

УТВЕРЖДЕНЫ

решением Наблюдательного совета
НКО НКЦ (АО)

от «11» февраля 2025 года (Протокол №15)

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

Москва, 2025 г.

СОДЕРЖАНИЕ

| | |
|---|----|
| РАЗДЕЛ I. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ | 5 |
| Статья 1. Термины и определения | 5 |
| Статья 2. Общие положения | 10 |
| Статья 3. Условия и порядок заключения / расторжения договора об имущественном пуле | 13 |
| Статья 4. Порядок формирования и прекращения имущественного пула..... | 14 |
| Статья 5. Права владельца клирингового сертификата участия | 15 |
| Статья 6. Торговые и клиринговые счета..... | 17 |
| Статья 7. Клиринговые регистры | 18 |
| РАЗДЕЛ II. ТРЕБОВАНИЯ К УЧАСТНИКАМ КЛИРИНГА | 23 |
| Статья 8. Условия клирингового обслуживания. Порядок предоставления допуска к клиринговому обслуживанию | 23 |
| Статья 9. Особенности приостановления допуска к клиринговому обслуживанию | 26 |
| Статья 10. Требования к Держателям. Порядок получения (лишения) статуса Держателя | 27 |
| Статья 11. Особенности открытия и порядок закрытия Торгово-клиринговых счетов Участника клиринга, порядок использования Торгово-клиринговых счетов 2-го и 3-го уровней, а также порядок аннулирования связи Расчетного кода и Раздела | 29 |
| Статья 12. Особенности открытия и порядок закрытия Торгово-клиринговых счетов имущественного пула | 32 |
| Статья 13. Особенности регистрации Обособленных клиентов | 33 |
| РАЗДЕЛ III. МЕРЫ, НАПРАВЛЕННЫЕ НА УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ ПРИ ОСУЩЕСТВЛЕНИИ КЛИРИНГА | 34 |
| Статья 14. Перечень мер, направленных на управление рисками при осуществлении клиринга | 34 |
| Статья 15. Перечень мер, направленных на управление рисками по операциям с клиринговыми сертификатами участия..... | 35 |
| Статья 16. Единый лимит по пулу | 36 |
| РАЗДЕЛ IV. ПОРЯДОК И УСЛОВИЯ ДОПУСКА ОБЯЗАТЕЛЬСТВ К КЛИРИНГУ | 39 |
| ПОДРАЗДЕЛ IV-I. ПОРЯДОК ЗАКЛЮЧЕНИЯ ВНЕБИРЖЕВЫХ СДЕЛОК С ЦЕННЫМИ БУМАГАМИ | 39 |
| Статья 17. Возможность заключения Внебиржевых сделок с ценными бумагами .. | 39 |
| Статья 18. Порядок заключения Внебиржевых сделок с ценными бумагами | 39 |
| ПОДРАЗДЕЛ IV-II. ПОРЯДОК ВЗАИМОДЕЙСТВИЯ С БИРЖЕЙ ПРИ ЗАКЛЮЧЕНИИ СДЕЛОК | 50 |
| Статья 19. Порядок взаимодействия с ПАО Московская Биржа при подаче заявок и заключении сделок, допуске к клирингу обязательств по биржевым сделкам, договорам М-Депозита, и обязательств по внесению компенсационных взносов | 50 |
| Статья 20. Процедура контроля обеспечения по сделкам | 55 |
| ПОДРАЗДЕЛ IV-III. ОСОБЕННОСТИ ОПРЕДЕЛЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ ПО СДЕЛКАМ | 62 |

| | |
|--|-----------|
| Статья 21. Особенности определения обязательств по сделкам РЕПО и кредитным договорам, порядок определения обязательств по уплате компенсационного взноса . | 62 |
| Статья 22. Особенности определения обязательств по депозитным договорам | 74 |
| РАЗДЕЛ V. ПОРЯДОК ПРОВЕДЕНИЯ КЛИРИНГА | 79 |
| ПОДРАЗДЕЛ V-I. ПОРЯДОК ВЫДАЧИ И ПОГАШЕНИЯ КЛИРИНГОВЫХ СЕРТИФИКАТОВ УЧАСТИЯ..... | 79 |
| Статья 23. Порядок внесения имущества в имущественный пул. Порядок выдачи клиринговых сертификатов участия | 79 |
| Статья 24. Порядок выдачи имущества из имущественного пула. Порядок погашения клиринговых сертификатов участия | 84 |
| Статья 25. Порядок замены имущества в имущественном пуле..... | 88 |
| ПОДРАЗДЕЛ V-II. КЛИРИНГОВЫЕ СЕССИИ | 89 |
| Статья 26. Особенности проведения клиринговой сессии mark-to-market. Порядок возникновения и исполнения Маржинальных требований по пулу | 89 |
| ПОДРАЗДЕЛ V-III. ПОРЯДОК ВКЛЮЧЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ В КЛИРИНГОВЫЙ ПУЛ | 93 |
| Статья 27. Общие требования к порядку исполнения обязательств по сделкам и обязательств по внесению компенсационных взносов | 93 |
| Статья 28. Порядок подачи и условия регистрации Отчетов на исполнение | 99 |
| Статья 29. Порядок подачи и условия исполнения поручений на исполнение второй части Сделки РЕПО с открытой датой | 103 |
| Статья 30. Проверки, выполняемые при подаче Отчетов на исполнение, Специальных отчетов на исполнение, Срочных отчетов на исполнение, поручений на внесение компенсационных взносов, поручений на отказ от компенсационных взносов, Поручений на отказ от исполнения сделки РЕПО / Поручений на отказ от исполнения сделки купли-продажи ценных бумаг / поручений на исполнение второй части Сделки РЕПО с открытой датой | 105 |
| Статья 31. Порядок подачи и условия регистрации поручений на внесение компенсационных взносов и поручений на отказ от компенсационных взносов | 108 |
| Статья 32. Порядок подачи и исполнения Поручений на отказ от исполнения сделки РЕПО / Поручений на отказ от исполнения кредитного договора / Поручений на отказ от исполнения сделки купли-продажи ценных бумаг..... | 109 |
| Статья 33. Порядок подачи и условия регистрации Специальных и/или Срочных отчетов на исполнение | 111 |
| Статья 34. Порядок определения и включения в клиринговый пул обязательств Участников клиринга по уплате Возмещения | 114 |
| Статья 35. Порядок включения в клиринговый пул и исполнения обязательств по депозитным договорам..... | 115 |
| Статья 36. Возврат части депозита до наступления Даты исполнения обязательств по возврату депозита | 121 |
| Статья 37. Порядок включения в клиринговый пул обязательств по договорам М-Депозита | 129 |
| Статья 38. Порядок подачи и условия исполнения Поручений на изменение срока исполнения обязательств по сделке | 131 |

| | |
|--|------------|
| Статья 39. Особенности возврата Обеспечения Участникам клиринга категории «К» | 132 |
| Статья 40. Порядок подачи и условия исполнения Поручений на отказ от исполнения сделки РЕПО с кодом расчетов Y0/Yn, Ym/Yn, Ym/YODn, T0/YODn ... | 133 |
| ПОДРАЗДЕЛ V-IV. ПОРЯДОК ДЕЙСТВИЙ В СЛУЧАЯХ НЕИСПОЛНЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ | 139 |
| Статья 41. Порядок выкупа клиринговых сертификатов участия у Банка России | 139 |
| Статья 42. Порядок действий в случае неисполнения обязательств по сделкам, заключенным без участия центрального контрагента | 141 |
| Статья 43. Процедура урегулирования взаимных требований по сделкам, заключенным без участия центрального контрагента | 144 |
| Статья 44. Порядок определения размера Фиксированного возмещения..... | 148 |
| ПОДРАЗДЕЛ V-V. ПОРЯДОК ИСПОЛНЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ, ВКЛЮЧЕННЫХ В КЛИРИНГОВЫЙ ПУЛ | 150 |
| Статья 45. Порядок исполнения обязательств и требований Участников клиринга и Клирингового центра, включенных в клиринговый пул | 150 |
| ПОДРАЗДЕЛ V-VI. ОСОБЕННОСТИ ВЗАИМОДЕЙСТВИЯ С РАСЧЕТНОЙ ОРГАНИЗАЦИЕЙ И РАСЧЕТНЫМ ДЕПОЗИТАРИЕМ | 156 |
| Статья 46. Особенности взаимодействия с Расчетной организацией | 156 |
| Статья 47. Особенности взаимодействия с Расчетным депозитарием | 157 |
| ПОДРАЗДЕЛ V-VII. ПОРЯДОК ПЕРЕДАЧИ ДОХОДА | 160 |
| Статья 48. Порядок передачи Доходов по сделкам РЕПО и сделкам купли-продажи ценных бумаг, заключенным с Клиринговым центром | 160 |
| Статья 49. Порядок передачи Доходов по сделкам РЕПО, заключенным с Банком России без участия центрального контрагента в отдельных Режимах торгов | 167 |
| РАЗДЕЛ VI. ПОРЯДОК ОПЛАТЫ УСЛУГ. ОТЧЕТЫ ПО ИТОГАМ КЛИРИНГА | 170 |
| Статья 50. Особенности оплаты услуг Клирингового центра, Биржи и Технического центра | 170 |
| Статья 51. Порядок представления информации и отчетов по итогам клиринга .. | 174 |
| РАЗДЕЛ VII. ПРОЧИЕ УСЛОВИЯ | 181 |
| Статья 52. Особенности Перевода обязательств и Обеспечения одного Участника клиринга другому Участнику клиринга | 181 |
| Статья 53. Порядок действий при возникновении обстоятельств, которые могут повлиять на возможность заключения Внебиржевых сделок с ценными бумагами .. | 182 |
| Приложение № 1 Документы, предоставляемые юридическим лицом для получения статуса Держателя | 183 |
| Приложение № 2 Временной регламент на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов | 195 |
| Приложение № 3 Порядок изменения значений клиринговых регистров Счет обеспечения T0 и Торгово-клиринговый счет T0..... | 198 |

РАЗДЕЛ I. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ

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

Статья 1. Термины и определения

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

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

| | |
|--|--|
| исполнения - | |
| Держатель - | организация, получившая статус Держателя в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов с целью использования ценных бумаг, учитываемых на торговых счетах депо номинального держателя / торговых счетах депо иностранного номинального держателя, открытых такому Держателю, для проведения Клиринговым центром Процедуры контроля обеспечения по сделкам и расчетов по итогам клиринга сделок Участников клиринга, депозитарное обслуживание которых и/или их клиентов осуществляется Держателем. |
| Депозитный договор (депозит) - | депозитный договор, заключаемый в порядке, установленном Правилами торгов на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, являющийся договором банковского вклада (депозита). |
| Договор М- Депозита - | договор банковского вклада (депозита), заключаемый в соответствии с Правилами проведения депозитных аукционов на рынке «М-Депозиты». |
| Доход - | суммы денежных средств или количество ценных бумаг, рассчитанные в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов исходя из соответствующих сумм любых дивидендов, процентов, выплат части номинальной стоимости, доходов или иных распределений на ценные бумаги, являющиеся объектом сделок, заключенных с Клиринговым центром, или сделок РЕПО с Банком России, заключенных без участия центрального контрагента в отдельных Режимах торгов. По сделкам РЕПО с Банком России, заключенным без участия центрального контрагента, передача номинальной стоимости при полном досрочном погашении облигаций не является Доходом. |
| Единый лимит по пулу - | величина, рассчитываемая Клиринговым центром в российских рублях по каждому Расчетному коду имущественного пула Участника клиринга в целях контроля за соответствием стоимости имущества, внесенного в соответствующий имущественный пул и учитываемого по такому Торгово-клиринговому счету, количеству выданных клиринговых сертификатов участия. |
| Клиринговый пул для М-Депозитов - | клиринговый пул, состоящий из подлежащих исполнению в дату формирования клирингового пула обязательств по внесению и возврату денежных средств по договорам М-Депозита. |
| Клиринговый пул для расчетов в ходе торгов - | клиринговый пул, состоящий из подлежащих исполнению в дату формирования клирингового пула обязательств по сделке с ценными бумагами с кодом расчетов Z0, X0 или из обязательств по сделкам, включенным в Срочный отчет на исполнение. |
| Клиринговый пул для расчетов по обязательствам по | клиринговый пул, состоящий из подлежащих исполнению в дату формирования клирингового пула обязательств по внесению депозитов. |

| | |
|--|---|
| внесению депозитов - | |
| Клиринговый пул для расчетов по обязательствам по возврату депозитов - | клиринговый пул, состоящий из подлежащих исполнению в дату формирования клирингового пула обязательств по возврату депозитов. |
| Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов - | клиринговый пул, состоящий из обязательств по сделкам и обязательств, возникших по итогам клиринга, подлежащих исполнению в определенный Правилами клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов момент времени в дату формирования клирингового пула. |
| Клиринговый пул для расчетов в ходе торгов по сделкам с центральным контрагентом - | клиринговый пул, состоящий из подлежащих исполнению в дату формирования клирингового пула обязательств по сделкам, заключенным с центральным контрагентом и включенным в Срочный отчет на исполнение. |
| Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов по сделкам с центральным контрагентом - | клиринговый пул, состоящий из подлежащих исполнению в определенный Правилами клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов момент времени в дату формирования клирингового пула обязательств по сделкам, заключенным с центральным контрагентом. |
| Код ценной бумаги - | код, позволяющий однозначно идентифицировать ценную бумагу в Клиринговой системе. |
| Компенсационный взнос - | сумма денежных средств или количество ценных бумаг, подлежащие уплате (поставке), в качестве частичного предварительного исполнения обязательств по второй части сделки РЕПО, в размере, определяемом в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, одним Участником клиринга другому Участнику клиринга, являющемуся его контрагентом по сделке РЕПО, условиями которой предусмотрено внесение компенсационных взносов. |
| Кросс-сделки (внебиржевые кросс-сделки) – | Внебиржевые сделки с ценными бумагами, заключаемые в Клиринговой системе на основании Предложений, поданных за счет одного и того же лица. |
| Маржинальное требование по пулу - | требование Клирингового центра к Участнику клиринга, являющемуся Участником пула, о внесении дополнительного имущества в имущественный пул, предъявляемое в порядке и случаях, определенных Правилами клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов. |
| Нетто-обязательство по денежным средствам | обязательство Участника клиринга или Клирингового центра по оплате / передаче ценных бумаг, возникшее в связи с прекращением всех обязательств, включенных в клиринговый |

| | |
|--|--|
| <i>/ ценным бумагам по сделкам клирингового пула -</i> | пул, в результате неттинга в ходе клиринга в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, определяемое в отношении Расчетного кода / Торгово-клирингового счета Участника клиринга (Клирингового центра). |
| <i>Нетто-требование по денежным средствам / ценным бумагам по сделкам клирингового пула -</i> | требование Участника клиринга или Клирингового центра по оплате / передаче ценных бумаг, возникшее в связи с прекращением всех обязательств, включенных в клиринговый пул, в результате неттинга в ходе клиринга в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, определяемое в отношении Расчетного кода / Торгово-клирингового счета Участника клиринга (Клирингового центра). |
| <i>Отчет на исполнение -</i> | поручение Участника клиринга, направляемое Клиринговому центру с использованием Клиринговой системы в форме электронного сообщения, подписанного ПЭП Участника клиринга, и инициирующее включение обязательств по сделке с ценными бумагами, в том числе по первой/второй части сделки РЕПО, и/или обязательств по кредитному договору в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов / в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов по сделкам с центральным контрагентом. |
| <i>Отчет на исполнение специальный / Специальный отчет на исполнение -</i> | поручение Участника клиринга, направляемое Клиринговому центру с использованием Клиринговой системы в форме электронного сообщения, подписанного ПЭП Участника клиринга, и инициирующее включение обязательств по нескольким сделкам с ценными бумагами, в том числе по первым/вторым частям сделок РЕПО, и/или обязательств по внесению компенсационных взносов, и/или обязательств по кредитному договору в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов / в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов по сделкам с центральным контрагентом. |
| <i>Отчет на исполнение срочный / Срочный отчет на исполнение -</i> | поручение Участника клиринга, направляемое Клиринговому центру с использованием Клиринговой системы в форме электронного сообщения, подписанного ПЭП Участника клиринга, и инициирующее включение обязательств по одной или нескольким сделкам с ценными бумагами, в том числе по первым/вторым частям сделок РЕПО, и/или обязательств по внесению компенсационных взносов, и/или обязательств по кредитному договору в Клиринговый пул для расчетов в ходе торгов / в Клиринговый пул для расчетов в ходе торгов по сделкам с центральным контрагентом. |
| <i>Период регистрации поручений -</i> | период расчетного дня, установленный в соответствии с Временным регламентом на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, в течение которого Клиринговый центр регистрирует поручения от Участников клиринга и/или Клиринговых организаций. |
| <i>Платежный агент -</i> | юридическое лицо, осуществляющее в соответствии с договором, заключенным с эмитентом, или решением о выпуске |

| | |
|---|---|
| | погашение облигаций и(или) выплату (передачу) доходов по облигациям, или Расчетный депозитарий. |
| Поручение на внесение компенсационного взноса - | поручение Участника клиринга, направляемое Клиринговому центру с использованием Клиринговой системы в форме электронного сообщения, подписанного ПЭП Участника клиринга, и иницирующее включение обязательства по внесению компенсационного взноса в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов. |
| Поручение на отказ от компенсационного взноса - | поручение Участника клиринга, / направляемое Клиринговому центру с использованием Клиринговой системы в форме электронного сообщения, подписанного ПЭП Участника клиринга, с целью отказа от получения компенсационного взноса. |
| Правила проведения депозитных аукционов - | Правила проведения депозитных аукционов на рынке «М-Депозиты», утверждаемые ПАО Московская Биржа. |
| Процедура контроля обеспечения по сделке с ценными бумагами / Процедура контроля обеспечения - | механизм контроля достаточности индивидуального клирингового обеспечения Участника клиринга для обеспечения исполнения обязательств по денежным средствам и/или ценным бумагам, осуществляемого при подаче заявки на заключение сделки с ценными бумагами / кредитного договора или при заключении сделки / кредитного договора или при регистрации заявки, являющейся допустимой встречной к Котировке участника торгов. |
| Регламент открытия, закрытия и блокировки Торгово-клиринговых счетов - | внутренний документ Клирингового центра, устанавливающий порядок кодификации и открытия в Клиринговой системе Торгово-клиринговых счетов, особенности проведения операций, осуществляемых в Клиринговой системе в соответствии с Правилами клиринга, а также порядок блокировки и закрытия Торгово-клиринговых счетов. Регламент открытия, закрытия и блокировки Торгово-клиринговых счетов раскрывается на Сайте Клирингового центра. |
| Сделка - | биржевая сделка, внебиржевая сделка. |
| Текущее значение дисконта (далее также – текущий дисконт) - | переменная величина, выраженная в процентах и отражающая соотношение между суммой текущего обязательства (в денежном выражении) Участника клиринга – продавца по первой части сделки РЕПО и рыночной стоимостью ценных бумаг, составляющих текущее обязательство Участника клиринга – покупателя по первой части сделки РЕПО, которая каждый торговый день рассчитывается в Клиринговой системе по заключенной сделке РЕПО в течение срока сделки РЕПО (если условиями этой сделки РЕПО предусмотрены максимальные и минимальные предельные значения дисконта). |
| Участник пула - | Участник клиринга, внесший имущество в имущественный пул. |

Статья 2. Общие положения

- 2.1. Клиринговый центр осуществляет клиринг, выполняя функции центрального контрагента по:
- биржевым сделкам купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов T0 (за исключением сделок размещения и выкупа), Yn, Nn;
 - сделкам РЕПО с кодом расчетов T0/Yn, Ym/Yn, T0/YODn, Ym/YODn;
 - депозитным договорам с кодом расчетов Ym/Yn;
 - внебиржевым сделкам купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов T0 (за исключением случаев, установленных пунктом 2.2 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов), Yn.
- 2.2. Клиринговый центр осуществляет клиринг без выполнения функций центрального контрагента по:
- сделкам купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов Bn, B0-B30, Z0, X0;
 - внебиржевым сделкам купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов T0, заключаемым в режимах «Размещение: Адресные сделки» и «Выкуп: Адресные сделки»;
 - сделкам РЕПО с кодом расчетов Rb, Sn, Z0;
 - сделкам размещения и выкупа с кодом расчетов T0, Z0, X0, Bn;
 - кредитным договорам с кодом расчетов Rb, Sn;
 - договорам М-Депозита с кодом расчетов Sn.
- 2.3. Клиринговый центр осуществляет клиринг с частичным обеспечением, клиринг с полным обеспечением и клиринг без предварительного обеспечения.
- 2.4. Клиринговый центр осуществляет клиринг с частичным обеспечением по следующим сделкам, стороной по которым является Участник клиринга категории «О», «Б» или «Б2»:
- сделкам купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов Yn, Nn;
 - сделкам РЕПО с кодом расчетов Ym/Yn, Ym/YODn;
 - депозитным договорам с кодом расчетов Ym/Yn;
 - вторым частям сделок РЕПО с кодом расчетов T0/Yn, T0/YODn.
- 2.5. Клиринговый центр осуществляет клиринг с полным обеспечением по:
- сделкам купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов T0, Z0, X0;
 - первым частям сделок РЕПО с кодом расчетов T0/Yn, Rb, Z0;
 - сделкам размещения и выкупа с кодом расчетов T0, Z0, X0;
 - сделкам, перечисленным в пункте 2.4 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, стороной по которым является Участник клиринга категории «В»;
 - операции выдачи кредита по кредитному договору с кодом расчетов Rb.
- 2.6. Клиринговый центр осуществляет клиринг без предварительного обеспечения по:
- сделкам купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов Bn, B0-B30;
 - сделкам РЕПО с кодом расчетов Sn;

- вторым частям сделок РЕПО с кодом расчетов Rb, Z0;
 - сделкам размещения и выкупа с кодом расчетов Vn;
 - сделкам, стороной по которым является Участник клиринга категории «К»;
 - сделкам, стороной по которым является Участник клиринга категории «А», если Правилами клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов и/или договором, заключенным с таким Участником клиринга, не установлен иной порядок осуществления клиринга;
 - кредитным договорам с кодом расчетов Sn;
 - операции возврата кредита по кредитному договору с кодом расчетов Rb;
 - договорам М-Депозита с кодом расчетов Sn.
- 2.7. Клиринговый центр осуществляет клиринг по сделкам с ценными бумагами, депозитным и кредитным договорам, заключенным с расчетами в российских рублях или в иностранной валюте.
- 2.8. Клиринговый центр не осуществляет клиринг по сделкам с ценными бумагами, депозитным и кредитным договорам с кодами расчетов, отличными от кодов расчетов, предусмотренных Правилами торгов на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.
- 2.9. Расчеты по результатам клиринга осуществляются в ходе торгов и по итогам торгов.
- 2.10. Порядок и сроки внесения и возврата Обеспечения определены общей частью Правил клиринга.
- 2.11. Способы обеспечения исполнения обязательств, допущенных к клирингу, установлены общей частью Правил клиринга. Имущество, составляющее имущественный пул, сформированный Клиринговым центром в соответствии со статьей 4 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, также является обеспечением исполнения обязательств, допущенных к клирингу.
- 2.11.1. Имущество, составляющее (внесенное в) имущественный пул, является обеспечением исполнения следующих обязательств с учетом положений пункта 23.12 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов:
- 1) обязательств по договору об имущественном пуле;
 - 2) допущенных к клирингу обязательств по Сделкам.
- 2.11.2. Способом обеспечения исполнения обязательств по сделкам РЕПО и кредитным договорам, заключенным без участия центрального контрагента, является Фиксированное возмещение.
- 2.12. Перечень видов используемых в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов торговых и клиринговых счетов, предназначенных для внесения ценных бумаг / денежных средств в качестве Обеспечения / в имущественный пул, приведен в статье 6 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.
- 2.13. Сроки определения и исполнения обязательств, указанных в Правилах клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, время проведения клиринговых сессий, а также сроки проведения клиринговых операций, сроки

предоставления документов Клиринговому центру / Клиринговым центром в процессе взаимодействия с Участниками клиринга при проведении клиринга и расчетов по сделкам в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов установлены Временным регламентом на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, являющимся приложением № 2 к Правилам клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.

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

- 2.14. Операции по объединению выпусков эмиссионных ценных бумаг и/или аннулированию индивидуальных номеров (кодов) дополнительных выпусков эмиссионных ценных бумаг осуществляются в Клиринговой системе на следующий Расчетный день после получения соответствующего уведомления от Расчетного депозитария и по окончании расчетов по сделкам с ценными бумагами по итогам клиринга этого дня. Проведение операций по объединению выпусков эмиссионных ценных бумаг и/или аннулированию индивидуальных номеров (кодов) дополнительных выпусков эмиссионных ценных бумаг в Клиринговой системе сопровождается корректировкой информации по сделкам с ценными бумагами, в том числе по сделкам РЕПО, Дата исполнения которых еще не наступила. Коды объединяемых выпусков ценных бумаг в реквизитах указанных сделок заменяются кодом объединенного выпуска, а аннулируемый код дополнительного выпуска ценных бумаг - кодом выпуска, по отношению к которому данный выпуск является дополнительным.
- 2.15. Техническим центром на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов является ПАО Московская Биржа.
- 2.16. Участник клиринга, не совпадающий в одном лице с Участником торгов, соглашается с тем, что условия договоров, заключаемых на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, стороной по которым является (будет являться) Участник клиринга, содержатся, в том числе, в заявках / Котировках участника торгов, подаваемых Участником торгов с указанием в качестве стороны по договору Участника клиринга, и /или Правилах торгов на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, либо определяются в соответствии с указанными документами.
- 2.17. Участник клиринга, совпадающий в одном лице с Участником торгов, соглашается с тем, что Клиринговый центр посредством Системы торгов передает Бирже информацию о сумме денежных средств на Торгово-клиринговом счете Участника клиринга, совпадающего в одном лице с Участником торгов, указываемом при подаче заявок, входящих в Алгоритмический пакет заявок (пакет заявок), подаваемых Участником торгов в Подсистеме обработки алгоритмических пакетов заявок Московской Биржи, в порядке и на условиях, предусмотренных Правилами торгов на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.

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

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

- порядок формирования и прекращения имущественного пула (определен статьей 4 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов);
- права владельца клирингового сертификата участия (определены статьей 5 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов);
- права и обязанности Участников пула и Клирингового центра (определены Правилами клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов);
- порядок и условия выдачи клиринговых сертификатов участия (определены статьей 23 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов);
- порядок и условия погашения клиринговых сертификатов участия (определены статьей 24 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов);
- порядок замены имущества в имущественном пуле (определен статьей 25 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов);
- порядок внесения в клиринговые регистры записей о внесенном в имущественный пул имуществе (определен в соответствующих статьях разделов IV-V Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов);
- порядок раскрытия и (или) предоставления информации об имущественном пуле (определен статьей 51 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов).

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

Договор об имущественном пуле считается заключенным с даты исполнения Клиринговым центром первого запроса на открытие Расчетного кода, содержащегося в Запросе на открытие Торгово-клирингового счета имущественного пула / Запросе на открытие Расчетного кода имущественного пула, направленном Участником клиринга в Клиринговый центр.

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

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

- 3.4. Номинальная стоимость одного клирингового сертификата участия составляет 1 (один) российский рубль.
- 3.5. Клиринговый центр вправе использовать в своих интересах денежные средства, включенные в состав имущественного пула, с учетом ограничений, установленных внутренним документом Клирингового центра, определяющим критерии размещения временно свободных денежных средств Клирингового центра, в том числе путем перевода денежных средств на корреспондентские счета Клирингового центра, используемые для учета (хранения) денежных средств, включенных в состав имущественного пула.
- Доходы от такого использования указанных денежных средств не включаются в состав имущественного пула.

Статья 4. Порядок формирования и прекращения имущественного пула

- 4.1. Клиринговый центр вправе принять решение о формировании имущественного пула, которое содержит:
- код (индивидуальное обозначение) имущественного пула;
 - наименование депозитария, осуществляющего централизованное хранение клиринговых сертификатов участия и учет прав на них;
 - дату начала формирования имущественного пула.
- 4.2. Решение Клирингового центра о формировании имущественного пула публикуется на Сайте Клирингового центра не позднее, чем за 5 (пять) календарных дней до даты начала формирования имущественного пула.
- 4.3. Клиринговый центр вправе вносить изменения в решение о формировании имущественного пула. Решение Клирингового центра о внесении изменений в решение о формировании имущественного пула публикуется на Сайте Клирингового центра и вступает в силу через 5 (пять) календарных дней с даты такого опубликования, если в самом решении не указан иной срок вступления его в силу.
- 4.4. Клиринговый центр вправе сформировать несколько имущественных пулов.
- 4.5. Перечень имущества, которое может быть внесено в каждый имущественный пул, состоит из ценных бумаг, драгоценных металлов и денежных средств, в том числе в иностранной валюте.
- 4.5.1. Перечень иностранных валют и драгоценных металлов, принимаемых в каждый из имущественных пулов, устанавливается решением Клирингового центра и раскрывается на Сайте Клирингового центра в виде информации об иностранных валютах и драгоценных металлах, принимаемых в каждый из имущественных пулов.
- 4.5.2. Включение ценной бумаги в каждый из имущественных пулов (за исключением имущественных пулов, в которые принимаются ценные бумаги, не принимаемые Клиринговым центром в качестве обеспечения исполнения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением) осуществляется одновременно при включении такой ценной бумаги в Перечень ценных бумаг, принимаемых в качестве обеспечения исполнения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением, в порядке, установленном общей частью Правил клиринга, без решения Клирингового центра.

В случае исполнения Клиринговым центром направляемого Участником клиринга в соответствии с общей частью Правил клиринга Запроса на изменение расширенного списка обеспечения, в котором указан соответствующий Торгово-клиринговому счету имущественного пула Торгово-клиринговый счет Участника клиринга, ценные бумаги, включенные в расширенный список обеспечения, считаются принимаемыми в имущественный пул по указанному в настоящем подпункте Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов Торгово-клиринговому счету имущественного пула.

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

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

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

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

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

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

Статья 5. Права владельца клирингового сертификата участия

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

Требование о погашении клиринговых сертификатов участия считается предъявленным Участником пула Клиринговому центру при подаче Участником

пула Запроса на возврат обеспечения, Запроса на перевод обеспечения или распоряжения на перевод денежных средств / драгоценных металлов / ценных бумаг в целях выдачи имущества из имущественного пула в соответствии со статьей 24 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.

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

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

- 5.1.1. В случае отзыва (аннулирования) у Участника пула лицензии на осуществление банковских операций, или принятия арбитражным судом решения о введении в отношении Участника пула одной из процедур банкротства, или при проведении ликвидационного неттинга в отношении Участника пула по иным основаниям, указанным в общей части Правил клиринга, прекращение обязательств по договору об имущественном пуле осуществляется в ходе ликвидационного неттинга в отношении Участника пула, проводимого в соответствии с общей частью Правил клиринга.
- 5.1.2. В случае отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций прекращение обязательств по договору об имущественном пуле осуществляется в ходе ликвидационного неттинга в отношении Клирингового центра, проводимого в соответствии с общей частью Правил клиринга.
- 5.2. Владелец клирингового сертификата участия, не являющийся Участником пула, вправе потребовать от Клирингового центра погашения принадлежащих ему клиринговых сертификатов участия и выплаты денежных средств в размере номинальной стоимости клиринговых сертификатов участия в случае отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций.
- 5.3. Банк России вправе потребовать от Клирингового центра выкупа его клиринговых сертификатов участия в случае, если Участник клиринга / клиент Участника клиринга, являющийся продавцом по первой части Сделки РЕПО с клиринговыми сертификатами участия, заключенного с Банком России, не исполнил обязательства по второй части Сделки РЕПО, в том числе, в случае прекращения обязательств Участника клиринга по основаниям отзыв (аннулирование) Банком России у Участника клиринга / клиента Участника клиринга, являющегося Кредитной организацией, лицензии на осуществление банковских операций и назначение временной администрации по управлению Участником клиринга - Кредитной организацией в рамках мер по предупреждению банкротства кредитной организации.

Порядок предъявления и исполнения требования о выкупе клиринговых сертификатов участия определен статьей 41 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.

Статья 6. Торговые и клиринговые счета

- 6.1. При осуществлении клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов Клиринговый центр использует следующие виды торговых банковских счетов в российских рублях / иностранных валютах / драгоценных металлах, открытых в Расчетной организации / Клиринговом центре с указанием Клирингового центра в качестве клиринговой организации, которая вправе давать распоряжения по этим счетам:
- торговый банковский счет Участника клиринга / клиента Участника клиринга;
 - специальный брокерский счет Участника клиринга;
 - специальный торговый счет Участника клиринга;
 - торговый банковский счет для учета денежных средств, находящихся в доверительном управлении Участника клиринга;
 - торговый банковский счет в драгоценных металлах, предназначенный для внесения имущества в имущественный пул.
- 6.2. Для использования при осуществлении клиринга торгового банковского счета клиента Участника клиринга Участник клиринга обязан предоставить Клиринговому центру Уведомление об использовании торгового банковского счета клиента Участника клиринга от такого клиента.
- 6.3. Торговые банковские счета используются для внесения денежных средств, предназначенных для обеспечения исполнения и исполнения обязательств по сделкам, за исключением Сделок Т+.
- 6.4. При осуществлении клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов Клиринговый центр использует следующие типы торговых счетов депо, открытых в Расчетном депозитарии с указанием Клирингового центра в качестве клиринговой организации, которая вправе давать распоряжения по этим счетам, а также следующие типы счетов, открытых в Расчетном депозитарии:
- торговый счет депо владельца Участника клиринга, Клирингового центра или клиента Участника клиринга;
 - торговый счет депо владельца типа «С» Участника клиринга;
 - торговый счет депо номинального держателя Участника клиринга или Держателя;
 - торговый счет депо иностранного номинального держателя;
 - торговый счет депо иностранного номинального держателя типа «С» Участника клиринга;
 - торговый счет депо иностранного номинального держателя типа «С» ICSD Участника клиринга;
 - торговый счет депо доверительного управляющего Участника клиринга;
 - торговый счет депо доверительного управляющего типа «С»;
 - счет брокера Участника клиринга;
 - эмиссионный счет эмитента;
 - казначейский счет депо эмитента или Клирингового центра.

- 6.5. При осуществлении клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов Клиринговый центр использует Разделы торговых счетов депо / счетов брокера, открытых в Расчетном депозитарии.
- 6.6. **Раздел T0** – Раздел, являющийся торговым разделом типа «Блокировано для клиринга в НКЦ» торгового счета депо или эмиссионного счета эмитента или счета брокера и используемый для учета ценных бумаг, предназначенных для обеспечения исполнения и исполнения обязательств по сделкам, за исключением Сделок T+.
- 6.7. **Раздел T+** – Раздел, являющийся торговым разделом типа «Блокировано для клиринга в НКЦ. Обеспечение» торгового счета депо, предназначенный для учета Обеспечения в ценных бумагах.
- 6.8. Разделы T0 и T+, открытые в рамках одного торгового счета депо, являются связанными, если коды таких разделов, за исключением первых двух символов, совпадают.
- 6.9. При осуществлении клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов Клиринговый центр использует клиринговые счета, предусмотренные общей частью Правил клиринга, а также:
- клиринговые счета депо, предназначенные для внесения ценных бумаг в соответствующие имущественные пулы.
- Для каждого из имущественных пулов, формируемых Клиринговым центром, используется отдельный клиринговый счет депо.
- 6.10. При осуществлении клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов Клиринговый центр использует следующие типы субсчетов депо к клиринговому счету депо, предназначенному для внесения ценных бумаг в имущественный пул (далее – субсчета депо имущественного пула):
- субсчет депо, открытый владельцу ценных бумаг, которым является Участник клиринга или клиент Участника клиринга;
 - субсчет депо, открытый номинальному держателю, которым является Участник клиринга или Держатель;
 - субсчет депо, открытый иностранному номинальному держателю, которым является Держатель;
 - субсчет депо, открытый доверительному управляющему, которым является Участник клиринга.

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

Статья 7. Клиринговые регистры

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

7.2. **Счет обеспечения T0** – лицевой счет, открытый в Клиринговом центре на балансовом счете № 30420 (30421) «Средства для исполнения обязательств, допущенных к клирингу, для индивидуального клирингового и иного обеспечения» («Средства нерезидентов для исполнения обязательств, допущенных к клирингу, для индивидуального клирингового и иного обеспечения») для учета денежных средств, предназначенных для обеспечения исполнения и исполнения обязательств по сделкам, за исключением Сделок T+.

Счет обеспечения T0 используется в случае, если денежные средства, предназначенные для обеспечения исполнения и/или исполнения обязательств по сделкам, зачисляются на торговый банковский счет Участника клиринга или клиента Участника клиринга.

7.2.1. Счет обеспечения T0 (открывается к торговому банковскому счету Участника клиринга или его клиента.

7.2.2. Счет обеспечения T0 в соответствующей валюте связывается с Расчетным кодом Участника клиринга на основании Запроса на открытие Торгово-клирингового счета, предоставляемого Участником клиринга Клиринговому центру в соответствии с общей частью Правил клиринга или на основании направляемого Участником клиринга в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов Запроса на присвоение Счету обеспечения T0 признака «для М-Депозитов», в случае указания Участником клиринга в таком запросе Расчетного кода Участника клиринга. На основании Запроса на присвоение Счету обеспечения T0 признака «для М-Депозитов» Счет обеспечения T0 может быть связан только с собственным Расчетным кодом Участника клиринга.

7.2.3. С одним Расчетным кодом Участника клиринга может быть связано не более одного Счета обеспечения T0 в каждой валюте.

7.3. В состав Торгово-клиринговых счетов на фондовом рынке входят Расчетный код Участника клиринга / Счет обеспечения T0 и Раздел. В состав Торгово-клиринговых счетов для заключения депозитных договоров может входить Расчетный код Участника клиринга и Раздел или только Расчетный код Участника клиринга. В состав Торгово-клиринговых счетов для заключения договоров М-Депозита могут входить Счета обеспечения T0 и Раздел, или только Счета обеспечения T0.

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

7.3.2. Один Расчетный код Участника клиринга / Счет обеспечения T0 может входить в состав нескольких Торгово-клиринговых счетов.

7.3.3. Допустимые соответствия типов Расчетного кода Участника клиринга / Счетов обеспечения T0 и Раздела в составе Торгово-клирингового счета установлены Регламентом открытия, закрытия и блокировки Торгово-клиринговых счетов.

7.3.4. Расчетный код ДУ, открытый для Обособленного клиента, не может входить в состав Торгово-клирингового счета для заключения депозитных договоров.

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

- 7.3.6. Для заключения иных сделок может использоваться Торгово-клиринговый счет, в состав которого входят:
- Раздел Т+ и Расчетный код Участника клиринга, к которому привязан Счет обеспечения;
 - Раздел Т0 и Расчетный код Участника клиринга, к которому привязан Счет обеспечения;
 - Раздел Т0 и Счет обеспечения Т0.
- 7.3.7. Для заключения депозитных договоров может использоваться только Торгово-клиринговый счет, в состав которого входит только собственный Расчетный код или Расчетный код ДУ Участника клиринга, к которому привязан Счет обеспечения.
- Такой Торгово-клиринговый счет имеет в Клиринговой системе специальный признак, означающий, что данный Торгово-клиринговый счет предназначен для заключения депозитных договоров.
- 7.3.8. Для заключения кредитных договоров может использоваться только Торгово-клиринговый счет, в состав которого входит только собственный Расчетный код Участника клиринга, к которому привязан Счет обеспечения.
- 7.3.9. Торгово-клиринговые счета, в состав которых входят Раздел Т0 и Счет обеспечения Т0, не могут использоваться для заключения Сделок в ходе дополнительной торговой сессии, за исключением Торгово-клиринговых счетов, оборотная часть комиссионных вознаграждений по Сделкам, заключенным с указанием которых, удерживается по Расчетному коду для списания комиссионных вознаграждений или основному Расчетному коду для списания комиссионных вознаграждений.
- 7.3.10. Торгово-клиринговые счета, в состав которых входят Раздел Т0 и Счет обеспечения Т0, не могут использоваться для заключения Сделок в ходе утренней дополнительной торговой сессии.
- 7.3.11. Для заключения договоров М-Депозита может использоваться только Торгово-клиринговый счет, в состав которого входят Счета обеспечения Т0, предназначенные для учета требований и обязательств, возникающих из договоров М-Депозита в соответствующих валютах (далее – Счет обеспечения Т0 для М-Депозитов).

Счетом обеспечения Т0 для М-Депозитов является Счет обеспечения Т0, в отношении которого Участник клиринга направил Клиринговому центру Запрос на присвоение признака «для М-Депозитов».

У Участника клиринга может быть открыт только один Счет обеспечения Т0 в соответствующей валюте, имеющий признак «для М-Депозитов».

Для прекращения использования Счета обеспечения Т0 для М-Депозитов для заключения договоров М-Депозита Участник клиринга направляет Клиринговому центру Запрос на аннулирование признака «для М-Депозитов» по такому Счету обеспечения Т0 или Запрос на присвоение иному Счету обеспечения Т0 в соответствующей валюте признака «для М-Депозитов».

Запросы на присвоение Счету обеспечения Т0 признака «для М-депозитов» / аннулирование признака «для М-депозитов» по Счету обеспечения Т0 исполняются Клиринговым центром не позднее третьего рабочего дня с даты их поступления.

Указанный в настоящем подпункте Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов Торгово-клиринговый счет открывается на основании

Запроса на присвоение Счету обеспечения T0 признака «для М-Депозитов», направляемого Участником клиринга впервые. Последующие Счета обеспечения T0 для М-Депозитов в валютах, отличных от валюты Счета обеспечения T0 для М-Депозитов, указанного выше, включаются в состав Торгово-клирингового счета, указанного в настоящем пункте Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, после исполнения Клиринговым центром Запроса на присвоение таким Счетам обеспечения T0 признака «для М-Депозитов». При этом Счета обеспечения T0, включенные в состав Торгово-клирингового счета, используемого для заключения договоров М-Депозита, связываются с Расчетным кодом, указанным во впервые направленном Участником клиринга Запросе на присвоение Счету обеспечения T0 признака «для М-Депозитов».

- 7.4. Торгово-клиринговые счета, в состав которых входят связанные Раздел T0 и Раздел T+, также являются связанными.
- 7.5. Для заключения сделок РЕПО с клиринговыми сертификатами участия Участник клиринга, за исключением Участника клиринга категории «А», обязан зарегистрировать Торгово-клиринговый счет имущественного пула, в состав которого входит Расчетный код имущественного пула, а также может входить субсчет депо имущественного пула.
- 7.5.1. Один субсчет депо имущественного пула может входить в состав только одного Торгово-клирингового счета имущественного пула;
- 7.5.2. Один Расчетный код имущественного пула может входить в состав только одного Торгово-клирингового счета имущественного пула;
- 7.5.3. Регистрация Торгово-клирингового счета имущественного пула производится в соответствии с общей частью Правил клиринга или на основании направляемого Участником клиринга Запроса на открытие Торгово-клирингового счета имущественного пула / Запроса на открытие Расчетного кода имущественного пула. Запрос на открытие Расчетного кода имущественного пула исполняется в порядке, установленном общей частью Правил клиринга для исполнения Запросов на открытие Расчетного кода.
- 7.6. Помимо информации, указанной в общей части Правил клиринга, при осуществлении клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов на клиринговых регистрах Клиринговый центр учитывает:
- информацию о денежных средствах, внесенных для обеспечения исполнения и исполнения обязательств по сделкам, за исключением Сделок T+, в разрезе валют и Счетов обеспечения T0;
 - информацию о ценных бумагах, внесенных для обеспечения исполнения и исполнения обязательств по сделкам, за исключением Сделок T+, в разрезе кодов ценных бумаг и Торгово-клиринговых счетов на фондовом рынке, в состав которых входит Раздел T0;
 - информацию о ценных бумагах, внесенных в соответствующий имущественный пул, в разрезе кодов ценных бумаг и Торгово-клиринговых счетов имущественного пула;
 - информацию о денежных средствах, внесенных в соответствующий имущественный пул, в разрезе валют и Расчетных кодов имущественного пула;
 - информацию о драгоценных металлах, внесенных в соответствующий

- имущественный пул, в разрезе драгоценных металлов и Расчетных кодов имущественного пула;
- Единый лимит по Расчетному коду в разрезе Расчетных кодов;
 - Единый лимит по пулу в разрезе Расчетных кодов имущественного пула;
 - входящее значение номинальной стоимости выданных клиринговых сертификатов участия, поручение на выдачу которых исполнено Расчетным депозитарием (I); учитывается в разрезе Расчетных кодов имущественного пула;
 - номинальную стоимость клиринговых сертификатов участия, подлежащих выдаче после исполнения (прекращения) обязательств, включенных в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов; учитывается в разрезе Расчетных кодов имущественного пула;
 - номинальную стоимость клиринговых сертификатов участия, подлежащих погашению после исполнения (прекращения) обязательств, включенных в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов; учитывается в разрезе Расчетных кодов имущественного пула;
 - текущее значение номинальной стоимости выданных клиринговых сертификатов участия, равное $I + C - D$; учитывается в разрезе Расчетных кодов имущественного пула;
 - информацию об обязанностях и требованиях Участников клиринга по каждому допущенному к клирингу обязательству по сделке;
 - Нетто-обязательство / Нетто-требование Участников клиринга по денежным средствам / ценным бумагам по сделкам клирингового пула в разрезе Расчетных кодов Участников клиринга (Счетов обеспечения T0) / Торгово-клиринговых счетов, валют / кодов ценных бумаг;
 - Нетто-обязательство / Нетто-требование Участников клиринга по денежным средствам / ценным бумагам, рассчитанное по Сделкам T+, в разрезе Расчетных кодов / Торгово-клиринговых счетов T+, Дат исполнения, валют / кодов ценных бумаг;
 - информацию о Маржинальных требованиях по пулу в разрезе Расчетных кодов имущественного пула (в случае наличия).
- 7.7. В состав Торгово-клирингового счета нерезидента может входить только Расчетный код нерезидента. Расчетный код нерезидента может входить в состав только Торгово-клирингового счета нерезидента.
- 7.8. Порядок ведения клиринговых регистров определен в общей части Правил клиринга, а также в соответствующих статьях разделов IV и V Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, порядок ведения клиринговых регистров Счет обеспечения T0 и Торгово-клиринговый счет T0 приведен в приложении № 3 к Правилам клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.

РАЗДЕЛ II. ТРЕБОВАНИЯ К УЧАСТНИКАМ КЛИРИНГА

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

- 8.1. На фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов Участникам клиринга могут быть присвоены следующие категории Участников клиринга:
- Участники клиринга категории «А»;
 - Участники клиринга категории «К»;
 - Участники клиринга категории «О»;
 - Участники клиринга категории «Б»;
 - Участники клиринга категории «Б2»;
 - Участники клиринга категории «В».
- 8.1.1. К клирингу без предварительного обеспечения допускаются Участники клиринга всех категорий.
- 8.1.2. Участники клиринга категории «А» и «К» имеют допуск к клирингу с частичным обеспечением, к клирингу с полным обеспечением, к клирингу без предварительного обеспечения.
- 8.2. Допуск к клиринговому обслуживанию на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов предоставляется Участнику клиринга, соответствующему требованиям, установленным для соответствующей категории Участников клиринга в общей части Правил клиринга, а также требованиям, указанным в пунктах 8.3-8.7 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.
- 8.3. Для допуска к клиринговому обслуживанию Участник клиринга категории «В» должен дополнительно соответствовать следующим требованиям:
- 8.3.1. иметь хотя бы один зарегистрированный в Клиринговом центре Торгово-клиринговый счет.
- 8.3.2. В случае несоответствия Участника клиринга требованиям по наличию действующего специального разрешения на осуществление операций на финансовых рынках, выданного компетентным органом государства учреждения Участника клиринга, и требованиям к размеру собственных средств (капитала), установленным общей частью Правил клиринга, такой Участник клиринга должен предоставить Гарантию в пользу Клирингового центра, по форме и содержанию удовлетворяющую требованиям Клирингового центра и выданную лицом (далее в настоящем подпункте Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов – Гарант), являющимся Резидентом, имеющим собственные средства (капитал) в размере, превышающем сумму выданных Клиринговому центру гарантий не менее чем на 1 000 000 000 (один миллиард) российских рублей, рейтинг по международной шкале долгосрочной кредитоспособности по обязательствам в российских рублях или в иностранной валюте не ниже ВВ- по классификации рейтинговых агентств «Standard & Poor's» или «Fitch Ratings» либо «Ва3» по классификации рейтингового агентства «Moody's Investors Service», либо кредитный рейтинг по национальной шкале не менее А- по классификации Аналитического Кредитного Рейтингового Агентства (АКРА), рейтингового агентства «Эксперт РА», Национального рейтингового агентства (НРА) или

рейтингового агентства «Национальные кредитные рейтинги» (НКР). При этом Гарант на дату выдачи Гарантии, а также в течение всего срока действия Гарантии:

- должен являться Участником клиринга, в деятельности которого отсутствуют факты ухудшения его финансового состояния и/или отсутствует информация, дающая основания считать возможными ухудшение финансового состояния Гаранта и/или неспособность Гаранта своевременно и в полном объеме исполнять свои обязательства по Сделкам с частичным обеспечением, Маржинальные требования и/или иные обязательства гаранта, возникающие из Правил клиринга,

либо

- если не является Участником клиринга, предоставляет Клиринговому центру финансовую отчетность в тех же объемах и те же сроки, которые установлены общей частью Правил клиринга, при этом, в деятельности Гаранта отсутствуют факты ухудшения его финансового состояния и/или отсутствует информация, дающая основания считать возможными ухудшение финансового состояния Гаранта и/или неспособность Гаранта своевременно и в полном объеме исполнять свои обязательства.

Участник клиринга одновременно с Гарантией предоставляет в Клиринговый центр в отношении Гаранта комплект документов в соответствии с Порядком предоставления информации и отчетности.

Гарантия должна содержать ничем не обусловленное обязательство Гаранта заплатить по требованию Клирингового центра сумму (в пределах суммы Гарантии), равную размеру неисполненных перед Клиринговым центром обязательств Участника клиринга.

Гарантия должна содержать условие о подсудности, в соответствии с которым все споры по Гарантии подлежат рассмотрению в Арбитражном суде г. Москвы или Арбитражном центре при Общероссийской общественной организации «Российский союз промышленников и предпринимателей», если иное не будет согласовано с Клиринговым центром.

Сумма Гарантии должна быть не меньше суммы, определяемой как разница между величиной требований Клирингового центра к размеру собственных средств (капитала), установленных общей частью Правил клиринга, и фактическим размером собственных средств (капитала) Участника клиринга на последнюю отчетную дату. Требование о сумме Гарантии должно соблюдаться в течение всего срока действия Гарантии. В случае если указанное условие о сумме Гарантии перестает соблюдаться, Клиринговый центр приостанавливает допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию.

Срок действия Гарантии должен быть не менее 1 (одного) года. Рекомендуемая форма Гарантии устанавливается Клиринговым центром и раскрывается путем размещения на Сайте Клирингового центра.

Если по прекращении Гарантии Участник клиринга продолжает не соответствовать требованиям по наличию действующего специального разрешения на осуществление операций на финансовых рынках, выданного компетентным органом государства учреждения Участника клиринга, и требованиям к размеру собственных средств (капитала), установленным общей частью Правил клиринга, такой Участник клиринга обязан предоставить новую Гарантию, соответствующую указанным требованиям. В случае непредоставления Участником клиринга Гарантии на новый срок не позднее, чем за 3 (три) рабочих дня до истечения срока ранее представленной

Гарантии, Клиринговый центр по истечении срока Гарантии приостанавливает допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию.

В случае если Гарант перестает соответствовать установленным критериям, и/или в отношении Гаранта выявлены факты, являющиеся в соответствии с общей частью Правил клиринга основаниями для приостановления или прекращения допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию, а также в случае непредоставления Гарантом финансовой отчетности в объеме и сроки, установленные общей частью Правил клиринга для Участников клиринга, Клиринговый центр приостанавливает допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию.

- 8.4. Для допуска к клиринговому обслуживанию с категорией «Б» или «Б2» Участник клиринга - Некредитная организация, не являющийся профессиональным участником рынка ценных бумаг, или лицом, осуществляющим иную лицензируемую деятельность на финансовом рынке, или Региональным органом власти, и Участник клиринга, являющийся Некредитной организацией – Нерезидентом, не имеющий действующего специального разрешения на осуществление операций на финансовых рынках, выданного компетентным органом государства учреждения Участника клиринга не являющийся Некредитной организацией ЕврАзЭС/ЕАЭС, должен дополнительно соответствовать следующим требованиям:
- 8.4.1. иметь собственные средства (капитал) не менее, чем 10 000 000 000 (десять миллиардов) российских рублей (или эквивалент этой суммы в иной валюте).
- 8.5. Для допуска к клиринговому обслуживанию с категорией «Б» или «Б2» Участник клиринга – Региональный орган власти, должен дополнительно соответствовать следующим требованиям:
- иметь рейтинг по международной шкале долгосрочной кредитоспособности по обязательствам в российских рублях или в иностранной валюте не ниже ВВ+ по классификации рейтинговых агентств «Standard & Poor's» или «Fitch Ratings» либо «Ba1» по классификации рейтингового агентства «Moody's Investors Service», либо
 - иметь кредитный рейтинг по национальной шкале не менее А-.ru по классификации Аналитического Кредитного Рейтингового Агентства (АКРА), рейтингового агентства «Эксперт РА», Национального рейтингового агентства (НРА) или рейтингового агентства «Национальные кредитные рейтинги» (НКР).
- 8.6. Для допуска к клиринговому обслуживанию с категорией «Б» или «Б2» Участник клиринга – Некредитная организация ЕврАзЭС/ЕАЭС, должен дополнительно соответствовать следующим требованиям:
- иметь собственные средства (капитал) не менее, чем 50 000 000 000 (пятьдесят миллиардов) российских рублей (или эквивалент этой суммы в иной валюте);
либо
 - иметь собственные средства (капитал) не менее, чем 10 000 000 000 (десять миллиардов) российских рублей (или эквивалент этой суммы в иной валюте) и рейтинг по международной шкале долгосрочной кредитоспособности по обязательствам в российских рублях или в иностранной валюте не ниже ВВ- по классификации рейтинговых агентств «Standard & Poor's» или «Fitch

Ratings» либо «ВАЗ» по классификации рейтингового агентства «Moody's Investors Service»;

либо

- иметь собственные средства (капитал) не менее, чем 20 000 000 000 (двадцать миллиардов) российских рублей (или эквивалент этой суммы в иной валюте) и более пятидесяти процентов акций (долей) в уставном капитале находится в прямой государственной собственности.

8.7. Для допуска к клиринговому обслуживанию с категорией «Б» или «Б2» Участник клиринга – Банк-нерезидент должен дополнительно соответствовать следующим требованиям:

- иметь собственные средства (капитал) не менее, чем 10 000 000 000 (десять миллиардов) российских рублей (или эквивалент этой суммы в иной валюте),

либо

- иметь собственные средства (капитал) не менее, чем 5 000 000 000 (пять миллиардов) российских рублей (или эквивалент этой суммы в иной валюте) и рейтинг по международной шкале долгосрочной кредитоспособности по обязательствам в российских рублях или в иностранной валюте не ниже ВВ- по классификации рейтинговых агентств «Standard & Poor's» или «Fitch Ratings» либо «ВАЗ» по классификации рейтингового агентства «Moody's Investors Service».

8.8. Участник клиринга категории «В» не может являться стороной по сделкам РЕПО с центральным контрагентом с плавающей ставкой РЕПО.

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

Статья 9. Особенности приостановления допуска к клиринговому обслуживанию

9.1. Клиринговый центр вправе приостановить допуск к клиринговому обслуживанию Участника клиринга категории «О», «Б», «Б2» или категории «В» по основаниям, предусмотренным общей частью Правил клиринга, а также по следующим основаниям:

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

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

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

9.2. Клиринговый центр вправе установить Участнику клиринга категории «Б» или «Б2» категорию «В» по основаниям, предусмотренным общей частью Правил клиринга, а также в следующих случаях:

- 9.2.1. при невыполнении Участником клиринга - Некредитной организацией, не являющимся профессиональным участником рынка ценных бумаг, или лицом, осуществляющим иную лицензируемую деятельность на финансовом рынке, или Региональным органом власти, или Участником клиринга, являющимся Некредитной организацией – Нерезидентом и не имеющим действующего специального разрешения на осуществление операций на финансовых рынках, выданного компетентным органом государства учреждения Участника клиринга, любого из требований, предусмотренных пунктом 8.4 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов;
- 9.2.2. при несоответствии Участника клиринга - Регионального органа власти требованиям, установленным пунктом 8.5 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.
- 9.3. Клиринговый центр приостанавливает допуск к клиринговому обслуживанию Участника клиринга категории «О», «Б», «Б2» или категории «В» по депозитным договорам при получении информации о наличии в отношении такого Участника клиринга решения о приостановлении операций по счетам налогоплательщика-организации и/или плательщика, принятого федеральным органом исполнительной власти.
- 9.4. Приостановление клирингового обслуживания Участника клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов означает невозможность Участнику клиринга становиться стороной по сделкам, заключаемым на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов Участниками торгов (за исключением Клирингового центра), за исключением заключения Участником клиринга депозитных договоров на основании заявок на заключение депозитного договора, внесенных в реестр предложений до момента приостановления допуска к клиринговому обслуживанию Участника клиринга, а также невозможность подачи таким Участником клиринга Предложений на заключение Внебиржевых сделок в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.

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

- 10.1. Для получения статуса Держателя юридические лица, являющиеся Участниками клиринга, предоставляют Клиринговому центру Заявление о предоставлении статуса Держателя.
- 10.2. Для получения статуса Держателя юридические лица – Резиденты должны иметь действующую лицензию профессионального участника рынка ценных бумаг на осуществление депозитарной деятельности, выданной уполномоченным органом.
Для получения статуса Держателя юридические лица – Нерезиденты должны иметь в соответствии с их личным законом право осуществлять учет и переход прав на ценные бумаги, и соответствовать требованиям, установленным законодательством Российской Федерации для открытия счета депо иностранного номинального держателя.
- 10.3. Для получения статуса Держателя юридические лица, не являющиеся Участниками клиринга (далее для целей настоящей статьи Правил клиринга на фондовом рынке,

рынке депозитов и рынке кредитов – Юридические лица), помимо документов, указанных в пункте 10.1 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, предоставляют Клиринговому центру:

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

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

- 10.4. Решение о предоставлении (приостановлении/лишении) статуса Держателя принимается Клиринговым центром.
- 10.5. Юридическому лицу / Участнику клиринга приостанавливается статус Держателя в случае аннулирования Банком России лицензии профессионального участника рынка ценных бумаг на осуществление депозитарной деятельности, если в решении Банка России указан срок для прекращения обязательств, связанных с осуществлением им депозитарной деятельности.
- 10.6. Клиринговый центр вправе принять решение о лишении Юридического лица / Участника клиринга статуса Держателя по любому из следующих оснований:
- 10.6.1. в случае приостановления действия лицензии профессионального участника рынка ценных бумаг на осуществление депозитарной деятельности;
- 10.6.2. в случае принятия Банком России решения об аннулировании лицензии на осуществление банковских операций;
- 10.6.3. при невыполнении условий для получения в соответствии с Порядком ЭДО отчетных документов по итогам клиринга в форме электронных документов;
- 10.6.4. нарушения Держателем требований по представлению документов, указанных в пункте 10.8 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов;
- 10.6.5. при применении к Держателю санкций уполномоченных органов за нарушение законодательства Российской Федерации, в том числе при применении административных наказаний;
- 10.6.6. неоднократного (два и более) нарушения Держателем установленных Правилами клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов требований;
- 10.6.7. в случае получения от иностранного налогового органа уведомления о невыполнении Держателем требований законодательства иностранного государства, имеющих экстерриториальное действие и затрагивающих деятельность финансовых институтов Российской Федерации;
- 10.6.8. в случае наличия риска потери деловой репутации Клирингового центра в связи с сохранением статуса Держателя;
- 10.6.9. в случае наличия у Клирингового центра информации о деятельности Держателя, свидетельствующей, по заключению Клирингового центра, о риске неисполнения

обязательств по сделкам или нарушения положений Правил клиринга Участником клиринга, депозитарное обслуживание которого и/или его клиентов осуществляется Держателем.

- 10.7. Клиринговый центр принимает решение о лишении Юридического лица / Участника клиринга статуса Держателя по любому из следующих оснований:
 - 10.7.1. в случае аннулирования Банком России лицензии профессионального участника рынка ценных бумаг на осуществление депозитарной деятельности;
 - 10.7.2. в случае отзыва Банком России лицензии на осуществление банковских операций;
 - 10.7.3. в случае получения заявления Держателя о лишении его статуса Держателя;
 - 10.7.4. в случае назначения временной администрации или принятия арбитражным судом решения о введении в отношении Держателя одной из процедур банкротства;
 - 10.7.5. ликвидации Держателя, а также в случае реорганизации Держателя при условии, что деятельность Держателя в результате реорганизации прекращается (за исключением реорганизации в форме преобразования, если Держатель сохраняет лицензию профессионального участника рынка ценных бумаг на осуществление депозитарной деятельности).
- 10.8. В случае изменения сведений, содержащихся в Анкете юридического лица или в иных ранее предоставленных Клиринговому центру документах, Держатель обязан в течение 5 (пяти) рабочих дней с даты вступления в силу указанных изменений предоставить Клиринговому центру Анкету юридического лица с обновленной информацией или письмо, содержащее информацию о таких изменениях, с приложением документов, подтверждающих изменения, в форме электронного документа или документа в бумажной форме.
- 10.9. Форматы предоставления Держателем Анкеты юридического лица определены Порядком предоставления информации и отчетности.
- 10.10. Клиринговый центр извещает юридическое лицо / Участника клиринга о получении им статуса Держателя, а также о приостановлении/лишении его статуса Держателя путем размещения соответствующей информации на Сайте Клирингового центра в течение 3 (трех) рабочих дней со дня принятия соответствующего решения.

Статья 11. Особенности открытия и порядок закрытия Торгово-клиринговых счетов Участника клиринга, порядок использования Торгово-клиринговых счетов 2-го и 3-го уровней, а также порядок аннулирования связи Расчетного кода и Раздела

- 11.1. На фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов необходимо открытие следующих Торгово-клиринговых счетов Участника клиринга: Торгово-клирингового счета на фондовом рынке, а также возможно открытие Торгово-клирингового счета для заключения депозитных договоров, Торгово-клиринговых счетов 2-ого уровня и Торгово-клиринговых счетов 3-ого уровня.
- 11.2. Клиринговый центр вправе отказать в регистрации Торгово-клирингового счета Участника клиринга, в состав которого входит Раздел торгового счета депо Держателя, в случае, если по заключению Клирингового центра регистрация такого Торгово-клирингового счета Участника клиринга может повлечь увеличение

принимаемых Клиринговым центром рисков и/или нарушение правил и порядка внутреннего контроля, осуществляемого Клиринговым центром в соответствии с нормативными актами Банка России.

- 11.3. Условия открытия Торгово-клиринговых счетов Участника клиринга изложены в Регламенте открытия, закрытия и блокировки Торгово-клиринговых счетов.
- 11.4. Запрос на открытие Торгово-клирингового счета Участника клиринга, содержащий указание на необходимость изменения Расчетного кода Участника клиринга, входящего в состав Торгово-клирингового счета Участника клиринга, исполняется при соблюдении следующих условий:
- Единый лимит по Расчетному коду Участника клиринга, входящему в состав Торгово-клирингового счета, до исполнения указанного запроса, и Единый лимит по Расчетному коду Участника клиринга, входящему в состав Торгово-клирингового счета, после исполнения указанного запроса, не станет отрицательным;
 - Расчетному коду Участника клиринга, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в таком запросе, не соответствует ни один Расчетный код 2-го уровня и/или Расчетный код 3-го уровня.
- 11.5. На фондовом рынке Участник клиринга, являющийся Нерезидентом из перечня, либо лицом, подконтрольным такому Нерезиденту из перечня, для получения возможности становиться стороной по сделкам, или иной Участник клиринга, для получения возможности становиться стороной по сделкам, заключаемым в интересах и (или) за счет Нерезидента из перечня, либо лицом, подконтрольным такому Нерезиденту из перечня, должен открыть Торгово-клиринговый счет нерезидента на фондовом рынке.
- 11.6. Участник клиринга категории «О», «Б» или «Б2» вправе с использованием Клиринговой системы установить для Торгово-клирингового счета Т+ признак «запрет коротких продаж» и/или для Расчетного кода Участника клиринга признак «запрет необеспеченных покупок».
- По Сделкам Т+, заключенным с указанием Торгово-клирингового счета Т+ с признаком «запрет коротких продаж», осуществляется клиринг с полным обеспечением по ценным бумагам.
- По Сделкам Т+, заключенным с указанием Торгово-клирингового счета Т+, в состав которого входит Расчетный код Участника клиринга с признаком «запрет необеспеченных покупок», осуществляется клиринг с полным обеспечением по денежным средствам.
- 11.6.1. Для Торгово-клирингового счета Т+ Участник клиринга категории «О», «Б» или «Б2» вправе с использованием Клиринговой системы установить ограничение на размер Нетто-обязательства по ценной бумаге. Соблюдение указанного ограничения проверяется при подаче заявки / Предложения / Котировки участника торгов на заключение Сделки Т+ с учетом обязательств и требований по Сделкам Т+, которые могут быть заключены на основании такой заявки / Предложения / Котировках участника торгов.

- 11.7. Если решением Клирингового центра не установлено иное, Клиринговый центр устанавливает по всем Торгово-клиринговым счетам нерезидента / Расчетным кодам нерезидента, открытым для фондового рынка, рынка депозитов и рынка кредитов, признак «запрет коротких продаж» / «запрет необеспеченных покупок».
- 11.8. Если решением Клирингового центра не установлено иное, Клиринговый центр устанавливает по всем Торгово-клиринговым счетам Участника клиринга категории «К», открытым для фондового рынка, рынка депозитов и рынка кредитов, признак «запрет коротких продаж».
- 11.9. Участник клиринга вправе с использованием Клиринговой системы установить для Торгово-клирингового счета 2-го уровня признак «запрет коротких продаж» и/или для Расчетного кода 2-го уровня признак «запрет необеспеченных покупок».
- 11.10. Участник торгов, заключивший с Клиринговым центром договор о ведении клиринговых регистров, предусмотренный общей частью Правил клиринга, вправе с использованием Клиринговой системы установить для Торгово-клирингового счета 3-го уровня признак «запрет коротких продаж» и/или для Расчетного кода 3-го уровня признак «запрет необеспеченных покупок».
- 11.11. Клиринговый центр посредством Системы торгов передает Бирже информацию:
- о зарегистрированных Торгово-клиринговых счетах Участников клиринга, Торгово-клиринговых счетах 2-го и 3-го уровней;
 - об Участниках торгов, имеющих право подавать заявки / Котировки участника торгов с указанием Торгово-клиринговых счетов 2-го уровня;
 - о зарегистрированных Обособленных клиентах;
 - о сумме денежных средств на Торгово-клиринговом счете Участника клиринга, совпадающего в одном лице с Участником торгов, указываемом при подаче заявок, входящих в Алгоритмический пакет заявок (пакет заявок), подаваемых Участником торгов в Подсистеме обработки алгоритмических пакетов заявок Московской Биржи, в порядке и на условиях, предусмотренных Правилами торгов на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов;
 - иную информацию, предусмотренную Правилами торгов на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.
- 11.12. Клиринговый центр осуществляет блокировку Торгово-клиринговых счетов Участника клиринга в порядке, определенном Регламентом открытия, закрытия и блокировки Торгово-клиринговых счетов.
- 11.13. Клиринговый центр осуществляет аннулирование связи Расчетного кода Участника клиринга / Расчетного кода нерезидента на фондовом рынке и Раздела на основании Запроса на аннулирование связи Расчетного кода и Раздела, предоставленного Участником клиринга Клиринговому центру. Указанное в настоящем пункте аннулирование осуществляется при соблюдении условий, указанных в абзацах 2 и 4 пункта 11.15 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.
- 11.14. Закрытие Торгово-клирингового счета Участника клиринга на фондовом рынке / Торгово-клирингового счета нерезидента на фондовом рынке / Торгово-клирингового счета для заключения депозитных договоров осуществляется в

порядке, определенном Регламентом открытия, закрытия и блокировки Торгово-клиринговых счетов.

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

- отсутствуют неисполненные обязательства и / или требования, учитываемые по Расчетному коду и / или по Разделу, входящему в состав Торгово-клирингового счета, закрытие которого осуществляет Клиринговый центр;
- отсутствует Обеспечение в ценных бумагах, учитываемое по Разделу, входящему в состав Торгово-клирингового счета, закрытие которого осуществляет Клиринговый центр (для Торгово-клиринговых счетов на фондовом рынке);
- значение Единого лимита по Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета, закрытие которого осуществляет Клиринговый центр, после закрытия указанного Торгово-клирингового счета, не станет отрицательным, или, если Единый лимит по такому Расчетному коду был отрицательным до закрытия указанного Торгово-клирингового счета, при условии, что Единый лимит по такому Расчетному коду, после закрытия указанного Торгово-клирингового счета, не станет меньше, чем Единый лимит по этому Расчетному коду, рассчитанный до закрытия указанного Торгово-клирингового счета.

Статья 12. Особенности открытия и порядок закрытия Торгово-клиринговых счетов имущественного пула

12.1. На основании Запроса на открытие Расчетного кода имущественного пула / Запроса на открытие Торгово-клирингового счета имущественного пула, полученного от Участника клиринга, Клиринговый центр:

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

12.1.2. для открытого в соответствии с подпунктом 12.1.1 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов Расчетного кода имущественного пула открывает один Счет обеспечения в российских рублях и по одному Счету обеспечения в каждой иностранной валюте, принимаемой в соответствующий имущественный пул;

12.1.3. открывает Торгово-клиринговый счет имущественного пула, в состав которого входит открытый в соответствии с подпунктом 12.1.1 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов Расчетный код имущественного пула;

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

12.1.5. направляет Расчетному депозитарию поручение на открытие субсчета депо соответствующего имущественного пула для депонента, которому открыт Раздел T+, входящий в состав Торгово-клирингового счета T+, указанного в Запросе на

- открытие Торгово-клирингового счета имущественного пула, с типом, соответствующим типу указанного Раздела Т+;
- 12.1.6. после получения от Расчетного депозитария информации об открытии субсчета депо имущественного пула в составе списка Разделов / субсчетов депо, направляемого в соответствии с общей частью Правил клиринга, включает в состав соответствующего Торгово-клирингового счета имущественного пула указанный субсчет депо имущественного пула.
- 12.2. Запрос на открытие Расчетного кода имущественного пула / Запрос на открытие Торгово-клирингового счета имущественного пула, в котором указан код / наименование имущественного пула и код Торгово-клирингового счета нерезидента, не исполняется Клиринговым центром.
- 12.3. Под каждый из имущественных пулов, формируемых Клиринговым центром, Участнику клиринга открываются отдельные субсчета депо имущественного пула, Расчетные коды имущественного пула и Торгово-клиринговые счета имущественного пула.
- 12.4. Торгово-клиринговый счет имущественного пула может указываться Участником торгов или Клиринговым центром в заявке на продажу ценных бумаг из имущественного пула. По такой сделке будет осуществляться клиринг с полным обеспечением по ценным бумагам.
Торгово-клиринговый счет имущественного пула может указываться Клиринговым центром в заявке на продажу иностранной валюты / драгоценных металлов из имущественного пула. По такой сделке будет осуществляться клиринг с полным обеспечением по иностранной валюте / драгоценным металлам.
- 12.5. Закрытие Торгово-клирингового счета имущественного пула осуществляется в порядке, определенном Регламентом открытия, закрытия и блокировки Торгово-клиринговых счетов.
- 12.6. Запрос на открытие Расчетного кода имущественного пула / Запрос на открытие Торгово-клирингового счета имущественного пула, в котором указан Торгово-клиринговый счет Т+, ранее соответствовавший закрытому Клиринговым центром Торгово-клиринговому счету имущественного пула, на котором учитывались денежные средства / драгоценные металлы / ценные бумаги, внесенные Участником клиринга в имущественный пул, указанный в таком Запросе на открытие Расчетного кода имущественного пула / Запросе на открытие Торгово-клирингового счета имущественного пула, не исполняется Клиринговым центром.

Статья 13. Особенности регистрации Обособленных клиентов

- 13.1. Участник клиринга не вправе указывать Расчетный код Обособленного клиента, входящий в состав Торгово-клиринговых счетов Обособленного клиента, при регистрации Торгово-клиринговых счетов, предназначенных для учета ценных бумаг, находящихся в обеспечении Участника клиринга, и не предназначенных для исполнения обязательств по Сделкам, заключенным в интересах и (или) за счет Обособленного клиента.

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

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

- 14.1. В целях снижения рисков, связанных с осуществлением клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, Клиринговый центр применяет меры, предусмотренные общей частью Правил клиринга.
- 14.1.1. Гарантийный фонд фондового рынка и рынка депозитов формируется за счет взносов всех Участников клиринга категории «О», «Б» и «Б2», допущенных к клирингу на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.
- 14.1.2. Для Участников клиринга категории «О», «Б» и «Б2» на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов минимальный размер взноса в Гарантийный фонд фондового рынка и рынка депозитов каждого Участника клиринга составляет 10 000 000 (десять миллионов) российских рублей.
- 14.2. Для Участников клиринга категории «Б» и «Б2», допущенных только к заключению депозитных договоров, минимальный размер взноса в Гарантийный фонд каждого Участника клиринга составляет 1 000 000 (один миллион) российских рублей.
- 14.3. Обеспечение под стресс обязаны вносить Участники клиринга категории «О», «Б» и «Б2».
- Порядок определения размера Обеспечения под стресс Участника клиринга установлен Методикой определения размера Обеспечения под стресс.
- 14.4. При неисполнении Участником клиринга Маржинального требования по фондам и/или Маржинального требования по обеспечению под стресс, порядок выставления и исполнения которых определен общей частью Правил клиринга:
- Участнику клиринга категории «Б» или «Б2» устанавливается категория «В»;
 - Участнику клиринга категории «О» по всем Расчетным кодам Участника клиринга устанавливается признак «запрет необеспеченных покупок» и по всем Торгово-клиринговым счетам Участника клиринга признак «запрет коротких продаж».
- 14.5. При использовании взноса Недобросовестного участника клиринга в Гарантийный фонд фондового рынка и рынка депозитов и/или Обеспечения под стресс на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов:
- Участнику клиринга категории «Б» или «Б2» устанавливается категория «В»;
 - Участнику клиринга категории «О» по всем Расчетным кодам Участника клиринга устанавливается признак «запрет необеспеченных покупок» и по всем Торгово-клиринговым счетам Участника клиринга признак «запрет коротких продаж».
- 14.6. В случае возмещения Недобросовестным участником клиринга средств Гарантийного фонда фондового рынка и рынка депозитов и Обеспечения под стресс на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов в течение 1 (одного) Расчетного дня после направления Клиринговым центром такому Участнику

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

- устанавливает Участнику клиринга категории «В» категорию «Б» или «Б2», если отсутствуют иные основания установления Участнику клиринга категории «Б» или «Б2» категории «В», предусмотренные Правилами клиринга;
- снимает Участнику клиринга категории «О» признак «запрет коротких продаж» и признак «запрет необеспеченных покупок», если отсутствуют иные основания для установления Участнику клиринга категории «О» признака «запрет коротких продаж» и признака «запрет необеспеченных покупок», предусмотренные Правилами клиринга.

- 14.7. На фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов контроль достаточности Обеспечения осуществляется с использованием Единого лимита по Расчетному коду.
- 14.8. Клиринговый центр вправе с использованием Клиринговой системы установить ограничение на минимальное допустимое отрицательное значение Единого лимита по Расчетному коду, рассчитанного без учета Обеспечения Участника клиринга.
- 14.9. Участник клиринга вправе с использованием Клиринговой системы установить ограничение на минимальное допустимое значение, в том числе отрицательное, Единого лимита по Расчетному коду, рассчитанного без учета Обеспечения Участника клиринга.

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

- 15.1. В целях снижения рисков, связанных с выдачей и обращением клиринговых сертификатов участия, Клиринговый центр кроме мер, предусмотренных статьей 14 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов:
- не реже, чем каждый Расчетный день, осуществляет переоценку стоимости имущества, внесенного каждым Участником клиринга в каждый из имущественных пулов, и контроль достаточности указанного имущества для обеспечения исполнения обязательств Участника клиринга по договору об имущественном пуле, в случае недостаточности – предъявляет Участнику клиринга Маржинальное требование по пулу;
 - при возврате имущества, внесенного в имущественный пул, осуществляет контроль достаточности указанного имущества для обеспечения исполнения обязательств Участника клиринга по договору об имущественном пуле.
- 15.2. Порядок расчета стоимости имущества, внесенного в имущественный пул, определен в статье 16 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.

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

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

Статья 16. Единый лимит по пулу

- 16.1. Единый лимит по пулу рассчитывается Клиринговым центром по Расчетному коду имущественного пула при внесении имущества в имущественный пул, при возврате имущества из имущественного пула, при подаче заявок на заключение Сделок с указанием Торгово-клирингового счета имущественного пула, при заключении Сделок или исполнении / прекращении обязательств по Сделкам, заключенных с указанием Торгово-клирингового счета имущественного пула, а также при изменении базовых риск-параметров.
- 16.2. Единый лимит по пулу используется для контроля за соответствием стоимости имущества, внесенного в соответствующий имущественный пул, номинальной стоимости выданных клиринговых сертификатов участия при выполнении операций, указанных в пункте 16.1 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, а также иных операций, предусмотренных Правилами клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов. Указанный контроль осуществляется, исходя из анализа изменения значения Единого лимита по пулу до и после проведения операции.
- 16.3. Единый лимит по пулу по Расчетному коду имущественного пула рассчитывается с учетом:
- российских рублей и иностранной валюты, внесенных в имущественный пул и учитываемых по Расчетному коду имущественного пула (учитываются со знаком «плюс»);
 - ценных бумаг, внесенных в имущественный пул и учитываемых по Торгово-клиринговому счету имущественного пула (учитываются со знаком «плюс»);
 - драгоценных металлов, внесенных в имущественный пул и учитываемых по Расчетному коду имущественного пула (учитываются со знаком «плюс»);
 - текущего значения номинальной стоимости выданных клиринговых сертификатов участия, учитываемого по Расчетному коду имущественного пула (отражается в Клиринговой системе со знаком «плюс», при расчете Единого лимита по пулу вычитается из рассчитываемого значения);
 - Нетто-обязательств Участника клиринга в российских рублях / иностранной валюте / драгоценных металлах, рассчитанных по Сделкам, учитываемых по Расчетному коду имущественного пула, по всем Датам исполнения (учитываются со знаком «минус»);
 - Нетто-требований Участника клиринга в российских рублях / иностранной валюте / драгоценных металлах, рассчитанных по Сделкам, учитываемых по Расчетному коду имущественного пула, по всем Датам исполнения (учитываются со знаком «плюс»);
 - Нетто-обязательств Участника клиринга в ценных бумагах, рассчитанных по Сделкам, учитываемых по Торгово-клиринговому счету имущественного пула, по всем Датам исполнения (учитываются со знаком «минус»);
 - Нетто-требований Участника клиринга в ценных бумагах, рассчитанных по Сделкам, учитываемых по Торгово-клиринговому счету имущественного пула, по всем Датам исполнения (учитываются со знаком «плюс»);
 - обязательств / требований, которые могут возникнуть в случае заключения на основании зарегистрированных заявок, поданных с указанием Торгово-

клирингового счета имущественного пула, Сделок, стороной по которым будет являться Участник клиринга.

- 16.4. Для расчета Единого лимита по пулу, Клиринговый центр использует риск-параметры, перечень, порядок расчета и изменения которых определен в методиках определения риск-параметров соответствующих Рынков.
- 16.5. Если по Торгово-клиринговому счету Т+ Участника клиринга Участником клиринга установлены индивидуальные Верхние и Нижние границы диапазона оценки рыночных рисков и/или Верхние и Нижние границы диапазона оценки процентных рисков, такие же риск-параметры применяются для Торгово-клирингового счета имущественного пула, соответствующего такому Торгово-клиринговому счету Т+.
- 16.6. Единый лимит по пулу рассчитывается Клиринговым центром исходя из оценки в российских рублях максимально возможного уменьшения в течение срока, необходимого для прекращения обязательств по договору об имущественном пуле в случае неисполнения Участником клиринга Маржинального требования по пулу, общей стоимости активов и обязательств, указанных в пункте 16.3 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, в связи с изменением риск-параметров.
- Указанная оценка проводится с использованием Верхних и Нижних границ диапазона оценки рыночных рисков 1-го, 2-го и 3-го уровня и Верхних и Нижних границ диапазона оценки процентных рисков 1-го, 2-го и 3-го уровня. В случае если Участником клиринга установлены индивидуальные значения указанных риск-параметров, указанная оценка проводится с использованием таких индивидуальных значений указанных риск-параметров.
- Основные правила расчета Единого лимита по пулу определены в документе «Принципы расчета Единого лимита», раскрываемом на Сайте Клирингового центра.
- 16.7. Если Единый лимит по пулу по Расчетному коду имущественного пула, рассчитанный в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, является неотрицательным, стоимость имущества, внесенного в имущественный пул и учитываемого по такому Расчетному коду имущественного пула, является соответствующей текущему значению номинальной стоимости выданных клиринговых сертификатов участия, учитываемой по тому же Расчетному коду имущественного пула.
- 16.7.1. При превышении стоимости имущества, внесенного в соответствующий имущественный пул, текущего значения номинальной стоимости выданных клиринговых сертификатов участия Клиринговый центр выдает Участнику пула дополнительные клиринговые сертификаты участия в порядке, определенном статьей 23 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, с учетом номинальной стоимости клиринговых сертификатов участия, выпускаемых / погашаемых в следующем Расчетном дне.
- 16.7.2. Если Единый лимит по пулу по Расчетному коду имущественного пула, рассчитанный в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, является отрицательным, Клиринговый центр вправе погасить клиринговые сертификаты участия, при соблюдении условий и в порядке, указанном в статье 24 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке

депозитов и рынке кредитов, и/или предпринимает действия, предусмотренные статьей 26 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.

- 16.7.3. В случае наличия у Клирингового центра информации об отрицательном значении Единого лимита по пулу по Расчетному коду имущественного пула Клиринговый центр вправе осуществить перевод обеспечения в денежных средствах с Расчетного кода, входящего в состав Торгово-клирингового счета Т+, соответствующего Торгово-клиринговому счету имущественного пула, в состав которого входит Расчетный код имущественного пула в целях приведения значения Единого лимита по пулу по Расчетному коду имущественного пула к неотрицательному значению.

РАЗДЕЛ IV. ПОРЯДОК И УСЛОВИЯ ДОПУСКА ОБЯЗАТЕЛЬСТВ К КЛИРИНГУ

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

Статья 17. Возможность заключения Внебиржевых сделок с ценными бумагами

- 17.1. Клиринговый центр составляет и утверждает список предметов обязательств из Внебиржевых сделок с ценными бумагами (далее – Список). Список раскрывается на Сайте Клирингового центра.
- 17.2. Условия Внебиржевых сделок с ценными бумагами соответствуют условиям сделок купли-продажи ценных бумаг с соответствующим кодом расчетов, определенным Правилами торгов на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, порядок заключения и исполнения Внебиржевых сделок с ценными бумагами определен Правилами клиринга.
- 17.3. Для целей осуществления клиринга по Внебиржевым сделкам с ценными бумагами, в дополнение к Списку, Клиринговый центр принимает решение о ценных бумагах, с которыми возможно заключение Внебиржевых сделок с ценными бумагами для последующего клиринга обязательств из них (далее – решение о ценных бумагах, с которыми возможно заключение Внебиржевых сделок).
- 17.4. Решение о ценных бумагах, с которыми возможно заключение Внебиржевых сделок, раскрывается на Сайте Клирингового центра и вступает в силу через 5 (пять) календарных дней после такого раскрытия, если в самом решении Клирингового центра не установлен иной срок вступления его в силу.
- 17.5. С момента вступления в силу Списка и решения, указанного в пункте 17.3 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, допускается заключение Внебиржевых сделок с ценными бумагами, отвечающим условиям, указанным в решении, принятом в соответствии с пунктом 17.3 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, и осуществление клиринга по Внебиржевым сделкам с указанными ценными бумагами на основании Правил клиринга.
- 17.6. Клиринговый центр вправе установить Верхнюю и Нижнюю границу ценового коридора для ценной бумаги, с которой возможно заключение Внебиржевых сделок с ценными бумагами. Порядок расчета Верхней и Нижней границы ценового коридора для ценной бумаги, с которой возможно заключение Внебиржевых сделок с ценными бумагами, определяется Методикой определения НКО НКЦ (АО) риск-параметров фондового рынка и рынка депозитов ПАО Московская Биржа, раскрываемой на Сайте Клирингового центра.

Статья 18. Порядок заключения Внебиржевых сделок с ценными бумагами

- 18.1. Участники клиринга вправе заключать Внебиржевые сделки с ценными бумагами в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов:
 - от своего имени и за свой счет;

- от своего имени и за счет своего клиента;
 - от своего имени и за счет имущества, находящегося в доверительном управлении Участника клиринга.
- 18.2. При заключении Внебиржевых сделок с ценными бумагами с Участниками клиринга Клиринговый центр осуществляет функции центрального контрагента. Клиринговый центр также оказывает клиринговые услуги без осуществления функций центрального контрагента в отношении Внебиржевых сделок, указанных в подпункте 18.3.1 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.
- 18.3. Клиринговый центр оказывает клиринговые услуги, в рамках которых Внебиржевые сделки с ценными бумагами могут заключаться в следующих режимах:
- Режим «Встречный аукцион с ЦК»,
 - Режим «Двусторонние сделки с ЦК»,
 - Режим «Непрерывный аукцион с ЦК»,
 - Режим «Адресные сделки с ЦК»,
 - Режим «Размещение: Адресные сделки»,
 - Режим «Выкуп: Адресные сделки».
- 18.3.1. Внебиржевые сделки с ценными бумагами в режимах «Размещение: Адресные сделки» и «Выкуп: Адресные сделки» заключаются Участниками клиринга без участия центрального контрагента.
- В режиме «Размещение: Адресные сделки» первичное предложение акций может осуществляться только по закрытой подписке среди ограниченного круга лиц.
- Предложение, поданное Участником клиринга в режиме «Размещение: Адресные сделки», может осуществляться как от своего имени (в том числе в интересах эмитента), так от имени и по поручению эмитента.
- Акцепт предложения в режиме «Размещение: Адресные сделки» осуществляется от имени Участника клиринга. В случае первичного предложения акций эмитентом, Участник клиринга, акцептовавший предложение эмитента или Участник клиринга, действующего в интересах эмитента, – является первичным приобретателем акций, размещенных по закрытой подписке среди ограниченного круга лиц.
- 18.4. Клиринговый центр принимает решение о ценных бумагах, с которыми возможно заключение Внебиржевых сделок с ценными бумагами в режимах «Размещение: Адресные сделки» и «Выкуп: Адресные сделки» для их клиринга, и о дате, в которую возможно заключение Внебиржевых сделок с ценными бумагами в указанных режимах (далее – для целей настоящей статьи Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов – Решение о ценных бумагах в режиме Размещения и Решение о ценных бумагах в режиме Выкупа соответственно). Решение о ценных бумагах в режиме Выкупа и Решение о ценных бумагах в режиме Размещения раскрываются на сайте Клирингового центра не позднее чем за 1 (один) календарный день до даты, в которую Клиринговый центр начинает оказывать клиринговые услуги в отношении внебиржевых сделок с ценными бумагами в режиме «Выкуп: Адресные сделки» и режиме «Размещение: Адресные сделки» соответственно, но не ранее времени раскрытия эмитентом или уполномоченным им

лицом информации о предстоящем размещении, выкупе, приобретении или продаже ценных бумаг. Решение о ценных бумагах в режиме Размещения не подлежит опубликованию на сайте Клирингового центра в случае оказания клиринговых услуг в отношении внебиржевых сделок с акциями в указанном режиме.

Клиринговым центром в указанных решениях также устанавливаются коды расчетов по Внебиржевым сделкам с ценными бумагами, заключаемыми в режимах «Размещение: Адресные сделки» / «Выкуп: Адресные сделки». Решением о ценных бумагах в режиме Размещения и Решением о ценных бумагах в режиме Выкупа могут быть установлены следующие коды расчетов: T0, Z0, X0, Bn.

- 18.5. Клиринговый центр вправе своим решением ограничить возможность заключения Внебиржевых сделок с ценными бумагами в одном или нескольких режимах, в том числе для отдельных категорий лиц, за счет которых могут быть заключены Внебиржевые сделки с ценными бумагами, а также ограничить коды расчетов по отдельным ценным бумагам.
- 18.6. В целях заключения Внебиржевой сделки с ценными бумагами Участник клиринга подает в Клиринговую систему Предложение, являющееся офертой на заключение Внебиржевой сделки с ценными бумагами. Предложение Участника клиринга адресовано Клиринговому центру.

В целях выражения намерений заключить Внебиржевую сделку, Участник клиринга вправе направить в Клиринговую систему сообщение, содержащее приглашение делать оферты, которое носит исключительно информационный характер и не является офертой на заключение Внебиржевой сделки с ценными бумагами (далее – Намерение). Намерение может быть адресовано одному или нескольким Участникам клиринга по выбору Участника клиринга, являющегося отправителем, либо не содержать адресата. Участник клиринга имеет право направить в Клиринговую систему неограниченное число Намерений одной направленности по одной ценной бумаге. В режимах «Размещение: Адресные сделки» и «Выкуп: Адресные сделки» Намерения не направляются.

После получения информации о поданном Намерении в Клиринговой системе после его регистрации, другой Участник клиринга вправе направить Предложение, соответствующее условиям Намерения, либо частично соответствующую условиям Намерения в части совпадения цены и/или количества ценных бумаг, либо подать Предложение, не связанное с указанным Намерением. В ответ на одно Намерение может быть получено неограниченное число Предложений, соответствующих условиям Намерения. При получении информации о таком Предложении Участник клиринга, направивший Намерение, вправе в период времени подачи Предложений / Намерений и заключения Внебиржевых сделок с ценными бумагами, установленный Временным регламентом на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, направить встречное Предложение к любому такому полученному Предложению либо к нескольким таким Предложениям.

- 18.7. Предложения в режимах «Встречный аукцион с ЦК» и «Двусторонние сделки с ЦК», а также «Непрерывный аукцион с ЦК» и «Адресные сделки с ЦК» могут подавать только Участники клиринга, совпадающие в одном лице с Участниками торгов. Предложения, соответствующие Намерениям, могут подаваться в режиме

- «Двусторонние сделки с ЦК». Намерения могут подавать только Участники клиринга, совпадающие в одном лице с Участниками торгов.
- 18.8. Предложения в режимах «Встречный аукцион с ЦК», «Непрерывный аукцион с ЦК» и «Адресные сделки с ЦК», «Размещение: Адресные сделки», «Выкуп: Адресные сделки», а также Предложения / Намерения в режиме «Двусторонние сделки с ЦК» подаются Участниками клиринга непосредственно в Клиринговую систему.
- 18.9. Предложение / Намерение формируется как электронный документ, подписанный ПЭП Участника клиринга. Такие электронные документы, подписанные ПЭП Участника клиринга, признаются электронными документами, равнозначными документам на бумажном носителе, подписанным собственноручной подписью. Порядок использования ПЭП определен общей частью Правил клиринга.
- 18.10. Предложения / Намерения могут подаваться в срок, установленный Временным регламентом на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов. Предложения в режимах «Размещение: Адресные сделки» и «Выкуп: Адресные сделки» подаются в срок, определенный в Решении о ценных бумагах в режиме Размещение / Решении о ценных бумагах в режиме Выкуп соответственно.
- 18.10.1. Срок действия Предложения / Намерения ограничен временем подачи Предложений / Намерений и заключения Внебиржевых сделок с ценными бумагами, установленным Временным регламентом на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов. Срок действия предложений в режимах «Размещение: Адресные сделки» и «Выкуп: Адресные сделки» определяется в Решении о ценных бумагах в режиме Размещение/Решении о ценных бумагах в режиме Выкуп соответственно.
- 18.11. Предложение, подаваемое Участником клиринга, содержит:
- наименование (код) ценной бумаги;
 - количество ценных бумаг (для режимов «Непрерывный аукцион с ЦК» и «Адресные сделки с ЦК» указывается в лотах). Для режима «Непрерывный аукцион с ЦК», «Размещение: Адресные сделки» допускается также указывать вместо количества ценных бумаг объем денежных средств, предназначенных для покупки ценных бумаг;
 - код расчетов;
 - Торгово-клиринговый счет 1-го, 2-го или 3-го уровня;
 - идентификатор Участника клиринга;
 - направленность Предложения (на покупку или на продажу);
 - цену за одну ценную бумагу (минимальная цена продажи/максимальная цена покупки за одну ценную бумагу). Для режима «Непрерывный аукцион с ЦК» допускается также указывать, что Предложение подается по рыночной стоимости. Для режимов «Размещение: Адресные сделки», «Выкуп: Адресные сделки» допускается указывать, что Предложение подается по цене контрагента. Валюта цены указывается в соответствии с перечнем валют, содержащимся в решении Клирингового центра, указанном в пункте 17.4 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов;
 - персональный идентификационный номер Предложения (далее – ПИН-код) - набор символов, позволяющий идентифицировать Предложения, которые могут быть при совпадении ПИН-кода и иных параметров Предложения,

установленных настоящими Правилами, признаны Клиринговым центром как допустимые встречные Предложения) (указывается только для заключения Внебиржевых сделок с ценными бумагами в режиме «Двусторонние сделки с ЦК» (при указании Участника клиринга – опционально); в режиме «Адресные сделки с ЦК» – обязательно);

- краткое наименование или идентификатор Участника клиринга, предложение которого может быть признано допустимым встречным или специальный код «Всем» в качестве указанного краткого наименования (для режима «Адресные сделки с ЦК»). В режиме «Двусторонние сделки с ЦК» Предложение может быть без указания, либо с указанием Участника клиринга, предложение которого может быть признано допустимым встречным. В режимах «Размещение: Адресные сделки» и «Выкуп: Адресные сделки» Предложения, поступающие от Участников клиринга, подаются с указанием краткого наименования или идентификатора Участника клиринга, выполняющего функции продавца / покупателя соответственно (эмитент ценных бумаг, в отношении которого принято Решение о ценных бумагах в режиме Размещение/Решение о ценных бумагах в режиме Выкуп (далее для целей настоящей статьи Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов – Участник клиринга-эмитент), Участник клиринга, действующий в интересах такого эмитента, иной Участник клиринга, осуществляющий продажу / покупку ценных бумаг в данных режимах);
- Предложения от Участника клиринга-эмитента, Участника клиринга, действующего в интересах эмитента ценных бумаг, в отношении которых принято указанное решение, или Участника клиринга, выполняющего функции продавца / покупателя, подаются с указанием краткого наименования или идентификатора Участника клиринга, Предложение которого может быть признано допустимым встречным.

Клиринговый центр вправе включить в Решение о ценных бумагах в режиме Размещение /Решение о ценных бумагах в режиме Выкуп особенности параметров Предложений, подаваемых Участниками клиринга в режимах «Размещение: Адресные сделки» и «Выкуп: Адресные сделки».

В Предложении, подаваемом Участником клиринга-эмитентом или Участником клиринга, действующим в интересах эмитента ценных бумаг, включенных в Решение о ценных бумагах в режиме Размещение/Решение о ценных бумагах в режиме Выкуп, указывается Торгово-клиринговый счет, в состав которого входит Раздел эмиссионного счета эмитента (для режима «Размещение: Адресные сделки с ЦК») или Раздел казначейского счета депо эмитента (для режима «Выкуп: Адресные сделки с ЦК»), открытого эмитенту ценных бумаг.

Намерение, подаваемое Участником клиринга, содержит:

- наименование (код) ценной бумаги;
- минимальное количество ценных бумаг;
- идентификатор Участника клиринга;
- направленность Намерения (на покупку или на продажу);
- допустимую цену за одну ценную бумагу (допустимой ценой за одну ценную бумагу является цена, указанная в Намерении, с учетом диапазона отклонения,

установленного Клиринговым центром). Валюта цены определяется Клиринговой системой в соответствии с перечнем валют, содержащимся в решении Клирингового центра, указанном в пункте 17.4 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.

- 18.12. Предложение может содержать указание на краткий код клиента Участника клиринга, за счет которого заключается Сделка.
- 18.13. После того, как информация о поданном Участником клиринга Предложении, направленном на заключение Внебиржевой сделки с ценными бумагами, стала доступной Клиринговому центру посредством Клиринговой системы, Клиринговый центр осуществляет проверку возможности регистрации такого Предложения следующим образом:
- 18.13.1. Клиринговый центр проверяет, что Предложение подано в отношении ценной бумаги, отвечающей условиям, указанным в решении, принятом в соответствии с пунктами 17.3 и 18.4 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов;
- 18.13.2. Клиринговый центр проверяет, что значение цены, указанной в Предложении, больше либо равно Нижней границе ценового коридора и меньше либо равно Верхней границе ценового коридора, установленных Клиринговым центром в соответствии с пунктом 17.6 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов для ценной бумаги, по которой подано Предложение (в случае если такие границы ценового коридора установлены Клиринговым центром).
- 18.13.3. Клиринговый центр выполняет проверку прохождения Предложением Процедуры контроля обеспечения в порядке, аналогичном порядку, установленному статьей 20 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов для заявок на заключение сделок с соответствующим кодом расчетов.
- Клиринговый центр осуществляет проверку, указанную в подпункте 18.13.1 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов в отношении Намерений, информация о которых стала доступна Клиринговому центру посредством Клиринговой системы.
- 18.13.4. Решением о ценных бумагах в режиме Размещение/Решение о ценных бумагах в режиме Выкуп может быть установлена обязанность Участников клиринга, подавших Предложения на заключение Внебиржевых сделок с ценными бумагами в режимах «Размещение: Адресные сделки»/«Выкуп: Адресные сделки», для исполнения которых на момент подачи недостаточно Обеспечения, и не обеспечивших к моменту исполнения Предложений наличия по Торгово-клиринговому счету, указанному в Предложении, Обеспечения в объеме, достаточном для прохождения процедуры контроля Обеспечения в соответствии со статьей 20 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, осуществить выплату Участнику клиринга-эмитенту или Участнику клиринга, действующему в интересах эмитента, отступного, рассчитываемого в порядке, установленном Решением о ценных бумагах в режиме Размещение/Решение о ценных бумагах в режиме Выкуп. Порядок исполнения обязательств по передаче отступного, указанного в настоящем пункте Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, аналогичен порядку, изложенному в пункте 27.17 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.

- 18.14. При положительном результате всех проверок, указанных в пункте 18.13 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов (в отношении Намерения - проверки, указанной в подпункте 18.13.1 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов), Клиринговый центр регистрирует в Клиринговой системе полученное Предложение / Намерение. При отрицательном результате хотя бы одной из указанных проверок, Клиринговый центр направляет Участнику клиринга отказ в регистрации Предложения / Намерения.
- 18.14.1. Клиринговый центр может направить Участнику клиринга отказ в регистрации Предложения в иных случаях, установленных Правилами клиринга.
- 18.14.2. При регистрации в Клиринговой системе полученного Предложения, Клиринговый центр начинает учитывать значения Единого лимита по Расчетному коду, Единого лимита по Расчетному коду 2-го уровня и/или Единого лимита по Расчетному коду 3-го уровня, рассчитанные при проверке возможности регистрации Предложения, в качестве новых значений Единого лимита по таким Расчетным кодам соответствующего уровня.
- 18.15. Участник клиринга имеет право отозвать поданное в Клиринговую систему Предложение до момента заключения Внебиржевой сделки с ценными бумагами на основании такого Предложения. В случае заключения на основании Предложения Внебиржевой сделки с ценными бумагами с количеством ценных бумаг, меньшим чем указано в Предложении, Участник клиринга имеет право отозвать Предложение в неисполненной части.
- 18.15.1. При отзыве Предложения Участником клиринга Клиринговый центр рассчитывает Единый лимит по Расчетному коду, Единый лимит по Расчетному коду 2-го уровня и/или Единый лимит по Расчетному коду 3-го уровня, входящему в состав Торгово-клирингового счета 1-го, 2-го или 3-го уровня, указанному в Предложении, и/или соответствующему Торгово-клиринговому счету 2-го или 3-го уровня, указанному в Предложении, без учета такого Предложения.
- 18.16. В случаях, установленных Правилами клиринга, Клиринговый центр вправе удалить из Клиринговой системы Предложения, поданные Участником клиринга.
- 18.17. Немедленно после регистрации в Клиринговой системе Предложения, поданного Участником клиринга, Клиринговый центр осуществляет проверку наличия Предложений Участников клиринга, имеющих совпадающие условия.
- 18.18. Предложениями, имеющими совпадающие условия, являются Предложения противоположной направленности со следующими одинаковыми условиями:
- наименование (код) ценной бумаги;
 - количество ценных бумаг (для режимов «Непрерывный аукцион с ЦК» и «Адресные сделки с ЦК» указывается в лотах);
 - цена за одну ценную бумагу (только для режимов «Двусторонние сделки с ЦК» и «Адресные сделки с ЦК»);
 - Цена продажи не больше, чем Цена покупки (Цена покупки не меньше, чем Цена продажи) (только для режимов «Встречный аукцион с ЦК» и «Непрерывный аукцион с ЦК»);
 - код расчетов;
 - Предложение подано Участником клиринга, указанным в качестве Участника клиринга, Предложение которого может быть признано Предложением с

- совпадающими условиями (в случае указания);
 - Значение ПИН-кода (только для режимов «Двусторонние сделки с ЦК» и «Адресные сделки с ЦК»).
- 18.19. Заключение Кросс-сделок запрещено за исключением случая, установленного пунктом 18.25 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.
- 18.20. При наличии Предложений, поданных Участниками клиринга на заключение Внебиржевых сделок с участием центрального контрагента и имеющих совпадающие условия, Клиринговый центр осуществляет акцепт Предложений (оферт). Клиринговый центр акцептует оферты посредством внесения в список (реестр) Внебиржевых сделок информации о двух Внебиржевых сделках с ценными бумагами с данными Участниками клиринга. Момент отображения в Клиринговой системе информации из списка (реестра) Внебиржевых сделок о двух Внебиржевых сделках с ценными бумагами с данными Участниками клиринга считается моментом получения такими Участниками клиринга – оферентами акцепта Клирингового центра на заключение Внебиржевой сделки с ценными бумагами на условиях, соответствующих условиям Предложений, имеющих совпадающие условия, является моментом достижения между Участником клиринга и Клиринговым центром соглашения о существенных условиях сделки, и моментом заключения Внебиржевых сделок с ценными бумагами между Участниками клиринга и Клиринговым центром.

Предложение, поданное Участником клиринга в режимах «Размещение: Адресные сделки» и «Выкуп: Адресные сделки» и имеющее совпадающие условия с другим Предложением, является акцептом Участника клиринга на заключение сделки с другим Участником клиринга, подавшим Предложение ранее. Клиринговый центр осуществляет внесение в список (реестр) Внебиржевых сделок информации о Внебиржевой сделке с ценными бумагами, заключенной между Участниками клиринга. Момент отображения в Клиринговой системе информации из списка (реестра) Внебиржевых сделок о Внебиржевой сделке с ценными бумагами, сторонами по которой являются данные Участники клиринга, считается моментом получения такими Участниками клиринга акцепта направленных ими оферт на заключение Внебиржевой сделки с ценными бумагами на условиях, соответствующих условиям Предложений, имеющих совпадающие условия и, соответственно, является моментом достижения между Участником клиринга соглашения о существенных условиях сделки, а также моментом заключения Внебиржевой сделки с ценными бумагами между Участниками клиринга в режимах «Размещение: Адресные сделки» и «Выкуп: Адресные сделки».

Местом заключения таких сделок является город Москва Российской Федерации.

- 18.21. В случае, если цены, указанные в Предложениях, имеющих совпадающие условия, не равны (только для режимов «Встречный аукцион с ЦК» и «Непрерывный аукцион с ЦК»), цена Внебиржевой сделки с ценными бумагами равна цене, указанной в Предложении, поданном ранее.

В случае, если количество ценных бумаг в Предложениях, имеющих совпадающие условия не равны (только для режимов «Встречный аукцион с ЦК» и «Непрерывный аукцион с ЦК»), Внебиржевая сделка с ценными бумагами заключается с минимальным количеством ценных бумаг из указанных в таких Предложениях. При

этом в Предложении с большим количеством ценных бумаг, количество ценных бумаг уменьшается на величину, равную количеству ценных бумаг в заключенной Внебиржевой сделке с ценными бумагами, и такое Предложение продолжает быть поданным в Клиринговую систему.

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

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

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

- 18.23. При заключении Внебиржевой сделки без участия центрального контрагента Клиринговый центр:
- присваивает заключенной Внебиржевой сделке с ценными бумагами номер;
 - осуществляет действия, предусмотренные пунктом 19.14 или 19.15 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, для сделок заключенных с кодами расчетов, соответствующих кодам расчетов с которыми заключены Внебиржевые сделки.
- 18.24. Клиринговый центр ведет реестр Предложений, поданных Участниками клиринга и Клиринговым центром, и реестр Внебиржевых сделок с ценными бумагами, заключенных с Участниками клиринга.
- 18.25. Участник клиринга вправе заключать Кросс-сделки в случае наличия у Клирингового центра полученной от Биржи информации об имеющемся разрешении на заключение Участником клиринга, являющимся Участником торгов, кросс-сделок на фондовом рынке Биржи, на основании заявок, поданных в режимах «Двусторонние сделки с ЦК» или «Адресные сделки с ЦК» данным Участником клиринга как Участником торгов за счет лица, зарегистрированного в качестве клиента такого Участника торгов.
- 18.26. Факт подачи Участниками клиринга, являющимися Участниками торгов, Предложений за счет одного и того же лица, зарегистрированного в качестве клиента таких Участников торгов, устанавливается Клиринговым центром на основании полученных от Биржи Идентификационных данных клиента, соответствующих краткому коду клиента, указанному в каждом Предложении.
- 18.27. Если заключенная Внебиржевая сделка с ценной бумагой, соответствует требованиям нормативных правовых актов о предоставлении на фондовую биржу информации о сделках купли-продажи, совершенных не на торгах организаторов торговли, Участник клиринга настоящим уполномочивает Клиринговый центр предоставлять отчеты о таких внебиржевых сделках, в случаях и в порядке, предусмотренных Правилами представления информации о внебиржевых сделках брокерами, дилерами, управляющими, акционерными инвестиционными фондами и управляющими компаниями и ведения реестра внебиржевых сделок Публичного акционерного общества «Московская Биржа ММВБ-РТС». Тариф за услугу по определению Внебиржевых сделок, информация о которых подлежит предоставлению на фондовую биржу, а также по предоставлению отчетов о Внебиржевых сделках (далее – плата за услугу Клирингового центра по

предоставлению отчетов о Внебиржевых сделках, заключенных в режимах «Двусторонние сделки с ЦК», «Адресные сделки с ЦК» и «Непрерывный аукцион с ЦК», а также «Размещение: Адресные сделки», «Выкуп: Адресные сделки») устанавливается Тарифами Клирингового центра, а порядок и сроки ее оплаты определяются статьей 50 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.

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

Статья 19. Порядок взаимодействия с ПАО Московская Биржа при подаче заявок и заключении сделок, допуске к клирингу обязательств по биржевым сделкам, договорам М-Депозита, и обязательств по внесению компенсационных взносов

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

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

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

- 1) активного состояния¹ в Клиринговой системе Торгово-клирингового счета, указанного в заявке;
- 2) для заявки на заключение сделки с кодом расчетов Yn , если значение цены, указанной в заявке, больше либо равно Нижней границе ценового коридора и меньше либо равно Верхней границе ценового коридора, установленных Клиринговым центром для ценной бумаги, по которой подана заявка;
- 3) для заявки на заключение сделки РЕПО с кодом расчетов $T0/Yn$, Ym/Yn , $T0/YODn$, $Ym/YODn$ если значение ставки РЕПО, указанной в заявке, больше либо равно Нижней границе коридора ставок РЕПО и меньше либо равно Верхней границе коридора ставок РЕПО, установленных Клиринговым центром для ценной бумаги, по которой подана заявка;
- 4) для заявки на заключение сделки РЕПО без указания даты второй части сделки РЕПО (далее – Сделка РЕПО с открытой датой) – категория «О», «Б» или «Б2» Участника клиринга, который по итогам исполнения заявки станет стороной по сделке, а также указание в заявке Торгово-клирингового счета, не являющегося Торгово-клиринговым счетом для заключения депозитных договоров, а в случае если указанная сделка заключается без участия центрального контрагента – указание в заявке Торгово-клирингового счета, не являющегося Торгово-клиринговым счетом $T0$;
- 5) для заявки на заключение сделки, в которой указан Торгово-клиринговый счет Участника клиринга, в состав которого входит Раздел эмиссионного счета эмитента или раздел казначейского счета депо, если владелец эмиссионного счета или казначейского счета депо, на котором открыт Раздел, входящий в состав Торгово-клирингового счета, указанного в заявке, является эмитентом ценной бумаги, указанной в заявке, по информации, полученной Клиринговым центром от Расчетного депозитария, или по информации, полученной Клиринговым центром из уведомления о проведении выкупа облигаций или

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

- приобретения акций, полученного Клиринговым центром от Участника клиринга, являющегося покупателем ценных бумаг при осуществлении выкупа облигаций или приобретения акций;
- б) прохождения заявкой Процедуры контроля обеспечения в соответствии со статьей 20 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, за исключением заявок на заключение договоров М-Депозита;
- 7) для заявки на заключение договора М-Депозита, если заявка подана Участником клиринга, имеющим на момент подачи заявки Расчетный код для М-Депозита.
- 19.3. Клиринговый центр информирует ПАО Московская Биржа об Участниках клиринга, имеющих право становиться стороной по договору М-Депозита, а также о номерах Расчетных кодов для М-Депозитов.
- 19.4. Клиринговый центр направляет ПАО Московская Биржа информацию об обязательствах и требованиях по договорам М-Депозита, включенных / не включенных в Клиринговый пул для М-Депозитов по результатам процедуры формирования указанного Клирингового пула в соответствии со статьей Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов в Расчетный день, в который осуществлялось формирование Клирингового пула для М-Депозитов, не реже одного раза в день.
- 19.5. Немедленно после получения информации о поданной Котировке участника торгов Клиринговый центр проверяет возможность регистрации Котировки участника торгов в Системе торгов.
Регистрация Котировки участника торгов в Системе торгов возможна при выполнении одновременно условий, указанных в подпунктах 1) - 5) пункта 19.2 настоящей статьи Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.
- 19.6. Процедура контроля обеспечения по сделкам с кодом расчетов T0, Z0, Rb, X0, Bn, B0-B30, Sn (за исключением договоров М-Депозита) осуществляется по Торгово-клиринговому счету, указанному в заявке на заключение сделки, или по Расчетному коду / Счету обеспечения T0, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в заявке на заключение сделки. Процедура контроля обеспечения по договорам М-Депозитов не осуществляется.
- 19.6.1. Процедура контроля обеспечения по сделкам с кодом расчетов Yn, T0/Yn, Ym/Yn, T0/YODn, Ym/YODn осуществляется по следующим Торгово-клиринговому счету T+ / Торгово-клиринговому счету имущественного пула и Расчетному коду:
- в случае если в заявке / Котировке участника торгов на заключение сделки указан Торгово-клиринговый счет T+, то по Торгово-клиринговому счету T+, указанному в заявке / Котировке участника торгов, и Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета T+, указанного в заявке / Котировке участника торгов;
 - в случае если в заявке / Котировке участника торгов на заключение сделки указан Торгово-клиринговый счет, в состав которого входят Раздел T0 и/или Счет обеспечения T0, то по Торгово-клиринговому счету T+, связанному с Торгово-клиринговым счетом, указанным в заявке / Котировке участника торгов, и по Расчетному коду, входящему в состав такого Торгово-

- клирингового счета T+;
- в случае если в заявке / Котировке участника торгов на заключение сделки указан Торгово-клиринговый счет имущественного пула, то по такому Торгово-клиринговому счету имущественного пула и по Расчетному коду, входящему в состав такого Торгово-клирингового счета имущественного пула;
 - по заявке на заключение депозитного договора - по Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в заявке.
- 19.6.2. Контроль достаточности обеспечения для исполнения обязательств по уплате оборотных частей комиссионных вознаграждений при подаче заявки / Котировки участника торгов осуществляется по Расчетному коду для списания комиссионных вознаграждений, порядок определения которого установлен общей частью Правил клиринга.
- 19.7. При выполнении условий, указанных в пункте 19.2 настоящей статьи, Клиринговый центр с использованием Системы торгов направляет Бирже Отчет о возможности регистрации заявки, при невыполнении хотя бы одного из условий, указанных в пункте 19.2 настоящей статьи, - Отчет о невозможности регистрации заявки.
- Отчет о невозможности регистрации заявки может быть направлен Клиринговым центром Бирже в иных случаях, установленных Правилами клиринга.
- 19.8. При выполнении условий, указанных в пункте 19.5 настоящей статьи Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, Клиринговый центр с использованием Системы торгов направляет Бирже Отчет о возможности регистрации Котировки участника торгов, при невыполнении хотя бы одного из условий, указанных в пункте 19.5 настоящей статьи Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, - Отчет о невозможности регистрации Котировки участника торгов.
- Отчет о невозможности регистрации Котировки участника торгов может быть направлен Клиринговым центром Бирже в иных случаях, установленных Правилами клиринга.
- 19.9. При регистрации заявки, являющейся в соответствии с Правилами торгов на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов допустимой встречной по отношению к зарегистрированной Котировке участника торгов, Клиринговый центр выполняет проверку прохождения Котировкой участника торгов Процедуры контроля обеспечения в порядке, аналогичном порядку, установленному статьей 20 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов для заявок на заключение сделок с соответствующим кодом расчетов. Отчет о результатах проверки прохождения Котировкой участника торгов Процедуры контроля обеспечения направляется Клиринговым центром Бирже.
- 19.10. При снятии в Системе торгов заявки / Котировки участника торгов с любым кодом расчетов Биржа с использованием Системы торгов направляет Клиринговому центру Уведомление о снятии заявки / Котировки участника торгов.
- 19.10.1. После получения Уведомления о снятии заявки на заключение сделки с кодом расчетов Yn, T0/Yn, Ym/Yn, T0/YODn, Ym/YODn поданной Участником торгов / Котировки участника торгов, стороной которой будет являться Участник клиринга, Клиринговый центр рассчитывает Единый лимит по соответствующему Расчетному

коду / Расчетному коду имущественного пула без учета отозванной заявки / Котировки участника торгов.

- 19.11. При регистрации в Системе торгов заявки, являющейся в соответствии с Правилами торгов на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов допустимой встречной по отношению к ранее зарегистрированной в Системе торгов заявке на заключение сделок с Клиринговым центром, Клиринговый центр заключает сделку с каждым из Участников клиринга, указанным в заявке в качестве стороны по сделке (за исключением заявок на заключение сделок с кодом расчетов К0 и заявок на заключение депозитного договора).
- 19.12. Клиринговый центр заключает сделку с Участниками клиринга, указанными в Котировке участника торгов и заявке в качестве стороны по сделке, при условии получения (поступлении на Биржу) от Участника торгов, подавшего Котировку, подтверждения на заключение сделки.
- 19.13. При регистрации в Системе торгов заявки на заключение сделки РЕПО с кодом расчетов Ym/Yn и заявки на заключение депозитного договора, являющихся в соответствии с Правилами торгов на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов допустимыми встречными заявками, Клиринговый центр заключает сделку РЕПО с кодом расчетов Ym/Yn с Участником клиринга, указанным в заявке на заключение такой сделки РЕПО в качестве стороны по сделке, и принимает на себя обязательство по обеспечению условий для заключения депозитного договора, указанное в Правилах торгов на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов. Заявки, по которым Клиринговый центр принял обязательства по обеспечению условий для заключения депозитного договора, вносятся Биржей в реестр предложений в порядке, установленном Правилами торгов на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.
- 19.13.1. Обязательство Клирингового центра по обеспечению условий для заключения депозитного договора заключается в обязанности Клирингового центра включить в соответствующий клиринговый пул обязательства по депозитному договору, заключенному в период с плановой даты заключения депозитного договора по следующий Расчетный день на условиях и в порядке, предусмотренном Правилами торгов на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.
- 19.14. После того, как информация о регистрации сделки стала доступной Клиринговому центру посредством Системы торгов, Клиринговый центр допускает к клирингу обязательства по заключенной сделке.
- 19.14.1. После того, как информация о регистрации сделки купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов Т0, К0, сделки РЕПО с кодом расчетов $T0/Yn$ стала доступной Клиринговому центру посредством Системы торгов, Клиринговый центр также:
- включает в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов по сделкам с центральным контрагентом с ближайшим временем исполнения обязательства/требования Участников клиринга по оплате и передаче ценных бумаг по заключенной сделке с кодом расчетов Т0, К0 / первой части заключенной сделки РЕПО с кодом расчетов $T0/Yn$;
 - рассчитывает Единый лимит по соответствующему Расчетному коду / Расчетному коду имущественного пула без учета заявки (части заявки), на основании которой была заключена указанная сделка, и с учетом указанной

заключенной сделки (для сделок, заключенных на основании заявок, поданных с указанием Торгово-клирингового счета Т+ / Торгово-клирингового счета имущественного пула).

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

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

19.14.3. После того, как информация о регистрации кредитного договора с кодом расчетов Rb стала доступной Клиринговому центру посредством Системы торгов, Клиринговый центр также:

- включает в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов с ближайшим временем исполнения обязательства / требования Участников клиринга по выдаче кредита по заключенному кредитному договору.

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

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

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

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

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

- включает в Клиринговый пул для расчетов в ходе торгов обязательства/требования Участников клиринга по оплате и передаче ценных бумаг по заключенной сделке (первой части заключенной сделки РЕПО) с кодом расчетов Z0, X0;
- рассчитывает Единый лимит по соответствующему Расчетному коду без учета заявки (части заявки), на основании которой была заключена указанная сделка, и с учетом указанной заключенной сделки (для сделок, заключенных на основании заявок, поданных с указанием Торгово-клирингового счета Т+);
- осуществляет взаимодействия с Расчетным депозитарием с целью проведения расчетов в ходе торгов по заключенной сделке (первой части заключенной сделки РЕПО) с кодом расчетов Z0, X0. Взаимодействие с Расчетным депозитарием с целью проведения расчетов по сделке с кодом расчетов X0 осуществляется с учетом требования, установленного подпунктом 47.3.1 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.

19.16. После того, как информация о заключенных при проведении депозитного аукциона договорах М-Депозита стала доступна Клиринговому центру посредством Системы торгов, Клиринговый центр:

в порядке, определенном статьей 37 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, проводит оценку возможности включения обязательств и требований по договорам М-Депозита в Клиринговый пул для М-Депозитов и включает в ближайший Клиринговый пул для М-Депозитов соответствующие обязательства / требования Участников клиринга по внесению денежных средств по договорам М-Депозита, прошедшие такую оценку.

19.17. Для целей расчета Единого лимита по заключенной Сделке РЕПО с открытой датой Датой исполнения второй части указанной сделки РЕПО считается Расчетный день, следующий за датой исполнения первой части (если первая часть сделки РЕПО еще не исполнена), или Расчетный день, следующий за текущей датой (если первая часть сделки РЕПО уже исполнена).

Статья 20. Процедура контроля обеспечения по сделкам

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

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

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

Для заявок на заключение кредитного договора, проверка, указанная в настоящем подпункте Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, осуществляется для операции выдачи кредита по кредитному договору по Участнику клиринга - кредитору.

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

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

Для заявок на заключение кредитного договора, проверка, указанная в настоящем подпункте Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, осуществляется для операции выдачи кредита по кредитному договору по Участнику клиринга - кредитору.

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

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

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

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

подпунктом 20.1.9 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов. При этом сумма операции, в отношении которой осуществляется указанная проверка, определяется в соответствии с подпунктами 20.1.1-20.1.4 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.

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

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

Для заявок на заключение кредитного договора, проверка, указанная в настоящем подпункте Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, осуществляется для операции выдачи кредита по кредитному договору по Участнику клиринга - кредитору.

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

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

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

Единый лимит по Расчетному коду является достаточным для исполнения обязательств по уплате оборотных частей комиссионных вознаграждений по Сделке, которая может быть заключена на основании поданной заявки, при условии, что

значение Единого лимита по Расчетному коду с учетом указанных обязательств не станет отрицательным.

Проверка достаточности Единого лимита по Расчетному коду для исполнения обязательств по уплате оборотных частей комиссионных вознаграждений не осуществляется при подаче заявок, приводящих к увеличению Единого лимита по Расчетному коду.

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

Для заявки на покупку ценных бумаг с кодом расчетов Y_n , $T0/Y_n$, Y_m/Y_n и для заявки на заключение депозитного договора с кодом расчетов Y_m/Y_n на заключение Сделки $T+$ с расчетами в иностранной валюте, для которой Клиринговым центром установлен признак «запрет коротких продаж», а также установлено значение параметра «лимит коротких продаж», отличное от нуля, Клиринговый центр проверяет, что значения в иностранной валюте, рассчитанные в соответствии с общей частью Правил клиринга для проверки возможности исполнения операции, проводимой по Торгово-клиринговому счету Участника клиринга при установлении Клиринговым центром для соответствующей иностранной валюты признака «запрет коротких продаж» значения параметра «лимит коротких продаж» для соответствующей иностранной валюты, отличное от нуля, с учетом обязательства в соответствующей иностранной валюте по Сделке, которая может быть заключена на основании поданной заявки, для каждой Даты исполнения, не станут ниже установленного Клиринговым центром значения параметра «лимит коротких продаж».

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

Для заявок на заключение кредитного договора, проверка, указанная в настоящем подпункте Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, осуществляется для операции выдачи кредита по кредитному договору по Участнику клиринга - кредитору.

20.1.11. Для заявки на продажу ценных бумаг с кодом расчетов Y_n , $T0/Y_n$, Y_m/Y_n на заключение Сделки $T+$, по которой должен осуществляться клиринг с полным обеспечением по ценным бумагам, дополнительно к проверке условий, указанных в подпункте 20.1.7 или подпункте 20.1.8 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, для заявки на продажу ценных бумаг с кодом расчетов $T0$, Rb , $Z0$, $X0$ на заключение сделки, Процедура контроля обеспечения по которой осуществляется по Торгово-клиринговому счету $T+$, дополнительно к проверке условий, указанных в подпунктах 20.1.3-20.1.4 и подпункте 20.1.5 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, Клиринговый центр проверяет, что значения в ценных бумагах, рассчитанные в соответствии с общей частью Правил клиринга для проверки возможности исполнения операции, проводимой по Торгово-клиринговому счету Участника клиринга при наличии признака «запрет необеспеченных покупок» / «запрет коротких продаж», и/или Участника клиринга категории «В», и/или ценных бумаг с признаком «запрет коротких продаж», с учетом обязательства в соответствующих ценных бумагах по Сделке, которая может быть заключена на основании поданной заявки, для каждой Даты исполнения (или для Дат исполнения, установленных общей частью Правил клиринга, в случае если Клиринговым центром установлен период действия признака «запрет коротких продаж» по ценной бумаге), не станут отрицательными, а в случае, если на конец Расчетного дня, предшествующего дню установления признака «запрет коротких продаж» по ценной бумаге на период, значение в ценных бумагах, рассчитанное в соответствии с общей частью Правил клиринга для проверки возможности исполнения операции, проводимой по Торгово-клиринговому счету Участника клиринга, при наличии признака «запрет необеспеченных покупок» / «запрет коротких продаж», и/или Участника клиринга категории «В», и/или ценных бумаг с признаком «запрет коротких продаж» для какой-либо из Дат исполнения являлось отрицательным, абсолютное значение отрицательного значения в ценных бумагах, рассчитанного с учетом обязательства в соответствующих ценных бумагах по Сделке, которая может быть заключена на основании поданной заявки для Дат исполнения, установленных общей частью Правил клиринга, в случае, если Клиринговым центром установлен период действия признака «запрет коротких продаж» по ценной бумаге, не увеличится.

Для заявки на продажу ценных бумаг с кодом расчетов Y_n , $T0/Y_n$, Y_m/Y_n на заключение Сделки $T+$, для которых Клиринговым центром установлен признак «запрет коротких продаж», а также установлено значение параметра «лимит коротких продаж», отличное от нуля, Клиринговый центр проверяет, что значения в ценных бумагах, рассчитанные в соответствии с общей частью Правил клиринга для проверки возможности исполнения операции, проводимой по Торгово-клиринговому счету Участника клиринга при установлении Клиринговым центром по такой ценной бумаге признака «запрет коротких продаж», а также значения параметра «лимит коротких продаж» для соответствующей ценной бумаги, отличное от нуля, с учетом обязательства в соответствующих ценных бумагах по Сделке, которая может быть заключена на основании поданной заявки, для каждой Даты исполнения, не станут ниже установленного Клиринговым центром значения параметра «лимит коротких продаж».

20.1.12. Для заявки на покупку ценных бумаг с кодом расчетов $T0$, Rb , $Z0$, $X0$ на заключение сделок с расчетами в российских рублях и заявки на покупку или продажу ценных бумаг с кодом расчетов $T0$, Rb , $Z0$, $X0$ на заключение сделок с расчетами в иностранной валюте, дополнительно к проверке условий, указанных в

- подпунктах 20.1.1-20.1.5 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, а также для заявки на покупку или на продажу с кодом расчетов Вп, В0-В30 или Sn, и для заявки на заключение кредитного договора с кодом расчетов Sn или Rb, Процедура контроля обеспечения по которым осуществляется по Счету обеспечения Т0, проверяется наличие денежных средств, учитываемых по такому Счету обеспечения Т0, необходимых для исполнения обязательства по уплате комиссионного вознаграждения по сделке, которая может быть заключена на основании поданной заявки.
- 20.1.13. Для заявок с кодом расчетов Т0, Z0, Rb, X0, Вп, В0-В30 или Sn проверки, указанные в подпунктах 20.1.1-20.1.5, Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, осуществляются с учетом Ограничительного лимита, установленного по соответствующему Счету обеспечения Т0 / Торгово-клиринговому счету.
- 20.1.14. Проверки, указанные в подпунктах 20.1.1-20.1.12 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, осуществляются с учетом поданной заявки, по которой осуществляется проверка, а также с учетом иных поданных заявок такой же направленности, а также зарегистрированных и не обеспеченных средствами под расчеты Отчетов на исполнение (Специальных отчетов на исполнение, Срочных отчетов на исполнение) такой же направленности, Поручений на отказ от исполнения сделки РЕПО, приводящих к изменению информации о денежных средствах / ценных бумагах, учитываемых по тому же клиринговому регистру, что и проверяемая заявка.
- 20.1.15. Для заявок на покупку ценных бумаг, поданных Участником клиринга категории «А», проверки, указанные в подпунктах 20.1.1, 20.1.5-20.1.8, 20.1.12, 20.1.13 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, не осуществляются.
- Для заявок на продажу ценных бумаг, поданных Участником клиринга категории «А», проверка, указанная в подпункте 20.1.3 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, осуществляется только в случае принятия Участником клиринга категории «А» на себя обязательств по внесению индивидуального клирингового обеспечения в ценных бумагах.
- 20.1.16. Для заявок на заключение депозитного договора и заявок на заключение сделок РЕПО с кодом расчетов Т0/Уп, Ум/Уп, Т0/УОДп, Ум/УОДп поданных Участником клиринга категории «К», проверки, предусмотренные настоящей статьей Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, не осуществляются.
- 20.2. В случае прохождения заявки на покупку или на продажу Процедуры контроля обеспечения, в ходе которой осуществлялась проверка достаточности Единого лимита по Расчетному коду / Расчетному коду имущественного пула, Клиринговый центр начинает учитывать значение Единого лимита по соответствующему Расчетному коду / Расчетному коду имущественного пула, рассчитанное в соответствии с подпунктом 20.1.9 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, в качестве нового значения Единого лимита по Расчетному коду / Расчетному коду имущественного пула, в случае непрохождения – Клиринговый центр не изменяет учитываемое значение Единого лимита по Расчетному коду / Расчетному коду имущественного пула.

- 20.3. Для заявок с отложенной датой активации Процедура контроля обеспечения в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов осуществляется в дату активации во время, установленное Временным регламентом на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов (далее – основная Процедура контроля обеспечения).
- 20.4. Для заявок с отложенной датой активации на условиях «Частичное обеспечение/отступное» осуществляется дополнительная Процедура контроля обеспечения при подаче такой заявки или в иной момент, установленный решением Биржи. Указанная процедура считается пройденной при соблюдении следующих условий:
- для заявок на покупку: сумма частичного обеспечения в денежных средствах, рассчитанная как произведение размера ставки частичного обеспечения и объема заявки, включающего НКД, не превышает суммы Обеспечения, учитываемого по соответствующему Расчетному коду;
 - для заявок на продажу: при условии достаточности Единого лимита по соответствующему Расчетному коду с учетом суммы частичного обеспечения в денежных средствах, рассчитанной как произведение размера ставки частичного обеспечения и объема заявки;
 - при условии достаточности Единого лимита по Расчетному коду для исполнения обязательств по уплате оборотных частей комиссионных вознаграждений в соответствии с подпунктом 20.1.9 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов;
 - при выполнении условия, указанного в подпункте 20.1.10 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, для указанной суммы частичного обеспечения.

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

- 20.4.1. В случае непрохождения заявки с отложенной датой активации на условиях «Частичное обеспечение/отступное» основной Процедуры контроля обеспечения Клиринговый центр включает в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов с ближайшим временем исполнения обязательство по уплате / требования по получению отступного за отказ от исполнения обязательств по заключению сделки на основании заявки с отложенной датой активации на условиях «Частичное обеспечение/отступное», величина которого определяется в соответствии с пунктом 27.17 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов (далее – отступное за отказ от заключения сделки).
- 20.5. Для заявок на покупку с отложенной датой активации на условиях «Частичное обеспечение/отступное» со ставкой частичного обеспечения в размере 100% осуществляется дополнительная Процедура контроля обеспечения при подаче такой заявки или в иной момент, установленный решением Биржи. При этом основная Процедура контроля обеспечения в отношении указанных заявок не производится.

ПОДРАЗДЕЛ IV-III. ОСОБЕННОСТИ ОПРЕДЕЛЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ ПО СДЕЛКАМ

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

21.1. Если решением Клирингового центра или Правилами клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов не определено иное, в том числе иной срок изменения Суммы РЕПО при начислении в течение срока сделки РЕПО купонного (процентного) дохода по облигациям и/или погашения части основного долга (проведения амортизационной выплаты) по облигациям, то при выплате в течение срока сделки РЕПО, заключенной без участия центрального контрагента (за исключением сделки РЕПО, заключенной в Режимах торгов «РЕПО с Банком России: Аукцион РЕПО», «РЕПО с Банком России: фикс.ставка», «РЕПО с Банком России: плав.ставка (доп.механизм)» или «Аукцион РЕПО с Банком России: плавающая ставка»), купонного (процентного) дохода по облигациям и/или погашения части основного долга (проведения амортизационной выплаты) по облигациям, Сумма РЕПО уменьшается на величину уплаченного купонного (процентного) дохода и/или на величину погашенной части основного долга (амортизационной выплаты) с даты получения Клиринговым центром от Платежного агента по облигациям, в сроки и в порядке определенным соглашением с Платежным агентом по облигациям, информации о проведении выплаты начисленного купонного (процентного) дохода и/или погашенной части основного долга (проведения амортизационной выплаты).

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

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

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

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

- 21.1.4. Если решением Клирингового центра не определено иное, Сумма РЕПО в сделках РЕПО, заключенных с облигациями в Режимах торгов, определенных решением Биржей, уменьшается на величину начисленного купонного (процентного) дохода и/или на величину погашенной части основного долга (амортизационной выплаты) исходя из кросс-курса на дату начала следующего купонного периода по облигациям, определенной эмиссионными документами (на дату получения от Платежного агента информации о выплате такого дохода, в случае получения Клиринговым центром соответствующей информации в порядке, определенном соглашением с Платежным агентом).
- 21.2. Если решением Клирингового центра или Правилами клиринга не предусмотрено иное, Участник клиринга - покупатель по первой части РЕПО обязан передать Участнику клиринга - продавцу по первой части РЕПО любые дивиденды, проценты или иное распределение на ценные бумаги, в отношении которых заключена сделка РЕПО, в течение 30 (тридцати) календарных дней, следующих за днем выплаты/передачи эмитентом таких дивидендов, процентов или иного распределения на ценные бумаги, в отношении которых заключена сделка РЕПО, если список лиц, имеющих право на их получение, определяется в период после исполнения обязательств по передаче ценных бумаг по первой части сделки РЕПО и до исполнения обязательств по передаче ценных бумаг по второй части сделки РЕПО. Стороны вправе дополнительным соглашением установить иной срок и (или) порядок передачи таких дивидендов, процентов или иного распределения на ценные бумаги, в отношении которых заключена сделка РЕПО, переданного эмитентом в неденежном виде.
- 21.3. По сделкам РЕПО, заключенным без участия центрального контрагента в Режимах торгов «РЕПО с Банком России: Аукцион РЕПО», «РЕПО с Банком России: фикс.ставка», «РЕПО с Банком России: плав.ставка (доп.механизм)» или «Аукцион РЕПО с Банком России: плавающая ставка», Участник клиринга - покупатель по первой части РЕПО обязан передать Участнику клиринга - продавцу по первой части РЕПО Доход на ценные бумаги, в отношении которых заключена сделка РЕПО, в порядке и сроки, определенные статьей 49 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, если список лиц, имеющих право на получение дивидендов, процентов или иного распределения, определяется в период после исполнения обязательств по передаче ценных бумаг по первой части сделки РЕПО и до исполнения обязательств по передаче ценных бумаг по второй части сделки РЕПО.
- 21.4. По сделкам РЕПО, являющимися Сделками Т+, Участник клиринга - покупатель по первой части РЕПО обязан передать Участнику клиринга - продавцу по первой части РЕПО Доход на ценные бумаги, в отношении которых заключена сделка РЕПО, в порядке и сроки, определенные статьей 48 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, если список лиц, имеющих право на получение дивидендов, процентов или иного распределения, определяется в период после исполнения обязательств по передаче ценных бумаг по первой части сделки РЕПО и до исполнения обязательств по передаче ценных бумаг по второй части сделки РЕПО.
- 21.5. Для сделок РЕПО, заключенных без участия центрального контрагента, действуют следующие условия:

- 21.5.1. В случае уплаты Участником клиринга - продавцом по первой части сделки РЕПО Участнику клиринга - покупателю по первой части сделки РЕПО компенсационных взносов в денежной форме сумма РЕПО уменьшается на величину таких компенсационных взносов в дату их внесения. В случае отсутствия в течение срока РЕПО по сделке РЕПО компенсационных взносов в денежной форме (или в случае отказа от получения компенсационных взносов в соответствии с пунктом 31.7 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов) сумма РЕПО остается неизменной (за исключением случаев выплат купонных (процентных) доходов и погашения части основного долга (проведение амортизационной выплаты) по облигациям).
- 21.5.2. В случае внесения Участником клиринга - покупателем по первой части сделки РЕПО Участнику клиринга - продавцу по первой части сделки РЕПО компенсационных взносов в форме ценных бумаг, текущее количество ценных бумаг по сделке РЕПО (обязательство по второй части сделки РЕПО для покупателя перед продавцом по первой части сделки РЕПО) уменьшается на количество ценных бумаг, составляющих величину таких компенсационных взносов (на дату их внесения). Если внесения компенсационных взносов в форме ценных бумаг не требуется, то текущее количество ценных бумаг по сделке РЕПО остается неизменным.
- 21.5.3. В случае невнесения в надлежащие сроки компенсационного взноса по Сделке РЕПО с открытой датой Участником клиринга, у которого возникла такая обязанность, Датой исполнения второй части такой Сделки РЕПО с открытой датой будет являться Расчетный день, следующий за датой, в которую возникла обязанность по внесению компенсационного взноса.
- 21.5.4. Если решением Клирингового центра не установлено иное, каждый Расчетный день, начиная с фактической даты исполнения обязательств по первой части сделки РЕПО (включая эту дату – для сделок РЕПО, заключаемых в режимах торгов «РЕПО с Банком России: Аукцион РЕПО», «РЕПО с Банком России: фикс.ставка», «РЕПО с Банком России: плав.ставка (доп.механизм)» или «Аукцион РЕПО с Банком России: плавающая ставка», и не включая эту дату – для сделок РЕПО, заключаемых в иных режимах торгов) до фактической даты исполнения обязательств по второй части этой сделки РЕПО или до Даты прекращения исполнения этой сделки РЕПО (включая эту дату (для сделок РЕПО за исключением заключаемых в режимах торгов «РЕПО с Банком России: Аукцион РЕПО», «РЕПО с Банком России: фикс.ставка», «РЕПО с Банком России: плав.ставка (доп.механизм)» или «Аукцион РЕПО с Банком России: плавающая ставка», и не включая дату для сделок РЕПО, заключаемых в таких режимах), в Клиринговой системе рассчитывается доход по сделке РЕПО и стоимость обратного выкупа по следующим формулам:

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

, где:

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

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

S_j - Сумма РЕПО в j-ый день;

R_j - Ставка РЕПО в j -ый день;

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

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

$$S_{II}^j = S_j + I_j, \text{ где}$$

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

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

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

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

Для сделок РЕПО, заключенных в Режимах торгов «РЕПО с Банком России: Аукцион РЕПО», «РЕПО с Банком России: фикс.ставка», «РЕПО с Банком России: плав.ставка (доп.механизм)» и «Аукцион РЕПО с Банком России: плавающая ставка» разница между i -ый дням и следующим за ним первым j -ым днем принимается равной 1 (единице) для целей расчета стоимости обратного выкупа.

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

Информация о размере индикативной ставки по сделке РЕПО с плавающей ставкой РЕПО, а также о величине отклонения от индикативной ставки предоставляется Участникам клиринга в Выписке из реестра сделок, принятых в клиринг, направляемой Клиринговым центром.

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

21.6. Для Сделок РЕПО с открытой датой Датой исполнения второй части Сделки РЕПО с открытой датой будет являться дата истечения периода времени, который в соответствии с заявкой на заключение Сделки РЕПО с открытой датой должен пройти между датой подачи поручения на исполнение второй части Сделки РЕПО с открытой датой и Датой исполнения второй части Сделки РЕПО с открытой датой (далее - Период до исполнения второй части РЕПО с открытой датой), или дата регистрации Клиринговым центром поданных Участниками клиринга, являющимися сторонами по Сделке РЕПО с открытой датой, Отчетов на исполнение.

21.6.1. В случае если окончание Периода до исполнения второй части Сделки РЕПО с открытой датой приходится на дату, не являющуюся Расчетным днем, Датой исполнения второй части Сделки РЕПО с открытой датой будет являться следующий за датой окончания Периода до исполнения второй части Сделки РЕПО с открытой датой Расчетный день за исключением случаев, предусмотренных настоящим пунктом Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.

21.6.2. В случае если в течение периода времени, исходя из максимально возможной Даты исполнения второй части Сделки РЕПО с открытой датой, указанной в заявке на заключение Сделки РЕПО с открытой датой, поручение на исполнение второй части Сделки РЕПО с открытой датой или Отчет на исполнение направлен не был, Датой исполнения Сделки РЕПО с открытой датой будет являться:

- дата, соответствующая максимально возможной Дате исполнения второй части Сделки РЕПО с открытой датой, указанной в заявке на заключение Сделки РЕПО с открытой датой, или
- последний Расчетный день в рамках периода времени, начинающегося с даты заключения Сделки РЕПО с открытой датой и заканчивающегося в максимально возможную Дату исполнения второй части Сделки РЕПО с открытой датой согласно заявке на заключение Сделки РЕПО с открытой датой, если дата, соответствующая максимально возможной Дате исполнения второй части Сделки РЕПО с открытой датой согласно заявке на заключение Сделки РЕПО с открытой датой, не является Расчетным днем;

21.6.3. В случае если дата окончания Периода до исполнения второй части Сделки РЕПО с открытой датой приходится на более поздний по отношению к максимально возможной Дате исполнения второй части Сделки РЕПО с открытой датой срок, Датой исполнения Сделки РЕПО с открытой датой будет являться последний Расчетный день в рамках периода времени, начинающегося с даты заключения Сделки РЕПО с открытой датой и заканчивающегося в максимально возможную Дату исполнения второй части Сделки РЕПО с открытой датой согласно заявке на заключение Сделки РЕПО с открытой датой.

21.6.4. В случае наличия информации о предстоящих в течение периода времени, исходя из максимально возможной Даты исполнения второй части Сделки РЕПО с открытой датой, указанной в заявке на заключение Сделки РЕПО с открытой датой, корпоративных событиях, препятствующих исполнению второй части Сделки РЕПО с открытой датой, Датой исполнения второй части Сделки РЕПО с открытой датой является последний Расчетный день перед указанным корпоративным событием, если иное не установлено решением Клирингового центра, которое может быть принято при наступлении указанных обстоятельств в соответствии с общей частью Правил клиринга.

21.7. Для кредитных договоров действуют следующие условия:

21.7.1. Если решением Клирингового центра не установлено иное, каждый Расчетный день, начиная с фактической даты исполнения обязательств по выдаче кредита по кредитному договору (не включая эту дату) до фактической даты исполнения обязательств по возврату кредита по кредитному договору, в Клиринговой системе рассчитывается доход в виде процентов по кредитному договору (далее – доход по кредитному договору) и размер обязательства по возврату кредита по кредитному договору (с учетом начисленных процентов) по следующим формулам:

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

где:

I_j - доход по кредитному договору в j-ый день;

S - Сумма кредита;

R_j - Ставка по кредитному договору в j -ый день;

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

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

$$S_{II}^j = S + I_j, \text{ где}$$

S_{II}^j - размер обязательства по возврату кредита по кредитному договору в j -ый день;

S - Сумма кредита.

Информация о размере индикативной ставки по кредитному договору с плавающей ставкой, а также о величине отклонения от индикативной ставки предоставляется Участникам клиринга в Выписке из реестра сделок, принятых в клиринг, направляемой Клиринговым центром.

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

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

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

Dt - текущее значение дисконта;

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

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

$$C_j = N_j * (P_j + At_j) * e_j / r_j, \text{ где}$$

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

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

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

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

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

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

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

- 21.8.2. Если решением Клирингового центра не установлено иное, в Режимов торгов «РЕПО с Банком России: Аукцион РЕПО», «РЕПО с Банком России: фикс.ставка», «РЕПО с Банком России: плав.ставка (доп.механизм)» и «Аукцион РЕПО с Банком России: плавающая ставка» каждый день, в который проводятся торги, при условии проведения торгов по ценной бумаге, по которой заключена данная сделка РЕПО, начиная с Даты исполнения обязательств по первой части сделки РЕПО до Даты исполнения обязательств по второй части этой сделки РЕПО, или до Даты прекращения исполнения этой сделки РЕПО, в Клиринговой системе после расчета расчетной цены дополнительно к значениям, рассчитываемым в соответствии с пунктом 21.8.1 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, рассчитывается текущий дефицит маржи:

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

Ds – текущий дефицит маржи;

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Dn – начальное значение дисконта.

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

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

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

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

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

Dn – начальное значение дисконта;

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

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

$\text{int}\{X\}$ – функция выделения целой части значения X ;

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

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

- 21.8.6. Порядок подачи поручений на внесение компенсационных взносов определен в статье 31 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, порядок исполнения обязательств по внесению компенсационных взносов – в разделе V-III Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.
- 21.9. В случае если в Дату внесения компенсационного взноса Участник клиринга отказался от получения компенсационного взноса в соответствии с пунктом 31.7 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, то Участник клиринга – контрагент по сделке освобождается от уплаты компенсационного взноса. В случае если в Дату внесения компенсационного взноса компенсационный взнос не был внесен, и Участник клиринга не отказался от получения компенсационного взноса в соответствии с пунктом 31.7 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, то обязательство по уплате компенсационного взноса считается неисполненным и срок его исполнения не подлежит пролонгации. В этом случае Датой исполнения обязательств по второй части соответствующей сделки РЕПО является первый Расчетный день, следующий за Датой внесения компенсационного взноса, в которую обязательство по внесению компенсационного взноса не было исполнено. Обязательства по второй части соответствующей сделки РЕПО должны быть исполнены обеими ее сторонами досрочно (до Даты исполнения обязательств по второй части сделки РЕПО, определенной при ее заключении), а именно, в первый Расчетный день, следующий за Датой внесения компенсационного взноса, в которую обязательство по внесению компенсационного взноса не было исполнено (исходя из рассчитанных в Клиринговой системе на соответствующую дату параметров сделки РЕПО).
- 21.10. Решением Клирингового центра может быть предусмотрено, что если величина рассчитанного Клиринговым центром компенсационного взноса в форме ценных бумаг по сделке РЕПО, подлежащего внесению в текущий Расчетный день, равна количеству ценных бумаг по такой сделке РЕПО, такой компенсационный взнос не подлежит внесению.
- 21.11. Решением Клирингового центра может быть предусмотрено, что если текущее значение Суммы РЕПО по сделке РЕПО с облигациями меньше производимой в текущий день выплаты дохода по облигации (купонный доход и амортизационная выплата), то сумма РЕПО не уменьшается на величину выплаченного дохода. Такой доход по облигации должен быть передан Участником клиринга - покупателем по первой части РЕПО Участнику клиринга - продавцу по первой части РЕПО в валюте выплаченного эмитентом ценных бумаг дохода, в срок, определенный пунктом 21.2 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.
- 21.12. Если решением Клирингового центра не установлено иное, каждый Расчетный день, начиная с фактической даты исполнения обязательств по первой части сделки РЕПО, являющейся Сделкой T+ (не включая эту дату), до фактической даты исполнения

обязательств по второй части этой сделки РЕПО, или до Даты прекращения исполнения этой сделки РЕПО (включая эту дату), в Клиринговой системе рассчитывается доход по сделке РЕПО и стоимость обратного выкупа по следующим формулам:

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

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

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

S – Сумма РЕПО в Расчетный день Даты исполнения обязательств по первой части сделки РЕПО;

R_j – Ставка РЕПО в j-ый день;

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

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

$$S_{II}^j = S_j + I_j$$

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

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

i-ый день – Дата последнего изменения перед текущим Расчетным (j-ым) днем следующих условий по сделке РЕПО: Сумма РЕПО и/или Ставка РЕПО

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

Информация о размере индикативной ставки по сделке РЕПО с плавающей ставкой РЕПО, а также о величине отклонения от индикативной ставки предоставляется Участникам клиринга в Выписке из реестра сделок, принятых в клиринг, направляемой Клиринговым центром.

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

$$A_{II}^j = N_j * At_j * e_j, \text{ где}$$

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

N_j – количество ценных бумаг в сделке,

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

Статья 22. Особенности определения обязательств по депозитным договорам

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

I_j – доход по депозиту в j -ый день;

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

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

R_j – процентная ставка в j -ый день;

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

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

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

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

i -ый день – Дата исполнения обязательств по внесению депозита по заключенному депозитному договору, либо дата последнего изменения перед текущим (j -ым) днем условия по депозитному договору: процентная ставка по депозиту.

Информация о размере индикативной ставки по депозитному договору с плавающей ставкой, а также о величине отклонения от индикативной ставки предоставляется Участникам клиринга в Выписке из реестра сделок, принятых в клиринг, направляемой Клиринговым центром.

22.2. В случае исполнения Заявления на временный возврат части депозита доход по депозиту пересчитывается Клиринговым центром с учетом изменения процентной ставки в соответствии с пунктом 36.16 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.

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

- документ об обращении взыскания), уведомляет Участника клиринга о необходимости внесения денежных средств в размере, необходимом для исполнения взыскания. Указанное уведомление направляется Участнику клиринга с использованием ЭДО.
- 22.4. В следующий за днем уведомления Расчетный день (если следующий Расчетный день является следующим календарным днем) или в день уведомления (если следующий Расчетный день не является следующим календарным днем) во время, определенное Временным регламентом, являющимся приложением к общей части Правил клиринга, как время первого в течение Расчетного дня исполнения Итоговых нетто-обязательств Участника клиринга по денежным средствам в соответствующей валюте, Клиринговый центр исполняет документ об обращении взыскания.
- 22.4.1. Для исполнения документа об обращении взыскания Клиринговый центр использует Обеспечение Участника клиринга, учитываемое по собственным Расчетным кодам Участника клиринга в размере, для которого выполняются условия возврата Обеспечения, предусмотренные общей частью Правил клиринга (далее – свободное обеспечение).
- 22.4.2. При недостаточности свободного обеспечения для исполнения документа об обращении взыскания, обязательство (обязательства) по возврату суммы депозита, на которую был заключен депозитный договор (депозитные договоры), по заключенному (заключенным) с таким Участником клиринга депозитному договору (депозитным договорам), прекращается возникновением обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга Обеспечения в соответствующей валюте. Указанное обязательство (обязательства) по возврату суммы депозита прекращается полностью или в части, равной разнице между суммой взыскания, расходов по совершению исполнительных действий, исполнительского сбора и суммой свободного обеспечения. При этом размер Обеспечения Участника клиринга в соответствующей валюте, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, увеличивается на размер прекращенного обязательства по возврату суммы депозита. После выполнения действий, указанных в настоящем подпункте, Клиринговый центр исполняет документ об обращении взыскания.
- 22.4.3. В случае прекращения обязательства (обязательств) по возврату суммы депозита в соответствии с подпунктом 22.4.2 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, Клиринговый центр пересчитывает размер ранее рассчитанного дохода по депозиту: доход по депозиту для прекращенной части депозита с даты заключения депозитного договора (не включая эту дату) до дня, указанного в пункте 22.4 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов (включая этот день), рассчитывается в соответствии с процентной ставкой равной 0,01% годовых, доход по депозиту для непрекращенной суммы депозита рассчитывается в соответствии с процентной ставкой депозитного договора.
- 22.4.4. Начиная со дня, следующего за днем, указанным в пункте 22.4 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, при расчете дохода по депозиту сумма депозита принимается равной величине, равной сумме депозита, уменьшенной на размер прекращенного обязательства по возврату депозитов.
- 22.5. Клиринговый центр вправе изменить размер обязательства (обязательств) по возврату суммы депозита, на которую был заключен депозитный договор

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

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

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

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

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

- 22.5.4. В случае уменьшения размера обязательства (обязательств) по возврату суммы депозита в соответствии с пунктом 22.5 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, Клиринговый центр пересчитывает размер ранее рассчитанного дохода по депозиту: доход по части депозита, равной разнице между суммой, на который было уменьшено обязательство по возврату депозита, и суммой, на которую был выполнен депозит (депозиты), с даты заключения депозитного договора (не включая эту дату) до дня, указанного в пункте 22.4 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов (включая этот день), рассчитывается в соответствии с процентной ставкой равной 0,01% годовых, доход по депозиту для непрерывной суммы депозита и выполненной части депозита рассчитывается в соответствии с процентной ставкой депозитного договора.
- 22.5.5. В случае прекращения обязательства (обязательств) по возврату суммы депозита полностью в соответствии с пунктом 22.5 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, Клиринговый центр пересчитывает размер ранее рассчитанного дохода по депозиту с даты заключения депозитного договора (не включая эту дату) до дня, указанного в пункте 22.4 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов (включая этот день), в соответствии с процентной ставкой, равной 0,01% годовых.
- 22.5.6. Начиная со дня, указанного в пункте 22.4 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, при расчете дохода по депозиту сумма депозита принимается равной величине, равной сумме депозита, уменьшенной на разницу между размером, на который было уменьшено обязательство по возврату депозита, и суммой, на которую был выполнен депозит.
- 22.6. Выбор депозитного договора (депозитных договоров), обязательство по которому прекращается полностью или в части, необходимой для исполнения документа об обращении взыскания, осуществляется Клиринговым центром в порядке убывания даты и времени заключения депозитного договора.
- 22.7. При обращении взыскания на денежные средства Участника клиринга в иностранной валюте, размещенные в депозит, Клиринговый центр продает иностранную валюту по курсу не ниже Нижней границы ценового коридора.
- 22.8. В случае наложения ареста на денежные средства Участника клиринга, размещенные в депозит, условия депозитного договора не меняются. В дату возврата депозита Клиринговый центр устанавливает ограничение на списание и иное использование денежных средств, составляющих Обеспечение Участника клиринга и полученных Участником клиринга в результате исполнения Клиринговым центром обязательств по возврату Участнику клиринга депозитов, в сумме, указанной в документе, являющемся основанием для наложения ареста.
- 22.9. В случае, если стороной по депозитному договору является Участник клиринга-государственная корпорация / Участник клиринга-государственная компания / Участник клиринга-публично-правовая компания, и Клиринговый центр перестал удовлетворять требованиям, предусмотренным Правилами инвестирования временно свободных средств государственной корпорации, государственной компании, публично-правовой компании, утвержденными постановлением (постановлениями) Правительства Российской Федерации, такой Участник клиринга вправе до Даты исполнения обязательства по возврату депозита досрочно расторгнуть депозитный договор (депозитные договоры) путем направления в

Клиринговый центр заявления в свободной форме с указанием основания досрочного расторжения депозитного договора (депозитных договоров).

- 22.9.1. Обязательство (обязательства) по возврату суммы депозита, на которую был заключен депозитный договор (депозитные договоры), по заключенному (заключенным) с таким Участником клиринга депозитному договору (депозитным договорам), прекращается (прекращаются) возникновением обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга Обеспечения в соответствующей валюте не позднее 10 (десятого) Расчетного дня, следующего за днем получения заявления Участника клиринга-государственной корпорации / Участника клиринга-государственной компании / Участника клиринга-публично-правовой компании о досрочном прекращении депозитного договора.
- 22.10. В случае прекращения обязательства (обязательств) по возврату суммы депозита в соответствии с подпунктом 22.9.1 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, Клиринговый центр не пересчитывает размер ранее рассчитанного дохода по депозиту: доход по депозиту рассчитывается в соответствии с процентной ставкой депозитного договора за период с даты заключения депозитного договора (не включая эту дату) до даты прекращения обязательства (обязательств) по возврату суммы депозита в соответствии с подпунктом 22.9.1 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов (включая эту дату).

РАЗДЕЛ V. ПОРЯДОК ПРОВЕДЕНИЯ КЛИРИНГА

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

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

- 23.1. Клиринговый центр выдает клиринговые сертификаты участия на имущество, внесенное в соответствующий имущественный пул.
- 23.2. Внесение российских рублей и иностранной валюты в имущественный пул возможно следующими способами:
- 1) путем перечисления денежных средств на соответствующий клиринговый банковский счет Клирингового центра по реквизитам, размещенным на Сайте Клирингового центра, с обязательным указанием в назначении платежа Расчетного кода имущественного пула;
 - 2) путем исполнения распоряжения на перевод денежных средств, поданного Участником клиринга с использованием Клиринговой системы;
 - 3) путем исполнения Запроса на перевод обеспечения.
- 23.3. Внесение ценных бумаг в имущественный пул возможно двумя способами:
- 1) путем исполнения распоряжения на перевод ценных бумаг (за исключением клиринговых сертификатов участия), поданного Участником клиринга с использованием Клиринговой системы;
 - 2) в результате исполнения Запроса на подбор ценных бумаг, поданного Участником клиринга с использованием Клиринговой системы.
- 23.4. Для внесения драгоценных металлов в имущественный пул Участнику клиринга должен быть открыт отдельный торговый банковский счет в соответствующем драгоценном металле, предназначенный для внесения имущества в имущественный пул.
- 23.5. Внесение драгоценных металлов в имущественный пул возможно следующими способами:
- 1) путем зачисления драгоценных металлов на торговый банковский счет в соответствующем драгоценном металле;
 - 2) путем исполнения распоряжения на перевод драгоценных металлов, поданного Участником клиринга с использованием Клиринговой системы (при наличии такой возможности);
 - 3) путем исполнения Запроса на перевод обеспечения.
- 23.6. Клиринговый центр учитывает в Клиринговой системе денежные средства / драгоценные металлы, перечисленные на соответствующий клиринговый банковский счет Клирингового центра / торговый банковский счет в соответствующем драгоценном металле, по Расчетному коду имущественного пула, указанному в назначении платежа / Расчетному коду имущественного пула, соответствующему торговому банковскому счету в драгоценном металле, на который зачислен драгоценный металл, и увеличивает Единый лимит по пулу по

- такому Расчетному коду имущественного пула с учетом суммы перечисленных денежных средств / количества зачисленного драгоценного металла.
- 23.6.1. Если Расчетный код имущественного пула, указанный в назначении платежа, не найден среди зарегистрированных Клиринговым центром Расчетных кодов имущественного пула, Клиринговый центр вправе запросить у Участника клиринга уточнение назначения платежа. В случае получения от Участника клиринга или от банка плательщика уточнения назначения платежа, учет денежных средств в соответствии с пунктом 23.6 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, осуществляется Клиринговым центром после получения от Участника клиринга / банка плательщика такого уточнения назначения платежа с правильно указанным Расчетным кодом имущественного пула.
- 23.6.2. Если в течение 5 (пяти) Расчетных дней по соответствующей валюте с даты, следующей за датой зачисления денежных средств в российских рублях / иностранной валюте на соответствующий клиринговый банковский счет Клирингового центра с не указанным / неправильно указанным Расчетным кодом имущественного пула в назначении платежа, Участник клиринга / банк плательщика не предоставит Клиринговому центру уточнение назначения платежа с правильно указанным Расчетным кодом имущественного пула, Клиринговый центр возвращает указанные денежные средства по реквизитам плательщика.
- 23.6.3. Денежные средства, зачисленные на соответствующий клиринговый банковский счет Клирингового центра позднее времени, установленного Временным регламентом на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, учитываются Клиринговым центром в следующем Расчетном дне.
- 23.7. После перечисления денежных средств на клиринговый банковский счет Клирингового центра, открытый в Расчетной организации, и учета их в качестве имущества, внесенного в имущественный пул, у Клирингового центра возникает обязательство вернуть имущество из имущественного пула Участнику клиринга. Указанное обязательство исполняется с учетом условий, определенных статьей 24 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.
- 23.7.1. Клиринговый центр вправе осуществить в любое время зачет денежных требований Участника клиринга по возврату ему денежных средств, внесенных в имущественный пул и учитываемых по Расчетному коду имущественного пула, с денежными требованиями Клирингового центра к этому Участнику клиринга, учитываемыми по такому Расчетному коду имущественного пула.
- 23.8. Порядок подачи и исполнения распоряжений на перевод денежных средств / ценных бумаг / драгоценных металлов определен общей частью Правил клиринга с учетом следующих особенностей:
- 23.8.1. В распоряжении на перевод денежных средств / ценных бумаг / драгоценных металлов, подаваемом с целью внесения имущества в имущественный пул, в качестве Торгово-клирингового счета, по которому осуществляется увеличение денежных средств / ценных бумаг / драгоценных металлов, должен быть указан Торгово-клиринговый счет имущественного пула.
- 23.8.2. Участник клиринга вправе предоставить Клиринговому центру Запрос об ограничении Торгово-клиринговых счетов для внесения и выдачи имущества.

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

1) ограничение для всех Торгово-клиринговых счетов.

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

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

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

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

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

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

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

23.8.6. Распоряжение на перевод ценных бумаг на Торгово-клиринговый счет имущественного пула, в состав которого входит субсчет депо имущественного пула, открытый иностранному номинальному держателю, для которого установлены

ограничения на зачисление таких ценных бумаг на его счета депо, не исполняется Клиринговым центром.

- 23.8.7. После увеличения суммы денежных средств / количества драгоценного металла / ценных бумаг, учитываемых по Расчетному коду имущественного пула / Торгово-клиринговому счету имущественного пула значение Единого лимита по пулу по Расчетному коду имущественного пула, входящему в состав Торгово-клирингового счета имущественного пула, указанного в распоряжении, увеличивается с учетом переведенной суммы денежных средств / количества драгоценного металла / ценных бумаг.
- 23.9. Порядок подачи и исполнения Запросов на подбор ценных бумаг с целью их внесения в имущественный пул определен общей частью Правил клиринга.
- 23.9.1. После увеличения количества ценных бумаг, учитываемых по Торгово-клиринговому счету имущественного пула, значение Единого лимита по пулу по Расчетному коду имущественного пула, входящему в состав такого Торгово-клирингового счета имущественного пула, увеличивается с учетом зачисленного количества ценных бумаг.
- 23.10. Порядок исполнения Запроса на перевод обеспечения определен общей частью Правил клиринга.
- 23.11. В случае подачи Участником клиринга Запроса на перевод обеспечения / распоряжения на перевод денежных средств / драгоценных металлов, указанного в настоящей статье Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, позднее срока, установленного Временным регламентом на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов для зачисления денежных средств на клиринговый банковский счет Клирингового центра для выдачи клиринговых сертификатов участия в текущем Расчетном дне, Клиринговый центр осуществляет выдачу клиринговых сертификатов участия на имущество, внесенное в имущественный пул в результате исполнения такого запроса / распоряжения, в Расчетный день, следующий за датой исполнения Клиринговым центром такого запроса / распоряжения.
- 23.12. Имущество, внесенное в имущественный пул, используется в следующей очередности:
- 1) для обеспечения исполнения обязательств по договору об имущественном пуле;
 - 2) для обеспечения исполнения обязательств по сделкам РЕПО с клиринговыми сертификатами участия при проведении ликвидационного неттинга в отношении Участника клиринга, клиента Участника клиринга или Клирингового центра в соответствии с общей частью Правил клиринга;
 - 3) для обеспечения исполнения обязательств Участника клиринга по Сделкам, в том числе по сделкам РЕПО с клиринговыми сертификатами участия (за исключением случая, указанного в подпункте 2) настоящего пункта);
 - 4) для исполнения обязательств по Сделкам, заключенных с указанием Торгово-клирингового счета имущественного пула;
 - 5) для исполнения обязательств по Сделкам, заключенных с указанием Торгово-клирингового счета Т+, соответствующего Торгово-клиринговому счету

имущественного пула, и иных обязательств, учитываемых по такому Торгово-клиринговому счету Т+.

23.13. Незамедлительно после увеличения в Клиринговой системе положительного значения Единого лимита по пулу по Расчетному коду имущественного пула в соответствии с пунктом 23.6, подпунктом 23.8.7, пунктом 26.3 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов Клиринговый центр:

- увеличивает значение номинальной стоимости выданных клиринговых сертификатов участия, учитываемое по Расчетному коду имущественного пула, на номинальную стоимость выдаваемых клиринговых сертификатов участия;
- увеличивает расчетное значение позиции по ценной бумаге клиринговый сертификат участия на текущий Расчетный день (в случае выдачи ценных бумаг клиринговый сертификат участия в текущем Расчетном дне) или на следующий Расчетный день (в случае выдачи ценных бумаг клиринговый сертификат участия в следующем Расчетном дне) учитываемое по Торгово-клиринговому счету Т+, соответствующему Торгово-клиринговому счету имущественного пула, в состав которого входит указанный Расчетный код имущественного пула, на количество выдаваемых клиринговых сертификатов участия, определенное в соответствии с подпунктом 23.13.1 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, и учитывает указанные клиринговые сертификаты участия в качестве Обеспечения Участника клиринга;
- учитывает новое значение Единого лимита по пулу по Расчетному коду имущественного пула;
- допускает к клирингу обязательства по клиринговым сертификатам участия, учтенные по Расчетному коду имущественного пула.

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

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

23.13.3. Для целей Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов под расчетной позицией по ценной бумаге клиринговый сертификат участия (расчетным количеством ценных бумаг клиринговый сертификат участия), понимается количество ценных бумаг клиринговый сертификат участия, учитываемое по Торгово-клиринговому счету Т+, с учетом обязательств и требований Участника клиринга по указанным ценным бумагам.

23.14. Поручение на выдачу клиринговых сертификатов участия включается в состав распоряжения на проведение операций по Разделам / субсчетам депо, направляемого Клиринговым центром Расчетному депозитарию в соответствии с пунктом 47.4 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, или в состав согласия на списание ценных бумаг с Разделов, направляемого Клиринговым центром Расчетному депозитарию в соответствии с пунктом 47.2 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.

- 23.15. После исполнения Расчетным депозитарием поручения Клирингового центра на выдачу клиринговых сертификатов участия клиринговые сертификаты участия, зачисленные на Раздел Т⁺, становятся индивидуальным клиринговым обеспечением.
- 23.16. Информация о количестве ценных бумаг / драгоценных металлов / сумме денежных средств, внесенных Участником клиринга в имущественный пул, предоставляется Участнику клиринга в составе Отчета об имуществе, внесенном в имущественные пулы.

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

- 24.1. Погашение клиринговых сертификатов участия осуществляется при выдаче имущества из имущественного пула по инициативе Участника пула при соблюдении условий, установленных настоящей статьей Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, а также в случае исполнения Клиринговым центром Запроса на изменение расширенного списка обеспечения, а также в иных случаях, установленных Правилами клиринга.
- 24.2. Выдача ценных бумаг из имущественного пула осуществляется на основании распоряжений на перевод ценных бумаг, поданных Участниками пула с использованием Клиринговой системы.
- 24.3. Выдача денежных средств / драгоценных металлов из имущественного пула осуществляется на основании:
- 1) Запроса на возврат обеспечения;
 - 2) Постоянного поручения на возврат обеспечения;
 - 3) Запроса на перевод обеспечения;
 - 4) распоряжений на перевод денежных средств / драгоценных металлов, поданных Участниками пула с использованием Клиринговой системы.
- 24.4. Распоряжение на перевод денежных средств / драгоценных металлов / ценных бумаг, подаваемое Участником пула с использованием Клиринговой системы в целях выдачи имущества из имущественного пула, должно содержать указание на Торгово-клиринговый счет имущественного пула в качестве Торгово-клирингового счета, по которому осуществляется уменьшение денежных средств / ценных бумаг.
- Порядок подачи и исполнения распоряжения на перевод денежных средств / драгоценных металлов / ценных бумаг соответствует порядку, определенному общей частью Правил клиринга, с учетом особенности, установленной подпунктом 23.8.2 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, а также особенностей, установленных настоящей статьей Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.
- 24.5. Запрос на возврат обеспечения / Постоянное поручение на возврат обеспечения, подаваемый / подаваемое Участником пула в целях выдачи имущества из имущественного пула, должен / должно содержать указание на Расчетный код имущественного пула.
- Порядок подачи и исполнения Запроса на возврат обеспечения / Постоянного поручения на возврат обеспечения соответствует порядку, определенному общей

частью Правил клиринга, с учетом особенностей, установленных настоящей статьёй Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.

- 24.6. В случае подачи Участником клиринга Запроса на возврат обеспечения или подачи Запроса на перевод обеспечения / распоряжения на перевод денежных средств или драгоценных металлов (далее, в настоящем пункте Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, – Запрос / распоряжение на перевод обеспечения), указанных в настоящей статье Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, позднее срока, установленного Временным регламентом на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов для зачисления денежных средств на клиринговый банковский счет Клирингового центра для выдачи клиринговых сертификатов участия в текущем Расчетном дне, Клиринговый центр осуществляет погашение клиринговых сертификатов участия на имущество, выданное из имущественного пула в результате исполнения соответствующего Запроса на возврат обеспечения или Запроса / распоряжения на перевод обеспечения, в Расчетный день, следующий за датой исполнения Клиринговым центром такого Запроса на возврат обеспечения или Запроса / распоряжения на перевод обеспечения.
- 24.7. Сроки подачи и исполнения Постоянных поручений на возврат обеспечения с целью выдачи имущества из имущественного пула установлены Временным регламентом, являющимся приложением к общей части Правил клиринга. В случае если Временным регламентом, являющимся приложением к общей части Правил клиринга, установлено, что Постоянное поручение на возврат обеспечения в соответствующей валюте исполняется в срок позднее срока, установленного Временным регламентом на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, для зачисления денежных средств на клиринговый банковский счет Клирингового центра для выдачи клиринговых сертификатов участия в текущем Расчетном дне, Клиринговый центр осуществляет погашение клиринговых сертификатов участия на имущество, выданное из имущественного пула в результате исполнения соответствующего Постоянного поручения на возврат обеспечения, в Расчетный день, следующий за датой исполнения Клиринговым центром такого Постоянного поручения на возврат обеспечения.
- 24.8. Если ценная бумага / драгоценный металл / валюта принимается в соответствующий имущественный пул, то выдача данного имущества из имущественного пула осуществляется только в случае погашения соответствующего количества клиринговых сертификатов участия, за исключением случаев, указанных в пункте 4.6 и пункте 24.6 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, а также случаев проведения ликвидационного неттинга в отношении Участника клиринга, клиента Участника клиринга или Клирингового центра в соответствии с общей частью Правил клиринга.
- 24.9. Погашение клиринговых сертификатов участия при выдаче имущества из имущественного пула осуществляется при соблюдении следующих условий:
- 1) в текущем Расчетном дне значение расчетной позиции по ценной бумаге клиринговый сертификат участия (расчетное количество ценных бумаг клиринговый сертификат участия), учитываемой по Торгово-клиринговому счету Т+, соответствующему Торгово-клиринговому счету имущественного пула, после погашения клиринговых сертификатов участия не становится отрицательным;

- 2) положительный Единый лимит по Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета Т+, соответствующего Торгово-клиринговому счету имущественного пула, не становится отрицательным после погашения клиринговых сертификатов участия, или
- 3) отрицательный Единый лимит по Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета Т+, соответствующего Торгово-клиринговому счету имущественного пула, не уменьшается после погашения клиринговых сертификатов участия;
- 4) при выдаче денежных средств / драгоценных металлов из имущественного пула, возвращаемая сумма денежных средств / драгоценных металлов не превышает максимального из двух значений: (1) суммы денежных средств в соответствующей валюте / количества драгоценных металлов, учитываемого по Расчетному коду имущественного пула; (2) суммы (с учетом знака) денежных средств в соответствующей валюте / драгоценных металлов, учитываемой по Расчетному коду имущественного пула, и Нетто-обязательства / Нетто-требования по денежным средствам в соответствующей валюте / драгоценным металлам с текущей Датой исполнения, рассчитанного по Сделкам и учитываемого по Расчетному коду имущественного пула;
- 5) значения, рассчитанные без учета возвращаемой суммы денежных средств / количества драгоценных металлов / ценных бумаг в соответствии с общей частью Правил клиринга для проверки возможности исполнения операции, проводимой по Торгово-клиринговому счету Участника клиринга при наличии признака «запрет необеспеченных покупок» / «запрет коротких продаж», и/или Участника клиринга категории «В», и/или ценных бумаг с признаком «запрет коротких продаж», для каждой Даты исполнения (или для Дат исполнения, установленных общей частью Правил клиринга в случае если Клиринговым центром установлен период действия признака «запрет коротких продаж» по ценной бумаге), не станут отрицательными, а в случае, если на конец Расчетного дня, предшествующего дню установления признака «запрет коротких продаж» по ценной бумаге на период, значение, рассчитанное в соответствии с общей частью Правил клиринга для проверки возможности исполнения операции, проводимой по Торгово-клиринговому счету Участника клиринга, при наличии признака «запрет необеспеченных покупок» / «запрет коротких продаж», и/или Участника клиринга категории «В», и/или ценных бумаг с признаком «запрет коротких продаж» для какой-либо из Дат исполнения являлось отрицательным, абсолютное значение отрицательной величины, рассчитанное без учета возвращаемого количества ценных бумаг, для Дат исполнения, установленных общей частью Правил клиринга, в случае, если Клиринговым центром установлен период действия признака «запрет коротких продаж» по ценной бумаге, не увеличится;
- 6) значения, рассчитанные без учета возвращаемой суммы денежных средств / количества драгоценных металлов / ценных бумаг, по которым Клиринговым центром установлен признак «Запрет коротких продаж», а также установлено значение параметра «лимит коротких продаж», отличное от нуля, рассчитанные в соответствии с общей частью Правил клиринга для проверки возможности исполнения операции, проводимой по Торгово-клиринговому счету Участника клиринга при установлении Клиринговым центром значения параметра «лимит коротких продаж» для соответствующей иностранной валюты/драгоценного металла/ценной бумаги, отличное от нуля, не станут

ниже установленного Клиринговым центром значения параметра «лимит коротких продаж».

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

24.10. Погашение клиринговых сертификатов участия, проводимое при отрицательном значении Единого лимита по пулу по Расчетному коду имущественного пула, осуществляется при условии, что значение расчетной позиции по ценной бумаге клиринговый сертификат участия (расчетное количество ценных бумаг клиринговый сертификат участия), учитываемой по Торгово-клиринговому счету T+, соответствующему Торгово-клиринговому счету имущественного пула, в состав которого входит такой Расчетный код имущественного пула, после погашения клиринговых сертификатов участия не становится отрицательным.

24.11. При соблюдении условий погашения клиринговых сертификатов участия, указанных в пункте 24.9 или 24.10 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, Клиринговый центр незамедлительно:

- уменьшает значение номинальной стоимости выданных клиринговых сертификатов участия, учитываемой по Расчетному коду имущественного пула, на номинальную стоимость погашаемых клиринговых сертификатов участия;
- уменьшает значение расчетной позиции по ценной бумаге клиринговый сертификат участия (расчетное количество ценных бумаг клиринговый сертификат участия) на текущий Расчетный день (в случае погашения ценных бумаг клиринговый сертификат участия в текущем Расчетном дне) или на следующий Расчетный день (в случае погашения ценных бумаг клиринговый сертификат участия в следующем Расчетном дне), учитываемой по Торгово-клиринговому счету T+, соответствующему Торгово-клиринговому счету имущественного пула, в состав которого входит указанный Расчетный код имущественного пула, на количество погашаемых клиринговых сертификатов участия, определенное в соответствии с подпунктом 24.11.1 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов;
- учитывает новое значение Единого лимита по пулу по Расчетному коду имущественного пула.

24.11.1. Количество погашаемых клиринговых сертификатов участия соответствует абсолютной величине отрицательного значения Единого лимита по пулу по

- Расчетному коду имущественного пула, округленного до ближайшего меньшего целого значения российских рублей.
- 24.11.2. Номинальная стоимость погашаемых клиринговых сертификатов участия равна произведению количества погашаемых клиринговых сертификатов участия на номинальную стоимость одного клирингового сертификата участия.
- 24.12. Поручение на погашение клиринговых сертификатов участия включается в состав распоряжения на проведение операций по Разделам / субсчетам депо, направляемого Клиринговым центром Расчетному депозитарию в соответствии с пунктом 47.4 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.
- 24.13. Порядок исполнения Запроса на перевод обеспечения определен общей частью Правил клиринга.
- 24.14. Сроки подачи и исполнения запросов / распоряжений с целью выдачи имущества из имущественного пула установлены Временным регламентом на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.
- 24.15. В случае если погашение клиринговых сертификатов участия, учитываемых по Торгово-клиринговому счету Т+, соответствующему Торгово-клиринговому счету имущественного пула, в количестве, соответствующем стоимости внесенного в имущественный пул имущества в ценных бумагах, включенных в расширенный список обеспечения, невозможно, Запрос на изменение расширенного списка обеспечения не исполняется Клиринговым центром.

Статья 25. Порядок замены имущества в имущественном пуле

- 25.1. При невозможности выдачи имущества из имущественного пула по причине несоблюдения условий погашения клиринговых сертификатов участия, предусмотренных пунктом 24.9 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, Участник пула вправе заменить ранее переданное в пул имущество на другое имущество.
- 25.2. Для осуществления такой замены Участник пула обязан внести другое имущество в имущественный пул в порядке, установленном статьей 23 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, в том числе, путем подачи Запроса на подбор ценных бумаг, при этом стоимость вносимого имущества должна соответствовать стоимости имущества, подлежащего замене.
- После внесения другого имущества в имущественный пул, Участник пула вправе обратиться к Клиринговому центру за выдачей соответствующего имущества в порядке, установленном статьей 24 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.
- 25.3. Участник клиринга вправе использовать имущество, внесенное с имущественный пул, для исполнения обязательств по Сделкам в порядке, определенном общей частью Правил клиринга.

ПОДРАЗДЕЛ V-II. КЛИРИНГОВЫЕ СЕССИИ

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

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

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

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

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

26.3. Если значение Единого лимита по пулу по Расчетному коду имущественного пула, рассчитанное в ходе клиринговой сессии mark-to-market, положительное, Клиринговый центр выдает Участнику пула клиринговые сертификаты участия в порядке, определенном пунктами 23.13-23.15 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.

26.4. Если значение Единого лимита по пулу по Расчетному коду имущественного пула, рассчитанное в ходе клиринговой сессии mark-to-market, отрицательное,

Клиринговый центр в порядке, установленном пунктами 24.10-24.12 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, осуществляет действия, направленные на погашение клиринговых сертификатов участия в количестве, указанном в подпункте 24.11.1 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, или в максимальном количестве, при котором условие, указанное в пункте 24.10 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, будет соблюдаться.

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

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

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

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

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

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

- 26.7.1. заключения Участником пула Сделок с указанием Торгово-клирингового счета Т+, соответствующего Торгово-клиринговому счету имущественного пула, в состав которого входит Расчетный код имущественного пула, по которому учитывается Маржинальное требование по пулу, приводящих к получению клиринговых сертификатов участия, которые погашаются при соблюдении условия, установленного пунктом 24.10 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов;

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

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

- 26.8. Маржинальное требование по пулу, учитываемое по Расчетному коду имущественного пула, считается прекращенным в момент времени, когда Единый лимит по пулу по такому Расчетному коду имущественного пула станет неотрицательным.

- 26.9. После определения Маржинальных требований по пулу Клиринговый центр направляет Расчетному депозитарию Запрос на подбор ценных бумаг с целью исполнения Маржинальных требований (только для Участников клиринга, соответствующих требованиям, установленным общей частью Правил клиринга).
- 26.9.1. Запрос на подбор ценных бумаг направляется с указанием суммы Маржинального требования по пулу и субсчетов депо имущественного пула, входящих в состав Торгово-клиринговых счетов имущественного пула совместно с Расчетным кодом имущественного пула, по которому учитывается Маржинальное требование по пулу.
- 26.9.2. Запрос на подбор ценных бумаг направляется в сроки, установленные Временным регламентом, являющимся приложением к общей части Правил клиринга.
- 26.10. В случае неисполнения Участником пула Маржинального требования по пулу в срок, установленный Временным регламентом на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, Клиринговый центр устанавливает для такого Расчетного кода имущественного пула Режим урегулирования, порядок применения которого определен общей частью Правил клиринга (если иное не предусмотрено решением Клирингового центра), и осуществляет действия в следующей последовательности (каждое последующее действие выполняется в случае, если предыдущее действие не привело к прекращению Маржинального требования по пулу):
- 26.10.1. заключает от имени Участника пула закрывающие Сделки, направленные на продажу имущества (ценных бумаг, драгоценных металлов или иностранной валюты) из имущественного пула, и заключает балансирующие сделки.
- Порядок заключения закрывающих и балансирующих сделок определен общей частью Правил клиринга.
- Выбор имущества, с которым заключаются указанные сделки, осуществляется Клиринговым центром.
- Указанные сделки заключаются до момента прекращения Маржинального требования по пулу.
- 26.10.2. после исполнения Маржинального требования по пулу Клиринговый центр снимает Режим урегулирования для Расчетного кода имущественного пула, по которому учитывалось неисполненное Маржинальное требование по пулу, если отсутствуют иные основания для установления Режима урегулирования, предусмотренные Правилами клиринга.
- 26.11. Порядок подачи и исполнения Запросов на подбор ценных бумаг с целью их внесения в имущественный пул определен общей частью Правил клиринга.
- 26.12. Ценные бумаги, зачисленные на субсчет депо имущественного пула по итогам исполнения Расчетным депозитарием Запроса Клирингового центра на подбор ценных бумаг, вносятся в имущественный пул и учитываются при расчете Единого лимита по пулу по Расчетному коду имущественного пула, по которому учитывалось неисполненное Маржинальное требование по пулу.
- Обязательства и требования по сделкам, заключенным в соответствии с подпунктом 26.10.1 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, учитываются при расчете Единого лимита по пулу по Расчетному коду имущественного пула, по которому учитывалось неисполненное Маржинальное требование по пулу.

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

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

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

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

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

Выставление Маржинальных требований по пулу в ходе торгов не осуществляется.

ПОДРАЗДЕЛ V-III. ПОРЯДОК ВКЛЮЧЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ В КЛИРИНГОВЫЙ ПУЛ

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

- 27.1. Для исполнения обязательств по сделкам / дополнительных обязательств, принятых при подаче заявки на заключение депозитного договора, Участники клиринга категории «О», «Б», «Б2» и «В» обязаны обеспечивать наличие денежных средств / ценных бумаг, учитываемых по Расчетным кодам / Торгово-клиринговым счетам, по которым осуществлялась проверка достаточности обеспечения при подаче заявок / Котировок участника торгов на заключение соответствующих сделок, определяемых в соответствии со статьей 19 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.
- 27.2. Участник клиринга категории «А» или «К» может заключать биржевые сделки без предварительного внесения индивидуального клирингового обеспечения в денежных средствах.
- 27.2.1. Для исполнения обязательств по заключенным Сделкам Т+ Участник клиринга категории «А» обязан внести денежные средства на клиринговый банковский или корреспондентский счет Клирингового центра по реквизитам, размещенным на Сайте Клирингового центра, с обязательным указанием в назначении платежа Расчетного кода Участника клиринга, и/или ценные бумаги на Разделы Т+ до установленного Временным регламентом, являющимся приложением к общей части Правил клиринга, времени исполнения Участниками клиринга Итоговых нетто-обязательств Участника клиринга по денежным средствам / Итоговых нетто-обязательств по ценным бумагам (для Сделок Т+).
- 27.2.2. Для исполнения обязательств по заключенным Сделкам Т+ Участник клиринга категории «К» обязан внести денежные средства на клиринговый банковский или корреспондентский счет Клирингового центра по реквизитам, размещенным на Сайте Клирингового центра, с обязательным указанием в назначении платежа Расчетного кода Участника клиринга до установленного Временным регламентом, являющимся приложением к общей части Правил клиринга, времени исполнения Участниками клиринга Итоговых нетто-обязательств Участника клиринга по денежным средствам (для Сделок Т+).
- 27.2.3. Для исполнения обязательств по денежным средствам по сделкам, за исключением Сделок Т+, Участник клиринга категории «А» обязан внести денежные средства на клиринговый банковский или корреспондентский счет Клирингового центра по реквизитам, размещенным на Сайте Клирингового центра, с обязательным указанием в назначении платежа Расчетного кода Участника клиринга, до установленного Временным регламентом на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов момента окончания Процедуры контроля обеспечения по сделкам с расчетами в соответствующей валюте.
- 27.2.4. Денежные средства, перечисленные Участником клиринга категории «А» или «К» на клиринговый банковский или корреспондентский счет Клирингового центра, учитываются по Расчетному коду, указанному в назначении платежа.
- 27.3. Исполнение обязательств по сделкам купли-продажи с кодом расчетов T0, K0, первым частям сделок РЕПО с кодом расчетов Rb, выдаче кредита по кредитному

договору с кодом расчетов Rb осуществляется в ходе первой и второй расчётной клиринговой сессии, время проведения которых установлено Временным регламентом, являющимся приложением к общей части Правил клиринга.

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

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

Порядок подачи и условия регистрации в Клиринговой системе Отчета на исполнение определены в статье 28 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, Специального и Срочного отчета на исполнение – в статье 33 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.

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

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

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

Порядок подачи и условия регистрации в Клиринговой системе Поручений на внесение компенсационных взносов и Поручений на отказ от компенсационных взносов определен в статье 31 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.

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

Частичное исполнение обязательств по внесению компенсационных взносов не допускается.

27.8. Участник клиринга, имеющий обязательства по внесению компенсационных взносов и/или по сделкам купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов Bn, B0-B30, первым и вторым частям сделок РЕПО с кодом расчетов Sn, вторым частям сделок РЕПО с кодом расчетов Z0 или Rb, кредитным договорам с кодом расчетов

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

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

Порядок и условия такой замены определены общей частью Правил клиринга.

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

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

Порядок подачи и исполнения Поручений на отказ от исполнения сделки РЕПО / Поручений на отказ от исполнения кредитного договора определен в статье 32 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.

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

Порядок подачи и исполнения Поручений на отказ от исполнения сделки купли-продажи ценных бумаг определен в статье 32 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.

27.13. В случае принятия нормативного (правового) акта Российской Федерации о переносе нерабочих (праздничных) и выходных дней или об объявлении рабочего дня нерабочим, в соответствии с которым Дата исполнения обязательств по заключенным Клиринговым центром с Участниками клиринга Сделкам станет выходным или нерабочим днем по законодательству Российской Федерации, если такая Дата исполнения не будет являться Расчетным днем, либо в случае получения от Биржи уведомления, в соответствии с которым Дата исполнения обязательств по заключенным Клиринговым центром с Участниками клиринга Сделкам перестанет являться Расчетным днем, Клиринговый центр в течение 10 (десяти) рабочих дней с даты опубликования такого нормативного (правового) акта / получения уведомления

от Биржи, если иной срок не установлен решением Клирингового центра, изменяет Даты исполнения обязательств по таким Сделкам на:

- ближайший следующий Расчетный день, если это не противоречит порядку определения Даты исполнения обязательств по соответствующим сделкам, установленному Правилами торгов на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов для случаев, когда Дата исполнения приходится на день, не являющийся Расчетным днем,
или
- день, определенный в соответствии с порядком определения Даты исполнения обязательств по соответствующим сделкам, установленным Правилами торгов на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов для случаев, когда Дата исполнения приходится на день, не являющийся Расчетным днем, если определение ближайшего следующего Расчетного дня как новой Даты исполнения противоречит порядку определения Даты исполнения обязательств по соответствующим сделкам, установленному Правилами торгов на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов для случаев, когда Дата исполнения приходится на день, не являющийся Расчетным днем,
или
- день, определенный решением Клирингового центра, если исполнение обязательств в новую Дату исполнения, определенную в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, невозможно в связи с приостановлением/прекращением торгов по ценной бумаге на Бирже, в том числе, в связи с конвертацией, объединением выпусков или досрочным погашением ценной бумаги, составляющей предмет обязательства.

27.13.1. Сумма сделки купли-продажи облигаций, стоимость обратного выкупа по сделке РЕПО, сумма возврата по депозиту пересчитываются с учетом такого изменения Даты исполнения.

27.13.2. После изменения Даты исполнения обязательств по Сделкам в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, Клиринговый центр изменяет Нетто-обязательства / Нетто-требования по соответствующим Датам исполнения, учитываемые по Расчетным кодам 1-го, 2-го и/или 3-го уровня, в соответствии с измененными условиями сделок.

27.13.3. Суммы рассчитанных комиссионных вознаграждений по Сделкам, Дата исполнения обязательств по которым изменена, не меняются.

27.13.4. Об изменении Дат исполнения обязательств по Сделкам, а также об изменении сумм сделок купли-продажи облигаций, стоимости обратного выкупа по сделке РЕПО, сумм возврата по депозиту Клиринговый центр уведомляет Биржу с использованием Системы торгов.

27.14. Участник клиринга вправе потребовать возврата части депозита до наступления Даты исполнения обязательств по возврату депозита и пополнить депозит до первоначальной суммы депозита в порядке и на условиях, определенных в статье 36 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.

27.15. Участник клиринга вправе до Даты исполнения обязательств по второй части сделок РЕПО с кодом расчетов Ym/Yn (за исключением сделок РЕПО, которым

соответствует депозитный договор или заявка на заключение депозитного договора, внесенная в реестр предложений), второй части сделок РЕПО с кодом расчетов Т0/Уп, заключенным на основании адресных заявок, изменить Дату исполнения обязательств путем подачи в Клиринговую систему Поручения на изменение срока исполнения обязательств по сделке.

Порядок подачи и условия исполнения Поручений на изменение срока исполнения обязательств по сделке определены в статье 38 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.

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

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

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

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

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

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

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

27.18. В случаях если между датой заключения Сделки купли-продажи акций (включая эту дату) и Датой исполнения обязательств по Сделке купли-продажи акций (не включая эту дату) в отношении акций, с которыми заключена Сделка, происходят корпоративные действия, предусматривающие дробление или консолидацию акций (за исключением дробления с образованием нового выпуска ценной бумаги), условия указанных Сделок в дату проведения корпоративного действия или в дату, в которую Клиринговый центр узнал о проведении корпоративного действия, после завершения расчетов по ценным бумагам по итогам клиринга в соответствии с пунктом 45.10 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов изменяются следующим образом:

27.18.1. В случае дробления акций:

- новое значение количества ценных бумаг в Сделке определяется как произведение количества ценных бумаг в Сделке до проведения корпоративного действия и коэффициента дробления;
- новое значение цены Сделки определяется как частное от деления суммы сделки и нового количества ценных бумаг в Сделке, округленное по правилам математического округления с точностью до двух знаков после запятой (в случае если иной порядок округления не установлен Правилами торгов для соответствующего режима торгов);
- сумма сделки не изменяется.

27.18.2. В случае консолидации акций:

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

количества ценных бумаг в Сделке и нового значения цены Сделки.

27.19. В случаях если между датой заключения сделки РЕПО (включая эту дату) и Датой исполнения обязательств по второй части сделки РЕПО (не включая эту дату) в отношении акций, с которыми заключена сделка РЕПО, происходят корпоративные действия, предусматривающие дробление или консолидацию акций (за исключением дробления с образованием нового выпуска ценной бумаги), условия указанных сделок РЕПО в дату проведения корпоративного действия или в дату, в которую Клиринговый центр узнал о проведении корпоративного действия, после завершения расчетов по ценным бумагам по итогам клиринга в соответствии с пунктом 45.10 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов изменяются следующим образом:

27.19.1. В случае дробления акций:

- новое значение количества ценных бумаг в первой части сделки РЕПО (если обязательства по первой части сделки РЕПО не исполнены) и/или второй части сделки РЕПО определяется как произведение количества ценных бумаг в сделке РЕПО до проведения корпоративного действия и коэффициента дробления;
- сумма первой и второй части сделки РЕПО не изменяются.

27.19.2. В случае консолидации акций:

- новое значение количества ценных бумаг в первой части сделки РЕПО (если обязательства по первой части сделки РЕПО не исполнены) и/или второй части сделки РЕПО определяется как частное от деления количества ценных бумаг в сделке РЕПО до проведения корпоративного действия и коэффициента консолидации, округленное до ближайшего меньшего целого значения;
- сумма первой и второй части сделки РЕПО не изменяются.

27.20. Участник клиринга вправе по согласованию с контрагентом отказаться от исполнения обязательств по сделке РЕПО с кодом расчетов Y0/Yn, Ym/YODn, T0/YODn, Ym/Yn, заключенной на основании адресных заявок (за исключением сделки РЕПО, которой соответствует депозитный договор или заявка на заключение депозитного договора, внесенная в реестр предложений).

Порядок подачи и исполнения Поручений на отказ от исполнения сделки РЕПО с кодом расчетов Y0/Yn, Ym/Yn, Ym/YODn, T0/YODn, заключенной на основании адресных заявок, предусмотрен в статье 40 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.

Статья 28. Порядок подачи и условия регистрации Отчетов на исполнение

28.1. Отчет на исполнение может быть подан по сделке купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов Bn, B0-B30, первой части сделки РЕПО с кодом расчетов Sn, операции выдачи кредита по кредитному договору с кодом расчетов Sn, второй части сделки РЕПО с кодом расчетов Sn, Z0 и Rb, операции возврата кредита по кредитному договору с кодом расчетов Sn и Rb а также по сделке купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов Yn (за исключением сделок, заключенных на основании заявок с указанием Торгово-клирингового счета имущественного пула), первой или второй части сделки РЕПО с кодом расчетов Ym/YODn, Ym/Yn (за исключением сделок РЕПО, которым соответствует депозитный договор или заявка

на заключение депозитного договора, внесенная в реестр предложений), второй части сделки РЕПО с кодом расчетов T0/Yn, T0/ YODn, заключенным на основании адресных заявок.

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

- по биржевой сделке с кодом расчетов B0 - с даты заключения до Даты прекращения исполнения;
- по биржевой сделке с кодом расчетов B01-B30, B01-Bn - с Расчетного дня, следующего за датой ее заключения, до Даты прекращения исполнения;
- по первой части сделки РЕПО с кодом расчетов Sn - с Даты исполнения первой части сделки РЕПО до Даты прекращения ее исполнения;
- по операции выдачи кредита по кредитному договору с кодом расчетов Sn - с Даты исполнения обязательства по выдаче кредита по кредитному договору до Даты прекращения исполнения обязательства по выдаче кредита по кредитному договору;
- по второй части сделки РЕПО с кодом расчетов Sn, Z0 и Rb - с Даты исполнения первой части сделки РЕПО до Даты прекращения исполнения второй части сделки РЕПО;
- по операции возврата кредита по кредитному договору с кодом расчетов Sn и Rb - с Даты исполнения обязательства по выдаче кредита по кредитному договору до Даты прекращения исполнения обязательства по возврату кредита по кредитному договору;
- по сделке купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов Yn, первой или второй части сделки РЕПО с кодом расчетов Ym/Yn, второй части сделки РЕПО с кодом расчетов T0/Yn, заключенным на основании адресных заявок, - в Дату исполнения;
- по второй части Сделки РЕПО с открытой датой - в Расчетный день, но не ранее Расчетного дня, следующего за Датой исполнения первой части Сделки РЕПО с открытой датой до максимально возможной Даты исполнения второй части Сделки РЕПО с открытой датой, определяемой исходя из пункта 21.6 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.

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

Отчет на исполнение по операции возврата кредита по кредитному договору с кодом расчетов Sn и Rb может быть подан Участником клиринга в Клиринговую систему при условии, что обязательство по выдаче кредита по кредитному договору является обеспеченным средствами под исполнение.

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

- 28.5. Отчет на исполнение, поданный Участником клиринга - покупателем, регистрируется в Клиринговой системе при прохождении в момент подачи Отчета на исполнение всех соответствующих проверок, предусмотренных статьей 30 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, в отношении обязательства данного Участника клиринга по денежным средствам, возникшего по данной сделке (первой или второй части сделки РЕПО) (с учетом НКД).
- 28.6. Отчет на исполнение, поданный Участником клиринга - продавцом, регистрируется в Клиринговой системе при прохождении в момент подачи Отчета на исполнение всех соответствующих проверок, предусмотренных статьей 30 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, в отношении обязательства данного Участника клиринга по ценным бумагам, возникшего по данной сделке (первой или второй части сделки РЕПО).
- 28.7. Отчет на исполнение, поданный по кредитному договору Участником клиринга, регистрируется в Клиринговой системе при прохождении в момент подачи Отчета на исполнение всех соответствующих проверок, предусмотренных статьей 30 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, в отношении обязательства данного Участника клиринга по выдаче / возврату кредита.
- 28.8. Отсутствие в Клиринговой системе зарегистрированного Отчета на исполнение по не обеспеченной средствами под исполнение сделке купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов Bn, B0-B30, первой части сделки РЕПО с кодом расчетов Sn, операции выдачи кредита по кредитному договору с кодом расчетов Sn, второй части сделки РЕПО с кодом расчетов Sn, Z0 и Rb, операции возврата кредита по кредитному договору с кодом расчетов Sn и Rb в Дату ее исполнения по состоянию на момент окончания периода регистрации поручений признается нарушением со стороны Участника клиринга требований Правил клиринга, повлекшим неисполнение обязательств по данной сделке (первой или второй части сделки РЕПО) в Дату исполнения, за исключением случаев, установленных Правилами клиринга.
- 28.8.1. В случае если в Дату исполнения второй части сделки РЕПО с кодом расчетов Sn, Z0 и Rb в Клиринговой системе Отчет на исполнение был зарегистрирован только одним Участником клиринга, такой Участник клиринга вправе не выставлять Отчет на исполнение по второй части сделки РЕПО с кодом расчетов Sn, Z0 и Rb после Даты ее исполнения в случаях, предусмотренных пунктом 28.2 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, и потребовать проведения Процедуры урегулирования взаимных требований по сделкам, заключенным без участия центрального контрагента, установленной статьей 43 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, в Дату исполнения после окончания периода регистрации поручений.
- 28.9. Участнику клиринга в Клиринговой системе раскрывается информация о регистрации Отчета на исполнение по сделке купли-продажи ценных бумаг, первой или второй части сделки РЕПО, поданного в Клиринговую систему его контрагентом / конечным контрагентом.
- 28.10. Участники клиринга вправе до окончания периода регистрации поручений отзывать зарегистрированные Отчеты на исполнение и подавать новые Отчеты на исполнение

при условии, что сделки (первые или вторые части сделки РЕПО / операции по выдаче или возврату кредита по кредитному договору), по которым подан Отчет на исполнение, не являются обеспеченными средствами под исполнение в соответствии с пунктом 28.11 настоящей статьи Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.

- 28.11. При условии регистрации в Клиринговой системе Отчетов на исполнение по сделке (первой или второй части сделки РЕПО / операции по выдаче или возврату кредита по кредитному договору), поданных обоими Участниками клиринга - сторонами по данной сделке / конечными контрагентами по парным сделкам, данная сделка / сделки (первая или вторая часть сделки РЕПО / операция по выдаче или возврату кредита по кредитному договору) считается обеспеченной / обеспеченными средствами под исполнение, и обязательства по данной сделке / сделкам (первой или второй части сделки РЕПО / по выдаче или возврату кредита по кредитному договору) включаются в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов / в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов по сделкам с центральным контрагентом с ближайшим временем исполнения.
- 28.12. В случае если вторая часть биржевой сделки РЕПО становится обеспеченной средствами под исполнение до Даты исполнения, Клиринговый центр формирует и передает Бирже Отчет о досрочном исполнении сделок РЕПО.
- 28.13. Отчет на исполнение по Сделке Т+, не обеспеченной средствами под исполнение на ближайшее время исполнения Участниками клиринга Итоговых нетто-обязательств по ценным бумагам, установленное Временным регламентом, являющимся приложением к общей части Правил клиринга, исключается из Клиринговой системы и не подлежит исполнению. Исполнение (прекращение) обязательств по такой Сделке Т+ осуществляется в сроки, установленные Временным регламентом, являющимся приложением к общей части Правил клиринга, путем включения их в Единый клиринговый пул в порядке, определенном общей частью Правил клиринга.
- Отчет на исполнение по сделке, не обеспеченной средствами под исполнение до окончания периода регистрации поручений, после его окончания исключается из Клиринговой системы и не подлежит исполнению.
- 28.14. Для Участников клиринга, предоставивших соответствующее заявление и до начала периода времени, установленного Временным регламентом на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, не подавших Отчет на исполнение, Специальный отчет на исполнение или Срочный отчет на исполнение по сделке купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов Вп, удовлетворяющей следующим условиям:
- эмитент ценных бумаг – Министерство финансов Российской Федерации;
 - Участник клиринга является покупателем;
 - сделка заключена в режиме торгов «Размещение: Аукцион» или «Размещение: Адресные заявки»;
 - Дата исполнения обязательств по Сделке наступила,
- Клиринговый центр в указанный период времени осуществляет проверки, предусмотренные статьей 30 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, в отношении обязательства данного Участника клиринга по денежным средствам, возникшего по данной Сделке, без подачи Участником клиринга Отчета на исполнение.

Указанное заявление исполняется Клиринговым центром не позднее Расчетного дня, следующего за датой предоставления указанного заявления.

В случае прохождения такой проверки данная Сделка считается обеспеченной средствами под исполнение, и обязательства по данной Сделке включаются в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов с ближайшим временем исполнения. Непрохождение указанной в настоящем пункте Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов проверки признается нарушением со стороны Участника клиринга требований Правил клиринга, повлекшим неисполнение обязательств по данной Сделке в Дату исполнения.

В случае наличия нескольких Сделок, удовлетворяющих условиям, указанным в настоящем пункте Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, проверки, указанные в настоящем пункте Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, осуществляются по каждой Сделке в порядке возрастания даты и времени заключения Сделок.

- 28.15. Документом, удостоверяющим выдачу / возврат кредита, является Выписка из реестра сделок, принятых в клиринг, содержащая информацию об исполнении обязательства по выдаче / возврату кредита по кредитному договору, предоставляемая Клиринговым центром Участнику клиринга.

Статья 29. Порядок подачи и условия исполнения поручений на исполнение второй части Сделки РЕПО с открытой датой

- 29.1. Поручение на исполнение второй части Сделки РЕПО с открытой датой может быть подано Участником клиринга, являющимся стороной по указанной сделке, в срок, установленный Временным регламентом на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, либо Клиринговым центром – в случаях, определенных Правилами клиринга. Исполнение второй части Сделки РЕПО с открытой датой Участниками клиринга – сторонами по Сделке РЕПО с открытой датой осуществляется на основании принятого поручения на исполнение второй части Сделки РЕПО с открытой датой, поданного хотя бы одной из сторон по Сделке РЕПО с открытой датой (за исключением случаев, предусмотренных пунктом 21.621.5.4 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов).

В случае если дата подачи поручения на исполнение второй части Сделки РЕПО с открытой датой, заключенной с участием центрального контрагента, приходится на день до исполнения первой части Сделки РЕПО с открытой датой, отсчет Периода исполнения второй части Сделки РЕПО с открытой датой начинается в Расчетный день, следующий за датой исполнения первой части Сделки РЕПО с открытой датой.

Поручение на исполнение второй части Сделки РЕПО с открытой датой, заключенной без участия центрального контрагента, не может быть подано Участником клиринга, являющимся стороной по такой Сделке, до исполнения первой части Сделки РЕПО с открытой датой.

- 29.2. В случае проведения в отношении Участника клиринга (клиента Участника клиринга) процедуры ликвидационного неттинга в соответствии с общей частью Правил клиринга Клиринговый центр от своего имени в дату начала проведения указанной процедуры подает в отношении Участника клиринга – конечного контрагента поручение на исполнение второй части Сделки РЕПО с открытой датой,

- заключенной с участием центрального контрагента. Дата окончания Периода до исполнения второй части Сделки РЕПО с открытой датой (с учетом положений пункта 21.6 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов), указанной в настоящем пункте Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, является Датой исполнения второй части Сделки РЕПО с открытой датой для Участника клиринга –конечного контрагента по такой Сделке РЕПО с открытой датой.
- 29.3. В случае изменения категории Участника клиринга, являющегося стороной по сделке РЕПО с открытой датой, заключенной с участием центрального контрагента, с категории «О», «Б» или «Б2» на категорию «В» Клиринговый центр в дату принятия такого решения от своего имени подает поручение на исполнение вторых частей Сделок РЕПО с открытой датой в отношении указанного в настоящем пункте Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов Участника клиринга, а также Участника клиринга – конечного контрагента. Дата окончания Периода до исполнения второй части Сделки РЕПО с открытой датой (с учетом положений пункта 21.6 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов), указанной в настоящем пункте Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, является Датой исполнения второй части Сделки РЕПО с открытой датой как для Участника клиринга, в отношении которого производится изменение категории, так и для Участника клиринга – конечного контрагента.
- 29.4. В случае принятия Клиринговым центром решения о приостановлении допуска к клиринговому обслуживанию Участника клиринга, являющегося стороной по Сделке РЕПО с открытой датой, заключенной с участием центрального контрагента, предусматривающего невозможность для Участника клиринга становиться стороной по Сделкам РЕПО с открытой датой, Клиринговый центр подает поручение на исполнение вторых частей Сделок РЕПО с открытой датой в отношении указанного в настоящем пункте Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов Участника клиринга, а также Участника клиринга – конечного контрагента. Дата окончания Периода до исполнения второй части Сделки РЕПО с открытой датой (с учетом положений пункта 21.6 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов), указанной в настоящем пункте Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, является Датой исполнения второй части Сделки РЕПО с открытой датой как для Участника клиринга, допуск к клиринговому обслуживанию которого приостановлен, так и для Участника клиринга – конечного контрагента. Действие указанного пункта Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов не распространяется на случаи проведения в отношении Участника клиринга (клиента Участника клиринга) процедуры ликвидационного неттинга в соответствии с общей частью Правил клиринга.
- 29.5. В случае наступления предусмотренных Правилами клиринга оснований для заключения с Недобросовестным участником клиринга, являющимся стороной по Сделке РЕПО с открытой датой, заключенной с участием центрального контрагента, закрывающих сделок, Клиринговый центр от имени Недобросовестного участника клиринга подает поручение на исполнение второй части Сделки РЕПО с открытой датой, а также предпринимает иные действия, предусмотренные Правилами клиринга. Дата окончания Периода до исполнения второй части Сделки РЕПО с открытой датой (с учетом положений пункта 21.6 Правил клиринга на фондовом

рынке, рынке депозитов и рынке кредитов), указанной в настоящем пункте Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, является Датой исполнения второй части сделки РЕПО с открытой датой как для Недобросовестного участника клиринга, так и для Участника клиринга – конечного контрагента.

Статья 30. Проверки, выполняемые при подаче Отчетов на исполнение, Специальных отчетов на исполнение, Срочных отчетов на исполнение, поручений на внесение компенсационных взносов, поручений на отказ от компенсационных взносов, Поручений на отказ от исполнения сделки РЕПО / Поручений на отказ от исполнения сделки купли-продажи ценных бумаг / поручений на исполнение второй части Сделки РЕПО с открытой датой

- 30.1. Проверка достаточности денежных средств по Счету обеспечения Т0 считается пройденной при условии превышения (равенства) суммы денежных средств, учитываемой по соответствующему Счету обеспечения Т0, за вычетом соответствующего Ограничительного лимита, величины(е) обязательства Участника клиринга по денежным средствам, в отношении которого осуществляется проверка.
- 30.2. Проверка достаточности денежных средств по Расчетному коду, соответствующему Счету обеспечения, считается пройденной при соблюдении следующих условий:
- Единый лимит по Расчетному коду с учетом обязательства Участника клиринга по денежным средствам, в отношении которого осуществляется проверка, не станет отрицательным, или, если Единый лимит по такому Расчетному коду был отрицательным до момента проверки, - проверку того, что Единый лимит по такому Расчетному коду, рассчитанный с учетом указанного обязательства, не станет меньше, чем Единый лимит по этому Расчетному коду, рассчитанный до момента проверки;
 - сумма обязательства Участника клиринга по денежным средствам, в отношении которого осуществляется проверка, не превышает максимального из двух значений: (1) значения Обеспечения в соответствующей валюте, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, уменьшенного на сумму обязательства с отложенным исполнением в такой валюте, определенного в соответствии с общей частью Правил клиринга; (2) суммы (с учетом знака) значения Обеспечения, уменьшенного на сумму обязательства с отложенным исполнением в такой валюте, определенного в соответствии с общей частью Правил клиринга, и Нетто-обязательства / Нетто-требования в соответствующей валюте с текущей Датой исполнения, учитываемых по Расчетному коду.
 - для Расчетного кода Участника клиринга с признаком «запрет необеспеченных покупок» и/или для Расчетного кода Участника клиринга категории «В», – значения в валюте, в которой проводятся расчеты по Сделке, рассчитанные в соответствии с общей частью Правил клиринга для проверки возможности исполнения операции, проводимой по Торгово-клиринговому счету Участника клиринга при наличии признака «запрет необеспеченных покупок» / «запрет коротких продаж», и/или Участника клиринга категории «В», с учетом обязательства Участника клиринга по денежным средствам, в отношении которого осуществляется проверка, для каждой Даты исполнения не станут отрицательными;

- для Расчетного кода Участника клиринга, по которому учитываются денежные средства в иностранной валюте, для которой Клиринговым центром установлен признак «запрет коротких продаж», а также установлено значение параметра «лимит коротких продаж», отличное от нуля, значения в иностранной валюте, в которой проводятся расчеты по Сделке, рассчитанные в соответствии с общей частью Правил клиринга для проверки возможности исполнения операции, проводимой по Торгово-клиринговому счету Участника клиринга при установлении Клиринговым центром значения параметра «лимит коротких продаж» для соответствующей иностранной валюты, отличного от нуля, не станут ниже установленного Клиринговым центром значения параметра «лимит коротких продаж»;
 - для Расчетного кода Единого пула – в случае положительного результата дополнительной проверки Единого лимита, указанной в общей части Правил клиринга.
- 30.3. Проверка достаточности ценных бумаг по Торгово-клиринговому счету T0 считается пройденной при условии превышения (равенства) количества ценных бумаг, учитываемых по соответствующему Торгово-клиринговому счету T0, за вычетом соответствующего Ограничительного лимита, величины(е) обязательства Участника клиринга по ценным бумагам, в отношении которого осуществляется проверка.
- 30.4. Дополнительно к условию, указанному в пункте 30.3 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, проверка достаточности ценных бумаг по Торгово-клиринговому счету T+ считается пройденной при соблюдении следующих условий:
- Единый лимит по Расчетному коду с учетом величины обязательства Участника клиринга по ценным бумагам, в отношении которого осуществляется проверка, не станет отрицательным, или, если Единый лимит по такому Расчетному коду был отрицательным до момента проверки, - проверку того, что Единый лимит по такому Расчетному коду, рассчитанный с учетом указанного обязательства, не станет меньше, чем Единый лимит по этому Расчетному коду, рассчитанный до момента проверки;
 - для Торгово-клирингового счета T+ с признаком «запрет коротких продаж», и/или для Участника клиринга категории «B», и/или ценных бумаг с признаком «запрет коротких продаж» – значения в ценных бумагах, рассчитанные в соответствии с общей частью Правил клиринга для проверки возможности исполнения операции, проводимой по Торгово-клиринговому счету Участника клиринга при наличии признака «запрет необеспеченных покупок» / «запрет коротких продаж», и/или Участника клиринга категории «B», и/или ценных бумаг с признаком «запрет коротких продаж», с учетом обязательства Участника клиринга по ценным бумагам, в отношении которого осуществляется проверка, для каждой Даты исполнения (или для Дат исполнения, установленных общей частью Правил клиринга в случае если Клиринговым центром установлен период действия признака «запрет коротких продаж» по ценной бумаге), не станут отрицательными, а в случае, если на конец Расчетного дня, предшествующего дню установления признака «запрет коротких продаж» по ценной бумаге на период, значение, рассчитанное в соответствии с общей частью Правил клиринга для проверки возможности исполнения операции, проводимой по Торгово-клиринговому счету Участника

клиринга при наличии признака «запрет необеспеченных покупок» / «запрет коротких продаж», и/или Участника клиринга категории «В», и/или ценных бумаг с признаком «запрет коротких продаж» для какой-либо из Дат исполнения являлось отрицательным, абсолютное значение отрицательной величины, рассчитанное с учетом обязательства Участника клиринга по ценным бумагам, в отношении которого осуществляется проверка, для Дат исполнения, установленных общей частью Правил клиринга, в случае, если Клиринговым центром установлен период действия признака «запрет коротких продаж» по ценной бумаге, не увеличится;

- для ценных бумаг, по которым Клиринговым центром установлен признак «запрет коротких продаж», а также установлено значение параметра «лимит коротких продаж», отличное от нуля, значения в ценных бумагах, рассчитанные в соответствии с общей частью Правил клиринга для проверки возможности исполнения операции, проводимой по Торгово-клиринговому счету Участника клиринга при установлении Клиринговым центром значения параметра «лимит коротких продаж» по соответствующей ценной бумаге, отличного от нуля, с учетом обязательства Участника клиринга по ценным бумагам, в отношении которого осуществляется проверка, для каждой Даты исполнения не станут ниже установленного Клиринговым центром значения параметра «лимит коротких продаж»;
- для Торгово-клирингового счета Т+, в состав которого входит Расчетный код Единого пула, – в случае положительного результата дополнительной проверки Единого лимита, указанной в общей части Правил клиринга.

30.5. Помимо условий, предусмотренных пунктами 30.2 и 30.4 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, проверка достаточности денежных средств и ценных бумаг, осуществляемая Клиринговым центром при подаче Участником клиринга, инициирующим исполнение второй части Сделки РЕПО с открытой датой, заключенной с участием центрального контрагента, поручения на исполнение второй части Сделки РЕПО с открытой датой, считается пройденной в случае, если по итогам исполнения поручения на исполнение второй части Сделки РЕПО с открытой датой величины, указанные в абзаце 4 пункта 30.2 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов и абзаце 3 пункта 30.4 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, рассчитанные для периода с Даты исполнения второй части Сделки РЕПО с открытой датой по максимально возможную Дату исполнения Сделки РЕПО с открытой датой, определяемую исходя из пункта 21.6 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, не станут отрицательными в любой из Расчетных дней такого периода. Указанное в настоящем пункте Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов условие применяется, в случае если по Расчетному коду Участника клиринга / Торгово-клиринговому счету Участника клиринга установлен признак «запрет необеспеченных покупок» / «запрет коротких продаж» и/или по ценной бумаге, с которой заключена Сделка РЕПО с открытой датой установлен признак «запрет коротких продаж».

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

30.7. Проверки, указанные в настоящей статье Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, не выполняются в отношении подаваемых Клиринговым центром поручений на исполнение второй части Сделки РЕПО с открытой датой в соответствии с пунктами 29.2 -29.5 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.

Статья 31. Порядок подачи и условия регистрации поручений на внесение компенсационных взносов и поручений на отказ от компенсационных взносов

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

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

31.3. Поручение на внесение компенсационного взноса в виде денежных средств, поданное Участником клиринга, регистрируется в Клиринговой системе при прохождении в момент подачи Поручения всех соответствующих проверок, предусмотренных статьей 30 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, в отношении обязательства данного Участника клиринга по внесению компенсационного взноса.

31.4. Поручение на внесение компенсационного взноса в виде ценных бумаг, поданное Участником клиринга, регистрируется в Клиринговой системе при прохождении в момент подачи Поручения всех соответствующих проверок, предусмотренных статьей 30 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, в отношении обязательства данного Участника клиринга по внесению компенсационного взноса.

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

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

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

Поручение на отказ от компенсационного взноса может быть подано при условии, что компенсационный взнос не является обеспеченным средствами под исполнение

в соответствии с пунктом 31.5 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.

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

- 31.8. Участнику клиринга в Клиринговой системе раскрывается информация о регистрации Поручения на отказ от компенсационного взноса, поданного в Клиринговую систему его контрагентом.
- 31.9. Отзыв Участником клиринга ранее зарегистрированного в Клиринговой системе Поручения на отказ от компенсационного взноса возможен только до момента регистрации в Клиринговой системе Поручения на отказ от компенсационного взноса, поданного его контрагентом.

Статья 32. Порядок подачи и исполнения Поручений на отказ от исполнения сделки РЕПО / Поручений на отказ от исполнения кредитного договора / Поручений на отказ от исполнения сделки купли-продажи ценных бумаг

- 32.1. Поручение на отказ от исполнения сделки РЕПО с кодом расчетов Sn / Поручение на отказ от исполнения сделки купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов В0-В30 может быть подано в Клиринговую систему Участником клиринга, являющимся стороной по сделке, в ходе периода регистрации поручений с даты заключения сделки РЕПО / сделки купли-продажи ценных бумаг до Даты исполнения обязательств по первой части сделки РЕПО / сделке купли-продажи ценных бумаг.
- Поручение на отказ от исполнения кредитного договора с кодом расчетов Sn может быть подано в Клиринговую систему Участником клиринга, являющимся стороной по сделке, в ходе периода регистрации поручений с даты заключения кредитного договора до Даты исполнения обязательств по выдаче кредита по кредитному договору.
- 32.2. Поручение на отказ от исполнения сделки РЕПО / Поручение на отказ от исполнения кредитного договора / Поручение на отказ от исполнения сделки купли-продажи ценных бумаг не может быть подано Участником клиринга, если обязательства по первой части сделки РЕПО / выдаче кредита по кредитному договору / сделке купли-продажи ценных бумаг исполнены, или первая часть сделки РЕПО / операция выдачи кредита по кредитному договору / сделка купли-продажи ценных бумаг является обеспеченной средствами под исполнение в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.
- 32.3. Если по первой части сделки РЕПО / операции выдачи кредита по кредитному договору / сделке купли-продажи ценных бумаг подан Отчет на исполнение (информация о первой части сделки РЕПО / операции выдачи кредита по кредитному договору / сделке купли-продажи ценных бумаг включена в Специальный или Срочный отчет на исполнение), но первая часть сделки РЕПО / обязательство по выдаче кредита по кредитному договору / сделка купли-продажи ценных бумаг не является обеспеченной средствами под исполнение, то для подачи Поручения на

отказ от исполнения сделки РЕПО / Поручения на отказ от исполнения кредитного договора / Поручения на отказ от исполнения сделки купли-продажи ценных бумаг необходимо сначала отозвать Отчет на исполнение (исключить информацию о первой части сделки РЕПО / операции выдачи кредита по кредитному договору / сделке купли-продажи ценных бумаг из Специального или Срочного отчета на исполнение).

- 32.4. Поручение на отказ от исполнения сделки РЕПО / Поручение на отказ от исполнения кредитного договора / Поручение на отказ от исполнения сделки купли-продажи ценных бумаг содержит номер первой части сделки РЕПО / номер операции выдачи кредита по кредитному договору / номер сделки купли-продажи ценных бумаг, от исполнения которой Участник клиринга желает отказаться, а также величину отступного за отказ от исполнения сделки РЕПО / сделки купли-продажи ценных бумаг.

Участник клиринга, подавший Поручение на отказ от исполнения сделки РЕПО/ Поручение на отказ от исполнения сделки купли-продажи ценных бумаг, обязан указать сумму отступного в той валюте, в которой проводятся расчеты по сделке РЕПО / сделке купли-продажи ценных бумаг, а также выбрать направление отступного: заплатить или получить.

- 32.5. Поручение на отказ от исполнения сделки РЕПО / Поручение на отказ от исполнения сделки купли-продажи ценных бумаг, поданное Участником клиринга, обязанным уплатить отступное, регистрируется в Клиринговой системе при прохождении в момент подачи Поручения на отказ от исполнения сделки РЕПО / Поручения на отказ от исполнения сделки купли-продажи ценных бумаг всех соответствующих проверок, предусмотренных статьей 30 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, в отношении обязательства данного Участника клиринга по уплате отступного.

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

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

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

Статья 33. Порядок подачи и условия регистрации Специальных и/или Срочных отчетов на исполнение

33.1. Участник клиринга вправе включить в Специальный и/или Срочный отчет на исполнение:

- сделки купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов Bn, B0-B30;
- первые части сделок РЕПО с кодом расчетов Sn;
- вторые части сделок РЕПО с кодом расчетов Sn, Z0 и Rb;
- операции выдачи кредита по кредитному договору с кодом расчетов Sn;
- операции возврата кредита по кредитному договору с кодом расчетов Sn и Rb;
- обязательства по внесению компенсационных взносов по биржевым сделкам РЕПО;
- сделки купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов Yn, заключенные на основании адресных заявок (за исключением сделок, заключенных на основании заявок с указанием Торгово-клирингового счета имущественного пула);
- первые и вторые части сделок РЕПО с кодом расчетов Ym/Yn, заключенных на основании адресных заявок (за исключением сделок РЕПО, которым соответствует депозитный договор или заявка на заключение депозитного договора, внесенная в реестр предложений, и за исключением включения в Срочный отчет на исполнение сделок РЕПО с клиринговыми сертификатами участия);
- вторые части сделок РЕПО с кодом расчетов T0/Yn, заключенных на основании адресных заявок (за исключением включения в Срочный отчет на исполнение сделок РЕПО с клиринговыми сертификатами участия).

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

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

33.4. По всем сделкам и/или обязательствам, указанным в пункте 33.1 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов и включенным в Специальный и/или Срочный отчет на исполнение, Клиринговый центр для каждого Расчетного кода и Торгово-клирингового счета, по которым проводится Процедура контроля обеспечения по сделкам, включенным в Специальный или Срочный отчет на исполнение, рассчитывает каждое нетто-обязательство (нетто-требование) Участника клиринга по денежным средствам или ценным бумагам.

33.4.1. Каждое нетто-обязательство (нетто-требование) Участника клиринга по денежным средствам рассчитывается по формуле:

$$POS_VAL = ST - SO, \text{ где:}$$

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

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

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

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

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

$POS_C = STC - SOC$, где:

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

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

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

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

- 33.5. Специальный и/или Срочный отчет на исполнение Участника клиринга, имеющего нетто-обязательство по денежным средствам, регистрируется в Клиринговой системе при прохождении в момент подачи Специального и/или Срочного отчета на исполнение всех соответствующих проверок, предусмотренных статьей 30 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, в отношении нетто-обязательства данного Участника клиринга по денежным средствам.

Специальный отчет на исполнение Участника клиринга, имеющего нетто-обязательство по ценным бумагам, регистрируется в Клиринговой системе при прохождении в момент подачи Специального отчета на исполнение всех соответствующих проверок, предусмотренных статьей 30 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, в отношении нетто-обязательства данного Участника клиринга по ценным бумагам.

Срочный отчет на исполнение Участника клиринга, имеющего нетто-обязательство по ценным бумагам, регистрируется в Клиринговой системе при прохождении в

момент подачи Срочного отчета на исполнение всех соответствующих проверок, предусмотренных статьей 30 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, в отношении нетто-обязательства данного Участника клиринга по ценным бумагам, а также при условии непревышения в момент подачи Срочного отчета на исполнение данного нетто-обязательства по ценным бумагам меньшей из двух величин: количества ценных бумаг, учитываемых по соответствующему Торгово-клиринговому счету, за вычетом соответствующего Ограничительного лимита, и количества ценных бумаг, учитываемых на соответствующем Разделе по информации, полученной от Расчетного депозитария.

- 33.6. Участнику клиринга в Клиринговой системе раскрывается информация о регистрации Специального и/или Срочного отчета на исполнение, поданного в Клиринговую систему его контрагентом / конечным контрагентом.
- 33.7. Участники клиринга вправе до окончания периода регистрации поручений отзывать зарегистрированные Специальные и/или Срочные отчеты на исполнение и подавать новые Специальные и/или Срочные отчеты на исполнение при условии, что сделки и/или обязательства, включенные в Специальный и/или Срочный отчет на исполнение, еще не являются обеспеченными средствами под исполнение в соответствии с пунктом 33.9 / 33.10 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.
- 33.8. Специальные и/или Срочные отчеты на исполнение, содержащие Сделки Т+ и не обеспеченные средствами под исполнение на ближайшее время исполнения Участниками клиринга Итоговых нетто-обязательств по ценным бумагам, установленное Временным регламентом, являющимся приложением к общей части Правил клиринга, исключаются из Клиринговой системы и не подлежат исполнению. Исполнение (прекращение) обязательств по Сделкам Т+, ранее включенным в такие отчеты, осуществляется в сроки, установленные Временным регламентом, являющимся приложением к общей части Правил клиринга, путем включения их в Единый клиринговый пул в порядке, определенном общей частью Правил клиринга.
- Специальные и Срочные отчеты на исполнение, не обеспеченные средствами под исполнение до окончания периода регистрации поручений, после его окончания исключаются из Клиринговой системы и не подлежат исполнению.
- 33.9. При условии регистрации в Клиринговой системе Специальных отчетов на исполнение, поданных обоими Участниками клиринга - контрагентами / конечными контрагентами и содержащих одинаковый набор сделок и/или парных сделок и/или обязательств, указанные сделки и/или обязательства считаются обеспеченными средствами под исполнение, а нетто-обязательства (нетто-требования) Участников клиринга по денежным средствам или ценным бумагам по сделкам и/или обязательствам, включенным в такие Специальные отчеты на исполнение, включаются в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов / Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов по сделкам с центральным контрагентом с ближайшим временем исполнения.
- 33.10. При условии регистрации в Клиринговой системе Срочных отчетов на исполнение, поданных обоими Участниками клиринга - контрагентами / конечными контрагентами и содержащих одинаковый набор сделок и/или парных сделок и/или

обязательств, указанные сделки и/или обязательства считаются обеспеченными средствами под исполнение, а нетто-обязательства (нетто-требования) Участников клиринга по денежным средствам или ценным бумагам, рассчитанные по сделкам и/или обязательствам, включенным в такие Срочные отчеты на исполнение, включаются в Клиринговый пул для расчетов в ходе торгов / Клиринговый пул для расчетов в ходе торгов по сделкам с центральным контрагентом.

Статья 34. Порядок определения и включения в клиринговый пул обязательств Участников клиринга по уплате Возмещения

- 34.1. Определение и учет обязательств и требований Участников клиринга по уплате Возмещения осуществляется в Клиринговой системе в российских рублях в отдельности по каждой биржевой сделке с ценными бумагами, каждому кредитному договору.
- 34.2. Обязательства и требования Участников клиринга по уплате Возмещения определяются в Клиринговой системе только по биржевым сделкам, в том числе по сделкам РЕПО и кредитным договорам, неисполненным до Даты прекращения исполнения, по которым только одним из Участников клиринга нарушены требования Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, повлекшим неисполнение обязательств по биржевой сделке с ценными бумагами, кредитному договору в Дату исполнения.
- Размер обязательств по уплате / требований по получению Участниками клиринга Возмещения определяются в Клиринговой системе в Дату прекращения исполнения этих сделок в соответствии со статьей 44 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, и допускаются к клирингу.
- 34.3. Обязательство Участника клиринга по уплате Возмещения подлежит исполнению начиная с Расчетного дня, следующего за Датой прекращения исполнения соответствующей биржевой сделки.
- 34.4. Учет обязательства Участника клиринга по уплате Возмещения может быть прекращен в Клиринговой системе (до удержания с этого Участника клиринга денежных средств в размере его обязательства по уплате Возмещения) на основании полученного от Участника клиринга уведомления об отказе от получения Фиксированного возмещения, в соответствии с пунктом 44.4 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.
- 34.5. Обязательства Участника клиринга по уплате Возмещения исполняются после исполнения Нетто-обязательств Участника клиринга по денежным средствам, определенных в соответствии со статьей 45 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, обязательств Участника клиринга по уплате комиссионных вознаграждений в соответствии со статьей 50 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, и обязательств по уплате неустоек в соответствии со статьей 45 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.
- 34.5.1. Возмещение по биржевым сделкам с ценными бумагами и кредитным договорам удерживается с Участников клиринга в порядке возрастания номеров сделок.

- 34.5.2. Возмещение по биржевой сделке с ценными бумагами и кредитному договору может быть удержано только в полном объеме, частичное удержание Возмещения не допускается.
- 34.6. Обеспечение Участника клиринга в российских рублях является достаточным для исполнения обязательств по уплате Возмещения, учитываемых по Расчетному коду Участника клиринга, если размер Обеспечения Участника клиринга в российских рублях, учитываемого по такому Расчетному коду, не меньше, чем размер указанных обязательств.
- 34.6.1. Обязательства по уплате / требования по получению Возмещения, учитываемые по Расчетному коду Участника клиринга, для исполнения которых достаточно Обеспечения, включаются в Единый клиринговый пул и исполняются в порядке, определенном общей частью Правил клиринга.
- 34.7. Неисполненные обязательства по уплате Возмещения по сделкам РЕПО и кредитным договорам учитываются в Клиринговой системе только в Расчетный день, следующий за Датой прекращения исполнения сделки, по сделкам купли-продажи - в течение 3 (трех) месяцев с Расчетного дня, следующего за Датой прекращения исполнения сделки, по которой возникли указанные обязательства по уплате Возмещения.
- По истечении указанного срока обязательства по уплате Возмещения не подлежат исполнению в Клиринговой системе.
- 34.7.1. Прекращение учета обязательств по уплате Возмещения в Клиринговой системе не влечет прекращение указанных обязательств. Требования о надлежащем исполнении указанных обязательств могут быть предъявлены любой из сторон в соответствии с гражданским законодательством при условии соблюдения порядка разрешения споров, предусмотренного общей частью Правил клиринга.

Статья 35. Порядок включения в клиринговый пул и исполнения обязательств по депозитным договорам

- 35.1. До момента времени, определенного Временным регламентом как время первого в течение Расчетного дня исполнения Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований по денежным средствам в соответствующей валюте, Клиринговый центр включает в Клиринговый пул для расчетов по обязательствам по возврату депозитов обязательства Клирингового центра по возврату Участникам клиринга депозитов с наступившей Датой исполнения.
- 35.2. Исполнение обязательств по возврату депозитов с наступившей Датой исполнения осуществляются до первого в течение Расчетного дня исполнения (прекращения) Итогового нетто-обязательства / Итогового нетто-требования по денежным средствам в соответствующей валюте, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга. Проверка достаточности денежных средств для заключения депозитного договора и исполнение обязательств по внесению депозитов осуществляются после первого в течение Расчетного дня исполнения (прекращения) Итогового нетто-обязательства / Итогового нетто-требования по денежным средствам в соответствующей валюте, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга.

- 35.3. Заключение депозитных договоров осуществляется за счет Обеспечения, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга после первого в течение Расчетного дня исполнения (прекращения) Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований по денежным средствам в соответствующей валюте, и/или за счет Обеспечения, полученного Участником клиринга в результате исполнения Клиринговым центром обязательств по возврату Участнику клиринга депозитов с наступившей Датой исполнения, в порядке возрастания плановой даты заключения депозитного договора, а для заявок на заключение депозитных договоров с одинаковой плановой датой заключения депозитных договоров – в порядке возрастания даты и времени внесения заявки на заключение депозитного договора в реестр предложений.
- 35.4. Обязательство Клирингового центра по возврату Участнику клиринга депозита с наступившей Датой исполнения включает в себя обязательство по возврату суммы депозита и суммы процентов, рассчитанной в соответствии с условиями заключенного депозитного договора и/или статьей 36 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов (применяется в случае изменения Участником клиринга суммы депозита). Датой исполнения обязательств Клирингового центра по возврату Участнику клиринга депозита является дата возврата депозита, определенная в соответствии с условиями депозитного договора и Правилами торгов на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.
- Документом, удостоверяющим возврат депозита, является Отчет о движении денежных средств, предоставляемый Клиринговым центром Участнику клиринга.
- 35.5. Обязательство Клирингового центра по возврату Участнику клиринга депозита в соответствующей валюте, учитываемое по Расчетному коду Участника клиринга, прекращается возникновением обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга Обеспечения в соответствующей валюте, учитываемого по тому же Расчетному коду. При этом размер Обеспечения Участника клиринга в соответствующей валюте, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, увеличивается на размер обязательства по возврату депозита.
- 35.6. Проверка достаточности денежных средств для заключения депозитного договора осуществляется в плановую дату заключения депозитного договора в соответствии с кодом расчетов, указанным в заявке на заключение депозитного договора, внесенной в реестр предложений, и в Расчетный день, следующий за указанной датой, в случае недостаточности в плановую дату заключения депозитного договора денежных средств для заключения депозитного договора в сумме депозита, указанной в заявке на заключение депозитного договора, внесенной в реестр предложений.
- 35.6.1. Сумма денежных средств Участника клиринга является достаточной для заключения депозитного договора, если сумма Обеспечения в денежных средствах, учитываемая по Расчетному коду (с учетом исполнения Клиринговым центром обязательств по возврату депозитов Участнику клиринга любой категории, кроме категории «Ж», Дата исполнения которых наступила, либо с учетом исполнения Клиринговым центром обязательств по возврату суммы депозита Участнику клиринга категории «К», Дата исполнения которых наступила, а также с учетом исполнения (прекращения) Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований по денежным средствам в соответствующей валюте) больше или равна сумме депозита, указанной в заявке на заключение депозитного договора, внесенной в реестр

предложений, поданной с указанием Торгово-клирингового счета, в состав которого входит такой Расчетный код, и не достаточной – если меньше.

35.6.2. Депозитный договор заключается за счет денежных средств, учитываемых в качестве Обеспечения по Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в заявке на заключение депозитного договора, внесенной в реестр предложений, на максимальную сумму, не превышающую одновременно:

- 1) сумму депозита, указанную в заявке на заключение депозитного договора, внесенной в реестр предложений, и
- 2) округленную до ближайшего меньшего целого числа сумму Обеспечения в российских рублях, учитываемого по соответствующему Расчетному коду, уменьшенную на сумму определенных в текущую дату обязательств по уплате оборотных частей комиссионных вознаграждений по депозитным договорам (при заключении депозитного договора в российских рублях),

или

сумму Обеспечения в соответствующей иностранной валюте, рассчитанную как частное от деления округленного до ближайшего меньшего целого числа произведения Обеспечения в соответствующей иностранной валюте, учитываемого по соответствующему Расчетному коду, и Центрального курса соответствующей иностранной валюты, действующего на момент подачи заявки на заключение депозитного договора, и Центрального курса соответствующей иностранной валюты, действующего на момент подачи заявки на заключение депозитного договора (при заключении депозитного договора в иностранной валюте).

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

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

За клиринговую услугу по переносу даты предоставления обеспечения в сумме, необходимой для заключения депозитного договора, в том числе, в случае если идентификационные данные, включая код клиента, указанные в заявке, на момент проверки были недействительны, Клиринговый центр взимает с Участника клиринга комиссионное вознаграждение, установленное Тарифами Клирингового центра. Указанное комиссионное вознаграждение определяется в плановую дату заключения депозитного договора и учитывается по:

- основному Расчетному коду для списания комиссионных вознаграждений, порядок определения которого установлен общей частью Правил клиринга, в случае если Расчетный код, входящий в состав Торгово-клирингового счета, указанного в заявке на заключение депозитного договора, внесенной в реестр предложений, является Расчетным кодом ДУ,
- Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в заявке на заключение депозитного договора, внесенной в реестр предложений, в случае если Расчетный код, входящий в состав Торгово-клирингового счета, указанного в заявке на заключение депозитного договора,

внесенной в реестр предложений, не является Расчетным кодом ДУ.

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

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

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

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

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

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

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

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

35.8.3. процентная ставка депозита, за исключением депозитного договора с плавающей ставкой, рассчитывается по следующей формуле и округляется по правилам математического округления с точностью до 7 знаков после запятой:

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

R – процентная ставка депозита;

S₁ – сумма депозита, определенная в соответствии с подпунктом 35.8.1 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов;

S₂ – сумма возврата, определенная в соответствии с подпунктом 35.8.2 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов;

T₃₆₅ – число дней между фактической датой заключения депозитного договора (не включая эту дату) и датой возврата депозита (включая эту дату), приходящихся на календарный год, состоящий из 365 (трёхсот шестидесяти пяти) дней;

T₃₆₆ – число дней между фактической датой заключения депозитного договора (не включая эту дату) и датой возврата депозита (включая эту дату), приходящихся на календарный год, состоящий из 366 (трёхсот шестидесяти шести) дней.

- 35.8.4. процентная ставка депозита по депозитному договору с плавающей ставкой рассчитывается как округленная по правилам математического округления с точностью до 7 знаков после запятой сумма индикативной ставки и отклонения от индикативной ставки, рассчитанного по следующей формуле:

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

spread – значение отклонения от индикативной ставки;

S₁ – сумма депозита, определенная в соответствии с подпунктом 34.8.1 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов;

S₂ – сумма возврата, определенная как сумма всех сумм возврата в заявках на заключение депозитных договоров, по которым заключается депозитный договор (с учетом частичного исполнения заявок), рассчитанных с использованием в качестве процентной ставки значений отклонений от индикативной ставки, указанных в заявках на заключение депозитных договоров, по которым заключается депозитный договор;

T₃₆₅ – число дней между фактической датой заключения депозитного договора (не включая эту дату) и датой возврата депозита (включая эту дату), приходящихся на календарный год, состоящий из 365 (трёхсот шестидесяти пяти) дней;

T₃₆₆ – число дней между фактической датой заключения депозитного договора (не включая эту дату) и датой возврата депозита (включая эту дату), приходящихся на календарный год, состоящий из 366 (трёхсот шестидесяти шести) дней.

- 35.9. Участник клиринга вправе отказаться от заключения одного депозитного договора на основании разных заявок в соответствии с пунктом 35.8 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, предоставив Клиринговому центру Заявление об объединении заявок на заключение депозитных договоров с указанием отменить объединение заявок на заключение депозитных договоров.
- 35.10. В случае непредоставления Участником клиринга Обеспечения в сумме депозита, указанной в заявке на заключение депозитного договора, внесенной в реестр предложений, в плановую дату заключения депозитного договора (для всех депозитных договоров) и в Расчетный день, следующий за указанной датой (для всех депозитных договоров, за исключением депозитных договоров со сроком 1 день), а также в случае неустранения на момент проверки некорректности идентификационных данных, в том числе недействительности кода клиента,

указанного в заявке, Клиринговый центр заключает балансирующие сделки РЕПО в порядке, определенном общей частью Правил клиринга.

35.11. Участник клиринга любой категории, кроме категории «К», обязан уплатить Клиринговому центру отступное в случае непредоставления Участником клиринга Обеспечения в сумме депозита, указанной в заявке на заключение депозитного договора, внесенной в реестр предложений, в плановую дату заключения депозитного договора в соответствии с кодом расчетов, указанным в заявке на заключение депозитного договора, внесенной в реестр предложений (для депозитных договоров со сроком 1 день), и в Расчетный день, следующий за указанной датой (для всех депозитных договоров, за исключением депозитных договоров со сроком 1 день)), а также в случае неустранения некорректности на момент проверки идентификационных данных, в том числе недействительности кода клиента, указанного в заявке.

35.11.1. Сумма отступного рассчитывается по формуле:

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

Penalty – сумма отступного, в российских рублях,

VAL_OBL – величина, равная разности сумм депозита, указанных в заявках на заключение депозитного договора, внесенных в реестр предложений, для заключения которых не достаточно денежных средств, и сумм депозитных договоров, заключенных на основании таких заявок в плановую дату заключения депозитного договора, или в Расчетный день, следующий за указанной датой (для случая, указанного в подпункте 35.11 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов);

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

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

R1 – ставка отступного, установленная в соответствии с Методикой определения риск-параметров валютного рынка и рынка драгоценных металлов;

R2 – ставка РЕПО / процентная ставка в балансирующей сделке, заключенной в соответствии с пунктом 35.9 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов;

R0 – процентная ставка, указанная в заявке на заключение депозитного договора, внесенной в реестр предложений (по депозитному договору с плавающей ставкой сумма индикативной ставки и отклонения от индикативной ставки);

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

Обязательство по уплате отступного, рассчитанное в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, учитывается по:

- основному Расчетному коду для списания комиссионных вознаграждений, порядок определения которого установлен общей частью Правил клиринга, в случае если Расчетный код, входящий в состав Торгово-клирингового счета, указанного в заявке на заключение депозитного договора, внесенной в реестр предложений, является Расчетным кодом ДУ,
- Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в заявке на заключение такого депозитного договора, в случае если Расчетный код, входящий в состав Торгово-клирингового счета, указанного в заявке на заключение депозитного договора, внесенной в реестр предложений, не является Расчетным кодом ДУ.

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

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

35.11.2. После заключения депозитного договора Клиринговый центр:

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

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

Статья 36. Возврат части депозита до наступления Даты исполнения обязательств по возврату депозита

36.1. При соблюдении условий, установленных настоящей статьей Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, Участник клиринга любой категории, кроме категории «К», до Даты исполнения обязательства по возврату депозита вправе временно вывести (вернуть) часть суммы депозита по заключенному депозитному договору, кроме депозитного договора с плавающей ставкой.

36.2. Для возврата части депозита Участник клиринга с использованием Клиринговой системы направляет Клиринговому центру Заявление на временный возврат части депозита.

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

- 36.3. Заявление на временный возврат части депозита должно содержать:
- номер депозитного договора;
 - наименование и код ценной бумаги, заявка на заключение сделки РЕПО с которой может быть признана допустимой встречной для заявки на заключение сделки РЕПО, заключаемой Клиринговым центром в соответствии с пунктом 36.10 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов в целях исполнения обязательства Клирингового центра по возврату суммы депозита при исполнении Заявления на временный возврат части депозита;
 - плановая дата пополнения депозита (кроме Участников клиринга категории «В»);
 - сумма денежных средств, на которую изменяется сумма депозита;
 - краткий код клиента Участника клиринга, за счет которого был заключен соответствующий депозитный договор (должен совпадать с кодом клиента, указанным в заявке на заключение депозитного договора).
- 36.4. В качестве плановой даты пополнения депозита Участник клиринга категории «Б» или «Б2» может указать любой Расчетный день до Даты исполнения обязательства по возврату депозита, включая эту дату. Направляя Клиринговому центру Заявление на временный возврат части депозита с указанием плановой даты пополнения депозита, Участник клиринга категории «Б» или «Б2» принимает обязательство пополнить депозит в случае исполнения Клиринговым центром такого Заявления на временный возврат части депозита, за исключением случая, когда в качестве плановой даты пополнения депозита Участник клиринга категории «Б» или «Б2» указал Дату исполнения обязательства по возврату депозита.
- При указании Участником клиринга категории «Б» или «Б2» в качестве плановой даты пополнения депозита Дату исполнения обязательства по возврату депозита считается, что сумма депозита изменена на срок депозитного договора с даты подачи Заявления на временный возврат части депозита, включая эту дату, до плановой даты пополнения депозита, включая эту дату.
- В случае исполнения Клиринговым центром Заявления на временный возврат части депозита с указанием плановой даты пополнения депозита, отличной от Даты исполнения обязательства по возврату депозита, Участник клиринга обязан пополнить депозит на условиях и в сумме, указанных в настоящей статье Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.
- 36.5. Участник клиринга категории «В» не вправе пополнить депозит. Плановая дата пополнения депозита в Заявлении на временный возврат части депозита не заполняется. При подаче Заявления на временный возврат части депозита Участником клиринга категории «В» считается, что сумма депозита изменена на срок депозитного договора с даты подачи Заявления на временный возврат части депозита, включая эту дату, до плановой даты пополнения депозита, включая эту дату.
- 36.6. Направление Участником клиринга Клиринговому центру Заявления на временный возврат части депозита является согласием Участника клиринга на:
- изменение процентной ставки по депозитному договору в соответствии с пунктом 36.16 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке

- кредитов;
- изменение условий депозита в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов;
 - уплату комиссионных вознаграждений, отступных, предусмотренных настоящей статьей Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.
- 36.7. Направление Участником клиринга категории «Б» или «Б2» Клиринговому центру Заявления на временный возврат части депозита с указанием плановой даты пополнения депозита, за исключением случая, когда плановая дата пополнения депозита совпадает с Датой исполнения обязательства по возврату депозита, является предложением Участника клиринга об изменении даты возврата депозита по депозитному договору, указанному в Заявлении на временный возврат части депозита, на дату, являющуюся Расчетным днем, следующим за плановой датой пополнения депозита, в случае, если в плановую дату пополнения депозита и/или в Расчетный день, следующий за плановой датой пополнения депозита, Участник клиринга не пополнил депозит на сумму денежных средств, указанную в Заявлении на временный возврат части депозита.
- 36.8. Направление Участником клиринга Клиринговому центру Заявления на временный возврат части депозита с указанием плановой даты пополнения депозита, за исключением случая, когда плановая дата пополнения депозита совпадает с Датой исполнения обязательства по возврату депозита, является поручением Клиринговому центру пополнить депозит за счет Обеспечения Участника клиринга и определить, какие депозиты пополнять.
- 36.9. Заявление на временный возврат части депозита исполняется в день его предоставления при выполнении условий, указанных в пункте 36.11 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов. Заявления на временный возврат части депозита, для которых за время торгов, в ходе которых возможна подача заявок на заключение депозитных договоров, не выполнены условия, указанные в пункте 36.11 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, аннулируются.
- 36.10. В целях исполнения обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга части суммы депозита при исполнении Заявления на временный возврат части депозита Клиринговый центр заключает сделку (сделки) РЕПО с клиринговыми сертификатами участия на следующих условиях:
- Датой исполнения обязательств по первой части сделки РЕПО является день исполнения Заявления на временный возврат части депозита;
 - Датой исполнения обязательств по второй части сделки РЕПО является плановая дата пополнения депозита или Дата исполнения обязательства Клирингового центра по возврату депозита (в случае изменения суммы депозита на весь срок депозитного договора);
 - Сумма РЕПО равна сумме денежных средств, указанной в Заявлении на временный возврат части депозита;
 - объектом сделки РЕПО являются ценные бумаги, указанные в Заявлении на временный возврат части депозита.

- 36.11. Клиринговый центр исполняет Заявление на временный возврат части депозита при выполнении следующих условий:
- 36.11.1. наименование и код ценной бумаги, указанные в Заявлении на временный возврат части депозита, совпадают с наименованием и кодом ценной бумаги, указанными в заявке, на основании которой заключен депозитный договор, номер которого указан в Заявлении на временный возврат части депозита;
- 36.11.2. сумма денежных средств, указанная в Заявлении на временный возврат части депозита, меньше, чем размер обязательства Клирингового центра по возврату суммы депозита по депозитному договору, номер которого указан в Заявлении на временный возврат части депозита;
- 36.11.3. Единый лимит по Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в заявке на заключение депозитного договора, номер которого указан в Заявлении на временный возврат части депозита, рассчитанный с учетом изменения суммы депозита, не станет отрицательным;
- 36.11.4. Клиринговый центр заключил сделку РЕПО с клиринговыми сертификатами участия на условиях, указанных в пункте 36.10 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.
- 36.12. Исполнение Клиринговым центром Заявления на временный возврат части депозита осуществляется в момент времени, определенный Временным регламентом как время первого в течение Расчетного дня исполнения Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований по денежным средствам в соответствующей валюте.
- 36.13. При исполнении Заявления на временный возврат части депозита обязательство Клирингового центра по возврату суммы депозита по депозитному договору, номер которого указан в Заявлении на временный возврат части депозита, прекращается в части, равной сумме денежных средств, указанной в Заявлении на временный возврат части депозита, возникновением обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга Обеспечения в соответствующей валюте в размере указанной суммы денежных средств. При этом размер Обеспечения Участника клиринга в соответствующей валюте, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, увеличивается на размер прекращенного обязательства по возврату суммы депозита.
- 36.14. Исполнение Клиринговым центром Заявления на временный возврат части депозита (за исключением случая, когда плановая дата пополнения депозита совпадает с Датой исполнения обязательства по возврату депозита) является согласием Клирингового центра с предложением Участника клиринга об изменении даты возврата депозита по депозитному договору, указанному в Заявлении на временный возврат части депозита, на дату, являющуюся Расчетным днем, следующим за плановой датой пополнения депозита, в случае, если в плановую дату пополнения депозита и/или в Расчетный день, следующий за плановой датой пополнения депозита, Участник клиринга не пополнил депозит на сумму денежных средств, указанную в Заявлении на временный возврат части депозита.
- 36.15. За клиринговую услугу по временному возврату части депозита, Клиринговый центр взимает с Участника клиринга комиссионное вознаграждение, установленное Тарифами Клирингового центра. Указанное комиссионное вознаграждение определяется в дату исполнения Заявления на временный возврат части депозита и

учитывается по Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в заявке на заключение депозитного договора, номер которого указан в Заявлении на временный возврат части депозита.

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

36.16. В случае исполнения Клиринговым центром Заявления на временный возврат части депозита:

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

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

где:

R_d – процентная ставка по депозитному договору (в % годовых) после исполнения Заявления на временный возврат части депозита;

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

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

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

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

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

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

D_c^{366} – фактическое число календарных дней между датой изменения суммы депозита и плановой датой пополнения включительно, приходящийся на календарный год, состоящий из 366 (трёхсот шестидесяти шести) дней;

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

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

- 36.16.2. Для каждого дня с даты, следующей за плановой датой пополнения депозита, процентная ставка равна процентной ставке, рассчитанной с учетом исполнения после даты исполнения Заявления на временный возврат части депозита, указанного в пункте 36.16 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, иных Заявлений на временный возврат части депозита или процентной ставке, действовавшей до исполнения Заявления на временный возврат части депозита (если с даты исполнения Заявления на временный возврат части депозита, указанного в пункте 36.16 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, не было исполнения иных Заявлений на временный возврат части депозита с плановой датой пополнения позже плановой датой пополнения, указанного в Заявлении на временный возврат части депозита, указанного в пункте 36.16 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов).
- 36.17. В случае исполнения Клиринговым центром Заявления на временный возврат части депозита Участник клиринга обязан пополнить депозит в плановую дату пополнения депозита, указанную в таком Заявлении на временный возврат части депозита, на сумму, не превышающую сумму денежных средств, указанную в таком Заявлении на временный возврат части депозита.
- 36.18. Пополнение депозита осуществляется за счет Обеспечения, внесенного до времени, определенного Временным регламентом как время первого в течение Расчетного дня исполнения Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований по денежным средствам в соответствующей валюте, или за счет Обеспечения, полученного Участником клиринга в результате исполнения Клиринговым центром обязательств по возврату Участнику клиринга депозитов с наступившей Датой исполнения, в порядке возрастания плановой даты заключения депозитного договора, и до исполнения обязательств по внесению депозитов.
- 36.19. Проверка достаточности денежных средств для пополнения депозита осуществляется в плановую дату пополнения депозита, указанную в Заявлении на временный возврат части депозита, и в Расчетный день, следующий за указанной датой, в случае недостаточности в плановую дату пополнения депозита денежных средств для пополнения депозита в сумме денежных средств, указанной в Заявлении на временный возврат части депозита.
- 36.19.1. Сумма денежных средств Участника клиринга является достаточной для пополнения депозита, если сумма Обеспечения в денежных средствах, учитываемая по Расчетному коду (с учетом исполнения Клиринговым центром обязательств по возврату Участнику клиринга депозитов с наступившей Датой исполнения) больше или равна сумме денежных средств, указанной в Заявлении на временный возврат части депозита (в плановую дату пополнения депозита), или разности суммы денежных средств, указанной в Заявлении на временный возврат части депозита, и суммы, на которую депозит был пополнен в плановую дату пополнения депозита (в Расчетный день, следующий за плановой датой пополнения депозита), и не достаточной – если меньше.

36.19.2. Пополнение депозита осуществляется за счет денежных средств, учитываемых в качестве Обеспечения по Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в заявке на заключение депозитного договора, номер которого указан в Заявлении на временный возврат части депозита, на максимальную сумму, не превышающую одновременно сумму денежных средств, указанной в Заявлении на временный возврат части депозита, и сумму Обеспечения в соответствующей валюте, округленную до ближайшего меньшего целого числа, учитываемую по соответствующему Расчетному коду, учитывающую уменьшение на сумму определенных в текущую дату обязательств по уплате оборотных частей комиссионных вознаграждений по депозитным договорам (при пополнении депозита в российских рублях).

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

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

В случае осуществления переноса даты пополнения депозита на следующий Расчетный день по Расчетному коду ДУ уплата комиссионного вознаграждения, указанного в настоящем пункте Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, осуществляется с собственного Расчетного кода Участника клиринга.

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

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

36.22. В случае изменения даты возврата депозита Участник клиринга обязан уплатить Клиринговому центру отступное (за исключением случая, когда плановая дата пополнения депозита совпадает с датой возврата депозита по депозитному договору).

Сумма отступного рассчитывается по формуле:

$Penalty = ROUND (VAL_OBL \times C \times n \times \max((\max(R1;R2)-R0);0) / 365; 2)$, где

Penalty – сумма отступного, в российских рублях,

VAL_OBL – изначальная сумма депозита;

C – курс иностранной валюты к российскому рублю, установленный Банком России на дату определения отступного (используется в случае, если сумма депозитного договора выражена в иностранной валюте);

n – количество календарных дней между датой расчета отступного (включая эту дату) и первоначальной Датой возврата депозита (не включая эту дату);

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

R2 – ставка РЕПО / процентная ставка в сделке РЕПО с клиринговыми сертификатами участия, заключенной Клиринговым центром в целях исполнения обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга части суммы депозита при исполнении Заявления на временный возврат части депозита;

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

Указанное отступное определяется в дату, являющуюся Расчетным днем, следующим за плановой датой пополнения депозита, и учитывается по Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в заявке на заключение депозитного договора, номер которого указан в Заявлении на временный возврат части депозита. Обязательства по уплате указанного отступного включаются в Единый клиринговый пул и исполняются в порядке, установленном общей частью Правил клиринга. В случае если временный возврат части депозита осуществляется по Расчетному коду ДУ, списание указанного отступного производится с собственного Расчетного кода Участника клиринга.

- 36.23. После изменения суммы депозита Клиринговый центр изменяет с учетом такого изменения суммы депозита Нетто-обязательство и/или Нетто-требование Участника клиринга в соответствующей валюте, учитываемые по соответствующему Расчетному коду, с Датами исполнения, соответствующими дате исполнения Заявления на временный возврат части депозита, плановой дате пополнения депозита и/или дате возврата депозита.
- 36.24. Документом, удостоверяющим изменение суммы депозита, являются Отчет о движении денежных средств, Отчет об изменении суммы депозита, предоставляемые Клиринговым центром Участнику клиринга и содержащие информацию об изменении суммы депозита и размере суммы, на которую может быть пополнен депозит. Информация о процентной ставке по депозитному договору предоставляется Участнику клиринга в Выписке из реестра сделок, принятых в клиринг и Отчете об изменении суммы депозита.
- 36.25. Участник клиринга вправе выбрать собственный Расчетный код для уплаты комиссионных вознаграждений, предусмотренных настоящей статьей Правил

клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов. В случае если Участник клиринга не выбрал указанный выше Расчетный код, комиссионные вознаграждения списываются с Расчетного кода, по которому осуществляется досрочный возврат части депозита (с учетом положений пунктов 36.19.3, 36.22 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов).

Статья 37. Порядок включения в клиринговый пул обязательств по договорам М-Депозита

- 37.1. Клиринговый центр проверяет обязательства по договорам М-Депозитов, заключаемым при проведении в системе торгов Биржи депозитных аукционов, на предмет соответствия условиям для включения в отдельный Клиринговый пул для М-Депозитов в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.
- 37.2. Клиринговый пул для М-Депозитов формируется Клиринговым центром из обязательств, учитывающихся на каждом Счете обеспечения Т0 для М-Депозитов, или Счете обеспечения Т0, утратившем признак «для М-Депозитов» (в случае, если на нем продолжают учитываться обязательства и требования по договору М-Депозита), по каждой из валют в Расчетные дни, которые являются Датами исполнения обязательств по внесению и возврату денежных средств по договорам М-Депозита, несколько раз в день на основе неттирования обязательств и требований по договорам М-Депозита. Периодичность формирования Клирингового пула для М-Депозитов в течение Расчетного дня определяется Клиринговым центром, в том числе на основе данных о проводимых ПАО Московская Биржа депозитных аукционах.
- 37.3. Проверка соблюдения условий включения обязательств по договорам М-Депозита в Клиринговый пул для М-Депозитов осуществляется Клиринговым центром с учетом размера Обеспечения Участника клиринга в соответствующей валюте, учитываемого по Счету обеспечения Т0 для М-Депозитов, или Счету обеспечения Т0, утратившему признак «для М-Депозитов», на котором учитываются обязательства и требования по договору М-Депозита, размера обязательств Участника клиринга по договорам М-Депозитов в соответствующей валюте, размера требований Участника клиринга по договорам М-Депозита в соответствующей валюте, а также с учетом направленности обязательств по договорам М-Депозита (в первую очередь выполняется проверка соблюдения условий включения в Клиринговый пул для М-Депозитов обязательств по возврату денежных средств по договору М-Депозита) и присвоенных ПАО Московская Биржа номеров договоров М-Депозита (в первую очередь проверяется соблюдение условий включения в Клиринговый пул для М-Депозитов обязательств по договорам М-Депозитов, имеющим наименьшее значение номера договора, присвоенного ПАО Московская Биржа).
- 37.4. Для исполнения обязательств по договору М-Депозита, по которому по результатам проверки, указанной в пункте 37.3 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, недостаточно Обеспечения, Клиринговый центр может использовать Обеспечение в денежных средствах, в которых выражено обязательство по договору М-Депозита, учитываемое на Расчетным коде, связанном на основании Запроса на открытие Торгово-клирингового счета со Счетом

- обеспечения ГО для М-Депозитов. Использование Клиринговым центром указанного в настоящем пункте Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов Обеспечения возможно в такой сумме (количестве), что в результате использования указанного Обеспечения установленные общей частью Правил клиринга условия возврата Клиринговым центром Участнику клиринга Обеспечения в денежных средствах с указанного в настоящем пункте Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов Расчетного кода будут соблюдены.
- 37.5. Обязательства по договорам М-Депозита, для исполнения которых по результатам проверки, указанной в пункте 37.3 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, а также после осуществления действий, указанных в пункте 37.4 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, у Участника клиринга недостаточно Обеспечения, не включаются в Клиринговый пул для М-Депозитов.
- 37.6. Требования Участника клиринга, соответствующие обязательствам по договорам М-Депозита, которые по результатам, указанной в пункте 37.3 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, оценки и действий, предусмотренных пунктом 37.4 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, не были включены в Клиринговый пул для М-Депозитов, не учитываются при проверке соблюдения условий включения в Клиринговый пул для М-Депозитов обязательств такого Участника клиринга по договорам М-Депозита и не включаются в указанный Клиринговый пул.
- 37.7. В случае невключения в Клиринговый пул для М-Депозитов обязательств Участника клиринга по договору М-Депозита, в Клиринговый пул для М-Депозитов не включаются требования Участника клиринга – контрагента по соответствующему договору М-Депозита.
- 37.8. В случае если в течение Расчетного дня Клиринговый пул для М-Депозитов формируется более одного раза, проверка соблюдения условий включения обязательств по договорам М-Депозита производится также в отношении обязательств по договорам М-Депозитов, ранее не включенным в течение Расчетного дня в Клиринговый пул для М-Депозитов.
- 37.9. В случае если обязательства по договорам М-Депозита с наступившей Датой исполнения в течение Расчетного дня не был включен ни в один из формируемых Клиринговых пулов для М-Депозитов, обязательства по таким Договорам М-Депозита исключаются из Клиринговой системы и подлежат самостоятельному урегулированию между Участниками клиринга, являющимися сторонами по ним.
- 37.10. Клиринговый центр вправе своим решением изменить указанную в пункте 37.3 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, очередность проверки соблюдения условий включения в Клиринговый пул для М-Депозитов обязательств по договорам М-Депозита, раскрываемом на Сайте Клирингового центра и вступающем в силу через 5 (пять) календарных дней после такого раскрытия, если в самом решении Клирингового центра не установлен иной срок вступления его в силу.

- 37.11. Исполнение обязательств и требований по внесению/возврату денежных средств по договорам М-Депозита, включенных в Клиринговый пул для М-Депозитов, отражается по соответствующим Счетам обеспечения Т0 для М-Депозитов Участников клиринга – сторон договора М-Депозита в разрезе каждого договора М-Депозита.
- 37.12. Обязательства и требования, включенные в Клиринговый пул для М-Депозитов, прекращаются возникновением Нетто-обязательства / Нетто-требования по денежным средствам каждого Участника клиринга, обязательства и/или требования которого были включены в Клиринговый пул для М-Депозитов.
- 37.13. Нетто-обязательства и нетто-требования по денежным средствам, возникшие в текущем Расчетном дне, в связи с прекращением всех обязательств и требований, включенных в Клиринговые пулы для М-Депозитов, включаются в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов и исполняются в порядке, определенном статьей 45 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.

Статья 38. Порядок подачи и условия исполнения Поручений на изменение срока исполнения обязательств по сделке

- 38.1. Поручение на изменение срока исполнения обязательств по сделке может быть подано по второй части сделок РЕПО с кодом расчетов Ym/Un (за исключением сделок РЕПО, которым соответствует депозитный договор или заявка на заключение депозитного договора, внесенная в реестр предложений), второй части сделок РЕПО с кодом расчетов T0/Un, заключенным на основании адресных заявок.
- 38.2. Поручение на изменение срока исполнения обязательств по сделке по второй части сделки РЕПО с кодом расчетов T0/Un, Ym/Un может быть подано Участником клиринга в Клиринговую систему при условии исполнения первой части сделки РЕПО.
- 38.3. Поручение на изменение срока исполнения обязательств по сделке, поданное Участником клиринга, регистрируется в Клиринговой системе, при соблюдении следующих условий:
- Единый лимит по Расчетному коду, рассчитанный с учетом изменения Даты исполнения обязательств по сделке, не станет отрицательным, или, если Единый лимит по такому Расчетному коду был отрицательным до момента проверки, Единый лимит по такому Расчетному коду, рассчитанный с учетом изменения Даты исполнения обязательств по сделке, не станет меньше, чем Единый лимит по этому Расчетному коду, рассчитанный до момента проверки;
 - Сумма денежных средств в валюте, в которой проводятся расчеты по сделке РЕПО / количество ценных бумаг являющихся объектом сделки РЕПО, рассчитанные в соответствии с общей частью Правил клиринга для проверки возможности исполнения операции, проводимой по Торгово-клиринговому счету Участника клиринга при наличии признака «запрет необеспеченных покупок» / «запрет коротких продаж», и/или Участника клиринга категории «В», и/или ценных бумаг с признаком «запрет коротких продаж», с учетом изменения Даты исполнения обязательств по сделке, для каждой Даты

исполнения (или для Дат исполнения, установленных общей частью Правил клиринга, в случае если Клиринговым центром установлен период действия признака «запрет коротких продаж» по ценной бумаге), не станут отрицательными (для Торгово-клирингового счета Участника клиринга, по которому установлен признак «запрет необеспеченных покупок» / Торгово-клиринговому счету Участника клиринга, в состав которого входит Расчетный код Участника клиринга, по которому установлен признак «запрет коротких продаж», и/или Участника клиринга категории «В», и/или ценных бумаг с признаком «запрет коротких продаж») или не станут меньше установленного Клиринговым центром значения параметра «лимит коротких продаж (в случае если по соответствующей иностранной валюте/ценной бумаге Клиринговым центром установлен признак «запрет коротких продаж», а также установлено значение параметра «лимит коротких продаж», отличное от нуля), а в случае, если на конец Расчетного дня, предшествующего дню установления признака «запрет коротких продаж» по ценной бумаге на период, количество ценных бумаг, являющихся объектом сделки РЕПО, рассчитанное в соответствии с общей частью Правил клиринга для проверки возможности исполнения операции, проводимой по Торгово-клиринговому счету Участника клиринга, при наличии признака «запрет необеспеченных покупок» / «запрет коротких продаж», и/или Участника клиринга категории «В», и/или ценных бумаг с признаком «запрет коротких продаж» для какой-либо из Дат исполнения являлось отрицательным, абсолютное значение отрицательной величины, рассчитанное с учетом изменения Даты исполнения обязательств по сделке, для Дат исполнения, установленных общей частью Правил клиринга, в случае, если Клиринговым центром установлен период действия признака «запрет коротких продаж» по ценной бумаге, не увеличится.

- 38.4. Участнику клиринга в Клиринговой системе раскрывается информация о регистрации Поручения на изменение срока исполнения обязательств по сделке, поданного в Клиринговую систему Участником клиринга - конечным контрагентом по парной сделке.
- 38.5. При регистрации в Клиринговой системе Поручений на изменение срока исполнения обязательств по сделке, поданных обоими Участниками клиринга - конечными контрагентами по парным сделкам, Дата исполнения обязательств по такой сделке меняется на текущую дату, при этом размер обязательства по второй части сделки РЕПО рассчитывается исходя из фактического срока сделки РЕПО.
- 38.6. Обязательства по сделкам, Дата исполнения которых была изменена, включаются в клиринговый пул, формируемый в такую Дату исполнения, и исполняются в порядке, установленном Правилами клиринга.

Статья 39. Особенности возврата Обеспечения Участникам клиринга категории «К»

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

- 39.2. Клиринговый центр в Дату исполнения обязательства по денежным средствам по второй части сделок РЕПО, стороной по которым является Участник клиринга категории «К», осуществляет возврат Обеспечения в денежных средствах Участнику клиринга категории «К» в сумме дохода по сделкам РЕПО, в порядке, предусмотренном общей частью Правил клиринга, без подачи поручений / запросов Участником клиринга категории «К».
- 39.3. Постоянное поручение на возврат обеспечения, поданное Участником клиринга категории «К», исполняется в порядке, предусмотренном общей частью Правил клиринга, в следующих размерах:
- в сумме Нетто-требования по возврату депозитов с наступившей Датой исполнения, за вычетом суммы процентов, указанной в пункте 39.1 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов;
 - в сумме Нетто-требования сделок РЕПО с наступившей Датой исполнения, в которых Участник клиринга категории «К» является покупателем по первой части сделок РЕПО и/или продавцом по второй части сделок РЕПО, за вычетом суммы дохода по сделкам РЕПО, указанной в пункте 39.2 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов;
 - в сумме Нетто-требования по сделкам РЕПО с наступившей Датой исполнения, в которых Участник клиринга категории «К» является продавцом по первой части сделок РЕПО и/или покупателем по второй части сделок РЕПО.

Статья 40. Порядок подачи и условия исполнения Поручений на отказ от исполнения сделки РЕПО с кодом расчетов Y0/Yn, Ym/Yn, Ym/YODn, T0/YODn

- 40.1. Поручение на отказ от исполнения сделок РЕПО с кодом расчетов Y0/Yn, T0/YODn заключенных на основании адресных заявок (за исключением сделок РЕПО, которым соответствует депозитный договор или заявка на заключение депозитного договора, внесенная в реестр предложений) до 19:00, может быть подано в Клиринговую систему Участником клиринга, являющимся стороной по сделке, в ходе периода регистрации поручений в дату заключения сделки РЕПО до момента наступления более раннего из двух событий: 1) Определения Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований по денежным средствам в соответствующей валюте по первой части сделки РЕПО или 2) момента Определения Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований по ценным бумагам по первой части сделки РЕПО (в зависимости от того, какое из этих событий наступит раньше).
- 40.2. Поручение на отказ от исполнения сделок РЕПО с кодом расчетов Y0/Yn, T0/YODn заключенных на основании адресных заявок после 19:00 и сделок РЕПО с кодом расчетов Ym/Yn, Ym/YODn, заключенных на основании адресных заявок (за исключением сделок РЕПО, которым соответствует депозитный договор или заявка на заключение депозитного договора, внесенная в реестр предложений), может быть подано в Клиринговую систему Участником клиринга, являющимся стороной по сделке, в ходе периода регистрации поручений в дату заключения сделки РЕПО.
- 40.3. Поручение на отказ от исполнения сделки РЕПО с кодом расчетов Y0/Yn, Ym/Yn, T0/YODn, Ym/YODn, заключенной на основании адресных заявок не может быть подано Участником клиринга, если первая часть сделки РЕПО является

обеспеченной средствами под исполнение в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.

- 40.4. Если по первой части сделки РЕПО подан Отчет на исполнение (информация о первой части сделки РЕПО включена в Специальный или Срочный отчет на исполнение), но первая часть сделки РЕПО не является обеспеченной средствами под исполнение, то для подачи Поручения на отказ от исполнения сделки РЕПО необходимо сначала отозвать Отчет на исполнение (исключить информацию о первой части сделки РЕПО из Специального или Срочного отчета на исполнение).
- 40.5. В Поручении на отказ от исполнения сделки РЕПО Участник клиринга обязан указать номер первой части сделки РЕПО, от исполнения которой Участник клиринга желает отказаться.
Отказ от исполнения первой части сделки РЕПО с кодом расчетов Y0/Yn, Ym/Yn, заключенной на основании адресных заявок, не предусматривает уплату отступного.
- 40.6. Поручение на отказ от исполнения сделки РЕПО с кодом расчетов Y0/Yn, Ym/Yn, Ym/YODn, T0/YODn, заключенной на основании адресных заявок, поданное Участником клиринга, регистрируется в Клиринговой системе при прохождении в момент подачи Поручения на отказ от исполнения сделки РЕПО всех соответствующих проверок, предусмотренных статьей 30 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, в отношении обязательств по сделке РЕПО, по которой подается Поручение на отказ от исполнения сделки РЕПО.
- 40.7. Участнику клиринга в Клиринговой системе раскрывается информация о регистрации Поручения на отказ от исполнения сделки РЕПО, поданного в Клиринговую систему конечным контрагентом по парной сделке.
- 40.8. При условии регистрации в Клиринговой системе Поручений на отказ от исполнения сделки РЕПО с кодом расчетов Y0/Yn, Ym/Yn, Ym/YODn, T0/YODn, заключенной на основании адресных заявок, поданных обоими Участниками клиринга – конечными контрагентами по парным сделкам, обязательства по сделке РЕПО считаются прекращенными, исключаются из числа обязательств, допущенных к клирингу, и не подлежат исполнению в Клиринговой системе.
- 40.9. Направление Участником клиринга Клиринговому центру Поручения на отказ от исполнения сделки РЕПО с кодом расчетов Y0/Yn, Ym/Yn, Ym/YODn, T0/YODn, является поручением Клиринговому центру заключить сделку своп или сделку РЕПО (или сделки купли-продажи ценных бумаг в случаях, установленных общей частью Правил клиринга) в случае выполнения следующего условия: в результате исполнения Поручения на отказ от исполнения сделки РЕПО с кодом расчетов Y0/Yn, Ym/Yn, Ym/YODn, T0/YODn, станут отрицательными значения в валюте, в которой проводятся расчеты по сделке РЕПО, по которой подается Поручение на отказ от исполнения сделки РЕПО, рассчитанные в соответствии с общей частью Правил клиринга для проверки возможности исполнения операции, проводимой по Торгово-клиринговому счету Участника клиринга при наличии признака «запрет необеспеченных покупок» / «запрет коротких продаж», и/или Участника клиринга категории «В», с учетом прекращения обязательства в соответствующей валюте по указанной сделке РЕПО.

- 40.10. Условия сделки РЕПО (двух сделок купли-продажи ценных бумаг), указанной в пункте 40.9 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, соответствуют определенным Правилами торгов на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов условиям сделок РЕПО с кодом расчетов Y0/Y1 (сделок купли-продажи с кодами расчетов Y0, Y1), заключаемых в Секции рынка РЕПО / Секции Фондового рынка, с учетом следующих особенностей:
- 40.10.1. по первой части сделки РЕПО (по первой сделке купли-продажи ценных бумаг) у Участника клиринга возникают требования в валюте, в которой проводятся расчеты по сделке РЕПО, по которой подается Поручение на отказ от исполнения сделки РЕПО, и обязательства в ценных бумагах (за исключением ценных бумаг, не принимаемых в качестве обеспечения исполнения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением), в объеме, соответствующем абсолютному значению отрицательного значения в валюте, в которой проводятся расчеты по сделке РЕПО, по которой подается Поручение на отказ от исполнения сделки РЕПО, рассчитанного в соответствии с общей частью Правил клиринга для проверки возможности исполнения операции, проводимой по Торгово-клиринговому счету Участника клиринга при наличии признака «запрет необеспеченных покупок» / «запрет коротких продаж», и/или Участника клиринга категории «В» (если указанное значение стало отрицательным) на момент времени определенный Временным регламентом как время первого в течение Расчетного дня исполнения Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований по денежным средствам в соответствующей валюте, и кратном лоту, установленному Биржей, с округлением в большую сторону, а также не превышающем суммы Итогового нетто-требования Недобросовестного участника клиринга в ценных бумагах и Обеспечения Недобросовестного участника клиринга в таких ценных бумагах, учитываемого по Торгово-клиринговому счету, с указанием которого была заключена сделка РЕПО, по которой подается Поручение на отказ от исполнения сделки РЕПО. Выбор ценных бумаг, в отношении которых заключается сделка РЕПО (сделки купли-продажи), осуществляется Клиринговым центром, при этом, в первую очередь, сделки РЕПО заключаются с клиринговыми сертификатами участия. Выбор Торгово-клирингового счета Т+, по которому учитываются возникшие обязательства в ценных бумагах, осуществляется Клиринговым центром;
- 40.10.2. Датой исполнения обязательств по первой части сделки РЕПО (первой сделке купли-продажи ценных бумаг) является день ее заключения;
- 40.10.3. Датой исполнения обязательств по второй части сделки РЕПО (второй сделке купли-продажи ценных бумаг) является Расчетный день, следующий за днем ее заключения;
- 40.10.4. Сумма РЕПО (сумма первой сделки купли-продажи ценных бумаг) определяется как произведение количества ценных бумаг в сделке и последней определенной Клиринговым центром Расчетной цены ценных бумаг;
- 40.10.5. Стоимость обратного выкупа (сумма второй сделки купли-продажи ценных бумаг) для Участника клиринга любой категории, кроме категории «К», определяется по формуле:

$$S_2 = S_1 * \left(1 + \frac{R}{100} \times \left(\frac{T_{365}}{365} + \frac{T_{366}}{366} \right) \right), \text{ где}$$

S_2 - Стоимость обратного выкупа (сумма второй сделки купли-продажи ценных бумаг);

S_1 - Сумма РЕПО (сумма первой сделки купли-продажи ценных бумаг);

R - ставка РЕПО, применяемая для случаев урегулирования обязательств по Сделкам Т+, для исполнения которых недостаточно денежных средств / ценных бумаг, установленная Клиринговым центром в соответствии с Методикой определения риск-параметров фондового рынка и рынка депозитов;

T_{365} - число дней между исполнением первой и второй частей сделки РЕПО (первой и второй сделкой купли-продажи ценных бумаг), приходящихся на календарный год, состоящий из 365 (трёхсот шестидесяти пяти) дней;

T_{366} - число дней между исполнением первой и второй частей сделки РЕПО (первой и второй сделкой купли-продажи ценных бумаг), приходящихся на календарный год, состоящий из 366 (трёхсот шестидесяти шести) дней.

Стоимость обратного выкупа (сумма второй сделки купли-продажи ценных бумаг) для Участника клиринга категории «К» равна Сумме РЕПО (сумме первой сделки купли-продажи ценных бумаг).

- 40.11. Условия сделки своп, указанной в пункте 40.9 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов соответствуют определенным Правилами торгов на валютном рынке условиям сделок своп с учетом следующих особенностей:
- 40.11.1. В случае если валюта, в которой проводятся расчеты по сделке РЕПО, по которой подается Поручение на отказ от исполнения сделки РЕПО - российский рубль, то по первой части сделки своп у Участника клиринга возникают требования в российских рублях и обязательства в иностранной валюте / драгоценном металле (за исключением иностранных валют / драгоценных металлов, не принимаемых в качестве обеспечения исполнения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением) в объеме, соответствующем абсолютному значению отрицательного значения в валюте, в которой проводятся расчеты по сделке РЕПО, по которой подается Поручение на отказ от исполнения сделки РЕПО, рассчитанного в соответствии с общей частью Правил клиринга для проверки возможности исполнения операции, проводимой по Торгово-клиринговому счету Участника клиринга при наличии признака «запрет необеспеченных покупок» / «запрет коротких продаж», и/или Участника клиринга категории «В» (если указанное значение стало отрицательным) на момент времени определенный Временным регламентом как время первого в течение Расчетного дня исполнения Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований по денежным средствам в соответствующей валюте, и кратном лоту, установленному Биржей, с округлением в большую сторону, а также не превышающем суммы Итогового нетто-требования Недобросовестного участника клиринга в иностранной валюте / драгоценном металле и Обеспечения Участника клиринга в такой иностранной валюте / таком драгоценном металле, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, входящему в состав Торгового-клирингового счета, с указанием которого была заключена сделка РЕПО, по которой подается Поручение на отказ от исполнения сделки РЕПО. Выбор иностранных валют / драгоценных металлов, в отношении которых заключается сделка своп, осуществляется Клиринговым центром;

- 40.11.2. В случае если валюта, в которой проводятся расчеты по сделке РЕПО, по которой подается Поручение на отказ от исполнения сделки РЕПО – иностранная валюта, то по первой части сделки своп у Участника клиринга возникают требования в такой иностранной валюте в объеме, равном абсолютному значению отрицательного значения в иностранной валюте, в которой проводятся расчеты по сделке РЕПО, по которой подается Поручение на отказ от исполнения сделки РЕПО, рассчитанного в соответствии с общей частью Правил клиринга для проверки возможности исполнения операции, проводимой по Торгово-клиринговому счету Участника клиринга при наличии признака «запрет необеспеченных покупок» / «запрет коротких продаж», и/или Участника клиринга категории «В» (если указанное значение стало отрицательным) на момент времени определенный Временным регламентом как время первого в течение Расчетного дня исполнения Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований по денежным средствам в соответствующей валюте, и обязательства в другой иностранной валюте или российских рублях, в объеме, соответствующем абсолютному значению отрицательного значения в иностранной валюте, в которой проводятся расчеты по сделке РЕПО, по которой подается Поручение на отказ от исполнения сделки РЕПО, и кратном лоту, установленному Биржей, с округлением в большую сторону, а также не превышающем суммы Итогового нетто-требования Недобросовестного участника клиринга в такой другой иностранной валюте / российских рублях и Обеспечения Недобросовестного участника клиринга в такой другой иностранной валюте / российских рублях, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, входящему в состав Торгового-клирингового счета, с указанием которого была заключена сделка РЕПО, по которой подается Поручение на отказ от исполнения сделки РЕПО;
- 40.11.3. Датой исполнения обязательств по первой части сделки своп является день ее заключения;
- 40.11.4. Датой исполнения обязательств по второй части сделки своп является Расчетный день по соответствующей валюте, следующий за датой заключения сделки своп;
- 40.11.5. Базовый курс сделки своп устанавливается равным Центральному курсу иностранной валюты / драгоценного металла, определенному в соответствии с Методикой риск-параметров валютного рынка и рынка драгоценных металлов в 19:00 по московскому времени текущего Торгового дня.
- 40.11.6. Цена сделки своп для Участника клиринга любой категории, кроме категории «К», рассчитывается по следующей формуле:
- $$\text{Swap_Price} = R_{c_VAL1_VAL2} \times S \times n / 365, \text{ где}$$
- Swap_Price – цена сделки своп,
- $R_{c_VAL1_VAL2}$ – Центральный курс сделок купли-продажи иностранной валюты / драгоценного металла VAL1 за валюту VAL2, определенный в соответствии с Методикой риск-параметров валютного рынка и рынка драгоценных металлов в 19:00 по московскому времени текущего Торгового дня,
- VAL – валюта лота сделки своп,
- S – ставка, установленная решением Клирингового центра,
- n – количество календарных дней между датой исполнения первой и второй части сделки своп.

Цена сделки своп для Участника клиринга категории «К» равна нулю.

- 40.12. В случае регистрации в Клиринговой системе Поручений на отказ от исполнения сделки РЕПО с кодом расчетов Y0/Yn, Ym/Yn, Ym/YODn, T0/YODn, заключенной на основании адресных заявок, поданных обоими Участниками клиринга – конечными контрагентами по парным сделкам и соблюдении условия, указанного в пункте 40.9 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, Клиринговый центр заключает от имени Участника клиринга, сделку своп или сделку РЕПО (две сделки купли-продажи ценных бумаг в случаях, установленных общей частью Правил клиринга) на условиях указанных в пункте 40.10, 40.11 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов. После заключения с Участниками клиринга сделок, указанных в настоящем пункте Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, Клиринговый центр включает обязательства по указанным сделкам с наступившей Датой исполнения в соответствующий клиринговый пул.

ПОДРАЗДЕЛ V-IV. ПОРЯДОК ДЕЙСТВИЙ В СЛУЧАЯХ НЕИСПОЛНЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ

Статья 41. Порядок выкупа клиринговых сертификатов участия у Банка России

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

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

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

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

Уведомление о выкупе клиринговых сертификатов участия, содержащее информацию, предусмотренную пунктом 41.1 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, должно быть направлено Банком России Клиринговому центру в дату отзыва (аннулирования) Банком России у Участника клиринга / клиента Участника клиринга, являющегося Кредитной организацией, лицензии на осуществление банковских операций.

41.3. Клиринговый центр выкупает у Банка России клиринговые сертификаты участия и передает Банку России денежные средства в российских рублях в объеме номинальной стоимости клиринговых сертификатов участия, предъявленных к выкупу, не позднее Расчетного дня, следующего за днем предъявления требования о выкупе.

Клиринговые сертификаты участия, выкупленные у Банка России, зачисляются Расчетным депозитарием на торговый раздел казначейского счета депо Клирингового центра.

41.4. В случае недостаточности у Клирингового центра свободных собственных денежных средств для выкупа клиринговых сертификатов участия у Банка России, Клиринговый центр заключает сделки своп с Уполномоченными участниками

клиринга в соответствии с Правилами клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.

- 41.5. С даты заключения договора об имущественном пуле в случае выкупа Клиринговым центром у Банка России клиринговых сертификатов участия, переданных таким Участником клиринга / клиентом Участника клиринга Банку России по первой части Сделки РЕПО, у Участника клиринга возникает обязательство перед Клиринговым центром уплатить денежные средства в сумме, равной номинальной стоимости клиринговых сертификатов участия, в отношении которых Участником клиринга / клиентом Участника клиринга не были исполнены обязательства перед Банком России по второй части Сделки РЕПО и требование к Клиринговому центру по получению клиринговых сертификатов участия в количестве, равном полученному Клиринговым центром от Банка России.
- 41.5.1. В случае отзыва (аннулирования) Банком России у Участника клиринга – Кредитной организации лицензии на осуществление банковских операций срок исполнения обязательства по уплате денежных средств Клиринговому центру в сумме, равной номинальной стоимости клиринговых сертификатов участия, в отношении которых Участником клиринга не были исполнены обязательства перед Банком России по второй части Сделки РЕПО, и срок исполнения требования к Клиринговому центру по получению клиринговых сертификатов участия в количестве, равном полученному Клиринговым центром от Банка России, считаются наступившими в дату, предшествующую дате отзыва (аннулирования) Банком России у Участника клиринга – Кредитной организации лицензии на осуществление банковских операций.
- 41.5.2. В случае отзыва (аннулирования) Банком России у клиента Участника клиринга, являющегося Кредитной организацией, лицензии на осуществление банковских операций и проведения вследствие этого Клиринговым центром ликвидационного неттинга в отношении такого клиента Участника клиринга в порядке, предусмотренном общей частью Правил клиринга, срок исполнения обязательства Участника клиринга по уплате денежных средств Клиринговому центру в сумме, равной номинальной стоимости клиринговых сертификатов участия, в отношении которых клиентом Участника клиринга не были исполнены обязательства перед Банком России по второй части Сделки РЕПО, и срок исполнения требования к Клиринговому центру по получению клиринговых сертификатов участия в количестве, равном полученному Клиринговым центром от Банка России, считаются наступившими в дату, предшествующую дате отзыва (аннулирования) Банком России у клиента Участника клиринга, являющегося Кредитной организацией, лицензии на осуществление банковских операций.
- 41.6. Датой исполнения обязательства Участника клиринга уплатить Клиринговому центру денежные средства в сумме, равной номинальной стоимости клиринговых сертификатов участия, в отношении которых Участником клиринга / клиентом Участника клиринга не были исполнены обязательства перед Банком России по второй части Сделки РЕПО, и Датой исполнения требования Участника клиринга к Клиринговому центру по получению клиринговых сертификатов участия в количестве, равном полученному Клиринговым центром от Банка России, является дата исполнения Клиринговым центром обязательства по выкупу клиринговых сертификатов участия у Банка России, за исключением случаев, установленных подпунктами 41.5.1-41.5.2 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.

- 41.6.1. Указанные обязательства и требования Участника клиринга, возникшие в связи с неисполнением Участником клиринга обязательств перед Банком России по второй части Сделки РЕПО, учитываются по собственному Расчетному коду и по Торгово-клиринговому счету Т+ Участника клиринга, в состав которого входит такой собственный Расчетный код и который соответствует Торгово-клиринговому счету имущественного пула. Выбор Расчетного кода и Торгово-клирингового счета Т+ из нескольких Торгово-клиринговых счетов Т+, отвечающих указанным условиям, осуществляется Клиринговым центром.
- 41.6.2. Указанные обязательства и требования Участника клиринга, возникшие в связи с неисполнением клиентом Участника клиринга обязательств перед Банком России по второй части Сделки РЕПО, при проведении ликвидационного неттинга в отношении клиента Участника клиринга учитываются по клиентскому Расчетному коду и по Торгово-клиринговому счету Т+ Участника клиринга, указанным Участником клиринга в Заявлении о проведении ликвидационного неттинга в отношении клиента Участника клиринга.
- 41.6.3. Указанные обязательства и требования Участника клиринга, возникшие в связи с неисполнением клиентом Участника клиринга обязательств перед Банком России по второй части Сделки РЕПО, в случае если Участник клиринга не представил Клиринговому центру Заявление о проведении ликвидационного неттинга в отношении клиента Участника клиринга в порядке, предусмотренном общей частью Правил клиринга, или в случае непринятия Клиринговым центром данного заявления к исполнению, учитываются по клиентскому Расчетному коду и по Торгово-клиринговому счету Т+ Участника клиринга, указанным Участником клиринга Клиринговому центру. В случае непредоставления Участником клиринга указанной информации в течение 1 (одного) Расчетного дня с даты предъявления Банком России требования о выкупе клиринговых сертификатов участия клиента Участника клиринга, указанные обязательства и требования Участника клиринга учитываются по собственному Расчетному коду и по Торгово-клиринговому счету Т+ Участника клиринга, в состав которого входит такой собственный Расчетный код и который соответствует Торгово-клиринговому счету имущественного пула.
- 41.6.4. Клиринговый центр допускает к клирингу указанные обязательства и требования Участника клиринга и Клирингового центра.
- 41.6.5. Исполнение указанных обязательств, а также их урегулирование в случае неисполнения осуществляется в стандартном порядке, определенном общей частью Правил клиринга.

Статья 42. Порядок действий в случае неисполнения обязательств по сделкам, заключенным без участия центрального контрагента

- 42.1. Урегулирование взаимоотношений в случаях неисполнения или ненадлежащего исполнения обязательств по второй части сделки РЕПО, заключенной без участия центрального контрагента, а также урегулирование вопросов, связанных с выплатой любых дивидендов, процентов и иного распределения на ценные бумаги, в отношении которых заключена сделка РЕПО, осуществляется в порядке, установленном соглашением, заключенным между Участниками клиринга, являющимися сторонами по сделке РЕПО, а при отсутствии такового – в соответствии с Процедурой урегулирования взаимных требований по сделкам,

заключенным без участия центрального контрагента, установленной статьей 43 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.

- 42.2. Урегулирование взаимоотношений в случаях неисполнения или ненадлежащего исполнения, обязательств по возврату кредита по кредитному договору, осуществляется в порядке, установленном соглашением, заключенным между Участниками клиринга, являющимися сторонами кредитного договора.

При отсутствии указанного в настоящем пункте соглашения, в случае неисполнения или ненадлежащего исполнения Участником клиринга (далее – Нарушившая сторона) обязательств по возврату кредита по кредитному договору другой Участник клиринга, являющийся стороной такого кредитного договора, вправе требовать от Нарушившей стороны исполнения обязательств по кредитному договору.

- 42.3. При неисполнении Участником клиринга сделки, заключенной без участия центрального контрагента, в том числе, в Дату исполнения (за исключением случаев, предусмотренных пунктом 42.5 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов), к данному Участнику клиринга может применяться следующий вид ответственности:

- 42.3.1. наложение штрафа в размере 0,05% (ноль целых пяти сотых процента) от суммы неисполненного обязательства. Штраф уплачивается Клиринговому центру.

- 42.4. Решением Клирингового центра может быть предусмотрена уплата Участником клиринга, указанным в заявке в качестве стороны по сделке, неустойки (штрафа) за ненадлежащее выполнение обязанности по обеспечению наличия денежных средств (ценных бумаг) в количестве, достаточном для заключения сделки по заявке, поданной Участником торгов с указанием реквизита «дата активации», в момент проведения Процедуры контроля ее обеспечения, в случае, если решением Клирингового центра предусмотрена такая обязанность. При этом размер неустойки (штрафа), определяемый решением Клирингового центра, не может быть более 3% от объема необеспеченной надлежащим образом заявки с учетом суммы НКД. Неустойка (штраф) подлежит уплате в пользу Клирингового центра.

Обязательство по уплате штрафа, предусмотренного настоящим пунктом Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, учитывается по Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в заявке на заключение сделки.

- 42.5. При неисполнении Участником клиринга сделки в Режиме торгов «Размещение: Аукцион» при размещении (доразмещении) облигаций, Генеральным агентом эмитента по обслуживанию которых является Банк России, в Дату исполнения (далее – Неисполнение на Аукционе) к данному Участнику клиринга применяется следующий вид ответственности:

- 42.5.1. неустойка в размере, определенном эмитентом / заявителем. Неустойка уплачивается эмитенту / заявителю в соответствии с реквизитами, указанными эмитентом / заявителем. Неустойка учитывается по основному Расчетному коду для списания комиссионных вознаграждений, порядок определения которого установлен общей частью Правил клиринга.

- 42.6. В случае повторного в течение 3 месяцев Неисполнения на Аукционе, Клиринговый центр направляет Бирже соответствующее уведомление;

- 42.7. В случае Неисполнения на Аукционе три раза в течение 3 месяцев, Клиринговый центр направляет Бирже соответствующее уведомление.
- 42.8. Неисполнение сделки купли-продажи, либо первой части сделки РЕПО, либо обязательства по выдаче кредита по кредитному договору, заключенным без участия центрального контрагента, не является неисполнением обязательств по такой сделке в случае, если до Даты исполнения такой сделки / такого обязательства (включая Дату исполнения) Участники клиринга – контрагенты по сделке отказались от исполнения сделки в соответствии со статьей 32 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.
- 42.9. При неуплате Участником клиринга компенсационного взноса в размере и порядке, определенном в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, на данного Участника клиринга может быть наложен штраф в пользу Клирингового центра в размере 0,05% (ноль целых пяти сотых процента) от текущей суммы РЕПО по соответствующей сделке.
- 42.10. Неисполнение Участниками клиринга – контрагентами обязательств по сделке с кодами расчетов Вп, В0-В30, Уп или обязательств по первой и/или второй части сделки РЕПО в связи с приостановлением/прекращением торгов по ценной бумаге на Бирже, в том числе, в связи с конвертацией, объединением выпусков или досрочным погашением ценной бумаги, составляющей предмет обязательства Участника клиринга в соответствии с заключенной на Бирже сделкой, не является нарушением Правил клиринга, за которое установлены меры ответственности в соответствии с Правилами клиринга, если такое приостановление/прекращение торгов по ценной бумаге повлекло невозможность исполнения обязательств по заключенной сделке в порядке, установленном Правилами клиринга.
- 42.11. Порядок определения размера Фиксированного возмещения установлен статьей 44 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.
- 42.11.1. Уплата Фиксированного возмещения Участником клиринга - контрагентом по сделке, не исполнившим своих обязательств по сделке, не освобождает такого Участника клиринга от исполнения всех обязательств по заключенной сделке, условия которой предусматривают уплату Фиксированного возмещения. При этом уплата Фиксированного возмещения Участником клиринга – контрагентом по сделке, не исполнившим своих обязательств по сделке, не освобождает такого Участника клиринга от возмещения убытков, причиненных неисполнением сделки Участнику клиринга, исполнившему свои обязательства по сделке, в размере, превышающем размер суммы Фиксированного возмещения, уплачиваемого Участнику клиринга, исполнившему свои обязательства по сделке.
- 42.11.2. В случае неисполнения одним из контрагентов сделки/части сделки РЕПО (за исключением Сделки Т+), обязательства по которой исполняются путем подачи Отчета на исполнение, по которой Правилами торгов на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов не предусмотрено заполнения реквизита заявки/сделки «Фиксированное возмещение», урегулирование взаимных требований контрагентов, заключивших такую сделку, происходит в соответствии с Процедурой урегулирования взаимных требований по сделкам, заключенным без участия центрального контрагента, установленной статьей 43 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.

Статья 43. Процедура урегулирования взаимных требований по сделкам, заключенным без участия центрального контрагента

- 43.1. Урегулирование вопросов, связанных с выплатой доходов по ценным бумагам, являющимся предметом сделки РЕПО (за исключением сделки РЕПО, заключенной в Режимах торгов «РЕПО с Банком России: Аукцион РЕПО», «РЕПО с Банком России: фикс.ставка», «РЕПО с Банком России: плав.ставка (доп.механизм)», «Аукцион РЕПО с Банком России: плавающая ставка»).
- 43.1.1. В случае неисполнения эмитентом своих обязательств по выплате доходов (процентного или купонного дохода, частичного погашения части основного долга) или иных выплат в виде денежных средств или другого имущества по ценным бумагам, являющимся объектом сделки РЕПО, Участник клиринга - покупатель по первой части сделки РЕПО имеет право на получение средств, уменьшивших Сумму РЕПО. Данное право может быть реализовано путем направления соответствующего заявления Участнику клиринга - продавцу по первой части сделки РЕПО. Возврат (выплата) излишне уплаченных сумм Участниками клиринга – сторонами по сделке РЕПО осуществляется в следующем порядке:
- 43.1.1.1. Участник клиринга - продавец по первой части сделки РЕПО осуществляет возврат излишне уплаченных сумм в срок не позднее 10 (десяти) рабочих дней со дня получения им соответствующего письменного заявления от Участника клиринга - покупателя по первой части сделки РЕПО.
- 43.1.1.2. В случае выплаты указанных доходов эмитентом после того, как они были перечислены Участником клиринга - продавцом по первой части сделки РЕПО Участнику клиринга - покупателю по первой части сделки РЕПО, Участник клиринга - покупатель по первой части сделки РЕПО в срок не позднее 3 (трёх) рабочих дней с даты получения доходов от эмитента обязан возвратить полученные доходы Участнику клиринга - продавцу по первой части сделки РЕПО.
- 43.1.2. В случае ненадлежащего исполнения Участником клиринга требований, предусмотренных подпунктом 43.1.1 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, такой Участник клиринга обязан уплатить Участнику клиринга - контрагенту по сделке РЕПО неустойку в размере двойной Ставки денежного рынка Московской Биржи RUSFAR, рассчитанной для 1 (одного) дня (overnight), действующей по состоянию на каждый день неисполнения указанных требований, начисленной на сумму подлежащих возврату (выплате) доходов за каждый день просрочки их возврата (выплаты).
- 43.2. Урегулирование вопросов, связанных с неисполнением или ненадлежащим исполнением обязательств по второй части сделок РЕПО (за исключением случая досрочного погашения облигаций, составляющих предмет обязательств по сделке РЕПО).
- 43.2.1. В случае неисполнения или ненадлежащего исполнения Участником клиринга (далее – Нарушившая сторона) обязательств по второй части сделки РЕПО другой Участник клиринга, являющийся стороной такой сделки РЕПО (далее – Ненарушившая сторона), вправе по своему выбору:
- 43.2.1.1. Требовать от Нарушившей стороны исполнения обязательств по сделке РЕПО. Процедура урегулирования, предусмотренная подпунктом 43.2.2 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, в этом случае не проводится. До направления уведомления о процедуре урегулирования в

соответствии с подпунктом 43.2.2 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов Ненарушившая сторона признается требующей от Нарушившей стороны исполнения обязательств по сделке РЕПО.

43.2.1.2.Требовать проведения процедуры урегулирования взаимных требований в порядке, предусмотренном подпунктом 43.2.2 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.

43.2.2. В случае принятия решения Ненарушившей стороной о проведении процедуры урегулирования взаимных требований согласно пункту 43.2.1.2 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, Ненарушившая сторона в течение 25 (двадцати пяти) календарных дней с Даты исполнения обязательств по второй части сделки РЕПО направляет Нарушившей стороне уведомление о процедуре урегулирования, содержащее:

(а) решение об урегулировании взаимных требований в соответствии с подпунктом 43.2.2 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов;

(б) информацию о размере остаточных обязательств по сделке РЕПО (включая расчет их суммы), определенных как разница между суммой денежных средств / стоимостью ценных бумаг, не переданных Нарушившей стороной по второй части сделки РЕПО, и стоимостью ценных бумаг / суммой денежных средств, не переданных Ненарушившей стороной по второй части сделки РЕПО.

43.2.2.1.Остаточные обязательства по сделке РЕПО определяются в денежном выражении.

43.2.2.2.Сумма остаточных обязательств перечисляется Участником клиринга, имеющим положительную величину остаточных обязательств по соответствующей сделке РЕПО.

43.2.2.3.Сумма остаточных обязательств по сделке РЕПО должна быть перечислена соответствующим Участником клиринга не позднее 4 (четырёх) рабочих дней с даты направления уведомления об урегулировании взаимных требований в соответствии с подпунктом 43.2.2 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, но в любом случае не позднее 30 (тридцати) календарных дней с Даты исполнения обязательств по второй части соответствующей сделки РЕПО.

43.2.2.4.После направления уведомления о процедуре урегулирования исполнение обязательств в натуре не допускается, если иное не согласовано сторонами в письменной форме.

43.2.2.5.В сумму остаточных обязательств по сделке РЕПО Ненарушившая сторона вправе включить невыплаченное Нарушившей стороной Фиксированное возмещение.

43.2.2.6.Обязательство по уплате суммы, составляющей остаточные обязательства по сделке РЕПО, признается исполненным с момента зачисления соответствующих денежных средств в полном объеме на счет Участника клиринга – получателя суммы остаточных обязательств по сделке РЕПО, указанный в уведомлении о процедуре урегулирования. В случае если в уведомлении о процедуре урегулирования отсутствует информация о счете Участника клиринга - покупателя, обязательство по уплате суммы, составляющей остаточные обязательства по сделке РЕПО, признается исполненным с момента списания денежных средств в размере остаточных обязательств со счета Участника клиринга – плательщика в пользу Участника клиринга – получателя по известным Участнику клиринга – плательщику реквизитам.

43.2.2.7. Ненарушившая сторона вправе по своему усмотрению:

- Начиная с рабочего дня, следующего за Датой исполнения обязательств по второй части сделки РЕПО (или начиная с рабочего дня, являющегося Датой исполнения обязательств по второй части сделки РЕПО в случае если Участник клиринга потребовал проведения Процедуры урегулирования взаимных требований в соответствии с подпунктом 28.8.1 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов), но в срок, не превышающий 25 (двадцати пяти) календарных дней с Даты исполнения обязательств по второй части сделки РЕПО - осуществить продажу в полном объеме ценных бумаг, полученных по первой части сделки РЕПО от Нарушившей стороны, или покупку в полном объеме ценных бумаг, эквивалентных ценным бумагам, переданным по первой части сделки РЕПО Нарушившей стороне, и осуществить расчет суммы остаточных обязательств, или
- Отказаться от продажи/покупки ценных бумаг, полученных / переданных по первой части сделки РЕПО от Нарушившей стороны, и осуществить расчет суммы остаточных обязательств.

43.2.2.8. Для целей расчета остаточных обязательств по сделке РЕПО стоимость ценных бумаг, не переданных по второй части сделки РЕПО, определяется следующим образом по выбору Ненарушившей стороны:

- В случае реализации (приобретения) ценных бумаг – как фактическая стоимость реализованных ценных бумаг или как фактическая стоимость приобретенных ценных бумаг, эквивалентных ценным бумагам, переданным по первой части сделки РЕПО. При определении фактической стоимости реализации или приобретения ценных бумаг учитываются также расходы, понесенные Ненарушившей стороной в связи с заключением и (или) исполнением соответствующих сделок покупки или продажи.
- В случае отказа от реализации (приобретения) ценных бумаг Ненарушившая сторона вправе самостоятельно рассчитать величину остаточных обязательств, используя для определения стоимости ценных бумаг расчетную стоимость, определенную на основании среднего арифметического не менее чем 5 (Пяти) котировок Участников торгов, полученных Ненарушившей стороной не ранее, чем за 5 (пять) рабочих дней до даты направления уведомления о процедуре урегулирования на объем ценных бумаг, соответствующий количеству ценных бумаг, не переданных по второй части сделки РЕПО. При этом Ненарушившая сторона самостоятельно определяет Участников торгов, котировки которых она использует для расчета остаточных обязательств. Также Ненарушившая сторона вправе рассчитать остаточные обязательства самостоятельно, используя в качестве расчетной стоимости ценных бумаг цену Ценового центра НРД на Дату исполнения обязательств по второй части соответствующей сделки РЕПО, либо расчетную цену ценных бумаг на день, следующий за Датой исполнения обязательств по второй части сделки РЕПО, либо, при её отсутствии – на дату ближайших торгов, состоявшихся в течение последних 12 месяцев до Даты исполнения обязательств по второй части данной сделки РЕПО.

Ненарушившая сторона также вправе обратиться за расчетом остаточных обязательств по сделкам РЕПО (за исключением сделок РЕПО, заключенных в Режимах торгов «РЕПО с Банком России: Аукцион РЕПО», «РЕПО с Банком России: фикс.ставка», «РЕПО с Банком России: плав.ставка (доп.механизм)»

и «Аукцион РЕПО с Банком России: плавающая ставка») к Клиринговому центру. Клиринговый центр осуществляет расчет остаточных обязательств, используя в качестве расчетной стоимости ценных бумаг цену Ценового центра НРД на Дату исполнения обязательств по второй части соответствующей сделки РЕПО, а при ее отсутствии – расчетную цену ценных бумаг на день, следующий за Датой исполнения обязательств по второй части сделки РЕПО, либо, при её отсутствии – на дату ближайших торгов, состоявшихся в течении последних 12 месяцев до Даты исполнения обязательств по второй части данной сделки РЕПО. По итогам расчета остаточных обязательств Клиринговый центр предоставляет Ненарушившей стороне Отчет о величине остаточных обязательств.

- 43.3. Урегулирование вопросов, связанных с неисполнением обязательств по второй части сделок РЕПО в случае досрочного погашения облигаций, составляющих предмет обязательств по сделке РЕПО.
- 43.3.1. В случае досрочного погашения облигаций, составляющих предмет обязательств по сделке РЕПО, и невозможности исполнения обязательств по сделке РЕПО в Клиринговой системе, в дату досрочного погашения обязательства по второй части сделки РЕПО прекращаются. На дату досрочного погашения Участники клиринга - контрагенты осуществляют расчет суммы остаточных обязательств путем определения разницы между стоимостью обратного выкупа по сделке РЕПО (с учетом уплаченных/полученных компенсационных взносов и выплат произведенных эмитентом в течение Срока РЕПО до даты досрочного погашения) и стоимостью ценных бумаг, определенной как сумма денежных средств, уплаченных эмитентом в счет досрочного погашения облигаций и иных выплат, произведенных эмитентом по облигациям в дату досрочного погашения. Участник клиринга вправе обратиться к Клиринговому центру за расчетом остаточных обязательств. Клиринговый центр вправе произвести расчет остаточных обязательств только в случае наличия у нее информации о величине выплат, произведенных эмитентом. По итогам расчета остаточных обязательств Клиринговый центр предоставляет Участнику клиринга Отчет о величине остаточных обязательств.
- 43.3.2. Сумма остаточных обязательств перечисляется соответствующим контрагентом по сделке РЕПО в течение 30 (тридцати) календарных дней с даты досрочного погашения.
- 43.4. Урегулирование вопросов, связанных с неисполнением обязательств по сделкам, обязательства по которым исполняются путем подачи Отчета на исполнение.
- 43.4.1. В случае неисполнения сделок, заключаемых на условиях отсроченного исполнения, по которым Правилами торгов на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов не предусмотрено заполнения реквизита заявки/сделки «Фиксированное возмещение», Участник клиринга, который не исполнил свои обязательства, обязан уплатить Участнику клиринга - контрагенту по сделке неустойку в размере двойной Ставки денежного рынка Московской Биржи RUSFAR, рассчитанной для 1 (одного) дня (overnight), действующей на день неисполнения указанных требований, начисленной на сумму обязательств по сделке за каждый день просрочки исполнения, если иное не установлено двусторонними соглашениями сторон.

- 43.5. Урегулирование вопросов, связанных с выплатой доходов по ценным бумагам и неисполнением обязательств по второй части сделок РЕПО в случае возникновения обстоятельств непреодолимой силы.
- 43.5.1. В случае возникновения обстоятельств непреодолимой силы (чрезвычайные и непредотвратимые обстоятельства, возникающие после наступления Даты исполнения обязательств по сделкам), влияющих на способность выполнения Участником клиринга требований, предусмотренных пунктами 43.1-43.2 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов и/или пунктами 21.1-21.2 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, Участник клиринга обязан проинформировать Участника клиринга - контрагента по сделке об их наступлении и прекращении в день их наступления и прекращения (в первый следующий рабочий день в случае их наступления и прекращения в нерабочий день) путем направления уведомления в письменной форме с приложением документов, подтверждающих наступление/прекращение таких обстоятельств, выданных компетентными государственными органами.
- 43.5.2. В качестве обстоятельств непреодолимой силы не могут рассматриваться аннулирование/приостановка лицензии профессионального участника рынка ценных бумаг, отзыв лицензии на осуществление банковских операций, назначение временной администрации или возбуждение процедуры банкротства.
- 43.5.3. Неисполнение требования, предусмотренного подпунктом 43.5.1 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, лишает Участника клиринга, нарушившего данное требование, права ссылаться на обстоятельства непреодолимой силы.
- 43.5.4. После прекращения действия обстоятельств непреодолимой силы Участники клиринга обязаны исполнить требования, предусмотренные пунктами 43.1-43.2 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов и/или пунктами 21.1-21.2 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.
- 43.5.5. В случае если обстоятельства непреодолимой силы действуют только в отношении одного из Участников клиринга и длятся более 10 (десяти) рабочих дней, другой Участник клиринга вправе отказаться от дальнейшего исполнения сделки/сделок РЕПО.
- 43.6. В Режимов торгов «РЕПО с Банком России: Аукцион РЕПО», «РЕПО с Банком России: фикс.ставка», «РЕПО с Банком России: плав.ставка (доп.механизм)» и «Аукцион РЕПО с Банком России: плавающая ставка» урегулирование предусмотренных настоящей статьей Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов взаимных требований по сделкам осуществляется в соответствии с Генеральным соглашением, заключенным между Банком России и Участником клиринга. В случае отсутствия в Генеральном соглашении порядка урегулирования определенных требований, урегулирование таких требований происходит в порядке, установленном настоящей статьей Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.

Статья 44. Порядок определения размера Фиксированного возмещения

- 44.1. При неисполнении Участником клиринга обязательств (по уплате денежных средств или по поставке ценных бумаг) по сделке с кодом расчетов В0-В30 данный Участник

- клиринга обязан уплатить Участнику клиринга - контрагенту по сделке Фиксированное возмещение. При этом Фиксированное возмещение рассчитывается как произведение ставки Фиксированного возмещения, указанной в адресной заявке, на объем данной сделки.
- 44.2. При неисполнении Участником клиринга обязательств (по уплате денежных средств или по поставке ценных бумаг) по первой или второй части сделки РЕПО или обязательства по возврату кредита по кредитному договору, заключенным без участия центрального контрагента, такой Участник клиринга обязан уплатить Участнику клиринга - контрагенту по сделке РЕПО / кредитному договору Фиксированное возмещение. При этом Фиксированное возмещение рассчитывается как произведение ставки Фиксированного возмещения, указанной контрагентами в адресных заявках, на основании которых была заключена данная сделка РЕПО / кредитный договор, на сумму РЕПО текущего торгового дня / сумму кредита.
- 44.3. Фиксированное возмещение по сделке, заключенной без участия центрального контрагента с расчетами в иностранной валюте, удерживается в российских рублях по курсу Банка России на Дату прекращения исполнения соответствующих сделок.
- 44.4. Участник клиринга имеет право отказаться от получения Фиксированного возмещения по сделке, заключенной без участия центрального контрагента, направив Клиринговому центру письменное уведомление до даты уплаты Фиксированного возмещения в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.
- 44.5. В случае если оба Участника клиринга - контрагента по сделке, заключенной без участия центрального контрагента, не исполнили свои обязательства по данной сделке, то они не имеют взаимных обязательств по уплате Фиксированного возмещения друг другу по данной сделке.

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

Статья 45. Порядок исполнения обязательств и требований Участников клиринга и Клирингового центра, включенных в клиринговый пул

45.1. Клиринговый центр осуществляет определение и учет обязательств и требований по денежным средствам по каждому Расчетному коду Участника клиринга (Клирингового центра) / Счету обеспечения Т0 в соответствии с условиями заключенных им сделок, обязательства по которым включены в соответствующий клиринговый пул.

Клиринговый центр осуществляет определение и учет обязательств и требований по ценным бумагам по каждому Торгово-клиринговому счету Участника клиринга (Клирингового центра) в отношении каждой ценной бумаги в отдельности в соответствии с условиями заключенных им сделок, обязательства по которым включены в соответствующий клиринговый пул.

45.2. Исполнение обязательств по сделкам, включенным в Клиринговый пул для расчетов в ходе торгов / Клиринговый пул для расчетов в ходе торгов по сделкам с центральным контрагентом, осуществляется сразу после их включения в соответствующий клиринговый пул.

45.2.1. По обязательствам, включенным в Клиринговый пул для расчетов в ходе торгов по сделкам с центральным контрагентом на основании Срочного отчета на исполнение, проводится неттинг, по итогам которого определяются нетто-обязательства / нетто-требования Участников клиринга и Клирингового центра по денежным средствам и по ценным бумагам, которые затем включаются в Клиринговый пул для расчетов в ходе торгов.

45.2.2. По обязательствам, включенным в Клиринговый пул для расчетов в ходе торгов, проводится неттинг, по итогам которого определяются Нетто-обязательства / нетто-требования Участников клиринга и Клирингового центра по денежным средствам и по ценным бумагам по сделкам клирингового пула в соответствии с подпунктами 33.4.1 и 33.4.2 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.

45.3. Исполнение обязательств по сделкам, включенным в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов и Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов по сделкам с центральным контрагентом, осуществляется в ходе расчетных клиринговых сессий, время проведение которых установлено Временным регламентом, являющимся приложением к общей части Правил клиринга, за исключением случая, установленного пунктом 45.11 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.

Для каждой расчетной клиринговой сессии формируется отдельный Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов и отдельный Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов по сделкам с центральным контрагентом.

Время формирования Клирингового пула для расчетов по итогам торгов и Клирингового пула для расчетов по итогам торгов по сделкам с центральным контрагентом соответствует времени начала соответствующей расчетной клиринговой сессии, если Временным регламентом на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов не установлено иное.

45.4. По обязательствам по сделкам с ценными бумагами с кодом расчетов T0 и обязательствам по первым частям сделок РЕПО с кодом расчетов T0/Yn, а также обязательствам по иным Сделкам T+, включенным в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов по сделкам с центральным контрагентом, проводится неттинг, по итогам которого определяются нетто-обязательства / нетто-требования Участников клиринга и Клирингового центра по денежным средствам и по ценным бумагам, которые затем включаются в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов.

45.5. По обязательствам, включенным в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов, проводится неттинг, по итогам которого определяются Нетто-обязательства / нетто-требования Участников клиринга и Клирингового центра по денежным средствам и по ценным бумагам по сделкам клирингового пула.

45.5.1. Нетто-обязательство (нетто-требование) Участника клиринга (Клирингового центра) по денежным средствам по сделкам клирингового пула по каждому Расчетному коду / Счету обеспечения T0 рассчитывается по формуле:

$POS_VAL = ST - SO$, где:

POS_VAL – Нетто-обязательство (Нетто-требование) Участника клиринга (Клирингового центра) по денежным средствам по сделкам клирингового пула;

ST – сумма требований, а SO – сумма обязательств Участника клиринга (Клирингового центра) по денежным средствам по включенным в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов:

- нетто-обязательствам / нетто-требованиям, определенным по итогам неттинга обязательств по сделкам, включенным в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов по сделкам с центральным контрагентом, в соответствии с пунктом 45.4 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов;
- нетто-обязательствам / нетто-требованиям, определенным по итогам неттинга обязательств по сделкам, включенным в Клиринговый пул для М-Депозитов, в соответствии с пунктом ПОДРАЗДЕЛ V-III.37.13 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов;
- первым частям сделок РЕПО с кодом расчетов Rb;
- сделкам купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов Bn, B0-B30;
- первым частям сделок РЕПО с кодом расчетов Sn;
- вторым частям сделок РЕПО с кодом расчетов Sn, Z0 и Rb;
- обязательствам / требованиям по возврату кредита по кредитному договору с кодом расчетов Sn и Rb;
- обязательствам / требованиям по выдаче кредита по кредитному договору с кодом расчетов Sn;
- обязательствам по внесению / требованиям по получению компенсационных взносов;
- обязательствам по уплате / требованиям по получению отступного за отказ от исполнения сделки РЕПО / сделки купли-продажи ценных бумаг;
- обязательствам по уплате / требованиям по получению отступного за отказ от заключения сделки;

- требованиям по зачислению денежных средств на Счет обеспечения T0 по распоряжениям на перевод денежных средств / запросам на изменение параметров Торгово-клирингового счета;
- обязательствам по списанию денежных средств со Счета обеспечения T0 по распоряжениям на перевод денежных средств / запросам на изменение параметров Торгово-клирингового счета.

Отрицательное значение POS_VAL означает наличие Нетто-обязательства Участника клиринга (Клирингового центра) по денежным средствам по сделкам клирингового пула, положительное значение POS_VAL – Нетто-требования Участника клиринга (Клирингового центра) по денежным средствам по сделкам клирингового пула.

45.5.2. Нетто-обязательство (Нетто-требование) Участника клиринга (Клирингового центра) по ценным бумагам по сделкам клирингового пула по каждому Торгово-клиринговому счету депо и в отношении каждой ценной бумаги рассчитывается по формуле:

$POS_C = STC - SOC$, где:

POS_C – Нетто-обязательство (Нетто-требование) Участника клиринга (Клирингового центра) по ценной бумаге по сделкам клирингового пула;

STC – сумма требований, а SOC – сумма обязательств Участника клиринга (Клирингового центра) по соответствующей ценной бумаге по включенным в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов:

- нетто-обязательствам / нетто-требованиям, определенным по итогам неттинга обязательств по сделкам, включенным в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов по сделкам с центральным контрагентом, в соответствии с пунктом 45.4 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов;
- первым частям сделок РЕПО с кодом расчетов Rb;
- сделкам купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов Bn, B0-B30;
- первым частям сделок РЕПО с кодом расчетов Sn;
- вторым частям сделок РЕПО с кодом расчетов Sn, Z0 и Rb;
- обязательствам по внесению / требованиям по получению компенсационных взносов;
- требованиям по зачислению ценных бумаг на Торгово-клиринговый счет T0 / Торгово-клиринговый счет T+ / Торгово-клиринговый счет имущественного пула по распоряжениям на перевод ценных бумаг в ближайшую расчетную клиринговую сессию / запросам на изменение параметров Торгово-клирингового счета;
- обязательствам по списанию ценных бумаг с Торгово-клирингового счета T+ / Торгово-клирингового счета имущественного пула Базового Участника клиринга;
- требованиям по зачислению ценных бумаг на Торгово-клиринговый счет T+ / Торгово-клиринговый счет имущественного пула Участника клиринга – реципиента;
- обязательствам по списанию ценных бумаг с Торгово-клирингового счета T0 / Торгово-клирингового счета T+ / Торгово-клирингового счета имущественного пула по распоряжениям на перевод ценных бумаг в

ближайшую расчетную клиринговую сессию / запросам на изменение параметров Торгово-клирингового счета;

- Итоговым нетто-обязательствам / Итоговым нетто-требованиям Участников клиринга по ценным бумагам, определенным в Едином клиринговом пуле в соответствии с общей частью Правил клиринга (только для Торгово-клиринговых счетов Т+ и Торгово-клиринговых счетов имущественного пула).

Отрицательное значение POS_C означает наличие Нетто-обязательства Участника клиринга (Клирингового центра) по ценной бумаге по сделкам клирингового пула, положительное значение POS_C – Нетто-требования Участника клиринга (Клирингового центра) по ценной бумаге по сделкам клирингового пула.

- 45.6. Нетто-обязательства (нетто-требования) Участников клиринга по ценным бумагам по сделкам клирингового пула, рассчитанные в соответствии с подпунктом 45.5.2 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, включаются в распоряжение на проведение операций по Разделам / субсчетам депо, направляемое Клиринговым центром Расчетному депозитарию в соответствии с пунктом 47.4 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.
- 45.7. Обязательства / требования по передаче ценных бумаг по сделкам купли-продажи с кодом расчетов Z0, X0 и первым частям сделок РЕПО с кодом расчетов Z0 или Нетто-обязательства (нетто-требования) Участников клиринга по ценным бумагам по сделкам клирингового пула, рассчитанные в соответствии с подпунктом 33.4.2 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов по обязательствам, включенным в Срочный отчет на исполнение, включаются в распоряжение на проведение операций по Разделам / субсчетам депо, направляемое Клиринговым центром Расчетному депозитарию в соответствии с пунктом 47.3 / 47.5 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.
- 45.8. Обязательства по оплате ценных бумаг по сделкам купли-продажи с кодом расчетов Z0, X0 и первым частям сделок РЕПО с кодом расчетов Z0, Нетто-обязательства Участников клиринга по денежным средствам по сделкам клирингового пула, рассчитанные в соответствии с подпунктом 33.4.1 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов по обязательствам, включенным в Срочный отчет на исполнение, или в соответствии с подпунктом 45.5.1 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов в отношении Счета обеспечения T0 или Расчетного кода, исполняются за счет денежных средств, учитываемых по тому же Счету обеспечения T0 / Расчетному коду.
- 45.8.1. Клиринговый центр зачитывает Обязательство по оплате ценных бумаг, Нетто-обязательство Участника клиринга по денежным средствам по сделкам клирингового пула (или его часть), определенное в отношении Счета обеспечения T0 / Расчетного кода, с требованием Участника клиринга по возврату денежных средств, учитываемых по тому же Счету обеспечения T0 / Расчетному коду.
- 45.9. Требование по оплате ценных бумаг по сделкам купли-продажи с кодом расчетов Z0, X0 и первым частям сделок РЕПО с кодом расчетов Z0 или Нетто-требование Участника клиринга по денежным средствам, рассчитанные в соответствии с подпунктом 33.4.1 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов по обязательствам, включенным в Срочный отчет на исполнение, или в соответствии с подпунктом 45.5.1 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке

депозитов и рынке кредитов в отношении Счета обеспечения T0 / Расчетного кода, прекращается возникновением обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга денежных средств, учитываемых по тому же Счету обеспечения T0 / Расчетному коду, в размере соответствующего требования / Нетто-требования Участника клиринга.

- 45.10. После исполнения (прекращения) Нетто-обязательств (нетто-требований) Участников клиринга по денежным средствам по сделкам клирингового пула в соответствии с пунктами 45.8 или 45.9 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов и направления в Расчетный депозитарий распоряжения на проведение операций по Разделам / субсчетам депо в соответствии с пунктом 47.3 или 47.4 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов обязательства Участников клиринга и Клирингового центра, включенные в соответствующий клиринговый пул, считаются прекращенными в соответствующем клиринговом пуле.

После получения от Расчетного депозитария отчета о проведении операций по Разделам / субсчетам депо в соответствии с пунктом 47.5 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов расчеты по ценным бумагам по итогам клиринга считаются завершенными.

- 45.11. В срок, установленный Временным регламентом на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, Клиринговый центр определяет подлежащие исполнению обязательства по Сделкам с центральным контрагентом с Датой исполнения в дату заключения, заключенным после 19:00 в рамках одного Торгово-клирингового счета:

45.11.1. включает в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов по сделкам с центральным контрагентом непрекращенные обязательства и требования Участника клиринга и Клирингового центра по Сделкам с центральным контрагентом с наступившей Датой исполнения;

45.11.2. прекращает однородные обязательства и требования Участника клиринга и Клирингового центра, включенные в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов по сделкам с центральным контрагентом, по каждому Торгово-клиринговому счету / Расчетному коду Участника клиринга;

45.11.3. формирует и направляет Участникам клиринга Выписки из реестра сделок, принятых в клиринг, содержащие информацию о Сделках с центральным контрагентом, обязательства по которым прекращены.

- 45.12. Участники клиринга вправе подавать Постоянные поручения на ограничение времени начала заключения сделок с Клиринговым центром в отношении Расчетных кодов, открытых для фондового рынка, рынка депозитов и рынка кредитов.

Порядок подачи и исполнения указанных поручений определен общей частью Правил клиринга.

- 45.13. Неисполненные обязательства и требования Участников клиринга по сделкам, за исключением Сделок T+, учитываются в Клиринговой системе и являются допущенными к клирингу вплоть до Даты прекращения исполнения таких сделок.

С Даты прекращения исполнения обязательства Участников клиринга по сделкам исключаются из числа обязательств, допущенных к клирингу, и не подлежат

исполнению в Клиринговой системе, неисполненные сделки исключаются из Клиринговой системы.

- 45.14. Исключение сделок из Клиринговой системы не влечет прекращение обязательств сторон по указанным сделкам. Требования о надлежащем исполнении таких сделок могут быть предъявлены любой из сторон в соответствии с гражданским законодательством при условии соблюдения порядка разрешения споров, предусмотренного общей частью Правил клиринга и Правилами торгов на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.

Обязательства и требования Участников клиринга по внесению компенсационных взносов учитываются в Клиринговой системе и являются допущенными к клирингу в Дату внесения компенсационных взносов. С даты, следующей за Датой внесения компенсационных взносов, обязательства Участников клиринга по компенсационным взносам не подлежат исполнению в Клиринговой системе.

ПОДРАЗДЕЛ V-VI. ОСОБЕННОСТИ ВЗАИМОДЕЙСТВИЯ С РАСЧЕТНОЙ ОРГАНИЗАЦИЕЙ И РАСЧЕТНЫМ ДЕПОЗИТАРИЕМ

Статья 46. Особенности взаимодействия с Расчетной организацией

- 46.1. Каждый Расчетный день до начала Торгов, Клиринговый центр направляет Расчетной организации запрос выписки по торговым банковским счетам, в ответ на который Расчетная организация передает Клиринговому центру выписку по торговым банковским счетам.
- 46.2. После получения от Расчетной организации выписки по торговым банковским счетам Клиринговый центр передает Расчетной организации распоряжение на перевод на клиринговый банковский счет Клирингового центра, открытый в Расчетной организации и предназначенный для учета индивидуального клирингового обеспечения, денежных средств с торговых банковских счетов в суммах, указанных в полученной от Расчетной организации выписки по торговым банковским счетам.
- После получения от Расчетной организации отчета об исполнении указанного распоряжения Клиринговый центр учитывает переведенные денежные средства на Счетах обеспечения T0, открытых к соответствующим торговым банковским счетам.
- 46.3. При увеличении в ходе торгов суммы денежных средств, учитываемых на торговом банковском счете, Расчетная организация передает Клиринговому центру информацию о таком увеличении, а Клиринговый центр учитывает это увеличение по Счету обеспечения T0 и передает Расчетной организации распоряжение на перевод на клиринговый банковский счет Клирингового центра денежных средств с торгового банковского счета в сумме указанного увеличения.
- 46.4. В случае необходимости в ходе Торгов списания денежных средств с торгового банковского счета, Расчетная организация направляет Клиринговому центру запрос согласия Клирингового центра на списание денежных средств с торговых банковских счетов.
- Клиринговый центр дает согласие на списание денежных средств с торгового банковского счета при условии, что сумма списания не превышает суммы денежных средств, учитываемой по соответствующему Счету обеспечения T0, за вычетом соответствующего Ограничительного лимита, и направляет Расчетной организации распоряжение на перевод денежных средств с клирингового банковского счета на торговый банковский счет на сумму списания.
- 46.5. После окончания торгов Клиринговый центр направляет Расчетной организации распоряжение на проведение операций по торговым банковским счетам, содержащее распоряжения на перевод денежных средств с клирингового банковского счета на торговые банковские счета в суммах денежных средств, учитываемых по Счетам обеспечения T0 после прекращения обязательств, включенных в последний в течение Расчетного дня Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов, увеличенных на сумму обязательств / нетто-обязательств по денежным средствам в отчетах на исполнение, не обеспеченных средствами под исполнение на момент формирования последнего в течение Расчетного дня Клирингового пула для расчетов по итогам торгов.

- 46.6. После исполнения Расчетной организацией распоряжения на проведение операций по торговым банковским счетам, направленного Клиринговым центром в соответствии с пунктом 46.5 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, Клиринговый центр направляет Расчетной организации уведомление о согласии на проведение операций по торговым банковским счетам.

Направление Расчетной организации указанного уведомления означает согласие Клирингового центра на проведение любых операций по торговым банковским счетам до момента получения Расчетной организацией от Клирингового центра запроса выписки по торговым банковским счетам, за исключением торговых банковских счетов, в отношении которых Клиринговым центром от Расчетной организации получена информация об обращении взыскания или наложении ареста на имущество Участника клиринга, находящееся на торговом банковском счете.

Порядок действий Клирингового центра, включая порядок взаимодействия с Расчетной организацией при обращении взыскания или наложении ареста на имущество Участника клиринга, находящееся на торговом банковском счете, определен общей частью Правил клиринга.

- 46.7. При получении от Расчетной организации уведомления о приостановлении или прекращении участия Участника клиринга / клиента Участника клиринга в платежной системе Расчетной организации Клиринговый центр прекращает проведение операций по торговым банковским счетам такого Участника клиринга / клиента Участника клиринга с Расчетного дня, следующего за днем получения от Расчетной организации указанного уведомления.

Статья 47. Особенности взаимодействия с Расчетным депозитарием

- 47.1. Учет ценных бумаг, внесенных Участником клиринга в имущественный пул, осуществляется на соответствующих субсчетах депо имущественного пула.
- 47.1.1. Списание / зачисление ценных бумаг с субсчетов / на субсчета депо имущественного пула осуществляется на основании распоряжений Клирингового центра.
- 47.1.2. Доходы и иные выплаты по ценным бумагам, учитываемым на субсчетах депо имущественного пула, перечисляются на соответствующий клиринговый счет Клирингового центра, предназначенный для внесения имущества в имущественный пул, в порядке, предусмотренном договором Клирингового центра с Расчетным депозитарием, в случае если это предусмотрено внутренними документами Расчетного депозитария.

Доходы и иные выплаты по ценным бумагам в имущественном пуле, зачисленные на соответствующий клиринговый счет Клирингового центра, предназначенный для внесения имущества в имущественный пул, в соответствии с настоящим подпунктом Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, учитываются как имущество, внесенное Участником клиринга в имущественный пул.

- 47.2. Клиринговый центр дает согласие на списание клиринговых сертификатов участия с Раздела Т+ при условии, что количество ценных бумаг, подлежащих списанию, не превышает количества ценных бумаг, учитываемого по Торгово-клиринговому счету Т+, и в результате такого списания Единый лимит по Расчетному коду, к которому относится указанный Раздел Т+, не станет отрицательным. При этом

согласие на списание клиринговых сертификатов участия в количестве превышения количества ценных бумаг, учитываемого по Торгово-клиринговому счету Т+, над количества ценных бумаг, учитываемых на Разделе Т+, входящем в состав такого Торгово-клирингового счета Т+, по информации, полученной от Расчетного депозитария, включает поручение Расчетному депозитарию на выдачу клиринговых сертификатов участия в количестве, равном такому превышению.

При согласии Клирингового центра на списание клиринговых сертификатов участия номинальная стоимость клиринговых сертификатов участия, подлежащих выдаче после исполнения (прекращения) обязательств, включенных в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов, уменьшается на количество клиринговых сертификатов участия, указанное в поручении на выдачу клиринговых сертификатов участия, направленном Расчетному депозитарию в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.

- 47.3. Проведение расчетов по ценным бумагам в ходе торгов осуществляется Расчетным депозитарием на основании полученного от Клирингового центра распоряжения на проведение операций по Разделам / субсчетам депо, содержащего обязательства и требования Участника клиринга по передаче ценных бумаг по сделкам с кодом расчетов Z0 / X0, включенные в Клиринговый пул для расчетов в ходе торгов, и обязательства по списанию / зачислению ценных бумаг по распоряжениям на немедленный перевод ценных бумаг.
- 47.3.1. Распоряжение на проведение операций по Разделам / субсчетам депо, содержащее обязательства и требования Участника клиринга по передаче размещаемых ценных бумаг по сделкам размещения с кодом расчетов X0, направляется Клиринговым центром Расчетному депозитарию сразу после получения от Расчетного депозитария информации о зачислении всех размещаемых ценных бумаг на счет Расчетного депозитария в реестре.
- 47.4. Проведение расчетов по ценным бумагам по итогам торгов осуществляется Расчетным депозитарием на основании полученного от Клирингового центра распоряжения на проведение операций по Разделам / субсчетам депо, содержащего:
- поручение на выдачу клиринговых сертификатов участия в количестве, соответствующем номинальной стоимости клиринговых сертификатов участия, подлежащих выдаче после исполнения (прекращения) обязательств, включенных в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов;
 - Нетто-обязательства и Нетто-требования Участника клиринга и Клирингового центра по ценным бумагам по сделкам клирингового пула, определенные на основании обязательств, включенных в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов;
 - поручение на погашение клиринговых сертификатов участия в количестве, соответствующем номинальной стоимости клиринговых сертификатов участия, подлежащих погашению после исполнения (прекращения) обязательств, включенных в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов.
- 47.4.1. Распоряжения на проведение операций по Разделам / субсчетам депо, содержащие Нетто-обязательства и Нетто-требования Участника клиринга и Клирингового центра по ценным бумагам по сделкам клирингового пула (за исключением клиринговых сертификатов участия) исполняются Расчетным депозитарием в

корреспонденции с субсчетом депо Клирингового центра, открытым в рамках клирингового счета депо Клирингового центра, предназначенного для исполнения операций по ценным бумагам по Разделам / субсчетам депо по итогам клиринга.

47.4.2. Распоряжения на проведение операций по Разделам / субсчетам депо, содержащие Нетто-обязательства и Нетто-требования Участника клиринга и Клирингового центра по клиринговым сертификатам участия исполняются Расчетным депозитарием в корреспонденции с торговым разделом казначейского счета депо Клирингового центра.

47.4.3. Поручения на выдачу / погашение клиринговых сертификатов участия исполняются Расчетным депозитарием в корреспонденции с основным разделом счета места хранения.

47.5. Проведение расчетов по ценным бумагам в ходе торгов осуществляется Расчетным депозитарием на основании полученного от Клирингового центра распоряжения на проведение операций по Разделам / субсчетам депо, содержащего Нетто-обязательства и Нетто-требования Участника клиринга и Клирингового центра по ценным бумагам по сделкам клирингового пула, определенные на основании обязательств, включенных в Клиринговый пул для расчетов в ходе торгов.

Указанного распоряжение исполняется Расчетным депозитарием в корреспонденции с субсчетом депо Клирингового центра, открытым в рамках клирингового счета депо Клирингового центра, предназначенного для исполнения операций по ценным бумагам по Разделам / субсчетам депо по итогам клиринга.

47.6. После исполнения распоряжения на проведение операций по Разделам / субсчетам депо, полученного от Клирингового центра, Расчетный депозитарий направляет Клиринговому центру отчет о проведении операций по Разделам / субсчетам депо.

После получения отчета о проведении операций по Разделам / субсчетам депо по итогам торгов Клиринговый центр устанавливает равной нулю номинальную стоимость клиринговых сертификатов участия, подлежащих выдаче в соответствии с распоряжением на проведение операций по Разделам / субсчетам депо, указанным в настоящей статье Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, и номинальную стоимость клиринговых сертификатов участия, подлежащих погашению в соответствии с распоряжением на проведение операций по Разделам / субсчетам депо, указанным в настоящей статье Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.

47.7. Порядок действий Клирингового центра, включая порядок взаимодействия с Расчетным депозитарием при обращении взыскания или наложении ареста на имущество Участника клиринга, находящееся на торговом счете депо, определен общей частью Правил клиринга.

ПОДРАЗДЕЛ V-VII. ПОРЯДОК ПЕРЕДАЧИ ДОХОДА

Статья 48. Порядок передачи Доходов по сделкам РЕПО и сделкам купли-продажи ценных бумаг, заключенным с Клиринговым центром

48.1. Обязательства по передаче Дохода возникают:

- по сделке РЕПО, заключенной с Клиринговым центром (за исключением Сделки РЕПО с открытой датой), в том числе Сделке РЕПО Клирингового центра, с ценными бумагами, по которым принято решение о выплате дохода, и список лиц, имеющих право на его получение, определяется в период с даты исполнения обязательств по передаче ценных бумаг по первой части сделки РЕПО (включая эту дату) и до даты исполнения обязательств по передаче ценных бумаг по второй части сделки РЕПО (не включая эту дату);
- по Сделке РЕПО с открытой датой, заключенной с Клиринговым центром, с ценными бумагами, по которым принято решение о выплате дохода, и дата определения списка лиц, имеющих право на его получение, является первой из дат определения списка лиц, имеющих право на получение дохода по ценной бумаге, которые предусмотрены решением о выпуске соответствующей ценной бумаги, за период с даты исполнения обязательств по передаче ценных бумаг по первой части Сделки РЕПО с открытой датой (включая эту дату) по максимально возможную дату исполнения второй части Сделки РЕПО с открытой датой в соответствии с пунктом 21.6 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов (в случае если решением о выпуске соответствующей ценной бумаги предусмотрено на период с даты исполнения обязательств по передаче ценных бумаг по первой части сделки РЕПО (включая эту дату) по максимально возможную дату исполнения второй части Сделки РЕПО с открытой датой в соответствии с пунктом 21.6 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов несколько корпоративных событий по определению списка лиц, имеющих право на получение дохода по ценной бумаге). После осуществления корпоративного события по определению списка лиц, имеющих право на получение дохода по ценным бумагам, указанным в настоящем абзаце, обязательство по передаче дохода также возникает в отношении дохода, дата определение списка лиц, имеющих право на получение которого установлена решением о выпуске ценных бумаг в качестве даты, являющейся следующей датой определения списка лиц, имеющих право на получение дохода по соответствующим ценным бумагам, по отношению к уже совершившемуся корпоративному событию по определению списка лиц, имеющих право на получение дохода по ценным бумагам;
- по заключенной Клиринговым центром с Недобросовестным или Добросовестным участником клиринга в соответствии с общей частью Правил клиринга второй сделке купли-продажи ценных бумаг, по которым принято решение о выплате дохода, и список лиц, имеющих право на его получение, определяется в период с даты исполнения обязательств по передаче ценных бумаг по первой сделке купли-продажи ценных бумаг (включая эту дату) и до даты исполнения обязательств по передаче ценных бумаг по второй сделке купли-продажи ценных бумаг (не включая эту дату);
- по сделке купли-продажи облигаций с кодом расчетов Yn, Nn, по которым принято решение о выплате дохода, и Дата исполнения обязательств по

которой приходится на период с даты определения списка лиц, имеющих право на получение дохода, до даты окончания купонного периода и/или амортизации (по тому же купонному периоду), включая эту дату в случае, если дата окончания купона не совпадает с датой начала следующего купонного периода, либо не включая эту дату в случае, если дата окончания купона совпадает с датой начала следующего купонного периода (для облигаций, входящих в список, определенный решением Биржи).

Для целей определения обязательства по передаче Дохода в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, датой определения списка лиц, имеющих право на получение дохода, является дата, определенная в соответствии с решением о выпуске соответствующей ценной бумаги.

В случае если Расчетный депозитарий опубликовал информацию об изменении даты определения списка лиц, имеющих право на получение дохода, для целей определения обязательства по передаче Дохода в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов применяется дата, опубликованная Расчетным депозитарием.

При этом если Расчетный депозитарий опубликовал информацию об изменении даты определения списка лиц, имеющих право на получение дохода по сделкам купли-продажи ценных бумаг, указанных в настоящем пункте Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, в дату определения указанного списка лиц, приведенную в информации, опубликованной Расчетным депозитарием, или позднее указанной даты, то передача Дохода не осуществляется, обязательства и требования по передаче Дохода прекращаются не позднее Расчетного дня, следующего за датой опубликования Расчетным депозитарием такой информации.

Информация о предстоящем погашении облигаций не является основанием для возникновения обязательства по передаче Дохода, связанного с выплатой номинальной стоимости облигаций по сделкам купли-продажи облигаций, заключенным с участием центрального контрагента. В указанном случае обязательства / требования по передаче Дохода не возникают.

- 48.2. По сделке с акциями российских организаций размер обязательства по передаче / требования по получению Дохода в форме денежных средств рассчитывается по формуле:

| | |
|---|---|
| $Inc = ROUND((N \times d - ROUND((N \times d \times T \times \max((D1 - D2); 0) / D1); 0)); 2)$, где | |
| Inc | размер обязательства по передаче / требования по получению Дохода по сделке (в валюте выплаты дивидендов, согласно полученной от Расчетного депозитария информации); |
| N | размер обязательства / требования Участника клиринга по ценным бумагам по сделке, указанной в пункте 48.1 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов (в штуках); |
| d | сумма начисления на одну акцию, установленная эмитентом ценных бумаг (в валюте выплаты дивидендов, согласно полученной от Расчетного депозитария информации); |
| T | ставка, равная налоговой ставке, установленной в отношении доходов от долевого участия в деятельности организаций, полученных в виде дивидендов юридическими лицами, |

| | |
|----|---|
| | являющимися налоговыми резидентами Российской Федерации, и предусмотренной подпунктом 2 пункта 3 статьи 284 Налогового кодекса Российской Федерации; |
| D1 | общая сумма дивидендов, подлежащая распределению российской организацией (эмитентом) в пользу всех получателей; |
| D2 | общая сумма дивидендов, полученных российской организацией (эмитентом) в текущем отчетном (налоговом) периоде и предыдущих отчетных (налоговых) периодах (за исключением дивидендов, указанных в подпункте 1 пункта 3 статьи 284 Налогового кодекса Российской Федерации) к моменту распределения дивидендов в пользу налогоплательщиков - получателей дивидендов, при условии, что указанные суммы дивидендов ранее не учитывались при определении налоговой базы, определяемой в отношении доходов, полученных российской организацией (эмитентом) в виде дивидендов. |

- 48.3. По сделке с акциями иностранных организаций и ценными бумагами иностранных биржевых инвестиционных фондов, а также по сделке с инвестиционными паями размер обязательства по передаче / требования по получению Дохода в форме денежных средств рассчитывается по формуле:

| | |
|-----------------------------|---|
| Inc = ROUND(N × d); 2), где | |
| Inc | размер обязательства по передаче / требования по получению Дохода по сделке (в валюте выплаты дивидендов, согласно полученной от Расчетного депозитария информации); |
| N | размер обязательства / требования Участника клиринга по ценным бумагам по сделке, указанной в пункте 48.1 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов (в штуках); |
| d | сумма начисления на одну акцию, установленная эмитентом ценных бумаг / сумма дохода на один инвестиционный пай, установленный управляющей компанией, осуществляющей доверительное управление имуществом, составляющим такой паевой инвестиционный фонд (в валюте выплаты дивидендов, согласно полученной от Расчетного депозитария информации); |

- 48.4. В случае выплаты дохода ценными бумагами, размер обязательства по передаче / требования по получению Дохода в форме ценных бумаг по сделке рассчитывается по формуле:

| | |
|------------------|---|
| Inc = N × d, где | |
| Inc | размер обязательства по передаче / требования по получению Дохода по сделке (в штуках); |
| N | размер обязательства / требования Участника клиринга по ценным бумагам по сделке, указанной в пункте 48.1 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов (в штуках); |
| d | количество ценных бумаг, передаваемых эмитентом на одну акцию, установленное эмитентом ценных бумаг (в штуках). |

- 48.5. По сделке с облигациями российских эмитентов размер обязательства по передаче / требования по получению Дохода в форме денежных средств рассчитывается по формуле:

| | |
|--------------------------|---|
| $Inc = N \times d$, где | |
| Inc | размер обязательства по передаче / требования по получению Дохода по сделке (в валюте выплаты купона, согласно полученной от Расчетного депозитария информации / в валюте номинальной стоимости облигации); |
| N | размер обязательства / требования Участника клиринга по ценным бумагам по сделке, указанной в пункте 48.1 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов (в штуках); |
| d | размер начисленного купона на одну облигацию, установленный эмитентом ценных бумаг (в валюте выплаты купона согласно полученной от Расчетного депозитария информации) / сумма номинальной стоимости облигации либо ее часть, выплачиваемая эмитентом при погашении, включая сумму премии за досрочное погашение, в случае ее выплаты эмитентом (досрочном, частичном или окончательном) (в валюте номинальной стоимости облигации). |

- 48.6. По сделке с облигациями, за исключением облигаций, указанных в пункте 48.5 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, размер обязательства по передаче / требования по получению Дохода в форме денежных средств рассчитывается по формуле:

| | |
|--|---|
| $Inc = ROUND ((N \times d - ROUND (N \times d \times T; 0)); 2)$, где | |
| Inc | размер обязательства по передаче / требования по получению Дохода по сделке (в валюте выплаты купона, согласно полученной от Расчетного депозитария информации / в валюте номинальной стоимости облигации); |
| N | размер обязательства / требования Участника клиринга по ценным бумагам по сделке, указанной в пункте 48.1 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов (в штуках); |
| d | размер начисленного купона на одну облигацию, установленный эмитентом ценных бумаг (в валюте выплаты купона, согласно полученной от Расчетного депозитария информации) / сумма номинальной стоимости облигации либо ее часть, выплачиваемая эмитентом при погашении (досрочном, частичном или окончательном), включая сумму премии за досрочное погашение, в случае ее выплаты эмитентом (в валюте номинальной стоимости облигации); |
| T | ставка, равная максимальной налоговой ставке у источника, установленной в отношении дохода в виде НКД по ценным бумагам в соответствии с налоговым законодательством страны, резидентом которой является эмитент ценной бумаги согласно полученной от Расчетного депозитария информации. В случае, если d - сумма номинальной стоимости облигации либо ее часть, выплачиваемая эмитентом при погашении (досрочном, частичном или окончательном), включая сумму премии за досрочное погашение, $T = 0$. |

- 48.7. По сделке с депозитарными расписками, базовой ценной бумагой по которым являются ценные бумаги иностранных эмитентов, размер обязательства по передаче / требования по получению Дохода в форме денежных средств рассчитывается по формуле:

| | |
|--|--|
| $Inc = ROUND(N \times (d - f \times Rate); 2)$, где | |
| Inc | размер обязательства по передаче / требования по получению Дохода по сделке (в валюте выплаты дохода, согласно полученной от Расчетного депозитария информации); |
| N | размер обязательства / требования Участника клиринга по ценным бумагам по сделке, указанной в пункте 48.1 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов (в штуках); |
| d | сумма начисления на одну ценную бумагу, установленная эмитентом ценных бумаг (в валюте выплаты дохода, согласно полученной от Расчетного депозитария информации); |
| f | размер комиссионного вознаграждения и/или других удержаний эмитента ценных бумаг, уменьшающий сумму начисления на одну ценную бумагу, установленную эмитентом ценных бумаг (в валюте, в которой взимается комиссионное вознаграждение / иное удержание); |
| Rate | Кросс-курс, применяемый для пересчета выраженных в иной валюте, отличной от валюты выплаты дохода, комиссионного вознаграждения и/или других удержаний эмитента ценных бумаг, в валюту выплаты дохода, который определяется как отношение курса валюты, в которой взимается комиссионное вознаграждение / иное удержание, к российскому рублю, установленного Банком России на дату передачи Дохода, к курсу валюты выплаты дохода к российскому рублю, установленному Банком России на дату передачи Дохода. В случае, если валюта, в которой взимается комиссионное вознаграждение / иное удержание, и валюта выплаты дохода совпадают, Rate равняется 1; в случае, если валютой, в которой взимается комиссионное вознаграждение / иное удержание, является российский рубль, то Rate определяется как отношение курса российского рубля к валюте выплаты дохода; в случае, если валютой выплаты дохода является российский рубль, то Rate определяется как курс валюты, в которой взимается комиссионное вознаграждение / иное удержание, к российскому рублю. |

- 48.8. По сделке с ценными бумагами, за исключением ценных бумаг, указанных в пунктах 48.2-48.3, 48.5-48.7 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, размер обязательства по передаче / требования по получению Дохода в форме денежных средств рассчитывается по формуле:

| | |
|---|---|
| $Inc = ROUND((N \times d - ROUND(N \times d \times T; 0) - N \times f); 2)$, где | |
| Inc | размер обязательства по передаче / требования по получению Дохода по сделке (в валюте выплаты дохода согласно полученной от Расчетного депозитария информации); |
| N | размер обязательства / требования Участника клиринга по ценным бумагам по сделке, указанной в пункте 48.1 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов |

| | |
|------|--|
| | (в штуках); |
| d | сумма начисления на одну ценную бумагу, установленная эмитентом ценных бумаг (в валюте выплаты дохода согласно полученной от Расчетного депозитария информации); |
| f | размер комиссионного вознаграждения и/или других удержаний эмитента ценных бумаг, уменьшающий сумму начисления на одну ценную бумагу, установленную эмитентом ценных бумаг (в валюте, в которой взимается комиссионное вознаграждение / иное удержание); |
| T | ставка, равная налоговой ставке у источника, установленной в отношении дохода согласно полученной от Расчетного депозитария информации; |
| Rate | кросс-курс, применяемый для пересчета выраженных в иной валюте, отличной от валюты выплаты дохода, комиссионного вознаграждения и/или других удержаний эмитента ценных бумаг, в валюту выплаты дохода, который определяется как отношение курса валюты, в которой взимается комиссионное вознаграждение / иное удержание, к российскому рублю, установленного Банком России на дату передачи Дохода, к валюте выплаты дохода к российскому рублю, установленному Банком России на дату передачи Дохода. В случае, если валюта, в которой взимается комиссионное вознаграждение / иное удержание, и валюта выплаты дохода совпадают, Rate равняется 1; в случае, если валютой, в которой взимается комиссионное вознаграждение / иное удержание, является российский рубль, то Rate определяется как отношение курса российского рубля к валюте выплаты дохода; в случае, если валютой выплаты дохода является российский рубль, то Rate определяется как курс валюты, в которой взимается комиссионное вознаграждение / иное удержание, к российскому рублю. |

- 48.9. Размер обязательств по передаче Дохода, определяемых в соответствии с пунктами 48.2-48.8 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, не уменьшается на сумму расходов, понесенных Участником клиринга и связанных с владением ценными бумагами, являющимися объектом сделок, указанных в пункте 48.1 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, иное не установлено пунктами 48.2-48.8 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.
- 48.10. Участник клиринга обязан по требованию Клирингового центра возместить Клиринговому центру расходы по оплате комиссий, предусмотренных тарифами Расчетного депозитария, и\ или сумм возмещения расходов Расчетного депозитария на исполнение им своих договорных обязательств, уплаченных Клиринговым центром в связи с обслуживанием субсчета депо и/или в связи с ценными бумагами, которые учитываются на таком субсчете депо, открытом в Расчетном депозитарии для Участника клиринга или клиента Участника клиринга.
- 48.11. Датой исполнения обязательств по передаче / требований по получению Дохода, определенных в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, является:

- Расчетный день, следующий за датой выплаты / передачи Расчетным депозитарием дохода, по информации, полученной от Расчетного депозитария, но не ранее следующего Расчетного дня после дня, в который соответствующая информация получена от Расчетного депозитария, в случае если доход выплачивается / передается через Расчетный депозитарий, или
 - Расчетный день, следующий за датой раскрытия эмитентом ценных бумаг информации о факте исполнения (полностью или частично) своих обязательств по выплате / передаче дохода, в случае если доход не выплачивается / не передается через Расчетный депозитарий.
- 48.12. Отчет об обязательствах по передаче / требованиям по получению Дохода, содержащий информацию об указанных обязательствах по каждой сделке, формируется Клиринговым центром и направляется Участникам клиринга каждый Расчетный день с даты возникновения обязательств по передаче / требований по получению Дохода до даты исполнения / даты прекращения указанных обязательств и требований, включая эти даты. В Отчет об обязательствах по передаче / требованиях по передаче Дохода включается информация обо всех сделках, в связи с заключением которых возникли обязательства по передаче / требования по получению Дохода.
- 48.13. В Дату исполнения обязательств по передаче / требований по получению Дохода, определенных в соответствии с пунктами 48.2-48.7 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, Клиринговый центр зачитывает встречные однородные обязательства по передаче и требования по получению Дохода по сделке, определенные в отношении одного Торгово-клирингового счета Т+ Участника клиринга.
- Обязательства по передаче / требования по получению Дохода, определенные после проведения зачета в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, учитываются в Клиринговой системе и являются обязательствами, подлежащими исполнению.
- 48.14. Клиринговый центр передает Доход Участнику клиринга, имеющему требование по получению Дохода в отношении одного или нескольких своих Торгово-клиринговых счетов Т+, в случае, если данный Участник клиринга не имеет не исполненных в установленный срок (просроченных) обязательств по передаче Дохода перед Клиринговым центром в отношении другого (других) своих Торгово-клиринговых счетов Т+.
- 48.15. Обязательства по передаче / требования по получению Дохода включаются в Единый клиринговый пул в порядке, установленном общей частью Правил клиринга.
- 48.16. Информация об исполненных обязательствах по передаче Дохода включается в Отчет о движении денежных средств.
- 48.17. Если по информации от Расчетного депозитария выплата доходов, по которой у Клирингового центра / Участника клиринга возникли обязательства и требования по передаче Дохода, по не зависящим от Клирингового центра / Участника клиринга причин произведена не будет, то передача Дохода не осуществляется, обязательства и требования по передаче Дохода прекращаются в связи с невозможностью

исполнения не позднее Расчетного дня, следующего за датой получения от Расчетного депозитария такой информации.

Статья 49. Порядок передачи Доходов по сделкам РЕПО, заключенным с Банком России без участия центрального контрагента в отдельных Режимов торгов

49.1. Обязательства по передаче Дохода возникают:

- по сделке РЕПО с Банком России, заключенной без участия центрального контрагента в Режимов торгов «РЕПО с Банком России: Аукцион РЕПО», «РЕПО с Банком России: фикс.ставка», «РЕПО с Банком России: плав.ставка (доп.механизм)» или «Аукцион РЕПО с Банком России: плавающая ставка», с ценными бумагами, по которым принято решение о выплате дохода, и список лиц, имеющих право на его получение, определяется в период с даты исполнения обязательств по передаче ценных бумаг по первой части сделки РЕПО (включая эту дату) и до даты исполнения обязательств по передаче ценных бумаг по второй части сделки РЕПО (не включая эту дату).

Для целей определения обязательства по передаче Дохода в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, датой определения списка лиц, имеющих право на получение дохода, является дата, определенная в соответствии с решением о выпуске соответствующей ценной бумаги.

В случае если Расчетный депозитарий опубликовал информацию об изменении даты определения списка лиц, имеющих право на получение дохода, для целей определения обязательства по передаче Дохода в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов применяется дата, опубликованная Расчетным депозитарием.

49.2. По сделке с акциями размер обязательства по передаче / требования по получению Дохода в форме денежных средств рассчитывается по формуле:

| | |
|---------------------------------------|---|
| $Inc = ROUND((N \times d);2)+k$, где | |
| Inc | размер обязательства по передаче / требования по получению Дохода по сделке (в валюте выплаты дивидендов, согласно полученной от Расчетного депозитария информации); |
| N | размер обязательства / требования Участника клиринга по ценным бумагам по сделке, указанной в пункте 49.1 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов (в штуках); |
| d | сумма начисления на одну акцию, установленная эмитентом ценных бумаг (в валюте выплаты дивидендов, согласно полученной от Расчетного депозитария информации); |
| k | сумма корректировки размера обязательства по передаче / требования по получению Дохода по сделке, определяемая в соответствии с внутренним документом Клирингового центра, которая может возникнуть в связи с округлением передаваемого Дохода по каждой сделке РЕПО. |

49.3. По сделке с облигациями размер обязательства по передаче / требования по получению Дохода в форме денежных средств рассчитывается по формуле:

| | |
|---------------------------------------|--|
| $Inc = ROUND((N \times d);2)+k$, где | |
| Inc | размер обязательства по передаче / требования по получению Дохода по сделке (в валюте выплаты купона, согласно полученной от Расчетного депозитария информации / в валюте номинальной стоимости облигации); |
| N | размер обязательства / требования Участника клиринга по ценным бумагам по сделке, указанной в пункте 49.1 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов (в штуках); |
| d | размер начисленного купона на одну облигацию, установленный эмитентом ценных бумаг (в валюте выплаты купона согласно полученной от Расчетного депозитария информации) / сумма части номинальной стоимости облигации, выплачиваемая эмитентом при погашении, включая сумму премии за досрочное погашение, в случае ее выплаты эмитентом (в валюте номинальной стоимости облигации); |
| k | сумма корректировки размера обязательства по передаче / требования по получению Дохода по сделке, определяемая в соответствии с внутренним документом Клирингового центра, которая может возникнуть в связи с округлением Дохода по каждой сделке РЕПО. |

- 49.4. Размер обязательств по передаче Дохода, определяемых в соответствии с пунктами 49.2-49.3 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, не уменьшается на сумму расходов, понесенных Участником клиринга и связанных с владением ценными бумагами, являющимися объектом сделок, указанных в пункте 49.1 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.
- 49.5. Датой исполнения обязательств по передаче / требований по получению Дохода, определенных в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, является:
- 49.6. Расчетный день, в который Расчетным депозитарием осуществляется выплата/передача дохода, по информации, полученной от Расчетного депозитария, но не ранее Расчетного дня, в который соответствующая информация получена от Расчетного депозитария. Обязательства по передаче Дохода исполняются в срок, установленный Временным регламентом на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.
- 49.7. Отчет об обязательствах по передаче / требованиях по получению Дохода, содержащий информацию об указанных обязательствах по каждой сделке, формируется Клиринговым центром и направляется Участникам клиринга в Дату исполнения указанных обязательств и требований.
- 49.8. В Дату исполнения обязательств по передаче / требований по получению Дохода, определенных в соответствии с пунктами 49.2-49.3 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, Клиринговый центр зачитывает встречные однородные обязательства по передаче и требования по получению Дохода по сделке, определенные в отношении одного Торгово-клирингового счета Участника клиринга.

Обязательства по передаче / требования по получению Дохода, определенные после проведения зачета в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, учитываются в Клиринговой системе и являются обязательствами, подлежащими исполнению.

- 49.9. Передача Дохода, определенного в соответствии с пунктами 49.2-49.3 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, не осуществляется в следующих случаях:
- выплата/передача дохода осуществлена по корпоративному действию, не входящему в перечень тех, по которым осуществляется передача Дохода согласно информации, полученной от Банка России;
 - в соответствии с полученной от Банка России информацией такая передача Дохода соответствующему Участнику клиринга запрещена;
 - на дату передачи Дохода допуск к клиринговому обслуживанию Участника клиринга прекращен или приостановлен;
 - у Участника клиринга имеются сделки РЕПО, указанные в пункте 49.1 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, дата исполнения второй части которых была изменена, и есть хотя бы одна сделка РЕПО, указанная в пункте 48.1 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, с датой исполнения второй части, приходящейся на текущий Расчетный день, по которой обязательства Участника клиринга не исполнены (прекращены).
- 49.10. Передача Дохода осуществляется при наличии на момент исполнения обязательства по передаче Дохода, определенного Временным регламентом на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, исполненных Отчетов на исполнение по всем сделкам РЕПО, по которым дата исполнения второй части приходится на дату передачи Дохода (если у Участника клиринга учитываются неисполненные обязательства по второй части сделки (сделок) РЕПО/неисполненные обязательства по уплате компенсационного(-ых) взноса(-ов), дата исполнения которых наступила по состоянию на день, предшествующий дате, в которую Доход подлежит передаче).
- 49.11. В случае если в соответствии с пунктами 49.1, 49.9-49.10 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов передача Дохода Участнику клиринга не была осуществлена, исполнение (прекращение) обязательств по передаче / требований по получению Дохода осуществляются Участниками клиринга и Банком России самостоятельно в соответствии с Генеральным соглашением, заключенным между Банком России и Участником клиринга.
- 49.12. Обязательства по передаче / требования по получению Дохода включаются в соответствующий клиринговый пул в порядке, установленном общей частью Правил клиринга.
- 49.13. Информация об исполненных обязательствах по передаче Дохода включается в Отчет о движении денежных средств.

РАЗДЕЛ VI. ПОРЯДОК ОПЛАТЫ УСЛУГ. ОТЧЕТЫ ПО ИТОГАМ КЛИРИНГА

Статья 50. Особенности оплаты услуг Клирингового центра, Биржи и Технического центра

- 50.1. На фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов Клиринговый центр взимает:
- комиссионное вознаграждение за клиринг в пользу Клирингового центра;
 - комиссионное вознаграждение за операции с клиринговыми сертификатами участия в пользу Клирингового центра;
 - комиссионное вознаграждение за клиринговые услуги по открытию и ведению Торгово-клирингового счета 3-го уровня;
 - комиссионное вознаграждение в пользу Биржи за услуги по организации торгов на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов;
 - абонентскую плату в пользу Биржи;
 - Дополнительное вознаграждение за предоставление ПАО Московская Биржа интегрированного технологического сервиса в пользу Технического центра (далее – Дополнительное вознаграждение);
 - комиссионное вознаграждение за предоставление дополнительного отчета по внебиржевым сделкам по инструменту;
 - плату за услугу по определению Внебиржевых сделок, информация о которых подлежит предоставлению на фондовую биржу и по предоставлению фондовой бирже сведений о внебиржевых сделках, заключенных в режимах «Двусторонние сделки с ЦК», «Адресные сделки с ЦК» и «Непрерывный аукцион с ЦК» (в том числе налог на добавленную стоимость (далее – НДС)).
- 50.1.1. В случаях, установленных Тарифами Клирингового центра, комиссионное вознаграждение за клиринг по сделкам РЕПО включает комиссионное вознаграждение за операции с клиринговыми сертификатами участия.
- 50.2. Участник клиринга вправе указать Клиринговому центру Идентификатор и наименование Участника торгов, не совпадающего в одном лице с Участником клиринга, в целях списания с указанного в заявлении Расчетного кода подлежащих уплате данным Участником торгов постоянных частей комиссионного вознаграждения Биржи, абонентской платы, комиссионного вознаграждения по тарифному плану «Размещения-фиксированный», а также комиссионного вознаграждения Клирингового центра за оказание Участнику торгов клиринговых услуг по открытию и/или ведению Торгово-клирингового счета 3-го уровня.
- 50.3. Удержание Клиринговым центром с Участника клиринга комиссионного вознаграждения по сделкам, заключенным с использованием Торгово-клирингового счета имущественного пула, осуществляется с Расчетного кода, входящего в состав Торгово-клирингового счета Т+, соответствующего Торгово-клиринговому счету имущественного пула, указанного в заявке / Котировке участника торгов на заключение сделки.
- 50.4. Обратная часть комиссионного вознаграждения по биржевым сделкам, учитываемая по Счету обеспечения Т0, рассчитывается при подаче заявки на заключение сделки (при наступлении времени активации заявки в случае его

наличия), на ее сумму уменьшается сумма денежных средств, учитываемая по такому Счету обеспечения T0.

- 50.5. Премия предоставляется по итогам отчетного периода, установленного Тарифами Клирингового центра, Участникам торгов / Участникам клиринга, выполнившим условия, необходимые для получения премии, предусмотренные Тарифами Клирингового центра и Тарифами Биржи, при условии, что на дату выплаты премии допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию не приостановлен / не прекращен.

Информация о суммах премии, подлежащих перечислению Участнику торгов / Участнику клиринга, предоставляется Участнику торгов / Участнику клиринга в Отчете о премии.

Премия перечисляется Участнику торгов / Участнику клиринга Биржей и Клиринговым центром на основной Расчетный код для списания комиссионных вознаграждений, порядок выбора которого установлен общей частью Правил клиринга, не позднее последнего Расчетного дня месяца, следующего за отчетным периодом оказания клиринговых услуг, установленным Тарифами Клирингового центра.

- 50.6. Абонентская плата, определенная в соответствии с Тарифами Биржи, определяется в первый Расчетный день календарного квартала, следующего за кварталом, за который взимается абонентская плата, и взимается в первый рабочий день календарного квартала, следующего за кварталом, за который взимается абонентская плата.

- 50.7. Комиссионное вознаграждение за предоставление по запросам Участников клиринга дубликатов отчетов по итогам клиринга, предусмотренных Правилами клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, определяется и взимается в день предоставления указанных дубликатов, и учитывается по Расчетному коду / Счету обеспечения T0, указанному Участником клиринга в запросе на предоставление дубликатов отчетов по итогам клиринга.

- 50.8. Участник торгов / Участник клиринга вправе выбрать тарифный план «Размещения-фиксированный».

Выбор тарифного плана «Размещения-фиксированный» осуществляется на основании Запроса о выборе тарифного плана «Размещения-фиксированный» предоставленного Участником торгов / Участником клиринга.

Запрос предоставляется Участником торгов / Участником клиринга Клиринговому центру не позднее, чем за 10 (десять) рабочих дней до начала периода, состоящего из 3 (трех) последовательных календарных месяцев, с которого будет применяться тарифный план «Размещения-фиксированный».

Если в запросе не указано на необходимость пролонгации, период действия тарифного плана «Размещения-фиксированный» составляет 12 (двенадцать) календарных месяцев, начиная с первого числа месяца, указанного в запросе.

В случае выбора Участником торгов / Участником клиринга тарифного плана «Размещения-фиксированный» Участник торгов / Участник клиринга уплачивает Комиссионное вознаграждение Биржи и Клирингового центра по биржевым сделкам купли-продажи облигаций и/или еврооблигаций 2 (двух) эмитентов, указанных в

Запросе Участника торгов / Участника клиринга о выборе тарифного плана «Размещения-фиксированный», в которых Участник торгов / Участник клиринга будет являться продавцом при осуществлении размещения или доразмещения (отчуждения первичным владельцем) в режимах торгов Режим основных торгов, Размещение: адресные заявки и Размещение: аукцион, а также в которых Участник торгов / Участник клиринга будет являться покупателем в режимах торгов Выкуп: адресные заявки, Выкуп: Аукцион, в пользу Биржи и Клирингового центра соответственно.

Иные виды комиссионного вознаграждения по указанным биржевым сделкам с Участника торгов / Участника клиринга, выбравшего тарифный план «Размещения-фиксированный», не взимаются.

Комиссионное вознаграждение по тарифному плану «Размещения-фиксированный» взимается с Участника торгов / Участнику клиринга в первый рабочий день первого месяца из 3 (трех) последовательных календарных месяцев, за которые взимается указанное комиссионное вознаграждение, по окончании Торгов в данный рабочий день.

- 50.9. Дополнительное вознаграждение, рассчитанное в отношении Участника торгов / Клиента в соответствии с Тарифами Технического центра, определяется в Расчетный день, в течение которого Участником торгов были поданы заявки / Котировки участника торгов на заключение сделок за свой счет или за счет указанного Клиента, и учитывается по Счету обеспечения Т0 / Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета, с указанием которого Участником торгов в течение данного Расчетного дня были поданы заявки / Котировки участника торгов на заключение сделок за свой счет или за счет указанного Клиента, если такой Торгово-клиринговый счет – единственный, либо по основному Расчетному коду для списания комиссионных вознаграждений, порядок определения которого установлен общей частью Правил клиринга, если Участником торгов в течение данного Расчетного дня были поданы заявки / Котировки участника торгов на заключение сделок за свой счет или за счет указанного Клиента с указанием нескольких Торгово-клиринговых счетов.
- 50.10. Комиссионное вознаграждение за предоставление дополнительного отчета по внебиржевым сделкам по инструменту взимается в тот же день, в который дополнительный отчет предоставляется Участнику клиринга, т.е. в первый рабочий день, одновременно являющийся расчетным днем, календарного месяца, следующего за месяцем, в котором заключались Внебиржевые сделки, информация о которых содержится в указанном дополнительном отчете, и удерживается с основного Расчетного кода Участника клиринга для списания комиссионных вознаграждений, порядок определения которого установлен общей частью Правил клиринга.
- 50.11. Плата за услугу Клирингового центра по определению Внебиржевых сделок, информация о которых подлежит предоставлению на фондовую биржу и по предоставлению фондовой бирже сведений о Внебиржевых сделках, заключенных в режимах «Двусторонние сделки с ЦК», «Адресные сделки с ЦК» и «Непрерывный аукцион с ЦК», установленная Тарифами Клирингового центра (далее в целях настоящего пункта – Плата за услугу по предоставлению фондовой бирже сведений), облагается НДС и взимается за отчетный квартал с Участника клиринга, заключившего хотя бы одну сделку в режимах «Двусторонние сделки с ЦК»,

«Адресные сделки с ЦК» и «Непрерывный аукцион с ЦК» в течение указанного квартала. С Участника клиринга допуск к клиринговому обслуживанию которого был прекращен до окончания отчетного квартала, данная плата не взимается. Плата за услугу по предоставлению фондовой бирже сведений определяется и взимается в последний рабочий день отчетного квартала, в котором Участником клиринга были заключены сделки в режимах «Двусторонние сделки с ЦК», «Адресные сделки с ЦК», «Непрерывный аукцион с ЦК», и удерживается с основного Расчетного кода Участника клиринга для списания комиссионных вознаграждений, порядок определения которого установлен общей частью Правил клиринга.

Клиринговый центр направляет Участнику клиринга счет-фактуру или УПД, включающий в себя счет-фактуру, в электронной форме, содержащие информацию о величине Платы за услугу по предоставлению фондовой бирже сведений, а также НДС, в порядке, определенном Тарифами Клирингового центра, не позднее 5 (пятого) календарного дня первого месяца квартала, следующего за отчетным кварталом, в котором Участнику клиринга была оказана услуга по предоставлению фондовой бирже сведений о Внебиржевых сделках, заключенных в режимах «Двусторонние сделки с ЦК», «Адресные сделки с ЦК» и «Непрерывный аукцион с ЦК». В целях обеспечения возможности направления Участнику клиринга счета-фактуры или УПД, включающего в себя счет-фактуру, в электронной форме, Участник клиринга обязан предоставить в Клиринговый центр реквизиты, необходимые для формирования счета-фактуры (УПД, включающего в себя счет-фактуру) в электронной форме, включающие в себя идентификатор участника документооборота – получателя файла обмена счета-фактуры, посредством направления Клиринговому центру документа Регистрация реквизитов для отправки электронных счетов-фактур REGEDMS по ЭДО или через Клиринговый терминал.

- 50.12. Обратная часть комиссионного вознаграждения за клиринг по депозитным договорам определяется в дату внесения заявки на заключение депозитного договора в реестр предложений.
- 50.13. Комиссионное вознаграждение за клиринг по депозитным договорам, заключенным в режиме торгов “Депозиты с ЦК – Аукцион”, определяется и взимается (если иное не установлено законодательством Российской Федерации) в первый рабочий день месяца, следующего за месяцем предоставления Участнику клиринга – Региональному органу власти, являющемуся Участником торгов, допуска к торгам на рынке депозитов и допуска к клиринговому обслуживанию на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов (в зависимости от того, какое из этих событий наступит позднее), и далее – в первый рабочий день календарного года оказания клиринговых услуг, и учитывается по основному Расчетному коду для списания комиссионных вознаграждений, порядок определения которого установлен общей частью Правил клиринга.
- 50.14. Комиссионное вознаграждение за клиринговые услуги по открытию Торгово-клирингового счета 3-го уровня взимается с Участника торгов / Участника клиринга, на основании запроса которого открыт Торгово-клиринговый счет 3-го уровня, не позднее рабочего дня, следующего за днем открытия Торгово-клирингового счета 3-го уровня, и учитывается по основному Расчетному коду для списания комиссионных вознаграждений, порядок определения которого установлен общей частью Правил клиринга.

- 50.15. Комиссионное вознаграждение за клиринговые услуги по ведению Торгово-клирингового счета 3-го уровня взимается с Участника торгов / Участника клиринга, которому оказываются клиринговые услуги по ведению клиринговых регистров 3-го уровня, в первый рабочий день отчетного месяца за каждый открытый Торгово-клиринговый счет 3-го уровня и учитывается по основному Расчетному коду для списания комиссионных вознаграждений, порядок определения которого установлен общей частью Правил клиринга.
- 50.16. Комиссионное вознаграждение Биржи по сделкам, клиринг по которым осуществляет иная клиринговая организация, рассчитывается при подаче заявки на заключение сделки, на его сумму уменьшается сумма денежных средств, учитываемая по основному Расчетному коду для списания комиссионных вознаграждений, порядок определения которого установлен общей частью Правил клиринга.
- Клиринговый центр взимает комиссионное вознаграждение Биржи по сделкам, клиринг по которым осуществляет иная клиринговая организация, только с Участников клиринга, являющихся Участниками торгов.
- 50.17. Обязательства Участника торгов / Участника клиринга по уплате комиссионного вознаграждения, учитываемые по соответствующему Расчетному коду, включаются в состав Единого клирингового пула и исполняются в порядке, определенном общей частью Правил клиринга.
- 50.18. Обязательства Участника торгов / Участника клиринга по уплате комиссионного вознаграждения, учитываемые по соответствующему Счету обеспечения Т0, исполняются после исполнения обязательств Участника клиринга по денежным средствам, определенных в соответствии со статьей 45 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.

Статья 51. Порядок представления информации и отчетов по итогам клиринга

- 51.1. Клиринговый центр обеспечивает Участнику клиринга возможность получения следующей информации из Клиринговой системы:
- о сделках, стороной по которым является Участник клиринга;
 - о размере Обеспечения в каждой валюте / каждом драгоценном металле, учитываемого по каждому Расчетному коду Участника клиринга;
 - о размере Обеспечения в ценных бумагах, учитываемого по каждому Торгово-клиринговому счету Участника клиринга;
 - о профилях активов в каждой валюте / каждом драгоценном металле, учитываемых по Расчетному коду Единого пула Участника клиринга, переданных / полученных из Клиринговой системы валютного рынка и рынка драгоценных металлов;
 - о профилях активов в российских рублях / каждой ценной бумаге, учитываемых по Расчетному коду Единого пула / Торгово-клиринговому счету Участника клиринга, переданных / полученных из Клиринговой системы срочного рынка;
 - о размере Единого лимита по Расчетному коду;
 - о значении ограничения на минимальное допустимое отрицательное значение

Единого лимита по Расчетному коду, рассчитанного без учета Обеспечения Участника клиринга, установленном Участником клиринга (по каждому Расчетному коду Участника клиринга) (в случае, если такое значение установлено);

- о значении Нетто-обязательства и/или Нетто-требования по денежным средствам / драгоценным металлам, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, в каждой валюте / каждом драгоценном металле и с каждой Датой исполнения (по каждому Расчетному коду Участника клиринга);
- о значении Нетто-обязательства и/или Нетто-требования по ценным бумагам, учитываемого по Торгово-клиринговому счету Участника клиринга, по каждому коду ценных бумаг и с каждой Датой исполнения (по каждому Торгово-клиринговому счету Участника клиринга);
- о размере Обеспечения в каждой валюте / каждом драгоценном металле, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, недостающего для исполнения Нетто-обязательства Участника клиринга в соответствующей валюте / соответствующем драгоценном металле, учитываемого по тому же Расчетному коду Участника клиринга, с наступившей Датой исполнения (по каждому Расчетному коду Участника клиринга);
- о размере Обеспечения в ценных бумагах, учитываемого по Торгово-клиринговому счету Участника клиринга, недостающего для исполнения Нетто-обязательства Участника клиринга в таких ценных бумагах, учитываемого по тому же Торгово-клиринговому счету Участника клиринга, с наступившей Датой исполнения (по каждому Торгово-клиринговому счету Участника клиринга);
- о наличии / отсутствии Маржинального требования, о сумме Маржинального требования в российских рублях (в случае наличия) (по каждому Расчетному коду Участника клиринга);
- о наличии / отсутствии Маржинального требования по пулу, о сумме Маржинального требования по пулу в российских рублях (в случае наличия) (по каждому Расчетному коду Участника клиринга);
- о наличии / отсутствии Задолженности Участника клиринга перед Клиринговым центром, о сумме Задолженности Участника клиринга (в случае наличия) (по каждому Расчетному коду Участника клиринга).

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

- Выписка из реестра Внебиржевых сделок с ценными бумагами;
- Выписка из реестра Предложений;
- Выписка из реестра Намерений;
- Выписка из реестра сделок, принятых в клиринг, содержащая информацию об обязательствах по сделкам, допущенных к клирингу;
- Выписка из реестра неисполненных и расторгнутых сделок;
- Выписка из протокола исполнения сделок, обязательств по внесению компенсационных взносов и уплате отступного, содержащая информацию о допущенных к клирингу обязательствах по внесению компенсационных взносов;
- Отчет о комиссионных вознаграждениях;

- Отчет о комиссионном вознаграждении по Сделкам РЕПО с открытой датой (направляется Участнику клиринга, являющемуся стороной по такой сделке);
- Отчет о торгово-клиринговых счетах Участника клиринга;
- Выписка из протокола внесения компенсационных взносов и исполнения обязательств по уплате отступного;
- Уведомление о замене Торгово-клирингового счета;
- Отчет об обязательствах по Сделкам Т+, содержащий информацию о допущенных к клирингу обязательствах по Сделкам Т+;
- Отчет об Обеспечении, содержащий информацию о размере Обеспечения Участника клиринга в денежных средствах и ценных бумагах и об изменении размера такого Обеспечения;
- Отчет об имуществе, внесенном в имущественные пулы;
- Отчет об обязательствах по передаче / требованиям по получению Дохода;
- Отчет о премии;
- Отчет о нормативной стоимости клиринговых сертификатов участия;
- Отчет об изменении суммы депозита;
- Отчет об обязательствах и требованиях по договорам М-Депозитов.

51.3. Для клиентов Участника клиринга Клиринговый центр формирует Выписку из реестра сделок, принятых в клиринг (по сделкам клиентов), содержащую информацию о допущенных к клирингу обязательствах по сделкам, заключенным за счет клиента Участника клиринга, для которого формируется отчет.

Указанный отчет направляется Участнику клиринга (для передачи их клиенту Участника клиринга) и/или уполномоченной им организации.

Для Держателей Клиринговый центр формирует Отчет о дополнительных торговых разделах, открытых для проведения операций Участниками клиринга, и иных реквизитах.

Указанный отчет направляется Держателям и/или уполномоченным ими организациям.

51.4. В случае предоставления Участником клиринга Клиринговому центру соответствующего заявления Клиринговый центр предоставляет такому Участнику клиринга дополнительный отчет по внебиржевым сделкам по инструменту, который содержит информацию о времени действия оферт на заключение Внебиржевых сделок с ценными бумагами и об объеме Внебиржевых сделок с ценными бумагами, заключенными в режимах, указанных в заявлении на предоставление дополнительных отчетов по внебиржевым сделкам по инструменту. Дополнительный отчет по внебиржевым сделкам по инструменту предоставляется в первый рабочий день, одновременно являющийся расчетным днем, календарного месяца, следующего за месяцем, в котором заключались Внебиржевые сделки, информация о которых содержится в указанном дополнительном отчете.

51.5. В случае предоставления Участником клиринга Клиринговому центру Заявления о предоставлении отчетов номинальному держателю, для Держателя / Участника клиринга, указанного в заявлении, Клиринговый центр формирует Выписку из реестра сделок, принятых в клиринг (для номинальных держателей), содержащую информацию о допущенных к клирингу обязательствах по сделкам, заключенным

Участником клиринга с указанием Торгово-клиринговых счетов, в состав которых входят Разделы Держателя / Разделы, открытые на торговом счете депо номинального держателя Участника клиринга.

Указанный отчет направляется Держателю и/или уполномоченной им организации.

- 51.6. Отчеты в форме электронных документов направляются Участнику клиринга / Держателю ежедневно при условии совершения им (по его поручению / с использованием его торговых разделов (торговых банковских счетов)) операций в Клиринговой системе.

Отчет о дополнительных торговых разделах, открытых для проведения операций Участниками клиринга, направляется Держателю дополнительно каждый первый Расчетный день месяца.

Отчет о торгово-клиринговых счетах Участника клиринга направляется Участнику клиринга ежедневно.

Отчеты о премии направляются Участникам клиринга, выполнившим условия, необходимые для получения премии по итогам отчетного периода, не позднее последнего Расчетного дня месяца, следующего за отчетным периодом.

- 51.7. Клиринговый центр обеспечивает Участнику клиринга, для которого зарегистрирован Торгово-клиринговый счет 2-го уровня, возможность получения следующей информации из Клиринговой системы:

- о сделках, заключенных Участником торгов с указанием Торгово-клирингового счета 2-го уровня, стороной по которым является Участник клиринга (по каждому Участнику торгов);
- о размере Обеспечения в каждой валюте / каждом драгоценном металле, информация о котором учитывается по каждому Расчетному коду 2-го уровня;
- о размере Обеспечения в ценных бумагах, информация о котором учитывается по каждому Торгово-клиринговому счету 2-го уровня;
- о профилях активов в каждой валюте / каждом драгоценном металле, учитываемых по Расчетному коду 2-го уровня, связанному с Расчетным кодом Участника клиринга, являющимся Расчетным кодом Единого пула, переданных / полученных из Клиринговой системы валютного рынка и рынка драгоценных металлов;
- о профилях активов в российских рублях, учитываемых по Расчетному коду 2-го уровня, связанному с Расчетным кодом Участника клиринга, являющимся Расчетным кодом Единого пула, переданных / полученных из Клиринговой системы срочного рынка;
- о профилях активов в каждой ценной бумаге, информация о которой учитывается по каждому Торгово-клиринговому счету 2-го уровня, в состав которого входит Расчетный код 2-го уровня, связанный с Расчетным кодом Участника клиринга, являющимся Расчетным кодом Единого пула, переданных / полученных из Клиринговой системы срочного рынка;
- о размере Единого лимита по Расчетному коду 2-го уровня;
- о значении ограничения на минимальное допустимое значение Единого лимита по Расчетному коду 2-го уровня, рассчитанного без учета Обеспечения, информация о котором учитывается по Расчетному коду 2-го уровня, установленном Участником клиринга (по каждому Расчетному коду 2-го

уровня) (в случае, если такое значение установлено);

- о значении Нетто-обязательства и/или Нетто-требования по денежным средствам / драгоценным металлам, учитываемого по Расчетному коду 2-го уровня, в каждой валюте / каждом драгоценном металле и с каждой Датой исполнения (по каждому Расчетному коду 2-го уровня);
- о значении Нетто-обязательства и/или Нетто-требования по ценным бумагам, учитываемого по Торгово-клиринговому счету 2-го уровня, по каждому коду ценных бумаг и с каждой Датой исполнения (по каждому Торгово-клиринговому счету 2-го уровня);
- о размере Обеспечения в каждой валюте / каждом драгоценном металле, информация о котором учитывается по Расчетному коду 2-го уровня, недостающего для исполнения Нетто-обязательства Участника клиринга в соответствующей валюте / соответствующем драгоценном металле, учитываемого по тому же Расчетному коду 2-го уровня, с наступившей Датой исполнения (по каждому Расчетному коду 2-го уровня);
- о размере Обеспечения в ценных бумагах, информация о котором учитывается по Торгово-клиринговому счету 2-го уровня, недостающего для исполнения Нетто-обязательства Участника клиринга в таких ценных бумагах, учитываемого по тому же Торгово-клиринговому счету 2-го уровня, с наступившей Датой исполнения (по каждому Торгово-клиринговому счету 2-го уровня).

51.8. Клиринговый центр обеспечивает Участнику торгов, заключившему с Клиринговым центром договор о ведении клиринговых регистров, предусмотренный общей частью Правил клиринга, и для которого зарегистрирован Торгово-клиринговый счет 3-го уровня, возможность получения следующей информации из Клиринговой системы:

- о размере Обеспечения в каждой валюте / каждом драгоценном металле, информация о котором учитывается по каждому Расчетному коду 2-го и 3-го уровня;
- о размере Обеспечения в ценных бумагах, информация о котором учитывается по каждому Торгово-клиринговому счету 2-го и 3-го уровня;
- о профилях активов в каждой валюте / каждом драгоценном металле, учитываемых по Расчетному коду 2-го и 3-го уровня, связанному / соответствующему Расчетному коду Участника клиринга, являющемуся Расчетным кодом Единого пула, переданных / полученных из Клиринговой системы валютного рынка и рынка драгоценных металлов;
- о профилях активов в российских рублях, учитываемых по Расчетному коду 2-го и 3-го уровня, связанному / соответствующему Расчетному коду Участника клиринга, являющемуся Расчетным кодом Единого пула, переданных / полученных из Клиринговой системы срочного рынка;
- о профилях активов в каждой ценной бумаге, информация о которой учитывается по каждому Торгово-клиринговому счету 2-го и 3-го уровня, в состав которого входит Расчетный код 2-го / 3-го уровня, связанный / соответствующий Расчетному коду Участника клиринга, являющимся Расчетным кодом Единого пула, переданных / полученных из Клиринговой системы срочного рынка;
- о размере Единого лимита по Расчетному коду 2-го и 3-го уровня;

- о значении ограничения на минимальное допустимое значение Единого лимита по Расчетному коду 2-го уровня, рассчитанного без учета Обеспечения, информация о котором учитывается по Расчетному коду 2-го уровня, установленном Участником клиринга (по каждому Расчетному коду 2-го уровня) (в случае, если такое значение установлено);
- о значении ограничения на минимальное допустимое значение Единого лимита по Расчетному коду 3-го уровня, рассчитанного без учета Обеспечения, информация о котором учитывается по Расчетному коду 3-го уровня, установленном Участником клиринга (по каждому Расчетному коду 3-го уровня) (в случае, если такое значение установлено);
- о значении Нетто-обязательства и/или Нетто-требования по денежным средствам / драгоценным металлам, учитываемого по Расчетному коду 2-го и 3-го уровня, в каждой валюте / каждом драгоценном металле и с каждой Датой исполнения (по каждому Расчетному коду 2-го и 3-го уровня);
- о значении Нетто-обязательства и/или Нетто-требования по ценным бумагам, учитываемого по Торгово-клиринговому счету 2-го и 3-го уровня, по каждому коду ценных бумаг и с каждой Датой исполнения (по каждому Торгово-клиринговому счету 2-го и 3-го уровня);
- о размере Обеспечения в каждой валюте / каждом драгоценном металле, информация о котором учитывается по Расчетному коду 2-го и 3-го уровня, недостающего для исполнения Нетто-обязательства Участника клиринга в соответствующей валюте / соответствующем драгоценном металле, учитываемого по тому же Расчетному коду 2-го или 3-го уровня, с наступившей Датой исполнения (по каждому Расчетному коду 2-го и 3-го уровня);
- о размере Обеспечения в ценных бумагах, информация о котором учитывается по Торгово-клиринговому счету 2-го и 3-го уровня, недостающего для исполнения Нетто-обязательства Участника клиринга в таких ценных бумагах, учитываемого по тому же Торгово-клиринговому счету 2-го или 3-го уровня, с наступившей Датой исполнения (по каждому Торгово-клиринговому счету 2-го и 3-го уровня).

51.9. Клиринговый центр формирует следующие отчеты для Участников торгов, заключивших с Клиринговым центром договор о ведении клиринговых регистров, предусмотренный общей частью Правил клиринга:

- Выписка из реестра сделок, принятых в клиринг, содержащая информацию об обязательствах по сделкам, допущенных к клирингу, заключенным с указанием Торгово-клиринговых счетов 2-го и 3-го уровня;
- Отчет об Обеспечении, содержащий информацию о размере Обеспечения в денежных средствах / драгоценных металлах / ценных бумагах, учитываемую по Расчетному коду 2-го и 3-го уровня / Торгово-клиринговому счету 2-го и 3-го уровня, и об изменении размера такого Обеспечения;
- Отчет о торгово-клиринговых счетах, содержащий информацию о зарегистрированных Торгово-клиринговых счетах 2-го и 3-го уровня;
- Отчет о Клиринговых идентификаторах;
- Отчет о комиссионных вознаграждениях.

51.10. Отчеты, указанные в пункте 51.9 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов направляются Участнику торгов в форме электронных документов в соответствии с Порядком ЭДО.

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

Копии электронных документов на бумажном носителе подписываются уполномоченным лицом Клирингового центра и предоставляются/направляются Участнику торгов.

РАЗДЕЛ VII. ПРОЧИЕ УСЛОВИЯ

Статья 52. Особенности Перевода обязательств и Обеспечения одного Участника клиринга другому Участнику клиринга

52.1. При Переводе обязательств и Обеспечения Участника пула также осуществляется уступка прав и перевод долга по договору об имущественном пуле, а также передача имущества Обособленного клиента, внесенного Базовым Участником клиринга в имущественный пул.

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

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

52.3. Если Участник клиринга - реципиент является Участником клиринга категории «В», а Базовый Участник клиринга является стороной по Сделке (Сделкам) РЕПО с открытой датой, Клиринговый центр осуществляет исполнение Заявления на перевод обязательств и Обеспечения только в случае и после подачи Базовым участником клиринга поручения на исполнение второй части Сделки РЕПО с открытой датой или регистрации Клиринговым центром поданных Базовым Участником клиринга и Участником клиринга – конечным контрагентом по Сделке РЕПО с открытой датой Отчетов на исполнение. Положения указанного пункта Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов не распространяются на случаи проведения процедуры Перевода обязательств и Обеспечения по основаниям, установленным законодательством, как они определены в общей части Правил клиринга.

52.4. 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 / Расчетный код ДУ, соответствующий данным регистрации Обособленного клиента и Участником клиринга – реципиентом, и Раздел, открытый Участником клиринга – реципиентом для обособленного учета Обеспечения в ценных бумагах Обособленного клиента в соответствии с требованием общей части Правил клиринга, если в Согласии на прием Торгово-клиринговый счет Участника клиринга – реципиента, не был указан;
- для Обособленных клиентов – владельцев клиринговых сертификатов участия,

регистрирует Торгово-клиринговый счет имущественного пула;

- для исполнения перевода Обеспечения и имущества из имущественного пула в ценных бумагах включает обязательство Базового Участника клиринга по списанию ценных бумаг и требование Участника клиринга – реципиента по зачислению ценных бумаг в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов ближайшей расчетной клиринговой сессии в соответствии с пунктом 45.5 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов;
- списывает драгоценные металлы, внесенные в имущественный пул с торгового банковского счета в соответствующем драгоценном металле Базового Участника клиринга, соответствующего Расчетному коду имущественного пула, за которым закреплен Обособленный клиент, предоставивший Заявление на перевод обязательств и Обеспечения, и зачисляет на торговый банковский счет в соответствующем драгоценном металле, соответствующий Расчетному коду имущественного пула Участника клиринга – реципиента.

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

Статья 53. Порядок действий при возникновении обстоятельств, которые могут повлиять на возможность заключения Внебиржевых сделок с ценными бумагами

53.1. В случае возникновения обстоятельств, вызывающих и/или создающих предпосылки к возникновению сбоев (отказов) при эксплуатации Клиринговой системы и/или иных программно-технических средств используемых при заключении Внебиржевых сделок с ценными бумагами и/или непосредственно препятствующие их нормальному (штатному) функционированию, в том числе, обстоятельства непреодолимой силы, а также сбои, неисправности и отказы оборудования; сбои и ошибки программного обеспечения; сбои, неисправности и отказы систем связи, энергоснабжения, кондиционирования и других систем жизнеобеспечения, а также иные обстоятельства, такие как случаи нарушения правил разграничения доступа и/или попыток несанкционированного доступа к Клиринговой системе, Клиринговый центр вправе:

- приостановить возможность подачи Предложений и заключения Внебиржевых сделок с ценными бумагами;
- удалить Предложения из Клиринговой системы.

53.2. При прекращении действия обстоятельств, которые повлекли приостановку возможности подачи Предложений и заключения Внебиржевых сделок с ценными бумагами, Клиринговый центр возобновляет возможность подачи Предложений и заключения Внебиржевых сделок с ценными бумагами.

Приложение № 1
к Правилам клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и
рынке кредитов

**Документы, предоставляемые юридическим лицом для получения
статуса Держателя**

1. Термины и определения

| | |
|--|--|
| Анкета юридического лица | Предоставляемая юридическим лицом анкета юридического лица, являющаяся приложением к Порядку представления информации и отчетности клиентами Небанковской кредитной организации-центрального контрагента «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество) и размещенная на Сайте Клирингового центра и в Программно-техническом комплексе «Личный кабинет Участника». |
| Анкета соответствия Нерезидента требованиям Правил Клиринга | Предоставляемая юридическим лицом анкета соответствия Нерезидента требованиям Правил клиринга, являющаяся приложением к Порядку представления информации и отчетности клиентами Небанковской кредитной организации-центрального контрагента «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество) и размещенная на Сайте Клирингового центра. |
| Апостиль | Штамп, соответствующий требованиям Конвенции, отменяющей требование легализации иностранных официальных документов, заключенной в г. Гааге 05.10.1961 (далее - Гагская конвенция), проставляемый компетентным органом государства, в котором этот документ был совершен. |
| Выписка документа из | Часть документа, изготовленная на бумажном носителе / в электронном виде и удостоверенная уполномоченным представителем юридического лица и оттиском печати (если применимо). |
| Копия | Документ, полностью воспроизводящий Оригинал и его внешние признаки, на бумажном носителе, заверенный уполномоченным лицом юридического лица и оттиском печати (если применимо), либо копия, заверенная электронной подписью уполномоченного лица юридического лица. |
| Нотариально удостоверенная выписка документа из | Часть документа, изготовленная на бумажном носителе/в электронном виде и удостоверенная нотариусом в соответствии с законодательством РФ о нотариате/законодательством о нотариате иностранного государства. |
| Нотариально удостоверенная копия | Копия документа, верность Оригинулу которой засвидетельствована нотариусом в соответствии с законодательством РФ о нотариате / законодательством о нотариате иностранного государства. |
| Оригинал | Подлинник (первоначальный экземпляр) электронного документа / документа на бумажном носителе, подписанный уполномоченным лицом юридического лица и заверенный оттиском печати (если применимо). Документы, изготовленные федеральным органом |

| | |
|--|--|
| | <p>исполнительной власти в электронном виде, и представленные Клиринговому центру в форме электронного документа, считаются Оригиналом и должны содержать, помимо файла с документами, файл с электронной подписью представителя органа, изготовившего и выдавшего документ.</p> <p>Устав / иные учредительные документы с изменениями и дополнениями должны содержать отметку о регистрации федеральным органом исполнительной власти, уполномоченным на осуществление государственной регистрации юридических лиц.</p> |
| Представитель | <p>Лицо, при совершении операции действующее от имени и в интересах или за счет юридического лица, полномочия которого основаны на доверенности, договоре, акте уполномоченного государственного органа или органа местного самоуправления, законе, а также единоличный исполнительный орган юридического лица.</p> |
| Требования к заверению документов, представляемых Нерезидентами | <p>Документы, составленные полностью или в какой-либо их части на иностранном языке, представляются с нотариально заверенным переводом на русский язык. Исключение составляют документы, выданные компетентными органами иностранных государств, удостоверяющие личности физических лиц, при условии:</p> <ul style="list-style-type: none">• наличия у физического лица документа, подтверждающего право законного пребывания (проживания) на территории РФ (например, виза, миграционная карта);• составления на нескольких языках, включая русский язык. |
| Электронный документ | <p>Документ, созданный в электронной форме без предварительного документирования на бумажном носителе, подписанный электронной подписью в порядке, установленном законодательством РФ.</p> |
| Электронная копия бумажного документа | <p>Документ, содержащий сканированную копию документа, выполненного с Оригинала на бумажном носителе или иного документа, оформленного в соответствии с требованиями, указанными в разделах 2 в перечне документов, представляемых Резидентами, и 3 в перечне документов, представляемых Нерезидентами, настоящего Приложения (далее - Перечень) и Порядком ЭДО.</p> |

- 1.1. Официальные документы, подтверждающие правовой статус Нерезидента, выданные компетентными органами иностранных государств, принимаются Клиринговым центром без их легализации в любом из следующих случаев:
 - 1.1.1. выданные документы подтверждают статус Банков-нерезидентов;
 - 1.1.2. выданные документы подтверждают статус Нерезидентов, не являющихся Банками-нерезидентами, за исключением случаев наличия у Клирингового центра сомнений в достоверности или точности предоставленных указанными лицами документов и (или) сведений либо подозрений в том, что цель заключения договора является совершение операций в целях легализации (отмывания) доходов, полученных преступным путем, или финансирования терроризма. В таких случаях Клиринговый центр вправе потребовать легализации указанных документов.
- 1.2. Легализация документов не требуется, если документы были оформлены на территории:

- 1.2.1. государств - участников Конвенции о правовой помощи и правовых отношениях по гражданским, семейным и уголовным делам 1993 года;
- 1.2.2. государств, с которыми Российская Федерация заключила договоры о правовой помощи и правовых отношениях по гражданским, семейным и уголовным делам.
- 1.3. Легализация осуществляется в установленном порядке:
 - 1.3.1. по общему правилу посредством консульской легализации, осуществляемой консульскими учреждениями РФ и консульскими отделами дипломатических представительств РФ;
 - 1.3.2. для стран-участников Гаагской конвенции путем проставления Апостиля.
- 1.4. Клиринговый центр оставляет за собой право принять один или несколько документов юридического лица без требования об их переводе на русский язык / нотариальному заверению / легализации в случаях, когда такое оформление необязательно в силу нормативных актов, международных соглашений и у Клирингового центра отсутствуют сомнения относительно корректности и достоверности представленных документов и информации.
- 1.5. Клиринговый центр вправе потребовать от юридического лица предоставление дополнительных документов, в том числе необходимых для целей выявления Клиринговым центром лиц, на которых распространяются временные меры экономического характера, также Клиринговый центр вправе потребовать уточнение информации, содержащейся в ранее предоставленных документах. При этом юридическое лицо обязано предоставить данные документы в срок, указанный в запросе, а если такой срок не указан, то в течение 5 (пяти) рабочих дней со дня получения им запроса Клирингового центра.
- 1.6. Документы, предоставляемые юридическим лицом, должны быть действительными на дату их предъявления в Клиринговый центр.
- 1.7. Иные термины используются в значениях, установленных законодательством РФ, Правилами клиринга и Порядком ЭДО.

2. Перечень документов, представляемых Резидентами

| № | Наименование документа | Возможные формы представления | Возможные способы представления | Примечание |
|---|---|-------------------------------|---------------------------------|--------------------|
| 1 | Заявление о предоставлении статуса Держателя (по форме Клирингового центра) | Оригинал | На бумажном носителе | В одном экземпляре |
| 2 | Анкета юридического лица | Оригинал | На бумажном носителе | В одном экземпляре |
| | | Электронная | В электронном виде | |

| | | | | |
|-----|--|--|-----------------------------|---|
| | | копия бумажного документа | | |
| 3 | Устав / иные учредительные документы с изменениями и дополнениями, действительными на дату представления в Клиринговый центр | <p>Оригинал (для изготовления и заверения копии работником Клирингового центра)</p> <p>Нотариально удостоверенная копия</p> <p>Копия документа, удостоверенная регистрирующим органом</p> <p>Копия</p> | <p>На бумажном носителе</p> | <p>Общества с ограниченной ответственностью (за исключением кредитных организаций, некредитных финансовых организаций, специализированных обществ, созданных в соответствии с законодательством Российской Федерации о ценных бумагах) (далее – Общество)</p> <p>дополнительно предоставляют свидетельство нотариуса об удостоверении принятия решения об избрании (назначении) единоличного исполнительного органа Общества в форме Нотариально удостоверенной копии, Копии, удостоверенной уполномоченным лицом Общества на бумажном носителе или в электронном виде, либо Оригинала в электронном виде с электронной подписью нотариуса.</p> |
| | | Оригинал | В электронном виде | |
| | | Электронная копия бумажного документа | | |
| 4 | Документы, подтверждающие полномочия | Оригинал (для изготовления и заверения копии работником Клирингового центра) | На бумажном носителе | |
| 4.1 | лица, действующего от имени юридического лица без доверенности | Нотариально | | |

| | | | | |
|-----|--|--|----------------------|---|
| | (например, протоколы / решения / распоряжения об избрании (назначении) на должность) | удостоверенная копия Копия | | |
| 4.2 | лиц, уполномоченных осуществлять действия (операции) от имени юридического лица во взаимоотношениях с Клиринговым центром, включая полномочия по подписанию необходимых документов | Выписка из документа Нотариально удостоверенная выписка из документа | | |
| | | Оригинал Электронная копия бумажного документа | В электронном виде | |
| 5 | Документы, удостоверяющие личность* лиц, имеющих право: | Оригинал (для изготовления и заверения копии работником Клирингового центра) | На бумажном носителе | *Возможно предоставление юридическим лицом письма в произвольной форме, содержащего следующие сведения о представителе: фамилия, имя, отчество (при наличии), гражданство, реквизиты документа, удостоверяющего личность, дату рождения, адрес места жительства (регистрации) или места пребывания, за подписью уполномоченного представителя юридического лица при одновременном представлении Оригинала / копии документа, удостоверяющего личность для сверки реквизитов работником Клирингового центра. В случае если |
| 5.1 | действовать от имени юридического лица без доверенности | Нотариально удостоверенная копия | | |
| 5.2 | осуществлять действия (операции) от имени юридического лица во взаимоотношениях с Клиринговым центром, включая полномочия по подписанию необходимых документов | Копия Оригинал (для письма) Электронная копия бумажного документа | В электронном виде | |

| | | | | |
|--|--|--|--|---|
| | | | | <p>физическое лицо, на которое требуется предоставить копию документа, удостоверяющего личность, является иностранным гражданином (лицом без гражданства), то дополнительно необходимо предоставить документ, подтверждающий право иностранного гражданина (лица без гражданства) на пребывание (проживание) в Российской Федерации или миграционную карту², если наличие таких документов предусмотрено законодательством Российской Федерации³. Если сведения о месте пребывания (проживания) не указаны в представляемых документах, то необходимо также представить такие сведения в письменном виде за подписью уполномоченного лица юридического лица</p> |
|--|--|--|--|---|

² Сведения о миграционной карте предоставляются в случае отсутствия иных документов, подтверждающих право иностранного гражданина или лица без гражданства на пребывание (проживание) в Российской Федерации.

³ Требования к заверению аналогичны требованиям к заверению документов, удостоверяющих личность, обозначенных в настоящем пункте 5.

3. Перечень документов, представляемых Нерезидентами

| № | Наименование документа | Возможные формы представления | Возможные способы представления | Примечание |
|---|---|--|---------------------------------|--------------------|
| 1 | Заявление о предоставлении статуса Держатель (по форме Клирингового центра) | Оригинал | На бумажном носителе | В одном экземпляре |
| 2 | Анкета юридического лица | Оригинал | На бумажном носителе | В одном экземпляре |
| | | <u>Оригинал</u> <u>Электронная копия бумажного документа</u> | В электронном виде | |
| 3 | Учредительные документы с изменениями и дополнениями, действительными на дату представления в Клиринговый центр | Оригинал (для изготовления и заверения копии работником Клирингового центра) Нотариально удостоверенная копия Копия документа, удостоверенная регистрирующим/ иным уполномоченным органом страны регистрации | На бумажном носителе | |
| | | Оригинал Электронная копия бумажного документа | В электронном виде | |
| 4 | Документы, подтверждающие государственную регистрацию юридического лица | Оригинал (для изготовления и заверения копии работником Клирингового центра) Нотариально | На бумажном носителе | |

| | | | | |
|---|---|--|-----------------------------|--|
| | | <p>удостоверенная копия</p> <p>Копия документа, удостоверяющая регистрирующим/ иным уполномоченным органом страны регистрации</p> <p>Копия</p> | | |
| | | <p>Оригинал</p> <p>Электронная копия бумажного документа</p> | <p>В электронном виде</p> | |
| 5 | <p>Документы, подтверждающие правовой статус юридического лица по законодательству страны его регистрации, в том числе:</p> <p>- выписка из торгового реестра страны регистрации юридического лица (при возможности ее представления) / или иной документ, подтверждающий правовой статус</p> | <p>Оригинал (для изготовления и заверения копии работником Клирингового центра)</p> <p>Нотариально удостоверенная копия</p> <p>Копия документа, удостоверяющая регистрирующим/ иным уполномоченным органом страны регистрации</p> <p>Копия</p> | <p>На бумажном носителе</p> | |
| | | <p>Оригинал</p> <p>Электронная копия бумажного документа</p> | <p>В электронном виде</p> | |
| 6 | <p>Документы (свидетельство / уведомление), подтверждающие постановку на учет в налоговом органе по месту регистрации иностранной</p> | <p>Оригинал (для изготовления и заверения копии работником Клирингового центра)</p> <p>Нотариально</p> | <p>На бумажном носителе</p> | |

| | | | | |
|---|--|---|----------------------|--|
| | организации | <p>удостоверенная копия</p> <p>Копия документа, удостоверенная регистрирующим/ иным уполномоченным органом страны регистрации</p> <p>Копия</p> | | |
| | | <p>Оригинал</p> <p>Электронная копия бумажного документа</p> | В электронном виде | |
| 7 | Документ, подтверждающий постановку юридического лица на налоговый учет в Российской Федерации (при наличии) | <p>Оригинал (для изготовления и заверения копии работником Клирингового центра)</p> <p>Нотариально удостоверенная копия</p> <p>Копия</p> | На бумажном носителе | |
| | | <p>Оригинал</p> <p>Электронная копия бумажного документа</p> | В электронном виде | |
| 8 | Специальное разрешение, лицензия или иное основание на осуществление деятельности, выданное компетентным органом, на право осуществления учета и перехода прав на ценные бумаги и (или) расчетов по ценным бумагам и (или) осуществления расчетов по ценным бумагам по | <p>Оригинал (для изготовления и заверения копии работником Клирингового центра)</p> <p>Нотариально удостоверенная копия</p> <p>Копия документа, удостоверенная уполномоченным представителем юридического</p> | На бумажном носителе | |

| | | | | |
|------|--|--|----------------------|---|
| | результатам торгов на иностранных биржах или иных регулируемых рынках либо клиринга по результатам таких торгов | лица Оригинал Электронная копия бумажного документа | В электронном виде | |
| 9 | Документы, подтверждающие полномочия | Оригинал (для изготовления и заверения копии работником Клирингового центра) | На бумажном носителе | |
| 9.1 | лица, действующего от имени юридического лица без доверенности (например, протоколы/решения/р аспоряжения об избрании (назначении) на должность) | Нотариально удостоверенная копия Копия | | |
| 9.2 | лиц, уполномоченных осуществлять действия (операции) от имени юридического лица во взаимоотношениях с Клиринговым центром, включая полномочия по подписанию необходимых документов | Выписка из документа Нотариально удостоверенная выписка из документа Оригинал Электронная копия бумажного документа | В электронном виде | |
| 10 | Документы, удостоверяющие личность* лиц, имеющих право: | Оригинал (для изготовления и заверения копии работником Клирингового центра) | На бумажном носителе | *Возможно предоставление юридическим лицом письма в произвольной форме, содержащего следующие сведения о представителе: |
| 10.1 | действовать от имени юридического лица без доверенности | Нотариально удостоверенная копия | | фамилия, имя, отчество (при наличии), гражданство, |
| 10.2 | осуществлять действия (операции) от имени юридического лица во взаимоотношениях с Клиринговым центром, включая полномочия по подписанию | Копия Оригинал (для письма) Электронная копия бумажного | В электронном виде | реквизиты документа, удостоверяющего личность, дату рождения, адрес места жительства |

| | | | |
|--|------------------------|-----------|--|
| | необходимых документов | документа | (регистрации) или места пребывания, за подписью уполномоченного представителя юридического лица при одновременном представлении Оригинала / копии документа, удостоверяющего личность, для сверки реквизитов работником Клирингового центра. В случае если физическое лицо, на которое требуется предоставить копию документа, удостоверяющего личность, является иностранным гражданином (лицом без гражданства), то дополнительно необходимо предоставить документ, подтверждающий право иностранного гражданина (лица без гражданства) на пребывание (проживание) в Российской Федерации или миграционную карту ⁴ , если наличие таких документов предусмотрено законодательством Российской Федерации ⁵ . Если |
|--|------------------------|-----------|--|

⁴ Сведения о миграционной карте предоставляются в случае отсутствия иных документов, подтверждающих право иностранного гражданина или лица без гражданства на пребывание (проживание) в Российской Федерации.

⁵ Требования к заверению аналогичны требованиям к заверению документов, удостоверяющих личность,

| | | | | |
|----|---|---|----------------------|--|
| | | | | сведения о месте пребывания (проживания) не указаны в представляемых документах, то необходимо также представить такие сведения в письменном виде за подписью уполномоченного лица юридического лица |
| 11 | Документ, подтверждающий согласование кандидатуры Руководителя юридического лица уполномоченным органом государства учреждения юридического лица (если такое согласование предусмотрено законодательством государства учреждения юридического лица) | Оригинал (для изготовления и заверения копии работником Клирингового центра) Нотариально удостоверенная копия Копия документа, удостоверенная регистрирующим/ иным уполномоченным органом страны регистрации Копия | На бумажном носителе | |
| | | Оригинал Электронная копия бумажного документа | В электронном виде | |

Приложение № 2
к Правилам клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и
рынке кредитов

**Временной регламент на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке
кредитов**

| № п/п | Наименование операции | Время (московское) |
|-----------|---|---|
| 1. | Операции по сделкам с ценными бумагами | |
| 1.1. | Процедура контроля обеспечения. | 6:50– 23:50 |
| 1.2. | Период регистрации поручений. Получение Клиринговым центром от Участников клиринга Специальных отчетов на исполнение. | 6:50 – 18:30 |
| 1.3. | Получение Клиринговым центром от Участников клиринга Срочных отчетов на исполнение. | 9:30 – 18:30 |
| 1.4. | Период регистрации поручений. Получение Клиринговым центром от Участников клиринга Отчетов на исполнение, Поручений на внесение компенсационных взносов и Поручений на отказ от компенсационных взносов по сделкам. | 6:50 – 19:00 |
| 1.5. | Период регистрации поручений. Получение Клиринговым центром от Участников клиринга поручений на исполнение второй части Сделки РЕПО с открытой датой. | 6:50 – 19:00 |
| 1.6. | Период регистрации поручений. Получение Клиринговым центром от Участников клиринга Поручений на отказ от исполнения сделок РЕПО с кодом расчетов Y0/Yn, Ym/Yn. | 6:50 – 23:50 |
| 1.7. | Осуществление Клиринговым центром проверок в отношении обязательства Участника клиринга по денежным средствам, возникшего по сделке купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов Вп, эмитентом которых является Министерство финансов Российской Федерации, заключенной в режиме торгов «Размещение: Аукцион» или «Размещение: Адресные заявки». | 18:50 – 18:59 |
| 1.8. | Процедура контроля обеспечения по сделкам с отложенной датой активации. | В дату активации во время, установленное по согласованию с Биржей |
| 2. | Время (сроки) внесения имущества в имущественный пул и выдачи имущества из имущественного пула | |
| 2.1. | Зачисление денежных средств на клиринговый банковский счет Клирингового центра для выдачи клиринговых сертификатов участия в текущем Расчетном дне ⁶ . | до 19:00 Расчетного дня |
| 2.2. | Зачисление денежных средств на клиринговый банковский счет Клирингового центра для выдачи клиринговых сертификатов участия в следующем Расчетном дне. | с 19:00 до 23:50 Расчетного дня |

⁶ Истечение времени зачисления денежных средств на клиринговый банковский счет Клирингового центра для выдачи клиринговых сертификатов участия в текущем Расчетном дне и начало времени зачисления денежных средств на клиринговый банковский счет Клирингового центра для выдачи клиринговых сертификатов участия в в следующем Расчетном дне может отличаться от установленного Временным регламентом на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов и зависит от срока завершения подготовки Клиринговым центром распоряжения на проведение операций по Разделам / субсчетам депо в соответствии пунктом 47.4 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.

| | | |
|-----------|---|--|
| 2.3. | Передача Участником клиринга Клиринговому центру распоряжений на перевод денежных средств / драгоценных металлов с целью внесения имущества в имущественный пул / выдачи имущества из имущественного пула (с использованием Клиринговой системы фондового рынка и рынка депозитов). | с 09:05 до 23:50 Расчетного дня |
| 2.4 | Передача Участником клиринга Клиринговому центру распоряжений на перевод ценных бумаг с целью внесения имущества в имущественный пул / выдачи имущества из имущественного пула (с использованием Клиринговой системы фондового рынка и рынка депозитов). | с 09:05 до 19:00 Расчетного дня |
| 2.5. | Прием Клиринговым центром от Участников клиринга Запросов на перевод Обеспечения в иностранной валюте, российских рублях, поданных с целью внесения имущества в имущественный пул / выдачи имущества из имущественного пула. | с 06 50 до 23:50 Расчетного дня |
| 2.6. | Прием Клиринговым центром от Участников клиринга Запросов на возврат обеспечения, поданных с целью выдачи имущества из имущественного пула: | в указанное время Расчетного дня по соответствующей валюте |
| | - гонконгских долларов; | с 08:00 до 11:00 Расчетного дня |
| | - юаней; | с 08:00 до 13:00 Расчетного дня |
| | - евро | с 08:00 до 15:45 Расчетного дня |
| | - фунтов стерлингов | с 08:00 до 17:00 Расчетного дня |
| | - российских рублей; | с 08:00 до 19:30 Расчетного дня |
| | - долларов США, драгоценных металлов. | с 08:00 до 20:00 Расчетного дня |
| 2.7. | Выдача денежных средств / драгоценных металлов / ценных бумаг из имущественного пула. | в являющийся Расчетным днем день получения Клиринговым центром соответствующего запроса / распоряжения |
| 3. | Сроки определения и исполнения обязательств | |
| 3.1. | Исполнение Маржинальных требований по пулу. | до 17:30 дня возникновения Маржинального требования по пулу |
| 3.2. | Исполнение обязательств по уплате комиссионных вознаграждений, учитываемых по Счетам обеспечения Т0. | до 19:00 Даты исполнения обязательств по уплате соответствующего комиссионного вознаграждения |
| 3.3. | Прекращение обязательств и требований по денежным средствам / ценным бумагам по Сделкам с Датой исполнения в дату их заключения, заключенным после 19:00. | 23:50 Даты исполнения |
| 3.4. | Получение информации от Расчетного депозитария об осуществлении выплаты/передачи дохода по сделкам РЕПО, заключенным с Банком России без участия центрального контрагента в отдельных режимах, согласно которой обязательство по передаче Дохода может быть | 19:00 Расчетного дня |

| | | |
|-----------|--|-------------------------------------|
| | исполнено в текущем Расчетном дне. | |
| 3.5. | Исполнение обязательств по передаче Дохода по сделкам РЕПО, заключенным с Банком России без участия центрального контрагента в отдельных режимах. | 19:00 Даты исполнения |
| 4. | Сроки предоставления отчетов по итогам клиринга | |
| 4.1. | Передача Клиринговым центром Участникам клиринга Отчетов об Обеспечении, Отчетов об обязательствах по Сделкам Т+, Отчетов об имуществе, внесенном в имущественные пулы, Отчета о нормативной стоимости клиринговых сертификатов участия, Выписок из реестра сделок, принятых в клиринг, и иных отчетов, предусмотренных статьей 51 Правил клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, за исключением Отчетов о Маржинальных требованиях. | До 9:00 следующего Расчетного дня |
| 4.2. | Передача Клиринговым центром Участникам клиринга Отчета о комиссионных вознаграждениях, содержащего информацию о сумме отступного за непредоставление Обеспечения в сумме депозита. | До 19:15 дня определения отступного |
| 5. | Время (сроки) подачи Предложений / Намерений и заключения Внебиржевых сделок | |
| 5.1. | - в режиме «Встречный аукцион с ЦК» | |
| | Подача Предложений | с 10:00 до 19:00 Расчетного дня |
| | Заключение Внебиржевых сделок | с 10:00 до 19:00 Расчетного дня |
| 5.2. | - в режиме «Двусторонние сделки с ЦК» | |
| | Подача Предложений | с 9:30 до 19:00 Расчетного дня |
| | Подача Намерений | с 9:30 до 23:50 Расчетного дня |
| | Заключение Внебиржевых сделок | с 9:30 до 19:00 Расчетного дня |
| 5.3. | - в режиме «Непрерывный аукцион с ЦК» | |
| | Подача Предложений | с 06:50 до 23:50 Расчетного дня |
| | Заключение Внебиржевых сделок | с 06:50 до 23:50 Расчетного дня |
| 5.4. | - в режиме «Адресные сделки с ЦК» | |
| | Подача Предложений | с 06:50 до 23:50 Расчетного дня |
| | Заключение Внебиржевых сделок | с 06:50 до 23:50 Расчетного дня |

Все иные документы передаются Клиринговому центру и/или предоставляются Клиринговым центром в процессе взаимодействия Клирингового центра с Участниками клиринга с 9:00 до 19:00 по московскому времени по Расчетным дням.

Приложение №3
к Правилам клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и
рынке кредитов

**Порядок изменения значений клиринговых регистров
Счет обеспечения T0 и Торгово-клиринговый счет T0**

Обозначения, используемые в таблицах:

S – сумма операции, указанная в заявке, запросе или реестре (в рублях, если не указано иное).

V – объем операции, указанный в заявке, запросе, сделке или реестре (в шт. ценных бумаг).

K – сумма комиссионного вознаграждения, рассчитанная по заявке (в рублях).

Сделки – сумма операции в соответствии с условиями сделки (в рублях, если не указано иное), где Сделки $\leq S$ для заявок на покупку, Сделки $\geq S$ для заявок на продажу.

Ксделки – сумма комиссионного вознаграждения (в рублях), рассчитанная по сделке, где Ксделки $\leq K$ для заявок на покупку, Ксделки $\geq K$ для заявок на продажу.

↑ - увеличение.

↓ - уменьшение.

1. Порядок изменения информации о денежных средствах

| № | Операция | Значение суммы денежных средств (в валюте), учитываемое по Счету обеспечения T0 |
|------|---|---|
| 1. | Исполнение Расчетной организацией распоряжения на перевод денежных средств с торговых банковских счетов на клиринговый банковский счет после получения от Расчетной организации выписки по торговым банковским счетам (S – сумма денежных средств, учитываемых на торговом банковском счете) | = S |
| 2. | Зачисление / списание денежных средств | |
| 2.1. | Зачисление денежных средств на клиринговый банковский счет после увеличения суммы денежных средств на торговом банковском счете на сумму S | ↑ на S |
| 2.2. | Исполнение распоряжения Участника клиринга или Клирингового центра на перевод денежных средств со Счета обеспечения T0 с использованием Клиринговой системы | ↓ на S |
| 2.3. | Списание денежных средств со Счета обеспечения T0 на основании Запроса на изменение параметров Торгово-клирингового счета в сумме, недостающей для исполнения Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам либо в размере Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам. | ↓ на S |
| 2.4. | Исполнение распоряжения Участника клиринга на перевод денежных средств со Счета обеспечения T0. | ↓ на S |
| 2.5. | Исполнение распоряжения Участника клиринга на перевод денежных средств на Счет обеспечения T0. | ↑ на S |
| 2.6. | Списание в ходе Торгов денежных средств с торгового банковского счета на основании запроса Расчетной организации | ↓ на S |
| 2.7. | Возврат денежных средств на Счет обеспечения T0 в размере Итогового нетто-требования Участника клиринга по денежным средствам на основании Запроса на изменение параметров Торгово- | ↑ на S |

| | | |
|-------|--|------------------|
| | клирингового счета | |
| 3. | Регистрация и снятие заявок на заключение сделок с кодом расчетов T0, Z0, X0, Rb, Bn, B0 – B30, Sn | |
| 3.1. | Регистрация заявки на покупку на заключение сделки с кодом расчетов T0, Rb; X=S+K (здесь и далее – в российских рублях, если не указано иное) | ↓ на X |
| 3.2. | Регистрация заявки на покупку на заключение сделки купли-продажи или сделки РЕПО с кодом расчетов Z0, X0; X=S+K | ↓ на X |
| 3.3. | Регистрация заявки на продажу на заключение сделки купли-продажи или сделки РЕПО с кодом расчетов Z0, X0 | ↓ на K |
| 3.4. | Регистрация заявки на покупку / продажу на заключение сделки с кодом расчетов Bn, B0 – B30, Sn | ↓ на K |
| 3.5. | Регистрация заявки на покупку на заключение сделки с кодом расчетов T0, Rb в иностранной валюте; S – в иностранной валюте, K – в российских рублях; позиции в иностранной валюте и в российских рублях проверяются и изменяются отдельно | ↓ на S ↓ на K |
| 3.6. | Регистрация заявки на покупку на заключение сделки купли-продажи или сделки РЕПО с кодом расчетов Z0, X0 в иностранной валюте; S – в иностранной валюте, K – в российских рублях; позиции в иностранной валюте и в российских рублях проверяются и изменяются отдельно | ↓ на S ↓ на K |
| 3.7. | Регистрация заявки на покупку на заключение сделки с кодом расчетов Bn, B0 – B30, Sn в иностранной валюте; S – в иностранной валюте, K – в российских рублях | ↓ на K |
| 3.8. | Регистрация заявки на продажу на заключение сделки с любым кодом расчетов в иностранной валюте; S – в иностранной валюте, K – в российских рублях | ↓ на K |
| 3.9. | Снятие заявки на покупку на заключение сделки с кодом расчетов T0, Rb в российских рублях; X=S+K | ↑ на X |
| 3.10. | Снятие заявки на покупку на заключение сделки купли-продажи или сделки РЕПО с кодом расчетов Z0, X0; X=S+K | ↑ на X |
| 3.11. | Снятие заявки на продажу на заключение сделки купли-продажи или сделки РЕПО с кодом расчетов Z0, X0 | ↑ на K |
| 3.12. | Снятие заявки на покупку на заключение сделки купли-продажи или сделки РЕПО с кодом расчетов Z0, X0 в иностранной валюте; S – в иностранной валюте, K – в российских рублях | ↑ на S ↑ на K |
| 3.13. | Снятие заявки на покупку / продажу на заключение сделки с кодом расчетов Bn, B0 – B30, Sn, в российских рублях и иностранной валюте | ↑ на K |
| 3.14. | Снятие заявки на покупку на заключение сделки с кодом расчетов T0, Rb в иностранной валюте; S – в иностранной валюте, K – в российских рублях | ↑ на S ↑ на K |
| 3.15. | Снятие заявки на продажу на заключение сделки с любым кодом расчетов в иностранной валюте; S – в иностранной валюте, K – в российских рублях | ↑ на K |
| 4. | Заключение сделок с кодом расчетов T0, Rb | |
| 4.1. | Заключение сделки по заявке на продажу с кодом расчетов T0, Rb в российских рублях; X=Сделки – Ксделки | ↑ на X |
| 4.2. | Заключение сделки по заявке на покупку с кодом расчетов T0, Rb, в | ↑ на X |

| | | |
|-------|--|------------------|
| | российских рублях; $X = S - \text{Сделки} + (K - \text{Ксделки})$ | |
| 4.3. | Заключение сделки по заявке на продажу с кодом расчетов T0, Rb в иностранной валюте; S – в иностранной валюте | ↑ на S |
| 4.4. | Заключение сделки по заявке на покупку с кодом расчетов T0, Rb в иностранной валюте; $X = S - \text{Сделки}$ (в иностранной валюте) $Y = (K - \text{Ксделки})$ (в российских рублях) | ↑ на X ↑ на Y |
| 5. | Регистрация и отзыв Отчетов на исполнение | |
| 5.1. | Регистрация в Клиринговой системе Отчета на исполнение, содержащего обязательство по оплате ценных бумаг / выдаче или возврату кредита по кредитному договору | ↓ на Сделки |
| 5.2. | Отзыв из Клиринговой системы Отчета на исполнение, содержащего обязательство по оплате ценных бумаг / выдаче или возврату кредита по кредитному договору | ↑ на Сделки |
| 5.3. | Прохождение Отчетом на исполнение, содержащим требование по оплате ценных бумаг / выдаче или возврату кредита по кредитному договору, Процедуры контроля обеспечения | ↑ на Сделки |
| 5.4. | Регистрация в Клиринговой системе Специального отчета на исполнение, содержащего условное двустороннее нетто-обязательство по денежным средствам (X, X<0) | ↓ на (-X) |
| 5.5. | Отзыв из Клиринговой системы Специального отчета на исполнение, содержащего условное двустороннее нетто-обязательство по денежным средствам (X, X<0) | ↑ на (-X) |
| 5.6. | Прохождение Специальным отчетом на исполнение, содержащим условное двустороннее нетто-требование по денежным средствам (X, X>0), Процедуры контроля обеспечения | ↑ на X |
| 5.7. | Регистрация в Клиринговой системе Срочного отчета на исполнение, содержащего нетто-обязательство по денежным средствам (X, X<0) | ↓ на (-X) |
| 5.8. | Отзыв из Клиринговой системы Срочного отчета на исполнение, содержащего нетто-обязательство по денежным средствам (X, X<0) | ↑ на (-X) |
| 5.9. | Регистрация в Клиринговой системе Поручения на внесение компенсационного взноса в виде денежных средств | ↓ на S |
| 5.10. | Регистрация в Клиринговой системе Поручения на внесение компенсационного взноса в виде денежных средств Участником клиринга – контрагентом по сделке | ↑ на S |
| 6. | Уплата / получение Компенсационного взноса / отступного | ↓ на S / ↑ на S |
| 7. | Расчеты по итогам клиринга по сделкам с кодом расчетов Z0 и Срочным отчетам на исполнение | |
| 7.1. | Исполнение обязательства по оплате ценных бумаг или нетто-обязательства по денежным средствам в размере X | ↓ на X |
| 7.2. | Исполнение требования по оплате ценных бумаг или нетто-требования по денежным средствам в размере X | ↑ на X |

2. Порядок изменения информации о ценных бумагах

| № | Операция | Значение количества ценных бумаг, учитываемого по Торгово-клиринговому счету T0 |
|------|--|---|
| 1. | Получение от Расчетного депозитария выписки по Разделам / субсчетам депо | = V0 |
| 2. | Зачисление / списание ценных бумаг | |
| 2.1. | Увеличение количества ценных бумаг, учитываемого по Торгово-клиринговому счету T0 на количество V в случаях зачисления ценных бумаг на Раздел T0. | ↑ на V |
| 2.2. | Исполнение распоряжения Участника клиринга или Клирингового центра на перевод ценных бумаг с Торгово-клирингового счета T0 с использованием Клиринговой системы | ↓ на V |
| 2.3. | Исполнение распоряжения Участника клиринга на перевод ценных бумаг на Торгово-клиринговый счет T0 с использованием Клиринговой системы | ↑ на V |
| 2.4. | Списание ценных бумаг с Торгово-клирингового счета T0 на основании Запроса на изменение параметров Торгово-клирингового счета в количестве, недостающем для исполнения Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по ценным бумагам либо в размере Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по ценным бумагам. | ↓ на V |
| 2.5. | Списание в ходе Торгов ценных бумаг с Разделов T0 на основании запроса Расчетного депозитария | ↓ на V |
| 2.6. | Возврат ценных бумаг в размере Итогового нетто-требования Участника клиринга по ценным бумагам на основании Запроса на изменение параметров Торгово-клирингового счета | ↑ на V |
| 2.7. | Исполнение Запроса на подбор ценных бумаг. | ↑ на V |
| 3. | Регистрация и снятие заявок T0, Rb, T0/Уп, Z0, X0 | |
| 3.1. | Регистрация заявки на продажу на заключение сделки с кодом расчетов T0, Rb, T0/Уп в российских рублях и/или иностранной валюте | ↓ на V |
| 3.2. | Регистрация заявки на продажу на заключение сделки купли-продажи с кодом расчетов Z0, X0 или сделки РЕПО с кодом расчетов Z0 в российских рублях и иностранной валюте | ↓ на V |
| 3.3. | Снятие заявки на продажу на заключение сделки с кодом расчетов T0, Rb, T0/Уп в российских рублях и/или иностранной валюте | ↑ на V |
| 3.4. | Снятие заявки на продажу на заключение сделки купли-продажи с кодом расчетов Z0, X0 или сделки РЕПО с кодом расчетов Z0 в российских рублях и иностранной валюте | ↑ на V |
| 4. | Заключение сделок T0, Rb, T0/Уп, Z0, X0 | |
| 4.1. | Заключение сделки по заявке на покупку с кодом расчетов T0, Rb, T0/Уп, X0 | ↑ на V |
| 5. | Регистрация и отзыв Отчетов на исполнение | |
| 5.1. | Регистрация в Клиринговой системе Отчета на исполнение, содержащего обязательство по передаче ценных бумаг | ↓ на V |
| 5.2. | Отзыв из Клиринговой системы Отчета на исполнение, содержащего обязательство по передаче ценных бумаг | ↑ на V |
| 5.3. | Прохождение Отчетом на исполнение, содержащим требование по передаче ценных бумаг, Процедуры контроля обеспечения | ↑ на V |

| | | |
|---------|---|-----------------|
| 5.4. | Регистрация в Клиринговой системе Специального отчета на исполнение, содержащего условное двустороннее нетто-обязательство по ценным бумагам ($X, X < 0$) | ↓ на (-X) |
| 5.5. | Отзыв из Клиринговой системы Специального отчета на исполнение, содержащего условное двустороннее нетто-обязательство по ценным бумагам ($X, X < 0$) | ↑ на (-X) |
| 5.6. | Прохождение Специальным отчетом на исполнение, содержащим условное двустороннее нетто-требование по ценным бумагам (X), Процедуры контроля обеспечения | ↑ на X |
| 5.7. | Регистрация в Клиринговой системе Срочного отчета на исполнение, содержащего нетто-обязательство по ценным бумагам ($X, X < 0$) | ↓ на (-X) |
| 5.8. | Отзыв из Клиринговой системы Срочного отчета на исполнение, содержащего нетто-обязательство по ценным бумагам ($X, X < 0$) | ↑ на (-X) |
| 5.9. | Регистрация в Клиринговой системе Поручения на внесение компенсационного взноса в виде ценных бумаг | ↓ на V |
| 5.10. | Регистрация в Клиринговой системе Поручения на внесение компенсационного взноса в виде ценных бумаг Участником клиринга – контрагентом по сделке | ↑ на V |
| 5.11. | Регистрация в Клиринговой системе Поручения на проведение расчетов по поставке (по поставочным контрактам срочного рынка) | |
| 5.11.1. | по обязательствам участника клиринга по поставке базисного актива | ↓ на V |
| 5.11.2. | по требованиям участника клиринга по поставке базисного актива | ↑ на V |
| 6. | Уплата / получение Компенсационного взноса | ↓ на V / ↑ на V |
| 7. | Расчеты по итогам клиринга по сделкам с кодом расчетов Z0 и Срочным отчетам на исполнение | |
| 7.1. | Исполнение обязательства по передаче ценных бумаг или нетто-обязательства по ценным бумагам в размере V | ↓ на V |
| 7.2. | Исполнение требования по передаче ценных бумаг или нетто-требования по ценным бумагам в размере V | ↑ на V |