

УТВЕРЖДЕНЫ

решением Наблюдательного совета  
НКО НКЦ (АО)

от «05» октября 2020 года (Протокол №4)

**ПРАВИЛА КЛИРИНГА  
НЕБАНКОВСКОЙ КРЕДИТНОЙ ОРГАНИЗАЦИИ-ЦЕНТРАЛЬНОГО  
КОНТРАГЕНТА «НАЦИОНАЛЬНЫЙ КЛИРИНГОВЫЙ ЦЕНТР»  
(АКЦИОНЕРНОЕ ОБЩЕСТВО).  
ЧАСТЬ V. ПРАВИЛА КЛИРИНГА НА ТОВАРНОМ РЫНКЕ**

Москва, 2020 г.

## СОДЕРЖАНИЕ

РАЗДЕЛ I. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ .....	4
Статья 1. Термины и определения.....	4
Статья 2. Общие положения.....	5
Статья 3. Торговые и клиринговые счета .....	6
Статья 4. Клиринговые регистры .....	7
РАЗДЕЛ II. ТРЕБОВАНИЯ К УЧАСТНИКАМ КЛИРИНГА.....	8
Статья 5. Условия клирингового обслуживания. Порядок предоставления допуска к клиринговому обслуживанию.....	8
Статья 6. Заверение об обстоятельствах .....	8
Статья 7. Особенности открытия Расчетных кодов Участника клиринга, порядок открытия и закрытия Торгово-клиринговых счетов Участника клиринга.....	11
Статья 8. Особенности регистрации Обособленных клиентов.....	12
Статья 9. Особенности приостановления и прекращения допуска к клиринговому обслуживанию .....	12
РАЗДЕЛ III. МЕРЫ, НАПРАВЛЕННЫЕ НА УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ ПРИ ОСУЩЕСТВЛЕНИИ КЛИРИНГА.....	15
Статья 10. Перечень мер, направленных на управление рисками при осуществлении клиринга .....	15
РАЗДЕЛ IV. ПОРЯДОК И УСЛОВИЯ ДОПУСКА ОБЯЗАТЕЛЬСТВ К КЛИРИНГУ .....	17
Статья 11. Порядок взаимодействия с Биржей при подаче заявок и заключении Договоров .....	17
РАЗДЕЛ V. ПОРЯДОК ПРОВЕДЕНИЯ КЛИРИНГА .....	22
ПОДРАЗДЕЛ V-I. ПОРЯДОК ВНЕСЕНИЯ И ВОЗВРАТА ОБЕСПЕЧЕНИЯ .....	22
Статья 12. Порядок внесения Обеспечения.....	22
Статья 13. Порядок возврата Обеспечения.....	22
ПОДРАЗДЕЛ V-II. КЛИРИНГОВЫЕ СЕССИИ .....	24
Статья 14. Порядок проведения клиринговой сессии mark-to-market. Особенности возникновения и исполнения Маржинальных требований .....	24
ПОДРАЗДЕЛ V-III. ПОРЯДОК ОПРЕДЕЛЕНИЯ И ИСПОЛНЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ ПО ДОГОВОРАМ .....	25
Статья 15. Порядок включения в клиринговый пул обязательств по Договорам .....	25

Статья 16. Порядок действий в случае наличия обязательств, для исполнения которых недостаточно товаров / денежных средств .....	27
Статья 17. Порядок заключения и условия своп договоров и форвардных договоров, заключаемых с Недобросовестными участниками клиринга .....	31
<b>ПОДРАЗДЕЛ V-IV. ПОРЯДОК ИСПОЛНЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ, ВКЛЮЧЕННЫХ В КЛИРИНГОВЫЙ ПУЛ .....</b>	<b>36</b>
Статья 18. Порядок исполнения обязательств и требований Участников клиринга и Клирингового центра по передаче товаров, включенных в клиринговый пул.....	36
<b>РАЗДЕЛ VI. ПОРЯДОК ВЗАИМОДЕЙСТВИЯ С ОПЕРАТОРОМ ТОВАРНЫХ ПОСТАВОК .....</b>	<b>38</b>
Статья 19. Порядок взаимодействия с Оператором товарных поставок .....	38
Статья 20. Порядок действий в случае обращения взыскания или наложения ареста на имущество Участника клиринга, находящееся на торговом товарном счете .....	39
<b>РАЗДЕЛ VII. ПОРЯДОК ОПЛАТЫ УСЛУГ. ОТЧЕТЫ ПО ИТОГАМ КЛИРИНГА .....</b>	<b>41</b>
Статья 21. Порядок оплаты услуг Клирингового центра, Биржи, Технического центра, Оператора товарных поставок и Экспедитора .....	41
Статья 22. Порядок предоставления отчетов по итогам клиринга.....	44
<b>РАЗДЕЛ VIII. ПРОЧИЕ УСЛОВИЯ .....</b>	<b>46</b>
Статья 23. Особенности перевода обязательств и Обеспечения одного Участника клиринга другому Участнику клиринга .....	46
Статья 24. Порядок выставления счетов-фактур .....	46
Приложение № 1 Временной регламент на товарном рынке .....	48

## РАЗДЕЛ I. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ

Настоящие «Правила клиринга Небанковской кредитной организации-центрального контрагента «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество). Часть V. Правила клиринга на товарном рынке» (далее – Правила клиринга на товарном рынке) 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 договоров, являющихся производными финансовыми инструментами, базисным активом которых является товар, заключаемых на торгах, организуемых АО НТБ.

### Статья 1. Термины и определения

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

<b>Аффилированность -</b>	в случаях, если Правила клиринга ставят наступление правовых последствий в зависимость от наличия между лицами отношений связанности (аффилированности), наличие или отсутствие таких отношений определяется в соответствии с Законом РСФСР от 22.03.1991 №948-1 «О конкуренции и ограничении монополистической деятельности на товарных рынках». Аффилированными лицами в целях Правил клиринга также признаются лица в случае, если одно из лиц контролирует или оказывает существенное влияние на другое лицо или если эти лица находятся под контролем или значительным влиянием третьего лица (третьих лиц). Контроль и значительное влияние определяются в соответствии с Международными стандартами финансовой отчетности, признанными на территории Российской Федерации.
<b>Договор -</b>	своп договор или форвардный договор, заключаемый на торгах Биржи.
<b>Методика определения расчетной цены -</b>	внутренний документ Биржи, устанавливающий порядок определения Расчетной цены и Расчетной цены своп.
<b>Методика определения риск-параметров товарного рынка -</b>	внутренний документ Клирингового центра, устанавливающий порядок определения риск-параметров товарного рынка АО НТБ.
<b>Методика определения категории Клиента Участника торгов</b>	Внутренний документ Биржи, устанавливающий порядок определения категории Клиента Участника торгов, утвержденный Биржей и раскрытый на сайте Биржи в информационно-телекоммуникационной сети «Интернет».
<b>Разрыв -</b>	ситуация, при которой для целей применения клиентом Участника клиринга или Клиринговым центром вычета по НДС в бюджете отсутствует источник для применения указанного вычета, сформированный клиентом Участника клиринга или

	другими лицами, участвующими в Связанной цепочке реализации товара.
<b>Согласованные действия</b>	действия Клиента и Участника клиринга на товарном рынке АО НТБ при отсутствии соглашения или при его наличии, направленные на нарушение заверений об обстоятельствах (пункты 6.1.2, 6.1.4, 6.1.5, 6.1.6 Правила клиринга на товарном рынке) и соответствующие совокупности условий, указанных в пункте 6.4.3 Правила клиринга на товарном рынке.
<b>Связанная цепочка реализации товара -</b>	совокупность лиц и договорных взаимоотношений между ними, задействованных в движении товара от момента его производства до момента приобретения товара на организованных торгах.

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

## **Статья 2. Общие положения**

- 2.1. Клиринговый центр осуществляет клиринг, выполняя функции центрального контрагента по всем Договорам, стороной по которым являются Участники клиринга.
- 2.2. Клиринговый центр осуществляет по Договорам клиринг с частичным обеспечением и клиринг с полным обеспечением по товарам и/или денежным средствам.
- 2.2.1. Клиринговый центр осуществляет клиринг с частичным обеспечением по товару:
- по форвардным договорам, заключенным Участниками клиринга категории «Б», в которых количество Расчетных дней между датой заключения и Датой исполнения больше или равно количеству Расчетных дней, установленному решением Клирингового центра;
  - по вторым частям своп договоров.
- 2.2.2. Клиринговый центр осуществляет клиринг с частичным обеспечением по денежным средствам:
- по форвардным договорам, заключенным Участниками клиринга категории «Б»;
  - по вторым частям своп договоров;
  - по первым частям своп договоров, заключенных Участниками клиринга категории «Б».
- 2.2.3. Клиринговый центр осуществляет клиринг с полным обеспечением по товару:
- по форвардным договорам, заключенным Участниками клиринга категории «Б», в которых количество Расчетных дней между датой заключения и Датой исполнения меньше количества дней, установленного решением Клирингового центра;

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

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

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

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

2.3. Сроки определения и исполнения обязательств, указанных в Правилах клиринга на товарном рынке, время проведения клиринговых сессий, а также сроки проведения клиринговых операций, сроки предоставления документов Клиринговому центру / Клиринговым центром в процессе взаимодействия с Участниками клиринга при проведении клиринга и расчетов по Договорам в соответствии с Правилами клиринга на товарном рынке, установлены Временным регламентом на товарном рынке, являющимся приложением № 1 к Правилам клиринга на товарном рынке. Сроки, не установленные Временным регламентом на товарном рынке, определяются в соответствии с Временным регламентом, являющимся приложением к общей части Правил клиринга.

2.4. Техническим центром на товарном рынке является АО НТБ.

2.5. Услуги Оператора товарных поставок оказывает НКО НКЦ (АО).

Оператор товарных поставок заключает договора хранения и / или осуществляет хранение имущества, используемого для исполнения и (или) обеспечения исполнения обязательств, допущенных к клирингу на основании и в соответствии с договором хранения или на иных основаниях в случаях, предусмотренных нормативными актами Банка России.

Оператор товарных поставок при осуществлении своей деятельности открывает торговые товарные счета.

### **Статья 3. Торговые и клиринговые счета**

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

- торговый товарный счет для учета товаров Участника клиринга;

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

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

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

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

#### **Статья 4. Клиринговые регистры**

4.1. При осуществлении клиринга на товарном рынке Клиринговый центр открывает и ведет клиринговые регистры, предусмотренные общей частью Правил клиринга.

4.2. Помимо информации, указанной в общей части Правил клиринга, при осуществлении клиринга на товарном рынке на клиринговых регистрах Клиринговый центр учитывает:

- Единый лимит по Расчетным кодам;
- обязанности и требования Участника клиринга по каждому Договору, обязательства по которому допущены к клирингу;
- Нетто-обязательства / Нетто-требования Участника клиринга по денежным средствам в разрезе Расчетных кодов и Дат исполнения;
- Нетто-обязательства / Нетто-требования Участника клиринга по товарам в разрезе Торгово-клиринговых счетов, товаров, Дат исполнения;
- Обеспечение Участника клиринга в товарах в разрезе Торгово-клиринговых счетов и товаров (с основными характеристиками);
- Обеспечение Участника клиринга в товарах в разрезе Торгово-клиринговых счетов и товаров с полным набором характеристик, включая основные и дополнительные характеристики.

4.3. Порядок ведения клиринговых регистров определен в общей части Правил клиринга, а также в соответствующих статьях разделов IV и V Правил клиринга на товарном рынке.

## **РАЗДЕЛ II. ТРЕБОВАНИЯ К УЧАСТНИКАМ КЛИРИНГА**

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

- 5.1. На товарном рынке Участникам клиринга могут быть присвоены следующие категории Участников клиринга:
- Участники клиринга категории «Б»;
  - Участники клиринга категории «В».
- 5.2. Допуск к клиринговому обслуживанию на товарном рынке предоставляется Участнику клиринга, соответствующему требованиям, установленным для соответствующей категории Участников клиринга в общей части Правил клиринга, а также требованиям, установленным настоящей статьей Правил клиринга на товарном рынке.
- 5.3. Для допуска к клиринговому обслуживанию Участник клиринга должен дополнительно соответствовать следующим требованиям:
- 5.3.1. иметь хотя бы один зарегистрированный в Клиринговом центре Торгово-клиринговый счет;
- 5.4. Клиринговый центр вправе предоставить Участнику клиринга допуск к клиринговому обслуживанию по всем Договорам или по отдельным видам Договоров.
- 5.5. Клиринговый центр вправе установить Участнику клиринга категорию «В» по основаниям, предусмотренным общей частью Правил клиринга.
- 5.6. Участник клиринга обязан в случае изменения списка аффилированных лиц Участника клиринга предоставить Клиринговому центру информацию обо всех аффилированных лицах Участника клиринга не позднее 1 (одного) рабочего дня с момента изменения указанного списка.
- 5.7. Участник клиринга обязан предоставить Клиринговому центру информацию, указанную в подпункте 6.1.9 Правил клиринга на товарном рынке, не позднее 1 (одного) рабочего дня с момента, когда такая информация стала известна или должна была стать известной Участнику клиринга.

### **Статья 6. Заверение об обстоятельствах**

- 6.1. В соответствии со статьей 431.2 Гражданского кодекса Российской Федерации Участник клиринга заверяет Клиринговый центр о следующих обстоятельствах:
- 6.1.1. все операции Участника клиринга по приобретению товара, зачисленного на торговый товарный счет, полностью отражены в первичной документации и налоговой отчетности Участника клиринга;
- 6.1.2. все операции клиента Участника клиринга по приобретению товара, зачисленного на торговый товарный счет, полностью отражены в первичной документации и



налоговой отчетности клиента Участника клиринга;

- 6.1.3. Участник клиринга исполнил обязанности по уплате налогов и сборов, вытекающие из сделок по приобретению товара, зачисленного на торговый товарный счет;
- 6.1.4. клиент Участника клиринга исполнил обязанности по уплате налогов и сборов, вытекающие из сделок по приобретению товара, зачисленного на торговый товарный счет;
- 6.1.5. Участник клиринга проверил полномочия представителей клиента Участника клиринга, подписавших документы, предоставленные Участником клиринга при зачислении товара на торговые разделы Участника клиринга;
- 6.1.6. при выполнении налоговых обязательств по исчислению и уплате НДС контрагентами при реализации товара, зачисленного на торговый товарных счет, от момента его производства до момента его реализации на организованных торгах, каждый продавец сформировал источник для применения его контрагентом правомерной налоговой выгоды в виде вычета НДС;
- 6.1.7. Клиринговому центру своевременно предоставлена актуальная информация обо всех аффилированных лицах Участника клиринга;
- 6.1.8. Участником клиринга собрана и актуализирована информация об Аффилированности клиентов Участника клиринга с Базисами;
- 6.1.9. Клиринговому центру своевременно предоставлена актуальная информация об Аффилированности клиентов Участника клиринга с Базисами.
- 6.2. Участник клиринга несет ответственность за нарушение заверений об обстоятельствах, предусмотренных подпунктами 6.1.1 – 6.1.6 Правил клиринга на товарном рынке, в порядке и в размере, указанном в пунктах 6.3 и 6.4 Правил клиринга на товарном рынке.  
Участник клиринга несет ответственность за нарушения заверений об обстоятельствах, предусмотренных подпунктами 6.1.7 – 6.1.9 Правил клиринга на товарном рынке, в порядке и в размере, указанном в пункте 6.7 Правил клиринга на товарном рынке.
- 6.3. Участник клиринга (в отношении сделок, заключенных таким Участником клиринга от своего имени и за свой счет) обязуется возместить Клиринговому центру в полном объеме убытки, понесенные Клиринговым центром в результате возникновения у него обязательств по уплате налогов и сборов вследствие нарушения Участником клиринга заверений об обстоятельствах, предусмотренных подпунктами 6.1.1, 6.1.3, 6.1.6. Правил клиринга на товарном рынке.
- 6.4. Участник клиринга (в отношении сделок, заключенных таким Участником клиринга от своего имени и за счет клиента Участника клиринга) обязуется возместить Клиринговому центру в полном объеме убытки, понесенные Клиринговым центром в результате возникновения у него обязательств по уплате налогов и сборов вследствие нарушения Участником клиринга заверений об обстоятельствах, предусмотренных подпунктами 6.1.2, 6.1.4, 6.1.5, 6.1.6 Правил клиринга на товарном рынке, при условии выявления одного из обстоятельств:

- 6.4.1. получена информация от Биржи, свидетельствующая о том, что Участником клиринга в нарушение условий Методики определения категории клиента Участника торгов была присвоена категория «Сельхозтоваропроизводитель» или «Имущественный клиент» своему клиенту, по поручению которого была заключена сделка, повлекшая нарушение заверений, указанных в настоящей статье Правил клиринга на товарном рынке;
- 6.4.2. при зачислении товара, в отношении которого было нарушено заверение, на торговые разделы Участника клиринга, Участником клиринга был предоставлен неполный пакет документов, указанных в Условиях оказания услуг оператора товарных поставок Небанковской кредитной организации-центрального контрагента «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество);
- 6.4.3. установление факта осуществления согласованных действий между Участником клиринга и клиентом Участника клиринга, соответствующих совокупности следующих критериев:
- 6.4.3.1. согласованные действия привели к нарушению заверений об обстоятельствах, предусмотренных подпунктами 6.1.2, 6.1.4, 6.1.5, 6.1.6 Правил клиринга на товарном рынке;
- 6.4.3.2. действия Участника клиринга и клиента Участника клиринга заранее известны каждому из них;
- 6.4.3.3. результат таких действий соответствует интересам клиента и Участника клиринга.
- 6.5. В случае возникновения убытков, предусмотренных пунктом 6.3 или пунктом 6.4 Правил клиринга на товарном рынке (при наличии обстоятельства, предусмотренного подпунктом 6.4.1 или 6.4.2 Правил клиринга на товарном рынке), Участник клиринга обязуется компенсировать Клиринговому центру все понесенные по его вине / вине его клиента убытки в течение 5 (пяти) рабочих дней с момента получения от Клирингового центра соответствующего требования.
- 6.6. В случае возникновения убытков Клирингового центра в соответствии с пунктом 6.4 Правил клиринга на товарном рынке и в целях всестороннего и полного изучения обстоятельств, предусмотренных подпунктом 6.4.3 Правил клиринга на товарном рынке, Клиринговый центр направляет Участнику клиринга претензию с описанием обстоятельств нарушения Участником клиринга заверений. Участник клиринга обязуется в течение 10 (десяти) календарных дней предоставить письменный мотивированный ответ на претензию. В случае возникновения спорных ситуаций, которые не могут быть урегулированы путем переговоров, спор передается на рассмотрение в третейский суд, указанный в общей части Правил клиринга.
- 6.7. Участник клиринга несет ответственность за нарушение заверений об обстоятельствах, предусмотренных подпунктами 6.1.7 – 6.1.9 Правил клиринга на товарном рынке, в случае возникновения убытков у Клирингового центра вследствие действий / бездействия аффилированных лиц Участника клиринга, либо вследствие действий / бездействия клиентов Участника клиринга, информация об Аффилированности которых с Базисами оказалась недостоверной или не была собрана и подтверждена или обновлена.
- В случае возникновения убытков у Клирингового центра, предусмотренных

настоящим пунктом Правил клиринга на товарном рынке, Клиринговый центр направляет Участнику клиринга претензию с описанием обстоятельств нарушения Участником клиринга заверений об обстоятельствах. Участник клиринга обязуется в течение 10 (десяти) календарных дней предоставить мотивированный ответ на претензию или возместить Клиринговому центру в полном объеме убытки, понесенные Клиринговым центром вследствие нарушения Участником клиринга заверений об обстоятельствах, предусмотренных подпунктами 6.1.7 – 6.1.9 Правил клиринга на товарном рынке. В случае возникновения спорных ситуаций, которые не могут быть урегулированы путем переговоров, спор передается на рассмотрение в третейский суд, указанный в общей части Правил клиринга.

## **Статья 7. Особенности открытия Расчетных кодов Участника клиринга, порядок открытия и закрытия Торгово-клиринговых счетов Участника клиринга**

- 7.1. При осуществлении клиринга на товарном рынке Участнику клиринга могут быть открыты собственные и клиентские Расчетные коды.
- 7.2. Расчет Единого лимита, определение Нетто-обязательств / Нетто-требований, Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований, Задолженностей Участника клиринга, проверка возможности регистрации заявок, перечисление и учет денежных средств Участника клиринга, исполнение (прекращение) обязательств по Договорам, возникновение и прекращение Маржинального требования, уплата комиссионных вознаграждений осуществляется по Расчетному коду Участника клиринга.
- 7.3. На товарном рынке необходимо открытие Торгово-клиринговых счетов Участника клиринга.
- 7.4. В состав Торгово-клирингового счета Участника клиринга, используемого на товарном рынке, входят Расчетный код и торговый раздел соответствующих типов:
- собственный Расчетный код и торговый раздел торгового товарного счета для учета товаров Участника клиринга;
  - клиентский Расчетный код и торговый раздел торгового товарного счета для учета товаров клиента Участника клиринга.
- Один торговый раздел может входить в состав только одного Торгово-клирингового счета.
- Один Расчетный код может входить в состав нескольких Торгово-клиринговых счетов.
- 7.5. Открытие Торгово-клирингового счета Участника клиринга осуществляется на основании Запроса на открытие Торгово-клирингового счета. Запрос на открытие Торгово-клирингового счета Участника клиринга должен содержать информацию о торговом разделе и Расчетном коде.
- 7.6. Участник клиринга категории «Б» вправе с использованием Клиринговой системы установить для Торгово-клирингового счета Участника клиринга признак «запрет коротких продаж» и признак «запрет необеспеченных покупок».
- По Договорам, заключенным с указанием Торгово-клирингового счета Участника

клиринга с признаком «запрет коротких продаж», осуществляется клиринг с полным обеспечением по товару.

По Договорам, заключенным с указанием Торгово-клирингового счета Участника клиринга с признаком «запрет необеспеченных покупок», осуществляется клиринг с полным обеспечением по денежным средствам.

- 7.7. Клиринговый центр посредством Системы торгов передает Бирже информацию:
- о зарегистрированных Торгово-клиринговых счетах Участника клиринга;
  - об Обособленных клиентах.
- 7.8. Закрытие Торгово-клирингового счета Участника клиринга осуществляется на основании Запроса на закрытие Торгово-клирингового счета, предоставленного Участником клиринга Клиринговому центру.
- 7.8.1. Клиринговый центр осуществляет закрытие Торгово-клирингового счета Участника клиринга при соблюдении следующих условий:
- отсутствуют неисполненные обязательства и / или требования, учитываемые по Торгово-клиринговому счету / Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в Запросе на закрытие Торгово-клирингового счета;
  - отсутствует Обеспечение в товарах, учитываемое по Торгово-клиринговому счету, указанному в Запросе на закрытие Торгово-клирингового счета.

## **Статья 8. Особенности регистрации Обособленных клиентов**

- 8.1. Помимо отдельного клиентского Расчетного кода Участник клиринга должен открыть для Обособленного клиента отдельный торговый раздел торгового товарного счета для учета товаров клиента Участника клиринга и зарегистрировать такой торговый раздел и такой Расчетный код в составе отдельного Торгово-клирингового счета.
- 8.2. В Запросе на регистрацию Обособленного клиента помимо информации, предусмотренной общей частью Правил клиринга, Участник клиринга обязан указать Торгово-клиринговые счета, открытые для Обособленного клиента.
- 8.3. Участник клиринга не вправе указывать Расчетный код, открытый для Обособленного клиента и зарегистрированный в составе Торгово-клиринговых счетов для Обособленного клиента, при регистрации иных Торгово-клиринговых счетов.

## **Статья 9. Особенности приостановления и прекращения допуска к клиринговому обслуживанию**

- 9.1. Клиринговый центр вправе установить Участнику клиринга категории «Б» категорию «В», а также приостановить допуск к клиринговому обслуживанию Участника клиринга по всем Договорам или по отдельным видам Договоров по основаниям, предусмотренным общей частью Правил клиринга.

- 9.2. Клиринговый центр вправе приостановить допуск к клиринговому обслуживанию Участника клиринга по всем Договорам или по отдельным видам Договоров в следующих случаях:
- 9.2.1. по основаниям, указанным в пункте 9.1 Правил клиринга на товарном рынке;
- 9.2.2. при отсутствии у Участника клиринга хотя бы одного зарегистрированного Торгово-клирингового счета;
- 9.2.3. в случаях нарушения Базисом, являющимся аффилированным лицом по отношению к Участнику клиринга и/или клиенту Участника клиринга, требований документов, регламентирующих взаимодействие Базиса и Оператора товарных поставок.
- 9.3. Клиринговый центр вправе приостановить допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию по Торгово-клиринговому счету, в состав которого входит торговый раздел торгового товарного счета, открытого для учета товаров клиента Участника клиринга, в отношении которого Клиринговым центром от налоговых органов получена информация о неосуществлении добровольного урегулирования Разрыва.
- 9.4. Допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию по Торгово-клиринговому счету, приостановленный на основании пункта 9.3 Правил клиринга на товарном рынке, возобновляется после получения Клиринговым центром от налоговых органов информации об урегулировании разрыва клиентом Участника клиринга.
- 9.5. Клиринговый центр вправе не возобновлять допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию по Торгово-клиринговому счету, в состав которого входит торговый раздел торгового товарного счета, открытого для учета товаров клиента Участника клиринга, приостановленный на основании пункта 9.3 Правил клиринга на товарном рынке, в случае наступления любого из указанных событий:
- по информации, полученной Клиринговым центром от налоговых органов, такой клиент Участника клиринга не осуществил добровольное урегулирование Разрыва;
  - Клиринговым центром исполнено требование налогового органа или судебное решение об уплате НДС в отношении сделки по реализации товара, заключенной по поручению такого клиента Участника торгов.
- 9.6. Клиринговый центр вправе прекратить допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию на товарном рынке по основаниям, установленным общей частью Правил клиринга, а также в следующих случаях:
- 9.6.1. невозмещения Участником клиринга убытков Клирингового центра, понесенных Клиринговым центром в результате исполнения требований налоговых органов или судебных решений об уплате НДС (включая штрафы и пени), которые были вызваны нарушением Участником клиринга / клиентом Участника клиринга заверений, установленных пунктом 6.1 Правил клиринга на товарном рынке, в порядке и сроки, которые установлены пунктами 6.5 и 6.6 Правил клиринга на товарном рынке;

- 9.6.2. неустранения в течение более чем 10 (десяти) рабочих дней обстоятельств, являющихся последствиями допущенных нарушений Базисом, являющимся аффилированным лицом по отношению к Участнику клиринга и/или клиенту Участника клиринга, и послуживших основанием для приостановления допуска к клиринговому обслуживанию такого Участника клиринга.
- 9.7. В случае выявления Аффилированности Участника клиринга или клиента Участника клиринга с Базисом, Клиринговый центр вправе приостановить допуск к клиринговому обслуживанию такого Участника клиринга по всем Договорам или по отдельным видам Договоров на таком Базисе.

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

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

- 10.1. В целях снижения рисков, связанных с осуществлением клиринга на товарном рынке, Клиринговый центр применяет меры, предусмотренные общей частью Правил клиринга.
- 10.2. Гарантийный фонд товарного рынка формируется Клиринговым центром за счет взносов в Гарантийный фонд всех Участников клиринга категории «Б», допущенных к клирингу на товарном рынке.  
Минимальный размер взноса в Гарантийный фонд каждого Участника клиринга категории «Б» составляет 1 000 000 (один миллион) российских рублей.
- 10.3. Обеспечение под стресс обязаны вносить Участники клиринга категории «Б». Порядок определения размера Обеспечения под стресс Участника клиринга установлен Методикой определения размера Обеспечения под стресс.
- 10.4. При неисполнении Участником клиринга Маржинального требования по фондам и/или Маржинального требования по обеспечению под стресс, порядок выставления и исполнения которых определен общей частью Правил клиринга, Участнику клиринга категории «Б» устанавливается категория «В».
- 10.5. При использовании взноса Недобросовестного участника клиринга в Гарантийный фонд товарного рынка и/или Обеспечения под стресс на товарном рынке, Участнику клиринга категории «Б» устанавливается категория «В».
- 10.6. В случае возмещения Недобросовестным участником клиринга средств Гарантийного фонда товарного рынка и Обеспечения под стресс на товарном рынке в течение 1 (одного) Расчетного дня после направления Клиринговым центром такому Недобросовестному Участнику клиринга Маржинального требования по фонду и/или Маржинального требования по Обеспечению под стресс, Клиринговый центр вправе установить Участнику клиринга категории «В» категорию «Б».
- 10.7. При расчете Единого лимита по Расчетному коду кроме величин, указанных в общей части Правил клиринга, также учитываются:
  - Обеспечение Участника клиринга в товарах, учитываемое по Торгово-клиринговым счетам, в состав которых входит Расчетный код;
  - Нетто-обязательства / Нетто-требования Участника клиринга в товарах, учитываемые по всем Торгово-клиринговым счетам, в состав которых входит Расчетный код, по всем Датам исполнения.
- 10.8. При наличии Базисов, являющихся аффилированными лицами с Участником клиринга или клиентом Участника клиринга, Участник клиринга предоставляет

Клиринговому центру список таких Базисов.

- 10.8.1. Товары, переданные на хранение на Базис, являющийся аффилированным лицом с Участником клиринга или клиентом Участника клиринга, и учитываемые по Торгово-клиринговому счету Участника клиринга, в состав которого входит торговый раздел торгового товарного счета для учета товаров Участника клиринга или клиента Участника клиринга, могут не учитываться по решению Клирингового центра в качестве Обеспечения такого Участника клиринга.
- 10.8.2. В случае выявления Аффилированности Участника клиринга с Базисом, Клиринговый центр вправе отказать Участнику клиринга в предоставлении допуска к клиринговому обслуживанию по Договорам с указанием такого Базиса или приостановить допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию по Договорам с указанием такого Базиса.



## **РАЗДЕЛ IV. ПОРЯДОК И УСЛОВИЯ ДОПУСКА ОБЯЗАТЕЛЬСТВ К КЛИРИНГУ**

### **Статья 11. Порядок взаимодействия с Биржей при подаче заявок и заключении Договоров**

- 11.1. Немедленно после того, как информация о поданной заявке на заключение Договора, стороной по которому будет являться Участник клиринга и по которому осуществляется клиринг с полным обеспечением по товару, и/или заявке, поданной с указанием Торгово-клирингового счета Участника клиринга с признаком «запрет коротких продаж», имеющей направленность «продажа» для форвардного договора или «продажа/покупка» для своп договора, стала доступной Клиринговому центру посредством Системы торгов, Клиринговый центр:
- 11.1.1. для заявки на заключение форвардного договора проверяет, что значение цены, указанной в заявке, больше либо равно Нижней границе ценового коридора и меньше либо равно Верхней границе ценового коридора, установленных Клиринговым центром для товара, по которому подана заявка, и для даты, соответствующей Дате исполнения обязательства по заключаемому Договору;
- 11.1.2. для заявки на заключение своп договора проверяет, что значение цены, указанной в заявке, больше либо равно Нижней границе коридора цен своп и меньше либо равно Верхней границе коридора цен своп, установленных Клиринговым центром для товара, по которому подана заявка, и для даты, соответствующей Дате исполнения обязательства по заключаемому Договору;
- 11.1.3. рассчитывает размер Обеспечения Участника клиринга в товаре, по которому подана заявка, которое может быть использовано для заключения Договора, с учетом:
- Обеспечения Участника клиринга в таком товаре с полным набором характеристик, соответствующих набору характеристик товара, указанных в заявке, учитываемого по Торгово-клиринговому счету, указанному в заявке;
  - обязательств и/или требований Участника клиринга по Договорам, по которым осуществляется клиринг с полным обеспечением по товару, в таком товаре с полным набором характеристик, соответствующих набору характеристик товара, указанных в заявке, учитываемых по Торгово-клиринговому счету, указанному в заявке;
  - обязательств по передаче товара Участника клиринга по Договорам, по которым осуществляется клиринг с частичным обеспечением по товару, в таком товаре с полным набором характеристик, соответствующих набору характеристик товара, указанных в заявке, учитываемых по Торгово-клиринговому счету, указанному в заявке, прошедших проверку наличия Обеспечения в товарах в соответствии с пунктом 15.2 Правил клиринга на товарном рынке;
  - всех зарегистрированных заявок, имеющих направленность «продажа», поданных Участниками торгов с указанием Торгово-клирингового счета, указанного в проверяемой заявке, и направленных на заключение Договоров с товаром с полным набором характеристик, соответствующих набору характеристик товара, указанных в заявке, стороной по которым будет

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

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

- 11.1.4. проверяет, что размер обязательства по передаче товара по Договору, который может быть заключен на основании поданной заявки, в Дату его исполнения не превышает размера Обеспечения Участника клиринга в таком товаре с полным набором характеристик, соответствующих набору характеристик товара, указанных в заявке, рассчитанного в соответствии с подпунктом 11.1.3 Правил клиринга на товарном рынке.
- 11.1.5. рассчитывает значение Единого лимита по Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета Участника клиринга, указанного в заявке, с учетом поданной заявки;
- 11.1.6. осуществляет контроль рассчитанного Единого лимита по Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета Участника клиринга, указанного в заявке, в соответствии с пунктом 11.5 Правил клиринга на товарном рынке.
- 11.2. Немедленно после того как информация о поданной заявке на заключение Договора, стороной по которому будет являться Участник клиринга и по которому осуществляется клиринг с полным обеспечением по денежным средствам, и/или заявке на покупку, поданной с указанием Торгово-клирингового счета Участника клиринга с признаком «запрет необеспеченных покупок», имеющей направленность «покупка» для форвардного договора или «покупка/продажа» для своп договора, стала доступной Клиринговому центру посредством Системы торгов, Клиринговый центр:
  - 11.2.1. для заявки на заключение форвардного договора проверяет, что значение цены, указанной в заявке, больше либо равно Нижней границе ценового коридора и меньше либо равно Верхней границе ценового коридора, установленных Клиринговым центром для товара, по которому подана заявка, и для даты, соответствующей Дате исполнения обязательства по заключаемому Договору;
  - 11.2.2. для заявки на заключение своп договора проверяет, что значение цены, указанной в заявке, больше либо равно Нижней границе коридора цен своп и меньше либо равно Верхней границе коридора цен своп, установленных Клиринговым центром для товара, по которому подана заявка, и для даты, соответствующей Дате исполнения обязательства по заключаемому Договору;
  - 11.2.3. рассчитывает сумму Обеспечения Участника клиринга в российских рублях, которое может быть использовано для заключения Договора, с учетом:
    - Обеспечения Участника клиринга в российских рублях, учитываемого по Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в заявке;
    - обязательств и/или требований Участника клиринга по Договорам, по которым осуществляется клиринг с полным обеспечением по денежным средствам, учитываемых по Расчетному коду, входящему в состав Торгово-

- клирингового счета, указанного в заявке, с Датой исполнения в дату заключения Договора;
- всех зарегистрированных заявок, имеющих направленность «покупка», поданных Участниками торгов с указанием Торгово-клирингового счета, указанного в проверяемой заявке и направленных на заключение Договоров, стороной по которым будет являться Участник клиринга и по которым осуществляется клиринг с полным обеспечением по денежным средствам, с Датой исполнения в дату заключения Договора;
- 11.2.4. проверяет, что размер обязательства по оплате товара по Договору, который может быть заключен на основании поданной заявки, не превышает Обеспечения Участника клиринга в российских рублях, рассчитанного в соответствии с подпунктом 11.2.3 Правил клиринга на товарном рынке;
- 11.2.5. рассчитывает значение Единого лимита по Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета Участника клиринга, указанного в заявке, с учетом поданной заявки;
- 11.2.6. осуществляет контроль рассчитанного Единого лимита по Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета Участника клиринга, указанного в заявке, в соответствии с пунктом 11.5 Правил клиринга на товарном рынке.
- 11.3. Немедленно после того, как информация о поданной Участником торгов заявке, направленной на заключение Договора, по которому осуществляется клиринг с частичным обеспечением, стороной по которому будет являться Участник клиринга, стала доступной Клиринговому центру посредством Системы торгов, Клиринговый центр:
- 11.3.1. для заявки на заключение форвардного договора проверяет, что значение цены, указанной в заявке, больше либо равно Нижней границе ценового коридора и меньше либо равно Верхней границе ценового коридора, установленных Клиринговым центром для товара, по которому подана заявка, и для даты, соответствующей Дате исполнения обязательства по заключаемому Договору;
- 11.3.2. для заявки на заключение своп договора проверяет, что значение цены, указанной в заявке, больше либо равно Нижней границе коридора цен своп и меньше либо равно Верхней границе коридора цен своп, установленных Клиринговым центром для товара, по которому подана заявка, и для даты, соответствующей Дате исполнения обязательства по заключаемому Договору;
- 11.3.3. рассчитывает значение Единого лимита по Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в заявке, с учетом поданной заявки;
- 11.3.4. осуществляет контроль рассчитанного Единого лимита по Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в заявке, в соответствии с пунктом 11.5 Правил клиринга на товарном рынке.
- 11.4. Немедленно после того, как информация о поданной Участником торгов Комбинированной заявке стала доступной Клиринговому центру посредством Системы торгов, Клиринговый центр:
- 11.4.1. проверяет, что значение указанной в заявке цены форвардного договора, который может быть заключен на основании такой Комбинированной заявки, больше либо

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

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

указанным в заявке в качестве стороны по Договору.

- 11.10. После того, как информация о регистрации Договора стала доступной Клиринговому центру посредством Системы торгов, Клиринговый центр:
- рассчитывает Единый лимит Участника клиринга по соответствующему Расчетному коду без учета заявки (части заявки), на основании которой заключен Договор, и с учетом заключенного Договора;
  - допускает к клирингу обязательства по заключенному Договору;
  - изменяет с учетом заключенного Договора Нетто-обязательство и/или Нетто-требование Участника клиринга по денежным средствам по Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в заявке, на основании которой заключен Договор, с Датами исполнения, соответствующими Дате (Датам) исполнения обязательств по оплате товара по заключенному Договору;
  - изменяет с учетом заключенного Договора Нетто-обязательство и/или Нетто-требование Участника клиринга по товарам по Торгово-клиринговому счету, указанному в заявке, на основании которой заключен Договор, с Датами исполнения, соответствующими Дате (Датам) исполнения обязательств по передаче товара по заключенному Договору.
- 11.11. Возможно возникновение разницы между суммой обязательств по парному Договору у Участника клиринга, являющегося Участником торгов - продавцом, и у Участника клиринга, являющегося Участником торгов - покупателем, при осуществлении Клиринговым центром функции центрального контрагента, в случае, если клиент Участника торгов - продавца, в интересах которого Участником торгов - продавцом заключен Договор, не является налогоплательщиком налога на добавленную стоимость. Указанная разница в соответствии с требованиями главы 21 Налогового кодекса Российской Федерации подлежит уплате Клиринговым центром в бюджет Российской Федерации.

## **РАЗДЕЛ V. ПОРЯДОК ПРОВЕДЕНИЯ КЛИРИНГА**

### **ПОДРАЗДЕЛ V-I. ПОРЯДОК ВНЕСЕНИЯ И ВОЗВРАТА ОБЕСПЕЧЕНИЯ**

#### **Статья 12. Порядок внесения Обеспечения**

- 12.1. Внесение Обеспечения в денежных средствах, осуществляется в порядке, определенном общей частью Правил клиринга, с учетом особенностей, установленных настоящей статьей Правил клиринга на товарном рынке.
- 12.2. В качестве Обеспечения принимаются российские рубли, товары, а также иностранная валюта, входящая в установленный решением Клирингового центра Перечень иностранной валюты, принимаемой в качестве Обеспечения.
- 12.3. Внесение Обеспечения в товарах осуществляется путем зачисления товаров на торговые разделы Участника клиринга.
- 12.4. При получении от Оператора товарных поставок информации о зачислении товаров на торговые разделы Участника клиринга Клиринговый центр увеличивает размер Обеспечения Участника клиринга в таком товаре (с основными характеристиками) и размер Обеспечения Участника клиринга в товаре с полным набором характеристик, учитываемые по Торгово-клиринговому счету, в состав которого входит торговый раздел, и увеличивает Единый лимит Участника клиринга с учетом зачисленного количества товара.
- 12.5. Товары, учитываемые в качестве Обеспечения Участника клиринга, используются для расчета Единого лимита по Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета, по которому такое Обеспечение учитывается, и для исполнения обязательств по передаче товара по торговому разделу, входящему в состав Торгово-клирингового счета, по которому указанное Обеспечение учитывается.

#### **Статья 13. Порядок возврата Обеспечения**

- 13.1. Возврат Обеспечения в денежных средствах осуществляется в порядке, определенном общей частью Правил клиринга, с учетом сроков, установленных Временным регламентом на товарном рынке.
- 13.2. Возврат Клиринговым центром Участнику клиринга товаров, учитываемых в качестве Обеспечения, осуществляется на основании распоряжения на списание товара с торгового раздела, поданного Оператору товарных поставок. Исполнение указанного распоряжения осуществляется в порядке, установленном статьей 19 Правил клиринга на товарном рынке.
- 13.3. Возврат Клиринговым центром Участнику клиринга товаров в соответствии с запросом согласия Клирингового центра на списание товара с торгового раздела осуществляется при соблюдении следующих условий:
  - количество товара с полным набором характеристик, учитываемое по

Торгово-клиринговому счету, в состав которого входит торговый раздел, указанный в запросе согласия Клирингового центра на списание товара с торгового раздела, не меньше, чем количество соответствующего товара, указанное в таком запросе;

- возвращаемое количество товара с полным набором характеристик не превышает размера Обеспечения в соответствующем товаре с полным набором характеристик, рассчитанного в соответствии с подпунктом 11.1.3 Правил клиринга на товарном рынке;
- если Единый лимит по Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета совместно с торговым разделом, указанным в запросе согласия Клирингового центра на списание товара с торгового раздела, рассчитанный без учета возвращаемого количества товара, не станет отрицательным.

13.4. При возврате Участнику клиринга товаров размер Обеспечения Участника клиринга в таком товаре (с основными характеристиками) и размер Обеспечения Участника клиринга в товаре с полным набором характеристик, учитываемые по Торгово-клиринговому счету, уменьшаются на количество возвращаемого товара.

13.5. Информация о размере Обеспечения и об изменении размера Обеспечения в денежных средствах и товарах передается Участнику клиринга в составе Отчета об Обеспечении.

Информация об операциях с Обеспечением Участника клиринга в денежных средствах передается Участнику клиринга в составе Отчета о движении денежных средств.

Отчет об Обеспечении и Отчет о движении денежных средств направляются Участнику клиринга в форме электронного документа в срок, установленный Временным регламентом на товарном рынке.

## **ПОДРАЗДЕЛ V-II. КЛИРИНГОВЫЕ СЕССИИ**

### **Статья 14. Порядок проведения клиринговой сессии mark-to-market. Особенности возникновения и исполнения Маржинальных требований**

- 14.1. В ходе клиринговой сессии mark-to-market, проводимой каждый Расчетный день в срок, установленный Временным регламентом на товарном рынке, Клиринговый центр, кроме действий, указанных в общей части Правил клиринга, выполняет следующие действия:
  - 14.1.1. для каждого Участника клиринга рассчитывает и устанавливает новые значения Единых лимитов по Расчетному коду.
- 14.2. Порядок возникновения и исполнения Маржинальных требований определен общей частью Правил клиринга с учетом следующих особенностей:
  - 14.2.1. Маржинальное требование может быть исполнено Участником клиринга путем внесения Обеспечения в товарах на соответствующий торговый раздел в порядке, определенном статьей 12 Правил клиринга на товарном рынке.



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

### **Статья 15. Порядок включения в клиринговый пул обязательств по Договорам**

- 15.1. Для исполнения обязательств по Договорам Участники клиринга обязаны обеспечивать наличие денежных средств, учитываемых по Расчетному коду, и/или товаров на торговых разделах, по которым должны исполняться обязательства по Договору.
- 15.1.1. Расчетным кодом, по которому должно учитываться исполнение обязательства по оплате товаров по Договору, является Расчетный код, входящий в состав Торгово-клирингового счета, указанного при подаче заявки на заключение Договора.
- 15.1.2. Торговым разделом, по которому должны исполняться обязательства по передаче / требования по получению товаров по Договору, является торговый раздел, входящий в состав Торгово-клирингового счета, указанного при подаче заявки на заключение Договора.
- 15.2. В Расчетный день, предшествующий Дате исполнения обязательств по форвардному договору на количество Расчетных дней, установленное решением Клирингового центра, в срок, установленный Временным регламентом на товарном рынке, по форвардным договорам, по которым при подаче заявки на их заключение осуществлялся клиринг с частичным обеспечением по товару, Клиринговый центр осуществляет проверку наличия Обеспечения в товарах, учитываемого по Торгово-клиринговому счету, в состав которого входит торговый раздел, по которому должны исполняться обязательства по передаче товара по форвардному договору, в количестве, необходимом для исполнения указанных обязательств в полном объеме. Размер указанного Обеспечения в товарах рассчитывается в соответствии с подпунктом 11.1.3 Правил клиринга на товарном рынке.
- В случае отсутствия указанного Обеспечения в необходимом количестве, обязательства по передаче товаров по Договору в полном объеме считаются не обеспеченными средствами под исполнение, Участник клиринга признается Недобросовестным участником клиринга, к нему применяются меры, предусмотренные статьей 16 Правил клиринга на товарном рынке.
- 15.3. В Дату исполнения в срок, установленный Временным регламентом на товарном рынке:
- 15.3.1. встречные однородные обязательства и требования Участника клиринга и Клирингового центра по Договорам, заключенным на основании Комбинированных заявок, с наступившей Датой исполнения прекращаются зачетом. Обязательства и требования в части, в которой они не были прекращены зачетом, подлежат включению в клиринговый пул в соответствии с подпунктом 15.3.2 Правил клиринга на товарном рынке;
- 15.3.2. Клиринговый центр включает в клиринговый пул:
- Задолженность Участника клиринга в российских рублях, возникшую в предыдущий Расчетный день и не погашенную по состоянию на

- установленный Временным регламентом на товарном рынке момент определения Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований по денежным средствам;
- обязательства и требования Участников клиринга и Клирингового центра по оплате и передаче / получению товара по Договорам с наступившей Датой исполнения, в том числе, обязательства и требования, не прекращённые в соответствии с подпунктом 15.3.1 Правил клиринга на товарном рынке;
  - обязательства Участника клиринга по уплате комиссионных вознаграждений с наступившей Датой исполнения, определенные в соответствии со статьей 21 Правил клиринга на товарном рынке;
  - обязательства Участника клиринга по уплате штрафов, определенные в предыдущий Расчетный день.
- 15.3.3. Клиринговый центр прекращает однородные денежные обязательства и требования Участника клиринга и Клирингового центра, включенные в клиринговый пул, по каждому Расчетному коду каждого Участника клиринга, и – определяет Итоговые нетто-обязательства и/или Итоговые нетто-требования по денежным средствам, возникшее в связи с прекращением обязательств и требований, указанных в настоящем подпункте Правил клиринга на товарном рынке;
- 15.3.4. формирует и передает Участникам клиринга Выписки из реестра Договоров, принятых в клиринг, содержащие информацию об обязательствах, включенных в клиринговый пул, и отчеты, содержащие информацию об Итоговых нетто-обязательствах / Итоговых нетто-требованиях по денежным средствам.
- 15.4. Участник клиринга обязан исполнить свои Итоговые нетто-обязательства по денежным средствам до времени, установленного Временным регламентом на товарном рынке.
- 15.5. Клиринговый центр исполняет требования Участника клиринга по получению товаров по Договорам, учитываемые по Торгово-клиринговому счету совместно с Расчетным кодом, при условии исполнения Участником клиринга Итогового нетто-обязательства по денежным средствам, учитываемого по тому же Расчетному коду. Клиринговый центр исполняет Итоговое нетто-требование Участника клиринга по денежным средствам, учитываемое по Расчетному коду, при условии исполнения Участником клиринга обязательств по поставке товаров по Договорам, учитываемых по всем Торгово-клиринговым счетам, в состав которых входит тот же Расчетный код.
- 15.6. Исполнение / прекращение Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований по денежным средствам, определенных в соответствии с подпунктом 15.3.3 Правил клиринга на товарном рынке, осуществляется в порядке, определенном общей частью Правил клиринга.
- 15.6.1. Участник клиринга, имеющий Итоговое нетто-обязательство по денежным средствам, для исполнения которого недостаточно денежных средств, признается Недобросовестным участником клиринга, к нему применяются меры, предусмотренные статьей 16 Правил клиринга на товарном рынке.

- 15.7. Обязательства / требования по передаче / получению товаров, включенные в клиринговый пул, исполняются в порядке, определенном статьей 18 Правил клиринга на товарном рынке.

**Статья 16. Порядок действий в случае наличия обязательств, для исполнения которых недостаточно товаров / денежных средств**

- 16.1. В случае наличия у Участника клиринга обязательств по передаче товаров по Договору, для исполнения которых недостаточно товаров, в период времени, установленный Временным регламентом на товарном рынке, Клиринговый центр устанавливает для Расчетного кода Участника клиринга, входящего в состав Торгово-клирингового счета, по которому учитывается обязательство по передаче товаров по Договору, для исполнения которого недостаточно товаров, Режим урегулирования, порядок применения которого определен общей частью Правил клиринга, и от имени Недобросовестного участника клиринга в отношении себя лично заключает закрывающий форвардный договор, являющийся закрывающей сделкой, и заключает балансирующую сделку, условия которых определены в пункте 16.3 Правил клиринга на товарном рынке.
- 16.2. Форвардный договор, указанный в пункте 16.1 Правил клиринга на товарном рынке, заключается при соблюдении следующих условий:
- 16.2.1. у Участника клиринга – кредитной организации не отозвана (не аннулирована) лицензия Банка России на осуществление банковских операций;
- 16.2.2. количество товара, в отношении которого необходимо заключить форвардный договор, больше или равно лоту такого товара, установленного Биржей.
- 16.3. Условия закрывающего форвардного договора и балансирующей сделки, заключаемых в соответствии с пунктом 16.1 Правил клиринга на товарном рынке, соответствуют определенным Правилами торгов на товарном рынке условиям форвардных договоров с учетом следующих особенностей:
- 16.3.1. по закрывающему форвардному договору у Участника клиринга возникают требования по соответствующему товару в количестве, равном величине не обеспеченного средствами под исполнение обязательства по передаче товаров по Договору (в полном объеме);
- 16.3.2. цена закрывающего форвардного договора равна цене балансирующей сделки с соответствующим товаром;
- 16.3.3. Датой исполнения обязательств по закрывающему форвардному договору и балансирующей сделке является Дата исполнения обязательств по Договору, не обеспеченному средствами под исполнение. Дата исполнения обязательств по закрывающему форвардному договору и балансирующей сделке не может быть ранее, чем третий Расчетный день после даты его заключения;
- 16.3.4. порядок заключения закрывающих и балансирующих сделок определен общей частью Правил клиринга.
- 16.4. После заключения закрывающих форвардных договоров и балансирующих сделок в соответствии с пунктом 16.1 Правил клиринга на товарном рынке Клиринговый

центр снимает Режим урегулирования для Расчетного кода Участника клиринга.

- 16.5. Клиринговый центр, действуя от имени Участника клиринга в отношении себя лично, осуществляет все юридические и фактические действия, необходимые для заключения сделок в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на товарном рынке без специального полномочия (доверенности), а также без согласия Участника клиринга.
- 16.6. В случае наличия у Участника клиринга Итогового нетто-обязательства по денежным средствам, для исполнения которого недостаточно денежных средств, Клиринговый центр:
- 16.6.1. В первую очередь, использует Обеспечение Участника клиринга в иностранной валюте для удовлетворения требований Клирингового центра по неисполненному Итоговому нетто-обязательству Участника клиринга путем продажи Клиринговым центром иностранной валюты, являющейся Обеспечением Участника клиринга, за российские рубли по курсу, не меньшему, чем Нижняя граница диапазона оценки рыночных рисков соответствующего уровня по иностранной валюте, установленная Клиринговым центром в соответствии с Методикой определения риск-параметров валютного рынка и рынка драгоценных металлов на конец Расчетного дня даты удовлетворения требований.
- Удовлетворение требований за счет Обеспечения Участника клиринга в иностранной валюте осуществляется Клиринговым центром без предварительного уведомления Участника клиринга.
- Сумма, полученная по указанной конверсионной сделке, засчитывается Клиринговым центром в счет исполнения Итогового нетто-обязательства Участника клиринга.
- Размер Обеспечения в иностранной валюте, учитываемого по Расчетному коду, уменьшается на сумму использованного Обеспечения Участника клиринга.
- 16.6.2. Во вторую очередь, в период времени, установленный Временным регламентом на товарном рынке, Клиринговый центр заключает с Недобросовестным участником клиринга своп договор или форвардный договор, условия и порядок заключения которых определены в статье 17 Правил клиринга на товарном рынке.
- 16.7. При наличии случаев, указанных в пунктах 16.1, 17.3 Правил клиринга на товарном рынке, с Участника клиринга взимается штраф при заключении закрывающего форвардного договора, рассчитываемый по формуле:
- $$\text{Penalty} = \text{ROUND} (\text{VAL\_OBL} \times \text{C} \times \text{K} \times \text{R} / 365; 2), \text{ где}$$
- Penalty – сумма штрафа при заключении закрывающего форвардного договора, в российских рублях,
- VAL\_OBL –объем денежных средств / товаров, обязательство по которым было не исполнено Недобросовестным участником клиринга, в закрывающем форвардном договоре, заключенном НКЦ от имени Недобросовестного участника клиринга ,
- C – Расчетная цена товара / C=1 для российских рублей;
- K – коэффициент, установленный решением Клирингового центра; по умолчанию K=5;
- R – ставка, установленная Клиринговым центром в соответствии с Методикой

определения риск-параметров товарного рынка.

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

16.7.1. Обязательство по уплате штрафа, рассчитанное в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга на товарном рынке, учитывается по основному Расчетному коду для списания комиссионных вознаграждений на товарном рынке, порядок определения которого установлен общей частью Правил клиринга.

16.7.2. Обязательство по уплате штрафа должно быть исполнено в Расчетный день, следующий за днем возникновения оснований для взимания штрафа.

16.7.3. Штраф не взимается с Участника клиринга, допуск к клиринговому обслуживанию, которого приостановлен в связи с аннулированием лицензии на осуществление профессиональной деятельности на рынке ценных бумаг.

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

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

$Penalty = | OBL\_C \times Rc\_RUB\_C + OBL\_RUB |$ , где

Penalty – сумма отступного, в российских рублях,

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

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

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

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

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

16.9. После заключения своп договоров / форвардных договоров в соответствии с

настоящей статьей Правил клиринга на товарном рынке Клиринговый центр:

- 16.9.1. допускает к клирингу обязательства по указанным Договорам;
- 16.9.2. включает обязательства с наступившей Датой исполнения по указанным Договорам в клиринговый пул;
- 16.9.3. прекращает однородные Итоговые нетто-обязательства / Итоговые нетто-требования по денежным средствам в соответствующей валюте, обязательства и требования в соответствующих валютах с наступившей Датой исполнения по указанным заключенным Договорам и определяет Итоговое нетто-обязательство и/или Итоговое нетто-требование по денежным средствам в соответствующей валюте, возникшее в связи с прекращением обязательств и требований, указанных в настоящем подпункте Правил клиринга на товарном рынке;
- 16.9.4. формирует и направляет Участнику клиринга новую Выписку из реестра Договоров, принятых в клиринг, а также новый отчет об Итоговых нетто-обязательствах / Итоговых нетто-требованиях по денежным средствам;
- 16.9.5. осуществляет исполнение / прекращение Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований по денежным средствам, определенных в соответствии с подпунктом 16.9.3 Правил клиринга на товарном рынке, в порядке, установленном общей частью Правил клиринга.
- 16.10. Обязательства по Договорам, заключенным в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на товарном рынке, с ненаступившей Датой исполнения учитываются в составе Нетто-обязательств / Нетто-требований Участника клиринга по денежным средствам / товарам с Датой исполнения, соответствующей дате исполнения указанных обязательств.
- 16.11. Итоговое нетто-обязательство в российских рублях, учитываемое по Расчетному коду Участника клиринга, не прекращенное по итогам действий, выполненных в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на товарном рынке, прекращается возникновением Задолженности Участника клиринга перед Клиринговым центром, учитываемой по такому Расчетному коду Участника клиринга.
- 16.12. Задолженность Участника клиринга должна быть погашена Участником клиринга не позднее времени определения Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований по денежным средствам, установленного Временным регламентом на товарном рынке.  
Информация о наличии у Участника клиринга Задолженности и ее размере предоставляется Участнику клиринга в составе Отчета о движении денежных средств.  
Задолженность Участника клиринга считается погашенной, если на момент времени, установленный Временным регламентом на товарном рынке в качестве времени определения Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований по денежным средствам, значение Обеспечения в российских рублях, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, по которому учитывалась Задолженность, является неотрицательным.

- 16.13. В случае непогашения Участником клиринга до времени определения Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований по денежным средствам, установленного Временным регламентом на товарном рынке, Задолженности непогашенная Задолженность включается в клиринговый пул в соответствии с подпунктом 15.3.2 Правил клиринга на товарном рынке и прекращается в таком клиринговом пуле.
- 16.14. Если Задолженность Участника клиринга не погашена полностью по итогам действий, выполненных в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на товарном рынке, и/или Участником клиринга в срок, установленный Временным регламентом на товарном рынке, Клиринговый центр использует Обеспечение Участника клиринга, учитываемое по иным собственным Расчетным кодам в соответствии с Правилами клиринга, а также средства Гарантийных фондов и/или Обеспечение под стресс в порядке, определенном общей частью Правил клиринга.
- 16.15. Клиринговый центр вправе принять решение о незаключении с Недобросовестным участником клиринга своп договора или форвардного договора в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на товарном рынке в случае невозможности заключения указанных договоров. Такое решение Клирингового центра должно также содержать порядок урегулирования неисполненных обязательств / требований Участников клиринга и Клирингового центра.

#### **Статья 17. Порядок заключения и условия своп договоров и форвардных договоров, заключаемых с Недобросовестными участниками клиринга**

- 17.1. Свop договоры, указанные в подпункте 16.6.2 Правил клиринга на товарном рынке, заключаются при соблюдении следующих условий:
- 17.1.1. у Участника клиринга – кредитной организации не отозвана (не аннулирована) лицензия Банка России на осуществление банковских операций;
- 17.1.2. допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию не приостановлен;
- 17.1.3. у Клирингового центра отсутствует информация об обстоятельствах в отношении Участника клиринга, перечисленных в общей части Правил клиринга, при наступлении которых допуск к клиринговому обслуживанию Участника клиринга будет приостановлен в следующий Расчетный день.
- 17.2. Свop договоры заключаются Клиринговым центром без подачи заявок от имени Недобросовестного участника клиринга в отношении себя лично в случае, установленном подпунктом 16.6.2 Правил клиринга на товарном рынке. Условия свop договоров соответствуют определенным Правилами торгов на товарном рынке условиям свop договоров с учетом следующих особенностей:
- 17.2.1. по первой части свop договора у Недобросовестного участника клиринга возникают требования в российских рублях и обязательства по товарам. Количество товара в свop договоре определяется таким образом, чтобы соответствующее ему требование по оплате товара было равно Итоговому нетто-обязательству Недобросовестного участника клиринга (или части Итогового нетто-обязательства Недобросовестного участника клиринга, для исполнения которого недостаточно денежных средств), или превышало указанное Итоговое нетто-

обязательство Недобросовестного участника клиринга (указанную часть Итогового нетто-обязательства Недобросовестного участника клиринга) на величину, не большую, чем произведение лота товара, установленного Биржей, и последней определенной Клиринговым центром Расчетной цены товара;

- 17.2.2. Датой исполнения обязательств по первой части своп договора является день ее заключения;
- 17.2.3. Датой исполнения обязательств по второй части своп договора является третий Расчетный день, следующий за датой заключения своп договора;
- 17.2.4. Базовый курс своп договора устанавливается равным Расчетной цене товара, определенной в соответствии с Методикой определения расчетной цены в 16:00 по московскому времени текущего Рабочего дня;
- 17.2.5. Цена своп договора устанавливается равной ставке, установленной Клиринговым центром в соответствии с Методикой определения риск-параметров товарного рынка;
- 17.2.6. в случае приостановления допуска к клиринговому обслуживанию в связи с аннулированием лицензии на осуществление профессиональной деятельности на рынке ценных бумаг, своп договор заключается с ценой своп договора, равной нулю, штрафы с Недобросовестного участника клиринга не взимаются.
- 17.3. При несоблюдении любого из условий, указанных в подпунктах 17.1.2-17.1.3 Правил клиринга на товарном рынке, а также:
  - 17.3.1. при наличии у Участника клиринга Итогового нетто-обязательства в российских рублях, для исполнения которого недостаточно денежных средств, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, в Дату исполнения второй части сделки своп, заключенной в соответствии с подпунктом 16.6.2 Правил клиринга на товарном рынке,  
Клиринговый центр устанавливает для Расчетного кода Участника клиринга, по которому учитывается Итоговое нетто-обязательство, для исполнения которого недостаточно денежных средств, Режим урегулирования, порядок применения которого определен общей частью Правил клиринга, и от имени Недобросовестного участника клиринга в отношении себя лично заключает закрывающий форвардный договор и закрывающий своп договор, а также заключает балансирующий форвардный договор и балансирующий своп договор, условия которых определены в пункте 17.5 Правил клиринга на товарном рынке.
- 17.4. Условие, указанное в подпункте 17.3.1 Правил клиринга на товарном рынке, не применяется, если причиной наличия у Участника клиринга Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам, для исполнения которого недостаточно денежных средств, является несвоевременное зачисление денежных средств на клиринговые банковские счета Клирингового центра в Расчетной организации, вызванное проведением процедур комплаенс-контроля в банках-корреспондентах, сбоями в работе платежных систем, а также обстоятельствами непреодолимой силы, определенными в пункте 17.5 Правил клиринга на товарном рынке.

Участник клиринга обязан предоставить Клиринговому центру документы,



подтверждающие действие причин, указанных в настоящем пункте Правил клиринга на товарном рынке.

- 17.5. Условия закрывающих форвардных договоров, закрывающих своп договоров, балансирующих форвардных договоров и балансирующих своп договоров, заключаемых в соответствии с пунктом 17.3 Правил клиринга на товарном рынке, соответствуют определенным Правилами торгов на товарном рынке условиям форвардных договоров и своп договоров, заключаемых на основании комбинированной заявки, с учетом следующих особенностей:
- 17.5.1. по первой части закрывающего своп договора у Недобросовестного участника клиринга возникают требования в российских рублях и обязательства по товарам;
- 17.5.2. по форвардному договору и второй части закрывающего своп договора у Недобросовестного участника клиринга возникают обязательства в российских рублях и требования по товарам;
- 17.5.3. количество товара в закрывающем форвардном договоре равно количеству товара в закрывающем своп договоре и должно быть кратно лоту товара, установленному Биржей, и не может превышать суммы Обеспечения в товарах, учитываемого по Торгово-клиринговому счету. Количество товара в закрывающем форвардном договоре и закрывающем своп договоре определяется таким образом, чтобы соответствующее ему требование по оплате товара было равно Итоговому нетто-обязательству Недобросовестного участника клиринга (или части Итогового нетто-обязательства Недобросовестного участника клиринга, для исполнения которого недостаточно денежных средств), или превышало указанное Итоговое нетто-обязательство Недобросовестного участника клиринга (указанную часть Итогового нетто-обязательства Недобросовестного участника клиринга) на величину, не большую, чем произведение лота товара, установленного Биржей, и цены заключаемого закрывающего форвардного договора;
- 17.5.4. закрывающий форвардный договор и закрывающий своп договор заключаются в отношении товара, учитываемого по Торгово-клиринговому счету, в состав которого входит Расчетный код, по которому учитывается Итоговое нетто-обязательство Участника клиринга, для исполнения которого недостаточно денежных средств. Выбор товара, в отношении которого заключается закрывающий форвардный договор и закрывающий своп договор, осуществляется Клиринговым центром;
- 17.5.5. цена закрывающего форвардного договора с товаром, указанным в подпункте 17.5.4 Правил клиринга на товарном рынке, или с иным товаром, отличающимся базисом от товара, указанного в подпункте 17.5.4 Правил клиринга на товарном рынке, равна цене балансирующего форвардного договора;
- 17.5.6. цена закрывающего своп договора равна цене балансирующего своп договора;
- 17.5.7. Датой исполнения обязательств по первой части закрывающего и балансирующего своп договора является день их заключения;
- 17.5.8. Датой исполнения обязательств по оплате и поставке товара по закрывающему форвардному договору, балансирующему форвардному договору, второй части закрывающего и балансирующего своп договора является третий Расчетный день после даты их заключения;

- 17.5.9. порядок заключения закрывающих и балансирующих сделок определен общей частью Правил клиринга.
- 17.6. После заключения закрывающих и балансирующих сделок в соответствии с пунктом 17.3 Правил клиринга на товарном рынке Клиринговый центр снимает Режим урегулирования для Расчетного кода Участника клиринга.
- 17.7. В случае невозможности исполнения Участником клиринга своих Итоговых нетто-обязательств по денежным средствам в соответствующей валюте вследствие непреодолимой силы или сбоя в платежной системе Банка России, Клиринговым центром с Участником клиринга заключаются своп договоры с ценой своп договора, равной нулю.
- Под обстоятельствами непреодолимой силы понимаются:
- военные действия, акты террора, диверсии и саботажа, массовые беспорядки, забастовки, смена политического режима, другие политические осложнения, как в Российской Федерации, так и в иных государствах;
  - решения органов государственной власти, иных органов, учреждений и организаций Российской Федерации и/или иных государств;
  - пожары или иные несчастные случаи, разрушения или значительные повреждения занимаемых Участником клиринга помещений;
  - любые иные обстоятельства, которые создают или могут создать угрозу жизни или здоровью работников Участника клиринга.
- О возникновении обстоятельств непреодолимой силы, вследствие которых исполнение Участником клиринга своих Итоговых нетто-обязательств по денежным средствам в соответствующей валюте невозможно, Участник клиринга обязан уведомить Клиринговый центр любыми доступными средствами связи до установленного Временным регламентом на товарном рынке времени заключения Договоров в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на товарном рынке.
- Участник клиринга обязан предоставить Клиринговому центру документы, подтверждающие обстоятельства непреодолимой силы в течение 7 (семи) дней. В случае непредоставления Участником клиринга Клиринговому центру таких документов в указанный срок с Участника клиринга по решению Клирингового центра взыскивается неустойка, равная цене своп договора, рассчитанной в соответствии с подпунктом 17.2.5 Правил клиринга на товарном рынке в расчете на количество календарных дней между датой исполнения первой части своп договора и датой расчета неустойки.
- Уплата Участником клиринга неустойки в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга на товарном рынке не освобождает Участника клиринга от исполнения обязательств по второй части своп договора, заключенного в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на товарном рынке.
- 17.8. Клиринговый центр вправе принять решение о заключении от имени Недобросовестного участника клиринга своп договоров в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на товарном рынке с ценой своп договора, равной нулю, при наличии обстоятельств, не указанных в пункте 17.6 Правил клиринга на товарном рынке и свидетельствующих об отсутствии вины такого Участника клиринга.

- 17.9. При наличии у Клирингового центра информации об обстоятельствах в отношении Участника клиринга, перечисленных в общей части Правил клиринга, при наступлении которых допуск к клиринговому обслуживанию Участника клиринга будет приостановлен в следующий Расчетный день, Клиринговый центр вправе принять решение о том, что Дата исполнения обязательств по Договорам, стороной которых является такой Участник клиринга, считается наступившей в текущий Расчетный день.
- 17.9.1. Обязательства по Договорам, в отношении которых Клиринговым центром принято решение в соответствии с пунктом 17.9 Правил клиринга на товарном рынке, включаются в клиринговый пул и участвуют в определении Итогового нетто-обязательства / Итогового нетто-требования Участника клиринга по денежным средствам в соответствии со статьей 15 Правил клиринга на товарном рынке, при этом при наличии у Участника клиринга Итогового нетто-обязательства, для исполнения которого недостаточно денежных средств, Клиринговый центр заключает от имени Недобросовестного участника клиринга закрывающий форвардный договор и закрывающий своп договор, а также заключает балансирующий форвардный договор и балансирующий своп договор в соответствии с пунктом 17.3 Правил клиринга на товарном рынке.
- 17.10. Клиринговый центр, действуя от имени Участника клиринга в отношении себя лично, осуществляет все юридические и фактические действия, необходимые для заключения Договоров в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на товарном рынке без специального полномочия (доверенности), а также без согласия Участника клиринга.

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

### **Статья 18. Порядок исполнения обязательств и требований Участников клиринга и Клирингового центра по передаче товаров, включенных в клиринговый пул**

- 18.1. Обязательства по передаче товаров по Договорам, включенные в клиринговый пул, исполняются за счет товаров, учитываемых на торговом разделе Участника клиринга - продавца.
- 18.2. Обязательства / требования по передаче / получению товаров по Договорам, включенные в клиринговый пул, включаются в распоряжение на перевод товаров, направляемое Клиринговым центром Оператору товарных поставок в соответствии с пунктом 19.6 Правил клиринга на товарном рынке и содержащее распоряжения на перевод товаров с торговых разделов Участников клиринга – продавцов на торговый раздел Клирингового центра и распоряжения на перевод товаров с торгового раздела Клирингового центра на торговые или поставочные разделы Участников клиринга – покупателей.
- 18.2.1. В распоряжение на перевод товаров включается распоряжение на перевод товаров с торгового раздела Клирингового центра на поставочный раздел Участника клиринга в следующих случаях:
- Участник клиринга – покупатель по форвардному договору имеет обязательство по уплате транспортного дифференциала и в Дату исполнения обязательства по форвардному договору в отношении товара, являющегося предметом указанного форвардного договора, не заключен своп договор, и соблюдаются условия для возврата Участнику клиринга товаров, указанные в пункте 13.3 Правил клиринга на товарном рынке;
  - в Дату исполнения обязательства по второй части своп договора, заключенного в отношении товара, полученного по форвардному договору, при условии, если в Дату исполнения обязательств по указанному форвардному договору Участник клиринга имел обязательство по уплате транспортного дифференциала и обязательство по уплате транспортного дифференциала не прекращено в соответствии с пунктом 21.11 Правил клиринга на товарном рынке.
- В иных случаях в распоряжение на перевод товаров включается распоряжение на перевод товаров с торгового раздела Клирингового центра на торговый раздел Участника клиринга – покупателя.
- 18.2.2. При наличии у Участника клиринга – покупателя по форвардному договору обязательства по уплате транспортного дифференциала и несоблюдении условий для возврата Участнику клиринга товаров, указанных в пункте 13.3 Правил клиринга на товарном рынке, обязательство по уплате транспортного дифференциала прекращается.
- 18.3. После исполнения (прекращения) Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований Участников клиринга по денежным средствам в соответствии с общей

частью Правил клиринга и направления Оператору товарных поставок распоряжения на перевод товаров в соответствии с пунктом 19.6 Правил клиринга на товарном рынке, обязательства / требования Участников клиринга по передаче / получению товаров, включенные в клиринговый пул, считаются прекращенными в клиринговом пуле.

После получения от Оператора товарных поставок отчета об исполнении распоряжения на перевод товаров в соответствии с пунктом 19.7 Правил клиринга на товарном рынке, расчеты по товарам по итогам клиринга считаются завершенными, размер Обеспечения Участника клиринга в соответствующем товаре увеличивается на сумму исполненного требования Участника клиринга по получению такого товара.

## **РАЗДЕЛ VI. ПОРЯДОК ВЗАИМОДЕЙСТВИЯ С ОПЕРАТОРОМ ТОВАРНЫХ ПОСТАВОК**

### **Статья 19. Порядок взаимодействия с Оператором товарных поставок**

- 19.1. Каждый Расчетный день до начала торгов Оператор товарных поставок передает Клиринговому центру список торговых разделов и выписку по торговым и выписку по поставочным разделам.
- 19.2. После получения от Оператора товарных поставок выписки по торговым разделам Клиринговый центр устанавливает в Клиринговой системе:
- значения Обеспечения в товарах с полным набором характеристик, учитываемого по Торгово-клиринговому счету, в состав которого входит соответствующий торговый раздел, в соответствии с информацией о количестве соответствующего товара, учитываемого на торговых разделах, полученной от Оператора товарных поставок в выписке по торговым разделам;
  - значения Обеспечения в товарах (с основными характеристиками), учитываемого по Торгово-клиринговому счету, как сумму значений Обеспечения в товарах с полным набором характеристик, учитываемого по тому же Торгово-клиринговому счету, основные характеристики которого соответствуют основным характеристикам товара.
- 19.3. Клиринговый центр соглашается с проведением любых операций, связанных с зачислением товаров на торговые разделы, по поручению лица, которому открыт торговый товарный счет.
- 19.4. Зачисление товаров на поставочные разделы осуществляется только по распоряжению Клирингового центра.  
Списание товаров с поставочных разделов осуществляется по распоряжению или с согласия Клирингового центра в соответствии с пунктом 21.13 Правил клиринга на товарном рынке.
- 19.5. В случае необходимости списания товара с торгового раздела, в том числе в случае получения от Участника клиринга распоряжения на списание товара с торгового раздела, Оператор товарных поставок направляет Клиринговому центру запрос согласия Клирингового центра на списание товара с торгового раздела.  
Списание товара с торгового раздела, в том числе на основании распоряжения Участника клиринга на списание товара с торгового раздела, осуществляется Оператором товарных поставок только в случае получения положительного ответа Клирингового центра на указанный запрос.
- 19.6. Проведение расчетов по товарам осуществляется Оператором товарных поставок на основании полученного от Клирингового центра распоряжения на перевод товаров, содержащего информацию об обязательствах / требованиях Участников клиринга по передаче / получению товаров.  
Исполнение распоряжения на перевод товаров, полученного от Клирингового

центра в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга на товарном рынке, осуществляется Оператором товарных поставок в корреспонденции с торговым разделом Клирингового центра.

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

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

## **Статья 20. Порядок действий в случае обращения взыскания или наложения ареста на имущество Участника клиринга, находящееся на торговом товарном счете**

- 20.1. В случае обращения взыскания или наложения ареста на имущество Участника клиринга, находящееся на торговом товарном счете Клиринговый центр:
- устанавливает ограничение на списание и иное использование товаров, учитываемых на каждом торговом товарном счете, в отношении которого наложен арест / обращено взыскание, в количестве, указанном в документе, являющемся основанием для обращения взыскания и/или наложения ареста, за исключением использования товаров для исполнения (прекращения) обязательств, допущенных к клирингу, не позднее дня, следующего за днем, когда Клиринговый центр получил документ, являющийся основанием для обращения взыскания и/или наложения ареста;
  - вправе направить Бирже уведомление о необходимости приостановки возможности заключения Договоров с указанием Торгово-клиринговых счетов, в состав которых входит торговый раздел торгового товарного счета, в отношении которого наложен арест / обращено взыскание.
- 20.1.1. Клиринговый центр:
- 1) не позднее дня, следующего за днем получения Клиринговым центром копии исполнительных документов, исполняет (прекращает) обязательства Участника клиринга с наступившей Датой исполнения;
  - 2) не позднее дня, следующего за днем получения Клиринговым центром исполнительных документов, сообщает судебному приставу-исполнителю

сведения о количестве товара, оставшегося после исполнения (прекращения) обязательств Участника клиринга.



## **РАЗДЕЛ VII. ПОРЯДОК ОПЛАТЫ УСЛУГ. ОТЧЕТЫ ПО ИТОГАМ КЛИРИНГА**

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

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

удерживается Клиринговым центром с Участника клиринга в первый Рабочий день календарного месяца, следующего за месяцем фактического оказания услуг, по основному Расчетному коду для списания комиссионных вознаграждений, порядок определения которого установлен общей частью Правил клиринга.

- 21.6.1. В случае приостановки / прекращения допуска Участника торгов к торгам в течение календарного месяца, вознаграждение за предоставление ИТС, комиссионное вознаграждение в пользу Оператора товарных поставок, определяется и удерживается в последний Рабочий день, когда Участник торгов был допущен к торгам, за исключением случаев, предусмотренных Тарифами Технического центра / тарифами Оператора товарных поставок.
- 21.7. Информация о размере Биржевого сбора, комиссионного вознаграждения Клирингового центра, Оператора товарных поставок, вознаграждения Технического центра, транспортного дифференциала, определенного в отчетную дату, указывается в Отчете о комиссионных вознаграждениях, направляемом Клиринговым центром Участникам клиринга в сроки, установленные Временным регламентом на товарном рынке.
- 21.8. Информация о рассчитанном Клиринговым центром размере Биржевого сбора, комиссионного вознаграждения Клирингового центра за клиринговое обслуживание по каждому Договору становится доступной Бирже посредством Системы торгов немедленно после его расчета.
- 21.9. В Дату исполнения обязательств по Договору, Клиринговый центр проверяет достаточность Обеспечения Участника клиринга в российских рублях для исполнения обязательства по уплате транспортного дифференциала за Доставку Товара, приобретенного по Договору.
- 21.9.1. Обеспечение Участника клиринга в российских рублях является достаточным для исполнения обязательства по уплате транспортного дифференциала, если размер Обеспечения Участника клиринга в российских рублях не меньше, чем размер обязательства по уплате транспортного дифференциала.
- 21.9.2. Если Обеспечение Участника клиринга в российских рублях является достаточным для исполнения обязательства по уплате транспортного дифференциала, Клиринговый центр исполняет указанное обязательство в соответствии с пунктом 21.12 Правил клиринга на товарном рынке.
- 21.10. Если в Дату исполнения обязательств по Договору Обеспечение Участника клиринга в российских рублях является не достаточным для исполнения обязательства по уплате транспортного дифференциала за Доставку Товара, приобретенного по Договору, Клиринговый центр осуществляет проверку достаточности Обеспечения Участника клиринга для исполнения указанного обязательства в соответствии с пунктом 21.9 Правил клиринга на товарном рынке в течение 5 (пяти) Расчетных дней, следующих за Датой исполнения обязательств по Договору.
- Если в один из указанных дней Обеспечение Участника клиринга в российских рублях является достаточным для исполнения обязательства по уплате транспортного дифференциала за Доставку Товара, приобретенного по Договору,

Клиринговый центр исполняет указанное обязательство в соответствии с пунктом 21.12 Правил клиринга на товарном рынке и взимает с Участника клиринга штраф за ненадлежащее исполнение обязательств по уплате транспортного дифференциала в пользу Экспедитора в соответствии с тарифами Экспедитора.

Порядок уплаты штрафа за ненадлежащее исполнение обязательств по уплате транспортного дифференциала установлен пунктом 21.12 Правил клиринга на товарном рынке.

- 21.11. Если обязательство по уплате транспортного дифференциала за Доставку Товара, приобретенного по Договору, не исполнено в течение срока, установленного пунктом 21.10 Правил клиринга на товарном рынке, обязательство по уплате транспортного дифференциала за Доставку Товара, приобретенного по Договору, прекращается, если товар был переведен на поставочный раздел, Клиринговый центр направляет Оператору товарных поставок распоряжение на перевод товара с полным набором характеристик с соответствующего поставочного раздела на соответствующий торговый раздел со значением базиса, установленным Клиринговым центром.
- 21.12. Обязательство по уплате транспортного дифференциала / обязательства по уплате штрафа за ненадлежащее исполнение обязательств по уплате транспортного дифференциала за Доставку Товара, приобретенного по Договору, учитываемое по Расчетному коду Участника клиринга, исполняется за счет Обеспечения в российских рублях, учитываемого по тому же Расчетному коду Участника клиринга - покупателя, по которому должны исполняться обязательства по Договору.  
При этом размер Обеспечения Участника клиринга в российских рублях, учитываемого по Расчетному коду, уменьшается на сумму исполненного обязательства.
- 21.13. После исполнения обязательства по уплате транспортного дифференциала за Доставку Товара, приобретенного по Договору, Клиринговый центр направляет Оператору товарных поставок согласие на списание с поставочного раздела товара с полным набором характеристик.
- 21.14. В случаях, установленных документами Оператора товарных поставок, Клиринговый центр взимает с Участника клиринга штраф в пользу Оператора товарных поставок.
- 21.14.1. Штраф учитывается по Расчетному коду Участника клиринга, входящего в состав Торгово-клирингового счета, по которому учитывается (учитывалось) Обеспечение, в отношении которого Участником клиринга были нарушены обязательства.
- 21.14.2. Штраф, учитываемый по Расчетному коду Участника клиринга, исполняется за счет Обеспечения в российских рублях, учитываемого по тому же Расчетному коду Участника клиринга.  
При этом размер Обеспечения Участника клиринга в российских рублях, учитываемого по Расчетному коду, уменьшается на сумму исполненного

обязательства по уплате штрафа.

## **Статья 22. Порядок предоставления отчетов по итогам клиринга**

22.1. Клиринговый центр обеспечивает Участнику клиринга с использованием рабочего места Участника клиринга возможность получения следующей информации из Клиринговой системы:

- о Договорах, стороной по которым является Участник клиринга;
- о размере Обеспечения Участника клиринга в каждой валюте / каждом товаре;
- о размере Единого лимита по Расчетному коду;
- о значении Нетто-обязательства и/или Нетто-требования Участника клиринга по денежным средствам / товарам с каждой Датой исполнения;
- о наличии / отсутствии Маржинального требования Участника клиринга, о сумме Маржинального требования в российских рублях (в случае наличия);
- о наличии / отсутствии Задолженности Участника клиринга перед Клиринговым центром, о сумме Задолженности Участника клиринга (в случае наличия).

22.2. Кроме отчетов, предусмотренных общей частью Правил клиринга, Клиринговый центр формирует следующие отчеты по итогам клиринга для Участников клиринга:

- Выписку из реестра Договоров, принятых в клиринг, содержащую информацию о допущенных к клирингу обязательствах по Договорам;
- Отчет об Итоговых нетто-обязательствах / Итоговых нетто-требованиях по денежным средствам, содержащий информацию об обязательствах в денежных средствах, определенных по результатам клиринга;
- Отчет об обязательствах, которые будут прекращены, содержащий информацию об Итоговых нетто-обязательствах / Итоговых нетто-требованиях по денежным средствам в Дату исполнения второй части сделки своп, заключенной в случае наличия у Участника клиринга Итогового нетто-обязательства по денежным средствам, для исполнения которого недостаточно денежных средств;
- Отчет об Обеспечении, содержащий информацию о размере Обеспечения в товарах и об изменении размера Обеспечения, включая информацию об использовании Обеспечения, в том числе для исполнения обязательств, определенных по итогам клиринга;
- Отчет о комиссионных вознаграждениях;
- Отчет о Торгово-клиринговых счетах Участника клиринга.

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

В случае несоответствия информации, полученной Участником клиринга с использованием Клиринговой системы, и информации, содержащейся в полученном от Клирингового центра Отчете об Итоговых нетто-обязательствах /

Итоговых нетто-требованиях по денежным средствам, исполнения обязательств должно осуществляться Участником клиринга на основании указанного отчета.

## **РАЗДЕЛ VIII. ПРОЧИЕ УСЛОВИЯ**

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

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

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

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

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

23.3. После завершения процедуры Перевода обязательств и Обеспечения Клиринговый центр закрывает Торгово-клиринговые счета, открытые Базовым Участником клиринга для Обособленного клиента.

### **Статья 24. Порядок выставления счетов-фактур**

24.1. Участник клиринга – продавец, являющийся стороной по Договору, предметом которых является товар, реализация которого признается объектом налогообложения налогом на добавленную стоимость в соответствии с главой 21 Налогового кодекса Российской Федерации, заключенному от имени такого Участника клиринга и за счет такого Участника клиринга или от имени такого Участника клиринга и за счет клиента, являющегося налогоплательщиком налога

на добавленную стоимость, составляет и выставляет Клиринговому центру счета-фактуры в электронной форме в порядке, определенном документом Биржи, определяющим порядок организации обмена счетами-фактурами между участниками торгов на товарном рынке Биржи.

**Приложение № 1**  
к Правилам клиринга на товарном рынке

**Временной регламент на товарном рынке**

№ п/п	Наименование операции	Время (москowsкое)
<b>1.</b>	<b>Время (сроки) проведения клиринговых операций в Клиринговой системе товарного рынка</b>	
1.1.	Проведение клиринговой сессии mark-to-market.	до 10:00 Расчетного дня
1.2.	Заключение закрывающих Договоров в случае неисполнения Участником клиринга Маржинального требования.	с 15:00 дня возникновения Маржинального требования
1.3.	Заключение закрывающих форвардных договоров в случае наличия у Участника клиринга обязательств по передаче товаров по форвардному договору, для исполнения которых недостаточно товаров.	с 10:00 до 16:00
1.4.	Заключение закрывающих форвардных договоров и закрывающих своп договоров при наличии у Участника клиринга Итогового нетто-обязательства в российских рублях, для исполнения которого недостаточно денежных средств, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, в Дату исполнения второй части сделки своп, заключенной в случае наличия у Участника клиринга Итогового нетто-обязательства по денежным средствам, для исполнения которого недостаточно денежных средств.	с 15:00
1.5.	Заключение своп договоров в случае наличия у Участника клиринга Итоговых нетто-обязательств по денежным средствам, для исполнения которых недостаточно денежных средств.	с 17:00 <sup>1</sup> до 17:05 <sup>1</sup>
<b>2.</b>	<b>Время (сроки) внесения и возврата Обеспечения</b>	
2.1.	Прием Клиринговым центром от Участников клиринга Запросов на возврат обеспечения и Запросов на депонирование.	до 17:05 Расчетного дня
2.2.	Исполнение Постоянных поручений на возврат обеспечения, содержащих признак, указывающий на необходимость возврата всей доступной суммы денежных средств в:	
	- российских рублях.	17:05
2.3.	Возврат Клиринговым центром Участникам клиринга денежных средств, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга, на основании Запроса на возврат обеспечения / Постоянного поручения на возврат обеспечения.	в являющийся Расчетным днем день получения Запроса на возврат обеспечения / в Расчетный день
<b>3.</b>	<b>Сроки определения и исполнения обязательств</b>	



№ п/п	Наименование операции	Время (москowsкое)
3.1.	Исполнение Маржинальных требований.	до 15:00 дня возникновения Маржинального требования
3.2.	Проверка наличия Обеспечения в товарах, необходимого для исполнения обязательств по передаче товаров по форвардному договору.	10:00 Расчетного дня, предшествующего Дате исполнения обязательств по форвардному договору на количество Расчетных дней, установленное решением Клирингового центра
3.3.	Определение Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований по денежным средствам в Дату исполнения второй части сделки своп, заключенной в случае наличия у Участника клиринга Итогового нетто-обязательства по денежным средствам, для исполнения которого недостаточно денежных средств.	15:00 Даты исполнения
3.4.	Исполнение Участником клиринга Итоговых нетто-обязательств по денежным средствам в Дату исполнения второй части сделки своп, заключенной в случае наличия у Участника клиринга Итогового нетто-обязательства по денежным средствам, для исполнения которого недостаточно денежных средств.	15:00 Даты исполнения
3.5.	Определение Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований по денежным средствам.	16:00 Даты исполнения
3.6.	Исполнение Участником клиринга Итоговых нетто-обязательств по денежным средствам.	до 17:00 <sup>1</sup> Даты исполнения
3.7.	Исполнение Участником клиринга обязательств по уплате транспортного дифференциала.	до 17:00 <sup>1</sup> Даты исполнения
<b>4.</b>	<b>Сроки предоставления отчетов по итогам клиринга</b>	
4.1.	Передача Клиринговым центром Участникам клиринга Отчета об обязательствах, которые будут прекращены.	с 10:00 до 10:15 Даты исполнения
4.2.	Передача Клиринговым центром Участникам клиринга Выписок из реестра Договоров, принятых в клиринг, и Отчетов об Итоговых нетто-обязательствах / Итоговых нетто-требованиях по денежным средствам.	с 16:00 до 16:15 Даты исполнения
4.3.	Передача Клиринговым центром Участникам клиринга Отчетов о комиссионных вознаграждениях, Отчетов о Торгово-клиринговых счетах Участника клиринга, Отчетов о клиринговых идентификаторах.	с 18:15 до 18:30

<b>№ п/п</b>	<b>Наименование операции</b>	<b>Время (московское)</b>
4.4.	Передача Клиринговым центром Участникам клиринга Выписок из реестра Договоров, принятых в клиринг и Отчетов об Итоговых нетто-обязательствах / Итоговых нетто-требованиях по денежным средствам по итогам заключения своп договоров в случае наличия Итоговых нетто-обязательств по денежным средствам, для исполнения которых недостаточно денежных средств.	с 18:15 до 18:30 <sup>1</sup> Расчетного дня
4.5.	Передача Клиринговым центром Участникам клиринга Отчетов об Обеспечении.	с 18:30 до 18:45

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



Пропитано, пронумеровано и скреплено печатью  
50 ( пятьдесят ) лист 66  
Председатель Правления НКО НКЦ (АО)

Э.В. Астагин  
« 5 » октября 2020 г.