Участника клиринга, являющимся Расчетным кодом Единого пула, переданных / полученных из Клиринговой системы валютного рынка и рынка драгоценных металлов;
- о профилях активов в российских рублях, учитываемых по Расчетному коду 2-го уровня, связанному с Расчетным кодом Участника клиринга, являющимся Расчетным кодом Единого пула, переданных / полученных из Клиринговой системы срочного рынка;
- о профилях активов в каждой ценной бумаге, информация о которой учитывается по каждому Торгово-клиринговому счету 2-го уровня, в состав которого входит Расчетный код 2-го уровня, связанный с Расчетным кодом Участника клиринга, являющимся Расчетным кодом Единого пула, переданных / полученных из Клиринговой системы срочного рынка;
- о размере Единого лимита по Расчетному коду 2-го уровня;
- о значении ограничения на минимальное допустимое значение Единого лимита по Расчетному коду 2-го уровня, рассчитанного без учета Обеспечения, информация о котором учитывается по Расчетному коду 2-го уровня, установленном Участником клиринга (по каждому Расчетному коду 2-го уровня) (в случае, если такое значение установлено);
- о значении Нетто-обязательства и/или Нетто-требования по денежным средствам / драгоценным металлам, учитываемого по Расчетному коду 2-го уровня, в каждой валюте / каждом драгоценном металле и с каждой Датой исполнения (по каждому Расчетному коду 2-го уровня);
- о значении Нетто-обязательства и/или Нетто-требования по ценным бумагам, учитываемого по Торгово-клиринговому счету 2-го уровня, по каждому коду ценных бумаг и с каждой Датой исполнения (по каждому Торгово-клиринговому счету 2-го уровня);
- о размере Обеспечения в каждой валюте / каждом драгоценном металле, информация о котором учитывается по Расчетному коду 2-го уровня, недостающего для исполнения Нетто-обязательства Участника клиринга в соответствующей валюте / соответствующем драгоценном металле, учитываемого по тому же Расчетному коду 2-го уровня, с наступившей Датой исполнения (по каждому Расчетному коду 2-го уровня);
- о размере Обеспечения в ценных бумагах, информация о котором

учитывается по Торгово-клиринговому счету 2-го уровня, недостающего для исполнения Нетто-обязательства Участника клиринга в таких ценных бумагах, учитываемого по тому же Торгово-клиринговому счету 2-го уровня, с наступившей Датой исполнения (по каждому Торгово-клиринговому счету 2-го уровня).

47.7. Клиринговый центр обеспечивает Участнику торгов, заключившему с Клиринговым центром договор о ведении клиринговых регистров, предусмотренный общей частью Правил клиринга, и для которого зарегистрирован Торгово-клиринговый счет 3-го уровня, возможность получения следующей информации из Клиринговой системы:

- о размере Обеспечения в каждой валюте / каждом драгоценном металле, информация о котором учитывается по каждому Расчетному коду 2-го и 3-го уровня;
- о размере Обеспечения в ценных бумагах, информация о котором учитывается по каждому Торгово-клиринговому счету 2-го и 3-го уровня;
- о профилях активов в каждой валюте / каждом драгоценном металле, учитываемых по Расчетному коду 2-го и 3-го уровня, связанному / соответствующему Расчетному коду Участника клиринга, являющемуся Расчетным кодом Единого пула, переданных / полученных из Клиринговой системы валютного рынка и рынка драгоценных металлов;
- о профилях активов в российских рублях, учитываемых по Расчетному коду 2-го и 3-го уровня, связанному / соответствующему Расчетному коду Участника клиринга, являющемуся Расчетным кодом Единого пула, переданных / полученных из Клиринговой системы срочного рынка;
- о профилях активов в каждой ценной бумаге, информация о которой учитывается по каждому Торгово-клиринговому счету 2-го и 3-го уровня, в состав которого входит Расчетный код 2-го / 3-го уровня, связанный / соответствующий Расчетному коду Участника клиринга, являющимся Расчетным кодом Единого пула, переданных / полученных из Клиринговой системы срочного рынка;
- о размере Единого лимита по Расчетному коду 2-го и 3-го уровня;
- о значении ограничения на минимальное допустимое значение Единого лимита по Расчетному коду 2-го уровня, рассчитанного без учета Обеспечения, информация о котором учитывается по Расчетному коду 2-го уровня, установленном Участником клиринга (по каждому Расчетному коду 2-го уровня) (в случае, если такое значение установлено);
- о значении ограничения на минимальное допустимое значение Единого лимита по Расчетному коду 3-го уровня, рассчитанного без учета Обеспечения, информация о котором учитывается по Расчетному коду 3-го уровня, установленном Участником клиринга (по каждому Расчетному коду 3-го уровня) (в случае, если такое значение установлено);
- о значении Нетто-обязательства и/или Нетто-требования по денежным средствам / драгоценным металлам, учитываемого по Расчетному коду 2-го и 3-го уровня, в каждой валюте / каждом драгоценном металле и с каждой Датой исполнения (по каждому Расчетному коду 2-го и 3-го уровня);

- о значении Нетто-обязательства и/или Нетто-требования по ценным бумагам, учитываемого по Торгово-клиринговому счету 2-го и 3-го уровня, по каждому коду ценных бумаг и с каждой Датой исполнения (по каждому Торгово-клиринговому счету 2-го и 3-го уровня);
- о размере Обеспечения в каждой валюте / каждом драгоценном металле, информация о котором учитывается по Расчетному коду 2-го и 3-го уровня, недостающего для исполнения Нетто-обязательства Участника клиринга в соответствующей валюте / соответствующем драгоценном металле, учитываемого по тому же Расчетному коду 2-го или 3-го уровня, с наступившей Датой исполнения (по каждому Расчетному коду 2-го и 3-го уровня);
- о размере Обеспечения в ценных бумагах, информация о котором учитывается по Торгово-клиринговому счету 2-го и 3-го уровня, недостающего для исполнения Нетто-обязательства Участника клиринга в таких ценных бумагах, учитываемого по тому же Торгово-клиринговому счету 2-го или 3-го уровня, с наступившей Датой исполнения (по каждому Торгово-клиринговому счету 2-го и 3-го уровня).

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

- Выписка из реестра сделок, принятых в клиринг, содержащая информацию об обязательствах по сделкам, допущенных к клирингу, заключенным с указанием Торгово-клиринговых счетов 2-го и 3-го уровня;
- Отчет об Обеспечении, содержащий информацию о размере Обеспечения в денежных средствах / драгоценных металлах / ценных бумагах, учитываемую по Расчетному коду 2-го и 3-го уровня / Торгово-клиринговому счету 2-го и 3-го уровня, и об изменении размера такого Обеспечения;
- Отчет о торгово-клиринговых счетах, содержащий информацию о зарегистрированных Торгово-клиринговых счетах 2-го и 3-го уровня;
- Отчет о Клиринговых идентификаторах;
- Отчет о комиссионных вознаграждениях.

47.9. Отчеты, указанные в пункте 47.8 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, направляются Участнику торгов в форме электронных документов в соответствии с Порядком ЭДО.

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

Копии электронных документов на бумажном носителе подписываются уполномоченным лицом Клирингового центра и предоставляются/направляются Участнику торгов.

РАЗДЕЛ VII. ПРОЧИЕ УСЛОВИЯ

Статья 48. Особенности Перевода обязательств и Обеспечения одного Участника клиринга другому Участнику клиринга

48.1. При Переводе обязательств и Обеспечения Участника пула также осуществляется уступка прав и перевод долга по договору об имущественном пуле, а также передача имущества Обособленного клиента, внесенного Базовым Участником клиринга в имущественный пул.

48.2. Согласие на прием, предоставляемое Участником клиринга - реципиентом, помимо информации, предусмотренной общей частью Правил клиринга, должно содержать информацию о Разделах и номерах торговых счетов депо, на которых открыты такие 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.

48.3. 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 Раздел, открытый Участником клиринга – реципиентом для обособленного учета Обеспечения в ценных бумагах Обособленного клиента в соответствии с требованием общей части Правил клиринга, если в Согласии на прием Торгово-клиринговый счет Участника клиринга – реципиента не был указан;
- для Обособленных клиентов – владельцев клиринговых сертификатов участия, регистрирует Торгово-клиринговый счет имущественного пула;
- направляет Расчетному депозитарию распоряжение на перевод ценных бумаг с Раздела(-ов) / субсчетов депо имущественного пула, входящего(-их) в состав Торгово-клирингового(-ых) счета(-ов) / Торгово-клиринговых счетов имущественного пула Базового Участника клиринга, открытого(-ых) для такого Обособленного клиента, на Раздел(-ы) / субсчета депо имущественного пула, входящий(-ие) в состав Торгово-клирингового(-ых) счета(-ов) / Торгово-клирингового счета имущественного пула Участника клиринга – реципиента.

48.4. После завершения процедуры Перевода обязательств и Обеспечения Клиринговый центр закрывает Торгово-клиринговые счета / Торгово-клиринговые счета

имущественного пула, открытые Базовым Участником клиринга для Обособленного клиента.

Статья 49. Порядок действий при возникновении обстоятельств, которые могут повлиять на возможность заключения Внебиржевых сделок с ценными бумагами

49.1. В случае возникновения обстоятельств, вызывающих и/или создающих предпосылки к возникновению сбоев (отказов) при эксплуатации Клиринговой системы и/или иных программно-технических средств используемых при заключении Внебиржевых сделок с ценными бумагами и/или непосредственно препятствующие их нормальному (штатному) функционированию, в том числе, обстоятельства непреодолимой силы, а также сбои, неисправности и отказы оборудования; сбои и ошибки программного обеспечения; сбои, неисправности и отказы систем связи, энергоснабжения, кондиционирования и других систем жизнеобеспечения, а также иные обстоятельства, такие как случаи нарушения правил разграничения доступа и/или попыток несанкционированного доступа к Клиринговой системе, Клиринговый центр вправе:

- приостановить возможность подачи Предложений и заключения Внебиржевых сделок с ценными бумагами;
- удалить Предложения из Клиринговой системы.

49.2. При прекращении действия обстоятельств, которые повлекли приостановку возможности подачи Предложений и заключения Внебиржевых сделок с ценными бумагами, Клиринговый центр возобновляет возможность подачи Предложений и заключения Внебиржевых сделок с ценными бумагами.

Приложение № 1
к Правилам клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов

Документы, предоставляемые юридическим лицом для получения статуса Держателя

I. Список документов, предоставляемых юридическим лицом – Резидентом

1) Анкета юридического лица, являющаяся приложением к Порядку предоставления информации и отчетности и размещенная на Сайте Клирингового центра, в форме электронного документа и/или на бумажном носителе.

2) Копии учредительных документов юридического лица с изменениями и дополнениями с отметкой о регистрации федеральным органом исполнительной власти, уполномоченным на осуществление государственной регистрации юридических лиц. Указанные копии должны быть заверены федеральным органом исполнительной власти, уполномоченным на осуществление государственной регистрации юридических лиц, или нотариально. В Клиринговый центр могут быть представлены оригиналы учредительных документов для изготовления копий и заверения их сотрудником Клирингового центра.

3) В отношении единоличного исполнительного органа (далее по тексту - Руководитель):

- подлинник или нотариально удостоверенная копия или копия, заверенная подписью Руководителя и печатью юридического лица (при наличии), решения уполномоченного органа юридического лица (также могут быть предоставлены нотариально удостоверенная выписка из решения или подлинник выписки, заверенный подписью лица, уполномоченного на подписание решения, или заверенный подписью Руководителя и печатью юридического лица (при наличии)) об избрании (назначении) Руководителя;
- копия документа, удостоверяющего личность Руководителя, заверенная подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии) или письмо юридического лица в произвольной форме, содержащее следующие сведения о Руководителе: фамилия, имя, отчество (при наличии), гражданство, реквизиты документа, удостоверяющего личность, дату и место рождения, адрес места жительства (регистрации) или места пребывания, заверенное подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии) при одновременном предоставлении оригинала или нотариально удостоверенной копии документа или копии документа, удостоверяющего личность Руководителя, заверенной подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии) для сверки предоставленных сведений.

4) Оригинал доверенности, или нотариально удостоверенная копия, или копия, заверенная лицом, выдавшим указанную доверенность на представителя юридического лица, уполномоченного осуществлять действия (операции) от имени юридического лица во взаимоотношениях с Клиринговым центром, включая

полномочия по подписанию необходимых документов. от имени юридического лица во взаимоотношениях с Клиринговым центром, включая полномочия по подписанию необходимых документов. В случае если доверенность предоставляет полномочия на совершение операций с денежными средствами или иным имуществом, дополнительно предоставляется копия документа, удостоверяющего личность представителя юридического лица, заверенная подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии) или письмо юридического лица в произвольной форме, содержащее следующие сведения о представителе: фамилия, имя, отчество (при наличии), гражданство, реквизиты документа, удостоверяющего личность, дату и место рождения, адрес места жительства (регистрации) или места пребывания, заверенное подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии), при одновременном предоставлении оригинала или нотариально удостоверенной копии документа или копии документа, удостоверяющего личность представителя, заверенной подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии) для сверки предоставленных сведений.

5) Согласие лиц, указанных в документах юридического лица, направляемых им в Клиринговый центр в соответствии с Правилами клиринга, на обработку персональных данных по форме, размещенной на Сайте Клирингового центра (в случае, если документы содержат персональные данные субъекта персональных данных в соответствии с Федеральным законом «О персональных данных» и если иное не вытекает из требований законодательства).

6) В случае если физическое лицо, на которое требуется предоставить копию документа, удостоверяющего личность, является иностранным гражданином (лицом без гражданства), пребывающим в Российской Федерации, то дополнительно необходимо предоставить:

- заверенную подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии) копию документа, подтверждающего право иностранного гражданина (лица без гражданства) на пребывание (проживание) в Российской Федерации (вид на жительство, разрешение на временное проживание, виза, иной документ, подтверждающий в соответствии с законодательством Российской Федерации право иностранного гражданина или лица без гражданства на пребывание (проживание) в Российской Федерации), или письмо юридического лица в произвольной форме, содержащее следующие сведения о физическом лице: фамилия, имя, отчество (при наличии), реквизиты документа, подтверждающего право иностранного гражданина (лица без гражданства) на пребывание (проживание) в Российской Федерации: серия (если имеется) и номер документа, дата начала срока действия права пребывания (проживания), дата окончания срока действия права пребывания в Российской Федерации), заверенное подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии) при одновременном предоставлении оригинала или нотариально удостоверенной копии документа или копии документа, подтверждающего право иностранного гражданина (лица без гражданства) на пребывание (проживание) в Российской Федерации, заверенной подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии) для сверки предоставленных сведений;
- заверенную подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица

(при наличии) копию миграционной карты или письмо юридического лица в произвольной форме, содержащее следующие сведения о физическом лице: фамилия, имя, отчество (при наличии), реквизиты миграционной карты: номер карты, дата начала срока пребывания, дата окончания срока пребывания в Российской Федерации, заверенное подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии) при одновременном предоставлении оригинала или нотариально удостоверенной копии документа или копии миграционной карты, заверенной подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии) для сверки предоставленных сведений;

- письмо со сведениями об адресе места жительства (регистрации) или места пребывания (в случае если такая информация не содержится в иных документах, предоставленных в соответствии с настоящим списком), заверенное подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии).

7) Иные документы, которые могут быть запрошены Клиринговым центром в необходимых случаях, также Клиринговый центр вправе потребовать уточнения информации, содержащейся в ранее предоставленных документах.

Документы, предоставляемые юридическим лицом, должны быть действительными на дату их предъявления Клиринговому центру.

Документы, представляемые в форме электронного документа, должны содержать сканированную копию документа. Сканированная копия выполняется с оригинала документа или иного документа, оформленного в соответствии с требованиями настоящего приложения к Правилам клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

II. Список документов, предоставляемых юридическим лицом – Нерезидентом

1) Анкета юридического лица, являющаяся приложением к Порядку предоставления информации и отчетности и размещенная на Сайте Клирингового центра, в форме электронного документа и/или на бумажном носителе.

2) Действующие редакции учредительных документов юридического лица и все изменения к ним.

3) Документ, подтверждающий государственную регистрацию юридического лица.

4) Специальное разрешение (лицензия), выданное уполномоченным органом государства учреждения юридического лица, на право осуществления учета и перехода прав на ценные бумаги и (или) расчетов по ценным бумагам и (или) осуществления расчетов по ценным бумагам по результатам торгов на иностранных биржах или иных регулируемых рынках либо клиринга по результатам таких торгов.

5) Документ о постановке на учет в налоговом органе юридического лица (при наличии).

6) Документ, подтверждающий постановку юридического лица на налоговый учет в Российской Федерации (копия, верность которой засвидетельствована нотариусом или самим юридическим лицом) (при наличии).

7) В отношении лица, уполномоченного действовать от имени юридического лица в соответствии с учредительными документами (далее по тексту – Руководитель):

- документ, подтверждающий согласование кандидатуры Руководителя юридического лица уполномоченным органом государства учреждения юридического лица (если такое согласование предусмотрено законодательством государства учреждения юридического лица);
- документ уполномоченного органа юридического лица, подтверждающий избрание (назначение) Руководителя;
- копия документа, удостоверяющего личность Руководителя, или других документов, которые установлены федеральным законом или признаваемые в соответствии с международным договором Российской Федерации в качестве документа, удостоверяющего личность.

8) Доверенности на представителей юридического лица, уполномоченных осуществлять действия (операции) от имени юридического лица во взаимоотношениях с Клиринговым центром, включая полномочия по подписанию необходимых документов. В случае если доверенность предоставляет полномочия на совершение операций с денежными средствами или иным имуществом, дополнительно предоставляются:

- заверенная подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии) копия документа, удостоверяющего личность представителя юридического лица, или других документов, которые установлены федеральным законом или признаваемые в соответствии с международным договором Российской Федерации в качестве документа, удостоверяющего личность;
- копия свидетельства о постановке на учет в налоговом органе (ИНН) представителя юридического лица, заверенная подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии), либо письмо в произвольной форме с указанием ИНН (при наличии).

9) Согласие лиц, указанных в документах юридического лица, направляемых им в Клиринговый центр в соответствии с Правилами клиринга, на обработку персональных данных по форме, размещенной на Сайте Клирингового центра (в случае, если документы содержат персональные данные субъекта персональных данных в соответствии с Федеральным законом «О персональных данных» и если иное не вытекает из требований законодательства).

10) В случае если физическое лицо, на которое требуется предоставить копию документа, удостоверяющего личность, является иностранным гражданином (лицом без гражданства), пребывающим в Российской Федерации, то дополнительно необходимо предоставить:

- заверенную подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии) копию документа, подтверждающего право иностранного гражданина (лица без гражданства) на пребывание (проживание) в Российской Федерации (вид на жительство, разрешение на временное проживание, виза, иной документ, подтверждающий в соответствии с законодательством Российской Федерации право иностранного гражданина или лица без гражданства на пребывание (проживание) в Российской Федерации), или письмо юридического лица в произвольной форме,

содержащее следующие сведения о физическом лице: фамилия, имя, отчество (при наличии), реквизиты документа, подтверждающего право иностранного гражданина (лица без гражданства) на пребывание (проживание) в Российской Федерации: серия (если имеется) и номер документа, дата начала срока действия права пребывания (проживания), дата окончания срока действия права пребывания в Российской Федерации), заверенное подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии) при одновременном предоставлении оригинала или нотариально удостоверенной копии документа или копии документа, подтверждающего право иностранного гражданина (лица без гражданства) на пребывание (проживание) в Российской Федерации, заверенной подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии) для сверки предоставленных сведений;

- заверенную подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии) копию миграционной карты или письмо юридического лица в произвольной форме, содержащее следующие сведения о физическом лице: фамилия, имя, отчество (при наличии), реквизиты миграционной карты: номер карты, дата начала срока пребывания, дата окончания срока пребывания в Российской Федерации, заверенное подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии) при одновременном предоставлении оригинала или нотариально удостоверенной копии документа или копии миграционной карты, заверенной подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии) для сверки предоставленных сведений;
- письмо со сведениями об адресе места жительства (регистрации) или места пребывания (если такая информация не содержится в иных документах, предоставленных в соответствии с настоящим списком), заверенное подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии).

11) Иные документы, которые могут быть запрошены Клиринговым центром в необходимых случаях, также Клиринговый центр вправе потребовать уточнения информации, содержащейся в ранее предоставленных документах.

Документы, составленные на территории иностранных государств, должны быть легализованы или апостилированы, если иное не предусмотрено международными договорами Российской Федерации.

Документы, составленные полностью или в какой-либо их части на иностранном языке, должны быть переведены на русский язык. Верность перевода или подлинность подписи переводчика должна быть засвидетельствована нотариусом.

Документы, предоставляемые юридическим лицом, должны быть действительными на дату их предъявления Клиринговому центру.

Приложение № 2
к Правилам клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов

Временной регламент на фондовом рынке и рынке депозитов

№ п/п	Наименование операции	Время (московское)
1.	**Операции по сделкам с ценными бумагами**	
1.1.	Процедура контроля обеспечения.	9:30– 19:00
1.2.	Период регистрации поручений. Получение Клиринговым центром от Участников клиринга Специальных и Срочных отчетов на исполнение.	9:30 – 18:30
1.3.	Период регистрации поручений. Получение Клиринговым центром от Участников клиринга Отчетов на исполнение, Поручений на внесение компенсационных взносов и Поручений на отказ от компенсационных взносов по сделкам.	9:30 – 19:00
1.4.	Процедура контроля обеспечения по сделкам с отложенной датой активации.	В дату активации во время, установленное по согласованию с Биржей
2.	**Время (сроки) внесения имущества в имущественный пул и выдачи имущества из имущественного пула**	
2.1.	Зачисление денежных средств на клиринговый банковский счет Клирингового центра для выдачи клиринговых сертификатов участия в текущем Расчетном дне.	до 19:00
2.2.	Передача Участником клиринга Клиринговому центру распоряжений на перевод денежных средств / ценных бумаг с целью внесения имущества в имущественный пул / выдачи имущества из имущественного пула (с использованием Клиринговой системы фондового рынка и рынка депозитов).	с 09:05 до 19:00 Расчетного дня
2.3.	Прием Клиринговым центром от Участников клиринга Запросов на перевод Обеспечения в иностранной валюте, российских рублях, поданных с целью внесения имущества в имущественный пул / выдачи имущества из имущественного пула.	с 09:00 до 19:00 Расчетного дня
2.4.	Прием Клиринговым центром от Участников клиринга Запросов на возврат обеспечения, поданных с целью выдачи имущества из имущественного пула:	в указанное время Расчетного дня по соответствующей валюте
	- гонконгских долларов;	до 11:00 Расчетного дня
	- юаней;	до 12:00 Расчетного дня
	- швейцарских франков;	до 14:00 Расчетного дня
	- евро, фунтов стерлингов;	до 16:25 Расчетного дня
	- российских рублей;	до 19:00 Расчетного дня
	- долларов США.	до 19:00 Расчетного дня
2.5.	Выдача денежных средств / ценных бумаг из имущественного пула.	в являющийся Расчетным днем день получения

		Клиринговым центром соответствующего запроса / распоряжения
3.	**Сроки определения и исполнения обязательств**	
3.1.	Исполнение Маржинальных требований по пулу.	до 17:30 дня возникновения Маржинального требования по пулу
3.2.	Исполнение обязательств по уплате комиссионных вознаграждений, учитываемых по Счетам обеспечения Т0.	до 19:00 Даты исполнения обязательств по уплате соответствующего комиссионного вознаграждения
4.	**Сроки предоставления отчетов по итогам клиринга**	
4.1.	Передача Клиринговым центром Участникам клиринга Отчетов об Обеспечении, Отчетов об обязательствах по Сделкам Т+, Отчетов об имуществе, внесенном в имущественные пулы, Отчета о нормативной стоимости клиринговых сертификатов участия и иных отчетов, предусмотренных статьей 47 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, за исключением Отчетов о Маржинальных требованиях.	до 9:00
4.2.	Передача Клиринговым центром Участникам клиринга Отчета о комиссионных вознаграждениях, содержащего информацию о сумме отступного за непредоставление Обеспечения в сумме депозита.	до 19:15 дня определения отступного
5.	**Время (сроки) подачи Предложений**	
5.1.	Подача Предложений и заключение Внебиржевых сделок с ценными бумагами.	с 10:00 до 19:00 Рабочего дня

Все иные документы передаются Клиринговому центру и/или предоставляются Клиринговым центром в процессе взаимодействия Клирингового центра с Участниками клиринга с 9:00 до 19:00 по московскому времени по Расчетным дням.

Приложение №3
к Правилам клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов

Порядок изменения значений клиринговых регистров Счет обеспечения Т0 и Торгово-клиринговый счет Т0

Обозначения, используемые в таблицах:

S – сумма операции, указанная в заявке, запросе или реестре (в рублях, если не указано иное).

V – объем операции, указанный в заявке, запросе, сделке или реестре (в шт. ценных бумаг).

K – сумма комиссионного вознаграждения, рассчитанная по заявке (в рублях).

Sсделки – сумма операции в соответствии с условиями сделки (в рублях, если не указано иное), где Sсделки <= S для заявок на покупку, Sсделки >= S для заявок на продажу.

Kсделки – сумма комиссионного вознаграждения (в рублях), рассчитанная по сделке, где Kсделки <= K для заявок на покупку, Kсделки>= K для заявок на продажу.

↑ - увеличение.

↓ - уменьшение.

1. Порядок изменения информации о денежных средствах

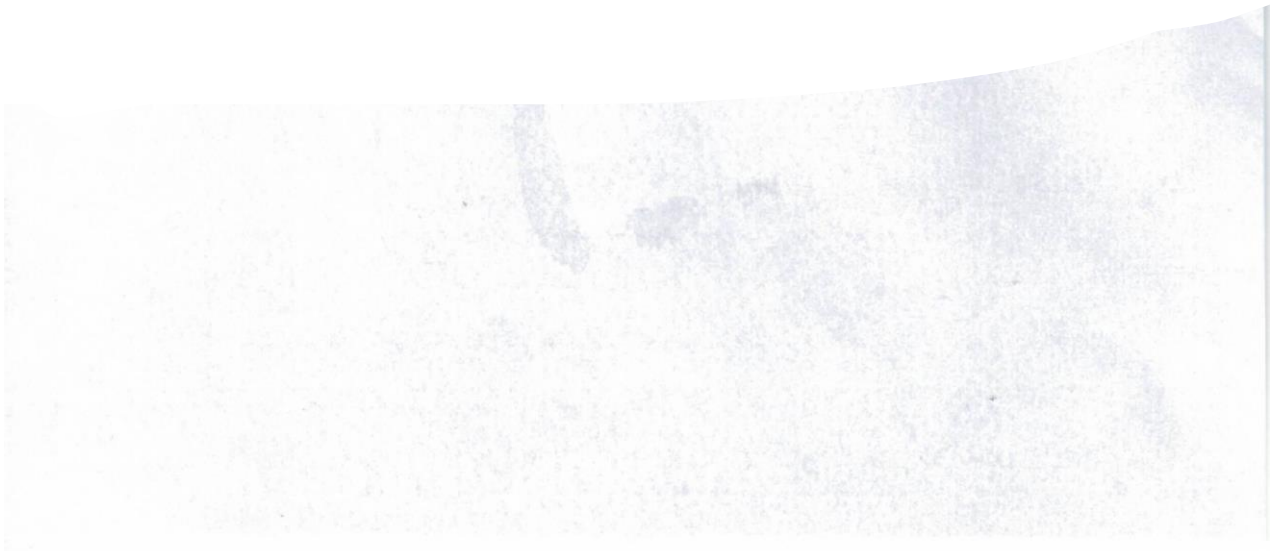
№	Операция	Значение суммы денежных средств (в соответствующей валюте), учитываемое по Счету обеспечения Т0
1.	Исполнение Расчетной организацией распоряжения на перевод денежных средств с торговых банковских счетов на клиринговый банковский счет после получения от Расчетной организации выписки по торговым банковским счетам (S – сумма денежных средств, учитываемых на торговом банковском счете)	= S
2.	**Зачисление / списание денежных средств**	
2.1.	Зачисление денежных средств на клиринговый банковский счет после увеличения суммы денежных средств на торговом банковском счете на сумму S	↑ на S
2.2.	Исполнение распоряжения Участника клиринга или Клирингового центра на перевод денежных средств со Счета обеспечения Т0 с использованием Клиринговой системы	↓ на S
2.3.	Списание денежных средств со Счета обеспечения Т0 на основании Запроса на изменение параметров Торгово-клирингового счета в сумме, недостающей для исполнения Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам либо в размере Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам.	↓ на S
2.4.	Исполнение распоряжения Участника клиринга на перевод денежных средств со Счета обеспечения Т0.	↓ на S
2.5.	Исполнение распоряжения Участника клиринга на перевод денежных средств на Счет обеспечения Т0.	↑ на S
2.6.	Списание в ходе Торгов денежных средств с торгового банковского счета на основании запроса Расчетной организации	↓ на S
2.7.	Возврат денежных средств на Счет обеспечения Т0 в размере Итогового нетто-требования Участника клиринга по денежным средствам на основании Запроса на изменение параметров Торгово-	↑ на S

	клирингового счета	
3.	**Регистрация и снятие заявок на заключение сделок с кодом расчетов T0, Z0, X0, Rb, Bn, B0 – B30, Sn**	
3.1.	Регистрация заявки на покупку на заключение сделки с кодом расчетов T0, Rb; X=S+K (здесь и далее – в российских рублях, если не указано иное)	↓ на X
3.2.	Регистрация заявки на покупку на заключение сделки купли-продажи или сделки РЕПО с кодом расчетов Z0**, X0**; X=S+K	↓ на X
3.3.	Регистрация заявки на продажу на заключение сделки купли-продажи или сделки РЕПО с кодом расчетов Z0**, X0**	↓ на K
3.4.	Регистрация заявки на покупку / продажу на заключение сделки с кодом расчетов Bn, B0 – B30, Sn	↓ на K
3.5.	Регистрация заявки на покупку на заключение сделки с кодом расчетов T0, Rb в иностранной валюте; S – в иностранной валюте, K – в российских рублях; позиции в иностранной валюте и в российских рублях проверяются и изменяются отдельно	↓ на S ↓ на K
3.6.	Регистрация заявки на покупку на заключение сделки купли-продажи или сделки РЕПО с кодом расчетов Z0**, X0** в иностранной валюте; S – в иностранной валюте, K – в российских рублях; позиции в иностранной валюте и в российских рублях проверяются и изменяются отдельно	↓ на S ↓ на K
3.7.	Регистрация заявки на покупку на заключение сделки с кодом расчетов Bn, B0 – B30, Sn в иностранной валюте; S – в иностранной валюте, K – в российских рублях	↓ на K
3.8.	Регистрация заявки на продажу на заключение сделки с любым кодом расчетов в иностранной валюте; S – в иностранной валюте, K – в российских рублях	↓ на K
3.9.	Снятие заявки на покупку на заключение сделки с кодом расчетов T0, Rb в российских рублях; X=S+K	↑ на X
3.10.	Снятие заявки на покупку на заключение сделки купли-продажи или сделки РЕПО с кодом расчетов Z0**, X0**; X=S+K	↑ на X
3.11.	Снятие заявки на продажу на заключение сделки купли-продажи или сделки РЕПО с кодом расчетов Z0**, X0**	↑ на K
3.12.	Снятие заявки на покупку на заключение сделки купли-продажи или сделки РЕПО с кодом расчетов Z0**, X0** в иностранной валюте; S – в иностранной валюте, K – в российских рублях	↑ на S ↑ на K
3.13.	Снятие заявки на покупку / продажу на заключение сделки с кодом расчетов Bn, B0 – B30, Sn, в российских рублях и иностранной валюте	↑ на K
3.14.	Снятие заявки на покупку на заключение сделки с кодом расчетов T0, Rb в иностранной валюте; S – в иностранной валюте, K – в российских рублях	↑ на S ↑ на K
3.15.	Снятие заявки на продажу на заключение сделки с любым кодом расчетов в иностранной валюте; S – в иностранной валюте, K – в российских рублях	↑ на K
4.	**Заключение сделок с кодом расчетов T0, Rb, K0**	
4.1.	Заключение сделки по заявке на продажу с кодом расчетов T0, Rb, K0, в российских рублях;	↑ на X

	X=Sсделки – Kсделки	
4.2.	Заключение сделки по заявке на покупку с кодом расчетов T0, Rb, в российских рублях; X = S – Sсделки + (K - Kсделки)	↑ на X
4.3.	Заключение сделки по заявке на покупку с кодом расчетов K0, в российских рублях; X=Sсделки + Kсделки	↓ на X
4.4.	Заключение сделки по заявке на продажу с кодом расчетов T0, K0, Rb в иностранной валюте; S – в иностранной валюте	↑ на S
4.5.	Заключение сделки по заявке на покупку с кодом расчетов T0, Rb в иностранной валюте; X = S – Sсделки (в иностранной валюте) Y = (K - Kсделки) (в российских рублях)	↑ на X ↑ на Y
4.6.	Заключение сделки по заявке на покупку с кодом расчетов K0 в иностранной валюте; Sсделки – в иностранной валюте, Kсделки – в российских рублях	↓ на Sсделки ↓ на Kсделки
5.	**Регистрация и отзыв Отчетов на исполнение**	
5.1.	Регистрация в Клиринговой системе Отчета на исполнение, содержащего обязательство по оплате ценных бумаг	↓ на Sсделки
5.2.	Отзыв из Клиринговой системы Отчета на исполнение, содержащего обязательство по оплате ценных бумаг	↑ на Sсделки
5.3.	Прохождение Отчетом на исполнение, содержащим требование по оплате ценных бумаг, Процедуры контроля обеспечения	↑ на Sсделки
5.4.	Регистрация в Клиринговой системе Специального отчета на исполнение, содержащего условное двустороннее нетто-обязательство по денежным средствам (X, X<0)	↓ на (-X)
5.5.	Отзыв из Клиринговой системы Специального отчета на исполнение, содержащего условное двустороннее нетто-обязательство по денежным средствам (X, X<0)	↑ на (-X)
5.6.	Прохождение Специальным отчетом на исполнение, содержащим условное двустороннее нетто-требование по денежным средствам (X, X>0), Процедуры контроля обеспечения	↑ на X
5.7.	Регистрация в Клиринговой системе Срочного отчета на исполнение, содержащего нетто-обязательство по денежным средствам (X, X<0)	↓ на (-X)
5.8.	Отзыв из Клиринговой системы Срочного отчета на исполнение, содержащего нетто-обязательство по денежным средствам (X, X<0)	↑ на (-X)
5.9.	Регистрация в Клиринговой системе Поручения на внесение компенсационного взноса в виде денежных средств	↓ на S
5.10.	Регистрация в Клиринговой системе Поручения на внесение компенсационного взноса в виде денежных средств Участником клиринга – контрагентом по сделке	↑ на S
5.11.	Регистрация в Клиринговой системе Поручения на проведение расчетов по поставке (по поставочным контрактам срочного рынка):	
5.11.1	по обязательствам участника клиринга по оплате поставки базового актива	↓ на S
5.11.2	по требованиям участника клиринга по оплате поставки базового актива	↑ на S
6.	**Уплата / получение Компенсационного взноса / отступного**	↓ на S / ↑ на S
7.	**Расчеты по итогам клиринга по сделкам с кодом расчетов Z0 и**	

	Срочным отчетам на исполнение	
7.1.	Исполнение обязательства по оплате ценных бумаг или нетто-обязательства по денежным средствам в размере X	↓ на X
7.2.	Исполнение требования по оплате ценных бумаг или нетто-требования по денежным средствам в размере X	↑ на X

2. Порядок изменения информации о ценных бумагах

№	Операция	Значение количества ценных бумаг, учитываемого по Торгово-клиринговому счету T0
1.	Получение от Расчетного депозитария выписки по Разделам / субсчетам депо	= V0
2.	**Зачисление / списание ценных бумаг**	
2.1.	Увеличение количества ценных бумаг, учитываемого по Торгово-клиринговому счету T0 на количество V в случаях зачисления ценных бумаг на Раздел T0.	↑ на V
2.2.	Исполнение распоряжения Участника клиринга или Клирингового центра на перевод ценных бумаг с Торгово-клирингового счета T0 с использованием Клиринговой системы	↓ на V
2.3.	Исполнение распоряжения Участника клиринга на перевод ценных бумаг на Торгово-клиринговый счет T0 с использованием Клиринговой системы	↑ на V
2.4.	Списание ценных бумаг с Торгово-клирингового счета T0 на основании Запроса на изменение параметров Торгово-клирингового счета в количестве, недостающем для исполнения Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по ценным бумагам либо в размере Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по ценным бумагам.	↓ на V
2.5.	Списание в ходе Торгов ценных бумаг с Разделов T0 на основании запроса Расчетного депозитария	↓ на V
2.6.	Возврат ценных бумаг в размере Итогового нетто-требования Участника клиринга по ценным бумагам на основании Запроса на изменение параметров Торгово-клирингового счета	↑ на V
2.7.	Исполнение Запроса на подбор ценных бумаг.	↑ на V
3.	**Регистрация и снятие заявок T0, Rb, T0/Yn, Z0, X0**	
3.1.	Регистрация заявки на продажу на заключение сделки с кодом расчетов T0, Rb, T0/Yn в российских рублях и/или иностранной валюте	↓ на V
3.2.	Регистрация заявки на продажу на заключение сделки купли-продажи с кодом расчетов Z0**,** X0 или сделки РЕПО с кодом расчетов Z0 в российских рублях и иностранной валюте	↓ на V
3.3.	Снятие заявки на продажу на заключение сделки с кодом расчетов T0, Rb, T0/Yn в российских рублях и/или иностранной валюте	↑ на V
3.4.	Снятие заявки на продажу на заключение сделки купли-продажи с кодом расчетов Z0**,** X0 или сделки РЕПО с кодом расчетов Z0 в российских рублях и иностранной валюте	↑ на V
4.	**Заключение сделок T0, K0, Rb, T0/Yn, Z0, X0**	

4.1.	Заключение сделки по заявке на покупку с кодом расчетов T0, K0, Rb, T0/Yn, X0	↑ на V
4.2.	Заключение сделки по заявке на продажу с кодом расчетов K0 в российских рублях и иностранной валюте	↓ на V
5.	**Регистрация и отзыв Отчетов на исполнение**	
5.1.	Регистрация в Клиринговой системе Отчета на исполнение, содержащего обязательство по передаче ценных бумаг	↓ на V
5.2.	Отзыв из Клиринговой системы Отчета на исполнение, содержащего обязательство по передаче ценных бумаг	↑ на V
5.3.	Прохождение Отчетом на исполнение, содержащим требование по передаче ценных бумаг, Процедуры контроля обеспечения	↑ на V
5.4.	Регистрация в Клиринговой системе Специального отчета на исполнение, содержащего условное двустороннее нетто-обязательство по ценным бумагам (X, X<0)	↓ на (-X)
5.5.	Отзыв из Клиринговой системы Специального отчета на исполнение, содержащего условное двустороннее нетто-обязательство по ценным бумагам (X, X<0)	↑ на (-X)
5.6.	Прохождение Специальным отчетом на исполнение, содержащим условное двустороннее нетто-требование по ценным бумагам (X), Процедуры контроля обеспечения	↑ на X
5.7.	Регистрация в Клиринговой системе Срочного отчета на исполнение, содержащего нетто-обязательство по ценным бумагам (X, X<0)	↓ на (-X)
5.8.	Отзыв из Клиринговой системы Срочного отчета на исполнение, содержащего нетто-обязательство по ценным бумагам (X, X<0)	↑ на (-X)
5.9.	Регистрация в Клиринговой системе Поручения на внесение компенсационного взноса в виде ценных бумаг	↓ на V
5.10.	Регистрация в Клиринговой системе Поручения на внесение компенсационного взноса в виде ценных бумаг Участником клиринга – контрагентом по сделке	↑ на V
5.11.	Регистрация в Клиринговой системе Поручения на проведение расчетов по поставке (по поставочным контрактам срочного рынка)	
5.11.1.	по обязательствам участника клиринга по поставке базового актива	↓ на V
5.11.2.	по требованиям участника клиринга по поставке базового актива	↑ на V
6.	**Уплата / получение Компенсационного взноса**	↓ на V / ↑ на V
7.	**Расчеты по итогам клиринга по сделкам с кодом расчетов Z0 и Срочным отчетам на исполнение**	
7.1.	Исполнение обязательства по передаче ценных бумаг или нетто-обязательства по ценным бумагам в размере V	↓ на V
7.2.	Исполнение требования по передаче ценных бумаг или нетто-требования по ценным бумагам в размере V	↑ на V