

УТВЕРЖДЕНЫ

решением Наблюдательного совета  
НКО НКЦ (АО)

от «21» ноября 2022 года (Протокол № 11)

**ПРАВИЛА КЛИРИНГА  
НЕБАНКОВСКОЙ КРЕДИТНОЙ ОРГАНИЗАЦИИ-ЦЕНТРАЛЬНОГО  
КОНТРАГЕНТА «НАЦИОНАЛЬНЫЙ КЛИРИНГОВЫЙ ЦЕНТР»  
(АКЦИОНЕРНОЕ ОБЩЕСТВО).  
ЧАСТЬ III. ПРАВИЛА КЛИРИНГА НА ВАЛЮТНОМ РЫНКЕ И РЫНКЕ  
ДРАГОЦЕННЫХ МЕТАЛЛОВ**

Москва, 2022 г.

## СОДЕРЖАНИЕ

|   |    |
|---|----|
| РАЗДЕЛ I. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ .....   | 4  |
| Статья 1. Термины и определения .....   | 4  |
| Статья 2. Общие положения .....   | 5  |
| Статья 3. Клиринговые регистры .....  | 6  |
| РАЗДЕЛ II. ТРЕБОВАНИЯ К УЧАСТНИКАМ КЛИРИНГА .....   | 7  |
| Статья 4. Условия клирингового обслуживания. Порядок предоставления допуска к клиринговому обслуживанию .....   | 7  |
| Статья 5. Особенности приостановления и прекращения допуска к клиринговому обслуживанию .....   | 8  |
| Статья 6. Особенности открытия и порядок закрытия Торгово-клиринговых счетов Участника клиринга, порядок использования Торгово-клиринговых счетов 2-го и 3-го уровней .....   | 9  |
| РАЗДЕЛ III. МЕРЫ, НАПРАВЛЕННЫЕ НА УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ ПРИ ОСУЩЕСТВЛЕНИИ КЛИРИНГА .....   | 11 |
| Статья 7. Перечень мер, направленных на управление рисками при осуществлении клиринга .....   | 11 |
| Статья 8. Требования к Провайдерам ликвидности .....  | 12 |
| РАЗДЕЛ IV. ПОРЯДОК И УСЛОВИЯ ДОПУСКА ОБЯЗАТЕЛЬСТВ К КЛИРИНГУ ....   | 13 |
| ПОДРАЗДЕЛ IV-I. ПОРЯДОК ЗАКЛЮЧЕНИЯ ВНЕБИРЖЕВЫХ СДЕЛОК С ИНОСТРАННОЙ ВАЛЮТОЙ И ВНЕБИРЖЕВЫХ СДЕЛОК С ДРАГОЦЕННЫМИ МЕТАЛЛАМИ .....   | 13 |
| Статья 9. Возможность заключения Внебиржевых сделок с иностранной валютой и Внебиржевых сделок с драгоценными металлами .....   | 13 |
| Статья 10. Порядок заключения Внебиржевых сделок с иностранной валютой и Внебиржевых сделок с драгоценными металлами .....  | 13 |
| Статья 11. Особенности заключения Внебиржевых сделок с иностранной валютой и Внебиржевых сделок с драгоценными металлами с Провайдерами ликвидности .....   | 18 |
| Статья 12. Особенности заключения Внебиржевых сделок с иностранной валютой и Внебиржевых сделок с драгоценными металлами при подаче Участником клиринга Предложений посредством информирующего Участника клиринга ..... | 21 |
| ПОДРАЗДЕЛ IV-II. ПОРЯДОК ВЗАИМОДЕЙСТВИЯ С БИРЖЕЙ ПРИ ЗАКЛЮЧЕНИИ СДЕЛОК .....  | 25 |
| Статья 13. Порядок взаимодействия с Биржей при подаче заявок и заключении Сделок .....  | 25 |
| РАЗДЕЛ V. ПОРЯДОК ПРОВЕДЕНИЯ КЛИРИНГА .....   | 31 |
| Статья 14. Порядок проведения клиринговой сессии mark-to-market. Порядок возникновения и исполнения Маржинальных требований .....   | 31 |
| Статья 15. Вариационная маржа .....   | 33 |
| Статья 16. Порядок определения обязательств, подлежащих исполнению. Порядок исполнения обязательств, определенных по итогам клиринга .....  | 36 |
| Статья 17. Особенности возврата Обеспечения Участникам клиринга категории   |    |

|  |    |
|--|----|
| «К».....   | 39 |
| РАЗДЕЛ VI. ПОРЯДОК ОПЛАТЫ УСЛУГ. ОТЧЕТЫ ПО ИТОГАМ КЛИРИНГА .....   | 41 |
| Статья 18. Особенности оплаты услуг Клирингового центра, Биржи и Технического центра.....  | 41 |
| Статья 19. Порядок предоставления информации и отчетов по итогам клиринга ....   | 43 |
| РАЗДЕЛ VII. ПРОЧИЕ УСЛОВИЯ .....   | 47 |
| Статья 20. Особенности перевода обязательств и Обеспечения одного Участника клиринга другому Участнику клиринга .....  | 47 |
| Статья 21. Порядок действий при возникновении обстоятельств, которые могут повлиять на возможность заключения Внебиржевых сделок с иностранной валютой / Внебиржевых сделок с драгоценными металлами ..... | 47 |
| Статья 22. Особенности возврата обеспечения в драгоценных металлах. ....   | 48 |
| Приложение № 1 Временной регламент на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.....   | 49 |
| Приложение № 2 .....   | 51 |

## **РАЗДЕЛ I. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ**

Настоящие «Правила клиринга Небанковской кредитной организации-центрального контрагента «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество). Часть III. Правила клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов» (далее – Правила клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов) 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 с иностранной валютой и драгоценными металлами, заключенных на торгах, организуемых ПАО Московская Биржа или не на организованных торгах в соответствии с Правилами клиринга, а также порядок заключения Внебиржевых сделок с иностранной валютой и Внебиржевых сделок с драгоценными металлами с Участниками клиринга и/или Провайдерами ликвидности.

### **Статья 1. Термины и определения**

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

|   |   |
|---|---|
| <b><i>Внебиржевая сделка с драгоценным металлом -</i></b> | сделка с драгоценным металлом, заключаемая Клиринговым центром с Участником клиринга / Провайдером ликвидности не на организованных торгах.   |
| <b><i>Внебиржевая сделка с иностранной валютой -</i></b>  | сделка с иностранной валютой, заключаемая Клиринговым центром с Участником клиринга / Провайдером ликвидности не на организованных торгах.  |
| <b><i>Провайдер ликвидности -</i></b>                     | лицо, соответствующее требованиям, установленным Правилами клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, с которым Клиринговый центр заключил соглашение, определяющее порядок и условия заключения и исполнения Внебиржевых сделок с иностранной валютой и/или Внебиржевых сделок с драгоценными металлами. |
| <b><i>Расчетная цена -</i></b>                            | цена, используемая для расчета вариационной маржи по своп контракту / фьючерсному контракту, определяемая в соответствии с Правилами клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.   |
| <b><i>Сделка -</i></b>                                    | сделка с иностранной валютой / драгоценным металлом, по которой Клиринговый центр осуществляет клиринг и является стороной по Сделке, в том числе сделка спот, сделка своп, своп контракт или фьючерсный контракт, в том числе Внебиржевая сделка с иностранной валютой или Внебиржевая сделка с драгоценным металлом.  |

## **Статья 2. Общие положения**

- 2.1. Клиринговый центр осуществляет клиринг, выполняя функции центрального контрагента по всем Сделкам, стороной по которым являются Участники клиринга.
- 2.2. Клиринговый центр не осуществляет клиринг по Внебиржевым сделкам с иностранной валютой и Внебиржевым сделкам с драгоценными металлами, заключенным с Провайдерами ликвидности, и не осуществляет функции центрального контрагента для Провайдеров ликвидности.
- 2.3. Клиринговый центр осуществляет клиринг с частичным обеспечением и клиринг с полным обеспечением.
- 2.4. Клиринговый центр осуществляет клиринг с частичным обеспечением по Сделкам, заключенным Участниками клиринга категории «О», «Б» и «Б2».
- 2.5. Клиринговый центр осуществляет клиринг с полным обеспечением по Сделкам, заключенным Участниками клиринга категории «В».
- 2.6. На валютном рынке и рынке драгоценных металлов Клиринговый центр осуществляет клиринг в отношении следующих сделок (договоров), заключаемых на валютном рынке и рынке драгоценных металлов:
  - сделок купли-продажи иностранной валюты / драгоценных металлов;
  - сделок своп с иностранной валютой / драгоценным металлом;
  - фьючерсных договоров (контрактов);
  - своп-договоров (своп контрактов).
- 2.7. Клиринговый центр осуществляет клиринг в отношении следующих Внебиржевых сделок с иностранной валютой и Внебиржевых сделок с драгоценными металлами, заключаемых с Участниками клиринга:
  - сделок купли-продажи иностранной валюты / драгоценных металлов;
  - сделок своп с иностранной валютой / драгоценным металлом;
  - своп-договоров (своп контрактов).
- 2.8. Обеспечение в иностранной валюте, учитываемое по Расчетным кодам, не являющимся Расчетными кодами Единого пула, является иным обеспечением.
- 2.9. Порядок и сроки внесения и возврата Обеспечения определены общей частью Правил клиринга.
- 2.10. Перечень активов, передача Профилей которых возможна между Клиринговой системой валютного рынка и рынка драгоценных металлов и Клиринговой системой фондового рынка:
  - денежные средства в российских рублях;
  - денежные средства в иностранных валютах, с которыми возможно заключение Сделок на валютном рынке;
  - драгоценные металлы, с которыми возможно заключение Сделок на рынке

драгоценных металлов.

- 2.11. Сроки определения и исполнения обязательств, указанных в Правилах клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, 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 валютном рынке и рынке драгоценных металлов установлены Временным регламентом на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, являющимся приложением № 1 к Правилам клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.
- Сроки, не установленные Временным регламентом на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, определяются в соответствии с Временным регламентом, являющимся приложением к общей части Правил клиринга.
- 2.12. Техническим центром на валютном рынке и рынке драгоценных металлов является ПАО Московская Биржа.

### **Статья 3. Клиринговые регистры**

- 3.1. При осуществлении клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов Клиринговый центр открывает и ведет клиринговые регистры, предусмотренные общей частью Правил клиринга.
- 3.2. Помимо информации, указанной в общей части Правил клиринга, при осуществлении клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов на клиринговых регистрах Клиринговый центр учитывает:
- Единый лимит по Расчетному коду;
  - информацию об обязательствах и требованиях Участника клиринга по каждому обязательству по Сделке, допущенному к клирингу;
  - информацию об обязательствах Участника клиринга и Клирингового центра по уплате вариационной маржи в разрезе Расчетных кодов;
  - Нетто-обязательства / Нетто-требования Участника клиринга с каждой Датой исполнения в каждой валюте и каждом драгоценном металле в разрезе Расчетных кодов.
- 3.3. Порядок ведения клиринговых регистров определен в общей части Правил клиринга, а также в соответствующих статьях разделов IV и V Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.

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

### **Статья 4. Условия клирингового обслуживания. Порядок предоставления допуска к клиринговому обслуживанию**

- 4.1. На валютном рынке и рынке драгоценных металлов 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».
- 4.2. Участники клиринга категории «В» не могут являться сторонами по сделкам фикс, средневзвешенным сделкам, сторонами поставочных и расчетных фьючерсных контрактов, заключенных на основании заявок по фиксингу и сторонами Внебиржевых сделок своп с иностранной валютой / драгоценным металлом с Провайдерами ликвидности.
- 4.3. Допуск к клиринговому обслуживанию на валютном рынке и рынке драгоценных металлов предоставляется Участнику клиринга, соответствующему требованиям, установленным для соответствующей категории Участников клиринга в общей части Правил клиринга, а также требованиям, установленным настоящей статьей Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.
- 4.4. Для допуска к клиринговому обслуживанию Участник клиринга категории «В» должен соответствовать следующим требованиям:
- 4.4.1. иметь не менее одного Расчетного кода Участника клиринга, открытого в Клиринговом центре.
- 4.5. Для допуска к клиринговому обслуживанию Участник клиринга категории «Б» или «Б2» должен соответствовать требованию, указанному в пункте 4.4.1 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, а также следующим требованиям:
- 4.5.1. Участник клиринга - Некредитная организация, не являющийся профессиональным участником рынка ценных бумаг или лицом, осуществляющим иную лицензируемую деятельность на финансовом рынке, и Участник клиринга, являющийся Некредитной организацией – Нерезидентом, не имеющий действующего специального разрешения на осуществление операций на финансовых рынках, выданного компетентным органом государства учреждения Участника клиринга:
- иметь собственные средства (капитал) не менее, чем 50 000 000 000 (пятьдесят миллиардов) российских рублей, либо
  - иметь собственные средства (капитал) не менее, чем 20 000 000 000 (двадцать

миллиардов) российских рублей и иметь следующий рейтинг либо организация, имеющая право прямо или косвенно осуществлять контроль за деятельностью Участника клиринга, имеет следующий рейтинг:

- 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 "Ba3" по классификации рейтингового агентства "Moody's Investors Service", либо
- кредитный рейтинг по национальной шкале не менее А- по классификации Аналитического Кредитного Рейтингового Агентства (АКРА) или рейтингового агентства «Эксперт РА».

- 4.6. Допуск к клиринговому обслуживанию Участников клиринга – Некредитных организаций, осуществляющих деятельность на основании лицензии на осуществление деятельности по пенсионному обеспечению и пенсионному страхованию и/или деятельности по управлению инвестиционными фондами, паевыми инвестиционными фондами и негосударственными пенсионными фондами, предоставляется только с категорией «В».
- 4.7. Для заключения сделок с драгоценными металлами / Внебиржевых сделок с драгоценными металлами Участником клиринга должен быть открыт в Клиринговом центре торговый банковский счет в соответствующем драгоценном металле. В случае заключения Участником клиринга сделок с драгоценными металлами/ Внебиржевых сделок с драгоценными металлами в интересах и/или за счет клиентов Участник клиринга вправе открыть в Клиринговом центре отдельный торговый банковский счет для совершения указанных в настоящем пункте сделок в интересах и/или за счет клиентов-физических лиц. Участником клиринга может быть открыто в Клиринговом центре несколько торговых банковских счетов, указанных в настоящем пункте.
- 4.8. К заключению Внебиржевых сделок с иностранной валютой и Внебиржевых сделок с драгоценными металлами допускаются Участники клиринга, допущенные к клиринговому обслуживанию на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.

## **Статья 5. Особенности приостановления и прекращения допуска к клиринговому обслуживанию**

- 5.1. Клиринговый центр вправе приостановить допуск к клиринговому обслуживанию Участника клиринга категории «О», категории «Б», категории «Б2» или категории «В» по основаниям, предусмотренным общей частью Правил клиринга.
- 5.2. Клиринговый центр вправе установить Участнику клиринга категории «Б» или «Б2» категорию «В» по основаниям, предусмотренным общей частью Правил клиринга, а также при несоответствии Участника клиринга - Некредитной организации, не являющегося профессиональным участником рынка ценных бумаг или лицом, осуществляющим деятельность на основании лицензии на осуществление страхования, и/или перестрахования, и/или взаимного страхования, и/или посреднической деятельности в качестве страхового брокера, или Участника



клиринга, являющегося Некредитной организацией – Нерезидентом, а также не имеющего действующего специального разрешения на осуществление операций на финансовых рынках, выданного компетентным органом государства учреждения Участника клиринга, требованиям, установленным подпунктом 4.5.1 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.

## **Статья 6. Особенности открытия и порядок закрытия Торгово-клиринговых счетов Участника клиринга, порядок использования Торгово-клиринговых счетов 2-го и 3-го уровней**

- 6.1. На валютном рынке и рынке драгоценных металлов необходимо открытие Торгово-клиринговых счетов Участника клиринга (Торгово-клиринговых счетов на валютном рынке и рынке драгоценных металлов), а также возможно открытие Торгово-клиринговых счетов 2-го уровня и Торгово-клиринговых счетов 3-го уровня.
- 6.2. Участник клиринга категории «О», «Б» или «Б2» вправе с использованием Клиринговой системы установить для Торгово-клирингового счета Участника клиринга признак «запрет коротких продаж» и/или для Расчетного кода Участника клиринга признак «запрет необеспеченных покупок».
- По Сделкам, заключенным с указанием Торгово-клирингового счета Участника клиринга с признаком «запрет коротких продаж», осуществляется клиринг с полным обеспечением по валюте лота.
- По Сделкам, заключенным с указанием Торгово-клирингового счета Участника клиринга, в состав которого входит Расчетный код Участника клиринга с признаком «запрет необеспеченных покупок», осуществляется клиринг с полным обеспечением по сопряженной валюте.
- 6.3. 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».
- 6.4. 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».
- 6.5. Клиринговый центр посредством ПТК ТЦ передает Бирже информацию:
- о зарегистрированных Торгово-клиринговых счетах Участников клиринга, Торгово-клиринговых счетах 2-го и 3-го уровней;
  - об Участниках торгов, имеющих право подавать заявки с указанием Торгово-клиринговых счетов 2-го уровня;
  - о зарегистрированных Обособленных клиентах;
  - иную информацию, предусмотренную Правилами торгов на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.

- 6.6. Расчет Единого лимита по Расчетному коду, определение Нетто-обязательств / Нетто-требований, Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований, Задолженностей Участника клиринга, проверка возможности регистрации заявок, перечисление и учет денежных средств и драгоценных металлов Участника клиринга, исполнение (прекращение) обязательств по Сделкам, возникновение и прекращение Маржинального требования, уплата комиссионных вознаграждений осуществляется по Расчетному коду Участника клиринга.
- 6.7. Клиринговый центр осуществляет блокировку Торгово-клиринговых счетов Участника клиринга в порядке, определенном Регламентом открытия, закрытия и блокировки Торгово-клиринговых счетов.
- 6.8. Закрытие Торгово-клирингового счета Участника клиринга осуществляется в порядке, определенном Регламентом открытия, закрытия и блокировки Торгово-клиринговых счетов.

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

#### **Статья 7. Перечень мер, направленных на управление рисками при осуществлении клиринга**

- 7.1. В целях снижения рисков, связанных с осуществлением клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, Клиринговый центр применяет меры, предусмотренные общей частью Правил клиринга.
- 7.2. Гарантийный фонд валютного рынка и рынка драгоценных металлов формируется Клиринговым центром за счет взносов в Гарантийный фонд всех Участников клиринга категорий «О», «Б» и «Б2», допущенных к клирингу на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.  
Минимальный размер взноса в Гарантийный фонд каждого Участника клиринга категорий «О», «Б» и «Б2» составляет 10 000 000 (десять миллионов) российских рублей.
- 7.3. Обеспечение под стресс обязаны вносить Участники клиринга категорий «О», «Б» и «Б2».  
Порядок определения размера Обеспечения под стресс Участника клиринга установлен Методикой определения размера Обеспечения под стресс.
- 7.4. 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 Торгово-клиринговым счетам Участника клиринга устанавливается признак «запрет коротких продаж» и всем Расчетным кодам Участника клиринга признак «запрет необеспеченных покупок»;
  - также применяются иные действия, предусмотренные общей частью Правил клиринга.
- 7.5. При использовании взноса Недобросовестного участника клиринга в Гарантийный фонд валютного рынка и рынка драгоценных металлов и/или Обеспечения под стресс на валютном рынке и рынке драгоценных металлов:
- Участнику клиринга категории «Б» или «Б2» устанавливается категория «В»;
  - Участнику клиринга категории «О» по всем Торгово-клиринговым счетам Участника клиринга устанавливается признак «запрет коротких продаж» и всем Расчетным кодам Участника клиринга признак «запрет необеспеченных покупок».
- 7.6. В случае возмещения Недобросовестным участником клиринга средств Гарантийного фонда валютного рынка и рынка драгоценных металлов и Обеспечения под стресс на валютном рынке и рынке драгоценных металлов в

течение 1 (одного) Расчетного дня после направления Клиринговым центром такому Недобросовестному Участнику клиринга Маржинального требования по фонду и/или Маржинального требования по Обеспечению под стресс Клиринговый центр вправе:

- установить Участнику клиринга категории «В» категорию «Б» или «Б2»;
- снять Участнику клиринга категории «О» признак «запрет коротких продаж» и признак «запрет необеспеченных покупок».

7.7. На валютном рынке и рынке драгоценных металлов контроль достаточности Обеспечения осуществляется с использованием Единого лимита по Расчетному коду.

## **Статья 8. Требования к Провайдерам ликвидности**

8.1. Провайдер ликвидности должен соответствовать следующим требованиям:

- 1) иметь действующее специальное разрешение на осуществление операций на финансовых рынках, выданное компетентным органом государства учреждения Провайдера ликвидности;
- 2) иметь кредитный рейтинг международных рейтинговых агентств на уровне не ниже А- по классификации рейтинговых агентств "Standard & Poor's" или "Fitch Ratings" либо А3 по классификации рейтингового агентства "Moody's Investors Service";
- 3) иметь собственные средства (капитал) не менее 1 000 000 000 (одного миллиарда) долларов США.

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

### **ПОДРАЗДЕЛ IV-1. ПОРЯДОК ЗАКЛЮЧЕНИЯ ВНЕБИРЖЕВЫХ СДЕЛОК С ИНОСТРАННОЙ ВАЛЮТОЙ И ВНЕБИРЖЕВЫХ СДЕЛОК С ДРАГОЦЕННЫМИ МЕТАЛЛАМИ**

#### **Статья 9. Возможность заключения Внебиржевых сделок с иностранной валютой и Внебиржевых сделок с драгоценными металлами**

- 9.1. Клиринговый центр составляет и утверждает список предметов обязательств из Внебиржевых сделок с иностранной валютой и Внебиржевых сделок с драгоценными металлами (далее - Список), Спецификацию Внебиржевых сделок с иностранной валютой и Спецификацию Внебиржевых сделок с драгоценными металлами.
- 9.2. С момента вступления в силу Списка допускается заключение Внебиржевых сделок с иностранной валютой / Внебиржевых сделок с драгоценными металлами, параметры которых содержатся в Списке, и осуществление клиринга по указанным Внебиржевым сделкам с иностранной валютой / Внебиржевым сделкам с драгоценными металлами на основании соответствующей Спецификации и Правил клиринга.
- 9.3. Список и Спецификации раскрываются на Сайте Клирингового центра.
- 9.4. Клиринговый центр вправе установить Верхнюю и Нижнюю границу ценового коридора для иностранной валюты / драгоценного металла, предлагаемой / предлагаемого для покупки/продажи при заключении Внебиржевых сделок с иностранной валютой / Внебиржевых сделок с драгоценными металлами (далее по тексту настоящего подраздела Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов – валюта лота), в валюте, за которую производится покупка или продажа (далее по тексту настоящего подраздела Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов – сопряженная валюта).
- 9.5. Клиринговый центр, являясь стороной Внебиржевых сделок своп с иностранной валютой / драгоценным металлом, заключаемых с Участниками клиринга, при выполнении им функций центрального контрагента, передает Репозитарию на основании договора, заключенного с Репозитарием, информацию о заключенных с Участниками клиринга Внебиржевых сделках своп с иностранной валютой / драгоценным металлом, в том числе на основании информации, полученной от Участника клиринга, в объеме, порядке и сроки, установленные нормативными актами Банка России.

#### **Статья 10. Порядок заключения Внебиржевых сделок с иностранной валютой и Внебиржевых сделок с драгоценными металлами**

- 10.1. Участники клиринга вправе заключать Внебиржевые сделки с иностранной валютой и Внебиржевые сделки с драгоценными металлами в соответствии с Правилами клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов:

- от своего имени и за свой счет;
  - от своего имени и за счет своего клиента.
- 10.2. При заключении Внебиржевых сделок с иностранной валютой и Внебиржевых сделок с драгоценными металлами с Участниками клиринга Клиринговый центр осуществляет функции центрального контрагента.
- 10.3. В целях заключения Внебиржевой сделки с иностранной валютой или Внебиржевой сделки с драгоценным металлом Участник клиринга подает в Клиринговую систему Предложение, являющееся офертой на заключение Внебиржевой сделки с иностранной валютой / Внебиржевой сделки с драгоценным металлом. Предложение Участника клиринга адресовано Клиринговому центру.
- 10.4. Предложения на заключение Внебиржевых сделок с иностранной валютой / Внебиржевых сделок с драгоценными металлами, контрагентами Клирингового центра по которым являются Участники клиринга, подаются Участниками клиринга с использованием Системы заключения внебиржевых сделок в соответствии с Правилами клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов и Правилами заключения внебиржевых сделок НКО НКЦ (АО), являющимися приложением № 2 к Правилам клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов. Предложение, подаваемое с использованием Системы заключения внебиржевых сделок, считается поданным в Клиринговую систему с момента регистрации в Клиринговой системе.
- 10.5. Предложение формируется как электронный документ, подписанный ПЭП Участника клиринга или Клирингового центра. Такие электронные документы, подписанные ПЭП Участника клиринга или Клирингового центра, признаются электронными документами, равнозначными документам на бумажном носителе, подписанным собственноручной подписью. Порядок использования ПЭП определен общей частью Правил клиринга.
- 10.6. Предложения могут подаваться в срок, установленный Временным регламентом на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.
- 10.6.1. Срок действия Предложения Участника клиринга на заключение Внебиржевой сделки с иностранной валютой / Внебиржевой сделки с драгоценным металлом, конечным контрагентом по которой является Участник клиринга, ограничен временем подачи Предложений и заключения Внебиржевых сделок с иностранной валютой / Внебиржевых сделок с драгоценными металлами, установленным Временным регламентом на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.
- 10.7. Предложение, подаваемое Участником клиринга, должно содержать:
- код Внебиржевой сделки с иностранной валютой / код Внебиржевой сделки с драгоценным металлом;
  - указание на Режим заключения внебиржевой сделки;
  - условия Внебиржевой сделки с иностранной валютой / Внебиржевой сделки с драгоценным металлом, предусмотренные Спецификацией;
  - Торгово-клиринговый счет 1-го, 2-го или 3-го уровня (за исключением

Предложений, подаваемых посредством информирующего Участника клиринга).

- 10.8. Предложение, подаваемое Участником клиринга, может содержать указание на Участника клиринга, Предложение которого может быть признано Предложением с совпадающими условиями (для Предложений на заключение Внебиржевой сделки с иностранной валютой / Внебиржевой сделки с драгоценным металлом, конечным контрагентом по которой является Участник клиринга).
- 10.9. Предложение, подаваемое Участником клиринга, может содержать краткий код клиента Участника торгов, совпадающего в одном лице с Участником клиринга (для Предложений на заключение Внебиржевой сделки с иностранной валютой / Внебиржевой сделки с драгоценным металлом, конечным контрагентом по которой является Участник клиринга).
- 10.10. После того, как информация о поданном Участником клиринга Предложении, направленном на заключение Внебиржевой сделки с иностранной валютой / Внебиржевой сделки с драгоценным металлом, стала доступной Клиринговому центру посредством Клиринговой системы, Клиринговый центр осуществляет проверку возможности регистрации такого Предложения следующим образом:
  - 10.10.1. Клиринговый центр проверяет соответствие условий, указанных в Предложении, требованиям, установленным в Списке для данной Внебиржевой сделки с иностранной валютой / Внебиржевой сделки с драгоценным металлом, и условиям, предусмотренным соответствующей Спецификацией;
  - 10.10.2. 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 9.4 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов для валюты лота за сопряженную валюту, по которым подано Предложение (в случае если такие границы ценового коридора установлены Клиринговым центром).
  - 10.10.3. Клиринговый центр выполняет проверки, аналогичные проверкам, установленным в статье 13 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов для заявок на заключение биржевых Сделок.
- 10.11. При положительном результате всех проверок, указанных в пункте 10.10 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, Клиринговый центр регистрирует в Клиринговой системе полученное Предложение. При отрицательном результате хотя бы одной из указанных проверок, Клиринговый центр направляет Участнику клиринга отказ в регистрации Предложения.
  - 10.11.1. Клиринговый центр может направить Участнику клиринга отказ в регистрации Предложения в иных случаях, установленных Правилами клиринга.
  - 10.11.2. 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.

- 10.12. С момента регистрации в Клиринговой системе полученного Предложения, отзыв такого предложения Участником клиринга не допускается, за исключением Предложений, поданных в режиме «Сделки с ЦК», без привлечения информирующего Участника клиринга.
- 10.13. В случаях, установленных Правилами клиринга, Клиринговый центр вправе удалить из Клиринговой системы Предложения, поданные Участником клиринга.
- 10.14. Немедленно после регистрации в Клиринговой системе Предложения, поданного Участником клиринга, Клиринговый центр осуществляет проверку наличия Предложений Участников клиринга, имеющих совпадающие условия.
- 10.15. Предложениями, имеющими совпадающие условия, являются Предложения противоположной направленности, поданные в одном Режиме заключения Внебиржевой сделки с иностранной валютой, со следующими одинаковыми условиями:
- код валюты лота и сопряженной валюты / код сделки своп / своп контракта;
  - количество валюты лота;
  - цена продажи или покупки в сопряженной валюте / цена сделки своп / своп контракта;
  - Дата / Даты исполнения обязательств по Сделке;
  - Предложение подано Участником клиринга, указанным в качестве Участника клиринга, Предложение которого может быть признано Предложением с совпадающими условиями (в случае указания).
- 10.16. При наличии Предложений, поданных Участниками клиринга и имеющих совпадающие условия, акцептом Предложений (оферт) со стороны Клирингового центра является внесение в реестр Внебиржевых сделок двух Внебиржевых сделок с иностранной валютой / Внебиржевых сделок с драгоценными металлами с данными Участниками клиринга. Момент отображения в Клиринговой системе информации из реестра Внебиржевых сделок о двух Внебиржевых сделках с иностранной валютой / Внебиржевых сделках с драгоценными металлами с данными Участниками клиринга считается моментом получения такими Участниками клиринга – оферентами акцепта Клирингового центра на заключение Внебиржевой сделки с иностранной валютой / Внебиржевой сделки с драгоценным металлом 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 иностранной валютой / Внебиржевых сделок с драгоценными металлами между Участниками клиринга и Клиринговым центром.
- Местом заключения такой сделки является город Москва Российской Федерации.
- 10.16.1. Информация о заключении Внебиржевых сделок с иностранной валютой и/или Внебиржевых сделок с драгоценными металлами, контрагентами Клирингового центра по которым являются Участники клиринга, передается Клиринговым центром в Систему заключения внебиржевых сделок.



- 10.17. При заключении Внебиржевой сделки с иностранной валютой / Внебиржевой сделки с драгоценным металлом с Участником клиринга Клиринговый центр:
- присваивает заключенной Внебиржевой сделке с иностранной валютой / Внебиржевой сделке с драгоценным металлом 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 иностранной валютой / Внебиржевая сделка с драгоценным металлом, без учета такого Предложения и с учетом заключенной Внебиржевой сделки с иностранной валютой / Внебиржевой сделки с драгоценным металлом;
  - допускает к клирингу обязательства по заключенной Внебиржевой сделке с иностранной валютой / Внебиржевой сделке с драгоценным металлом;
  - по Внебиржевой сделке с иностранной валютой / Внебиржевой сделке с драгоценным металлом, заключенной с указанием Торгово-клирингового счета Участника клиринга, изменяет с учетом заключенной Внебиржевой сделки с иностранной валютой / Внебиржевой сделки с драгоценным металлом Нетто-обязательство и/или Нетто-требование Участника клиринга по Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета Участника клиринга, указанного в Предложении, на основании которого заключена Внебиржевая сделка с иностранной валютой / и Внебиржевая сделка с драгоценным металлом, с Датами исполнения, соответствующими Дате (Датам) исполнения обязательств по заключенной Внебиржевой сделке с иностранной валютой / Внебиржевой сделке с драгоценным металлом;
  - по Внебиржевой сделке с иностранной валютой / Внебиржевой сделке с драгоценным металлом, заключенной с указанием Торгово-клирингового счета 2-го уровня, изменяет с учетом заключенной Внебиржевой сделки с иностранной валютой / Внебиржевой сделке с драгоценным металлом Нетто-обязательство и/или Нетто-требование, учитываемое по Расчетному коду 2-го уровня, входящему в состав Торгово-клирингового счета 2-го уровня, указанного в Предложении, и Нетто-обязательство и/или Нетто-требование Участника клиринга по Расчетному коду, соответствующему Торгово-клиринговому счету 2-го уровня, указанному в Предложении, на основании которого заключена Внебиржевая сделка с иностранной валютой / Внебиржевая сделка с драгоценным металлом, с Датами исполнения, соответствующими Дате (Датам) исполнения обязательств по заключенной Внебиржевой сделке с иностранной валютой / Внебиржевой сделке с драгоценным металлом;
  - по Внебиржевой сделке с иностранной валютой / Внебиржевой сделке с драгоценным металлом, заключенной с указанием Торгово-клирингового счета 3-го уровня, изменяет с учетом заключенной Внебиржевой сделки с иностранной валютой / Внебиржевой сделке с драгоценным металлом Нетто-обязательство и/или Нетто-требование, учитываемое по Расчетному коду 3-го уровня, входящему в состав Торгово-клирингового счета 3-го уровня, указанного в Предложении, и Нетто-обязательство и/или Нетто-требование,

учитываемое по Расчетному коду / Расчетному коду 2-го уровня, соответствующему Торгово-клиринговому счету 3-го уровня, указанному в Предложении, на основании которого заключена Внебиржевая сделка с иностранной валютой / Внебиржевая сделка с драгоценным металлом, с Датами исполнения, соответствующими Дате (Датам) исполнения обязательств по заключенной Внебиржевой сделке с иностранной валютой / Внебиржевой сделке с драгоценным металлом.

- 10.18. Клиринговый центр ведет реестр Предложений, поданных Участниками клиринга и Клиринговым центром, и реестр Внебиржевых сделок с иностранной валютой и Внебиржевых сделок с драгоценными металлами, заключенных с Участниками клиринга и/или Провайдерами ликвидности.

### **Статья 11. Особенности заключения Внебиржевых сделок с иностранной валютой и Внебиржевых сделок с драгоценными металлами с Провайдерами ликвидности**

- 11.1. При заключении Внебиржевых сделок с иностранной валютой или Внебиржевых сделок с драгоценными металлами с Участниками клиринга и Провайдерами ликвидности Клиринговый центр осуществляет функции центрального контрагента.
- 11.2. Клиринговый центр посредством Клиринговой системы предоставляет Участникам клиринга без изменений получаемую от Провайдера ликвидности информацию, необходимую для направления Участником клиринга Предложения Клиринговому центру, в том числе информацию о валюте лота, цене в сопряженной валюте, количестве валюты лота, предлагаемой для покупки/продажи (далее – котировка Провайдера ликвидности).
- 11.2.1. Срок действия Предложения Участника клиринга ограничивается моментом окончания проверки Клиринговым центром наличия соответствующей котировки Провайдера ликвидности, удовлетворяющей условиям Предложения, поданного Участником клиринга. Условия, при которых котировка Провайдера ликвидности считается удовлетворяющей Предложению Участника клиринга, содержатся в пункте 11.5 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.
- 11.3. При отрицательном результате хотя бы одной из проверок, указанных в пункте 10.10 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, Клиринговый центр удаляет Предложение из Клиринговой системы.
- 11.4. Немедленно после регистрации в Клиринговой системе Предложения, поданного Участником клиринга, Клиринговый центр осуществляет проверку наличия котировки Провайдера ликвидности, удовлетворяющей зарегистрированному в Клиринговой системе Предложению, поданному Участником клиринга.
- 11.5. Котировка Провайдера ликвидности считается удовлетворяющей зарегистрированному в Клиринговой системе Предложению, поданному Участником клиринга, при соблюдении следующих условий:
- котировка Провайдера ликвидности и Предложение, поданное Участником клиринга, имеют противоположную направленность;
  - котировка Провайдера ликвидности и Предложение, поданное Участником

клиринга, содержат одинаковые наименование валюты лота, наименование сопряженной валюты и Дату исполнения обязательств по Сделке;

- котировка Провайдера ликвидности соответствует условиям Предложения, поданного в соответствии с требованиями Режима заключения Внебиржевой сделки;
- цена, указанная в котировке Провайдера ликвидности, не больше, чем цена покупки (не меньше, чем цена продажи), указанная в Предложении, поданном Участником клиринга.

11.6. При наличии соответствующей котировки Провайдера ликвидности, удовлетворяющей условиям Предложения, поданного Участником клиринга при соблюдении ограничений, установленных Клиринговым центром в отношении Провайдера ликвидности, Клиринговый центр в целях заключения Внебиржевой сделки с иностранной валютой / Внебиржевой сделки с драгоценным металлом с Участником клиринга подает в Клиринговую систему Предложение, являющееся акцептом оферты Участника клиринга, и заключает две Внебиржевые сделки с иностранной валютой / две Внебиржевые сделки с драгоценными металлами – с Участником клиринга, подавшим Предложение, и с Провайдером ликвидности. Порядок заключения указанных сделок содержится в пунктах 11.12 и 11.13 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.

11.7. Участник клиринга и Клиринговый центр устанавливают, что Предложение (акцепт) Клирингового центра, содержащий условия о цене и объеме Внебиржевой сделки с иностранной валютой / Внебиржевой сделки с драгоценным металлом, удовлетворяющие условиям пункта 11.12 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, является акцептом, удовлетворяющим условиям Предложения (оферты) Участника клиринга, и соглашение между Участником клиринга и Клиринговым центром о существенных условиях Внебиржевой сделки с иностранной валютой / Внебиржевой сделки с драгоценным металлом считается достигнутым.

11.8. Внебиржевая сделка с Участником клиринга, подавшим Предложение в адрес Клирингового центра, заключается путем направления ему ответного Предложения Клирингового центра. Момент отображения в Клиринговой системе ответного Предложения Клирингового центра (акцепта) считается моментом получения Участником клиринга согласия Клирингового центра на заключение Внебиржевой сделки с иностранной валютой / Внебиржевой сделки с драгоценным металлом и является моментом заключения Внебиржевой сделки с иностранной валютой / Внебиржевой сделки с драгоценным металлом между Участником клиринга и Клиринговым центром.

Местом заключения такой сделки является город Москва Российской Федерации.

11.9. Особенности заключения Внебиржевых сделок своп с иностранной валютой / драгоценным металлом в Режиме «Аукцион RFS» установлены Правилами заключения внебиржевых сделок НКО НКЦ (АО), являющимися приложением № 2 к Правилам клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.

- 11.10. Клиринговый центр не несет ответственности за убытки, которые может понести Участник клиринга в случае заключения Внебиржевой сделки с иностранной валютой / Внебиржевой сделки с драгоценным металлом на условиях, отличающихся от условий, содержащихся в изначально поданном Участником клиринга Предложении.
- 11.11. Внебиржевая сделка с Провайдером ликвидности заключается в порядке, предусмотренном соглашением, заключенным Клиринговым центром с Провайдером ликвидности, определяющим порядок и условия заключения и исполнения Внебиржевых сделок с иностранной валютой/ Внебиржевых сделок с драгоценными металлами.
- 11.12. Цена Внебиржевой сделки с иностранной валютой/ Внебиржевой сделки с драгоценным металлом, заключаемой Клиринговым центром с Участником клиринга, и Внебиржевой сделки с иностранной валютой/ Внебиржевой сделки с драгоценным металлом, заключаемой Клиринговым центром с Провайдером ликвидности, равна цене, указанной в Предложении, поданном Участником клиринга, либо равна цене большей, чем цена, указанная Участником клиринга в Предложении на продажу иностранной валюты/ драгоценного металла, либо равна цене меньшей, чем цена, указанная Участником клиринга в Предложении на покупку иностранной валюты / драгоценного металла. При этом цены указанных в настоящем пункте Внебиржевой сделки с иностранной валютой/ Внебиржевой сделки с драгоценным металлом, заключаемой Клиринговым центром с Участником клиринга, и Внебиржевой сделки с иностранной валютой/ Внебиржевой сделки с драгоценным металлом, заключаемой Клиринговым центром с Провайдером ликвидности, равны.
- Объем Внебиржевой сделки с иностранной валютой/ Внебиржевой сделки с драгоценным металлом, заключаемой Клиринговым центром с Участником клиринга, и Внебиржевой сделки с иностранной валютой/ Внебиржевой сделки с драгоценным металлом, заключаемой Клиринговым центром с Провайдером ликвидности, равен минимальному объему из указанных в Предложении, поданном Участником клиринга, либо в котировке Провайдера ликвидности. При этом объемы указанных в настоящем пункте Внебиржевой сделки с иностранной валютой/ Внебиржевой сделки с драгоценным металлом, заключаемой Клиринговым центром с Участником клиринга, и Внебиржевой сделки с иностранной валютой/ Внебиржевой сделки с драгоценным металлом, заключаемой Клиринговым центром с Провайдером ликвидности, равны.
- 11.13. При отсутствии в Клиринговой системе котировки Провайдера ликвидности, удовлетворяющей условиям Предложения Участника клиринга, предусмотренным пунктом 11.5 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, Клиринговый центр удаляет Предложение, поданное Участником клиринга, из Клиринговой системы в связи с истечением срока действия указанного Предложения и 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.

## **Статья 12. Особенности заключения Внебиржевых сделок с иностранной валютой и Внебиржевых сделок с драгоценными металлами при подаче Участником клиринга Предложений посредством информирующего Участника клиринга**

12.1. Участник клиринга вправе подавать в Клиринговую систему свои Предложения на заключение Внебиржевых сделок с иностранной валютой и Внебиржевых сделок с драгоценными металлами в Режиме «Сделки с ЦК» с привлечением другого Участника клиринга (далее – информирующий Участник клиринга), передающего сформированное и подписанное в соответствии с требованиями Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов Предложение Участника клиринга-заявителя в Клиринговую систему.

Участник клиринга, подающий в Клиринговую систему свои Предложения с привлечением информирующего Участника клиринга, именуется далее по тексту настоящей статьи «Участник клиринга – заявитель».

12.2. Для реализации возможности подачи Предложений через информирующего Участника клиринга Участник клиринга – заявитель подает в Клиринговый центр заявление по форме, установленной Клиринговым центром, и содержащее:

12.2.1. Идентификатор информирующего Участника клиринга;

12.2.2. Торгово-клиринговый счет 1-го, 2-го или 3-го уровня, который может быть указан в Предложениях Участника клиринга – заявителя, подаваемых с привлечением информирующего Участника клиринга. В состав Торгово-клирингового счета 1-го, 2-го или 3-го уровня, должен входить Расчетный код, имеющий признак, указывающий на модель использования Расчетного кода: для заключения сделок Участником клиринга, совпадающим в одном лице с Участником торгов, и/или для заключения внебиржевых сделок Участником клиринга.

12.3. После получения заявления, указанного в пункте 12.2 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, Клиринговый центр формирует и направляет Участнику клиринга – заявителю специальный код, который должен указываться Участником клиринга – заявителем в сформированных им Предложениях, которые информирующий Участник клиринга направляет в Клиринговую систему в порядке, предусмотренном настоящей статьёй Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов (далее – Код для направления Предложения).

Код для направления Предложения однозначно определяет соответствие Участника клиринга – заявителя, Торгово-клирингового счета Участника клиринга – заявителя и информирующего Участника клиринга, с привлечением которого данный Участник клиринга – заявитель может подавать Предложения.

12.4. Предложение, сформированное Участником клиринга – заявителем и направляемое в Клиринговую систему информирующим Участником клиринга, должно содержать Код для направления Предложения.

12.5. Предложение, сформированное Участником клиринга – заявителем и направленное в Клиринговую систему информирующим Участником клиринга, должно содержать указание на Участника клиринга, Предложение которого может быть признано Предложением с совпадающими условиями. При этом Идентификатор Участника

клиринга, Предложение которого может быть признано Предложением с совпадающими условиями, должен соответствовать Идентификатору информирующего Участника клиринга или Идентификатору другого Участника клиринга – заявителя, Предложение которого направлено тем же информирующим Участником клиринга.

- 12.6. В случае отказа в регистрации Предложения Участника клиринга – заявителя и/или Предложения информирующего Участника клиринга, в том числе в случае несоответствия Предложения Участника клиринга – заявителя требованиям, установленным в пунктах 12.4, 12.5 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, Клиринговый центр направляет информирующему Участнику клиринга и Участнику клиринга – заявителю отказ в регистрации их Предложений.
- 12.7. Для заключения Внебиржевой сделки с иностранной валютой / Внебиржевой сделки с драгоценным металлом на основании Предложения Участника клиринга – заявителя, направленного в Клиринговую систему информирующим Участником клиринга, и Предложения информирующего Участника клиринга, являющегося Предложением с совпадающими условиями (или другого Участника клиринга – заявителя, Предложение которого является Предложением с совпадающими условиями и направлено тем же информирующим Участником клиринга), информирующий Участник клиринга направляет в Клиринговую систему сообщение о готовности заключить сделку, содержащее следующие условия заключения Внебиржевой сделки с иностранной валютой / Внебиржевой сделки с драгоценным металлом:
- цена Внебиржевой сделки с иностранной валютой / Внебиржевой сделки с драгоценным металлом равна цене, указанной в Предложениях, направленных информирующим Участником клиринга,
  - объем Внебиржевой сделки с иностранной валютой / Внебиржевой сделки с драгоценным металлом равен объему, указанному в Предложениях, направленных информирующим Участником клиринга, либо меньше объема, указанного в Предложениях, направленных информирующим Участником клиринга.
- 12.8. Немедленно после регистрации в Клиринговой системе Предложения, сформированного Участником клиринга – заявителем и направленного в Клиринговую систему информирующим Участником клиринга, и Предложения информирующего Участника клиринга, являющегося Предложением с совпадающими условиями (или другого Участника клиринга – заявителя, Предложение которого является Предложением с совпадающими условиями и направлено тем же информирующим Участником клиринга), Клиринговый центр осуществляет проверку наличия сообщения о готовности заключить сделку или сообщения об отказе от заключения сделки от информирующего Участника клиринга.
- 12.8.1. При получении сообщения об отказе от заключения сделки от информирующего Участника клиринга Клиринговый центр удаляет из Клиринговой системы Предложение Участника клиринга – заявителя и Предложение информирующего Участника клиринга, являющееся Предложением с совпадающими условиями (или

- другого Участника клиринга – заявителя, Предложение которого является Предложением с совпадающими условиями и направлено тем же информирующим Участником клиринга).
- 12.8.2. При получении сообщения о готовности заключить сделку от информирующего Участника клиринга Клиринговый центр заключает Внебиржевые сделки с иностранной валютой / Внебиржевые сделки с драгоценными металлами с Участником клиринга – заявителем и информирующим Участником клиринга, Предложение которого является Предложением с совпадающими условиями (или с другим Участником клиринга – заявителем, Предложение которого является Предложением с совпадающими условиями и направлено тем же информирующим Участником клиринга) в соответствии с пунктом 10.16 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов на условиях, указанных в сообщении о готовности заключить сделку.
- 12.8.3. В случае непредоставления информирующим Участником клиринга сообщения о готовности заключить сделку или в случае получения Клиринговым центром сообщения об отказе от заключения сделки до окончания периода подачи Предложений Клиринговый центр удаляет из Клиринговой системы Предложение Участника клиринга – заявителя и Предложение информирующего Участника клиринга (или другого Участника клиринга – заявителя, Предложения которого является Предложением с совпадающими условиями и направлено тем же информирующим Участником клиринга) с совпадающими условиями.
- 12.9. Процедура аутентификации в отношении Предложений, поданных Участником клиринга – заявителем, с целью заключения сделок в Режиме «Сделки с ЦК» с привлечением информирующего Участника клиринга осуществляется Техническим центром с использованием Клиринговой системы в момент получения Клиринговой системой такого Предложения путем проверки соответствия Кода для направления Предложения Клиринговому идентификатору, присвоенному Техническим центром Участнику клиринга – заявителю и Клиринговому идентификатору информирующего Участника клиринга, указанного Участником клиринга – заявителем при подаче заявления, указанного в пункте 12.2 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.
- 12.10. После получения Предложения в порядке, предусмотренном пунктом 12.8 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов и прохождения процедуры аутентификации, предусмотренной пунктом 12.9 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных, Клиринговый центр направляет Участнику клиринга – заявителю сообщение о поступлении в Клиринговую систему от информирующего Участника клиринга Предложения, сформированного Участником клиринга – заявителем, на заключение сделки в Режиме «Сделки с ЦК», и содержащего Код для направления Предложений.
- 12.11. Участник клиринга соглашается с передачей Техническому центру на условиях соблюдения конфиденциальности Предложений в целях проведения процедуры аутентификации.
- 12.12. Технический центр с использованием Клиринговой системы осуществляет аутентификацию лица, подписавшего Предложение, путем сопоставления ПЭП,

содержащегося в Предложении, реквизиту, являющемуся ПЭП, и присвоенному Участнику клиринга, информация о котором содержится в базе данных Клиринговой системы.

- 12.13. Подавая заявление, указанное в пункте 12.2 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, Участник клиринга – заявитель самостоятельно выбирает информирующего Участника клиринга и несет все риски, связанные с направлением информирующим Участником клиринга в Клиринговый центр Предложений, сформированных Участником клиринга – заявителем. Клиринговый центр не несет ответственности за убытки, причиненные Участнику клиринга – заявителю или иным лицам недобросовестными действиями (бездействием) информирующего Участника клиринга.
- 12.14. Подача Участником клиринга – заявителем Предложения на заключение Внебиржевой сделки с иностранной валютой / Внебиржевой сделки с драгоценным металлом не требует дополнительного подтверждения от Участника клиринга – заявителя.



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

### **Статья 13. Порядок взаимодействия с Биржей при подаче заявок и заключении Сделок**

- 13.1. Немедленно после того, как информация о поданной Участником торгов заявке на продажу, направленной на заключение Сделки, по которой осуществляется клиринг с полным обеспечением по иностранной валюте / драгоценному металлу, являющемуся валютой лота, и/или заявке на продажу, поданной с указанием Торгово-клирингового счета Участника клиринга с признаком «запрет коротких продаж» и/или Торгово-клирингового счета 2-го или 3-го уровня, соответствующего Торгово-клиринговому счету Участника клиринга с признаком «запрет коротких продаж», стороной по которой будет являться Участник клиринга, стала доступной Клиринговому центру посредством ПТК ТЦ, Клиринговый центр:
- 13.1.1. проверяет, что значение цены, указанной в заявке, больше либо равно Нижней границе ценового коридора и меньше либо равно Верхней границе ценового коридора, установленных Клиринговым центром;
- 13.1.2. проверяет, что значения в иностранной валюте, являющейся валютой лота, рассчитанные в соответствии с общей частью Правил клиринга для проверки возможности исполнения операции, проводимой по Расчетному коду Участника клиринга/Торгово-клиринговому счету Участника клиринга при наличии признака «запрет необеспеченных покупок» / «запрет коротких продаж», и/или Участника клиринга категории «В», с учетом обязательства в валюте лота по Сделке, которая может быть заключена на основании поданной заявки, для каждой Даты исполнения не станут отрицательными;
- 13.1.3. рассчитывает значение Единого лимита по Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета Участника клиринга / соответствующему Торгово-клиринговому счету 2-го или 3-го уровня, указанному в заявке, с учетом поданной заявки, и осуществляет проверку достаточности Единого лимита по Расчетному коду для подачи заявки и проверку достаточности Единого лимита по Расчетному коду для исполнения обязательств по уплате оборотных частей комиссионных вознаграждений в порядке, установленном пунктом 13.4 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.
- 13.2. Немедленно после того как информация о поданной Участником торгов заявке на покупку, направленной на заключение Сделки, по которой осуществляется клиринг с полным обеспечением по иностранной валюте, являющейся сопряженной валютой, и/или заявке на покупку, поданной с указанием Торгово-клирингового счета Участника клиринга, в состав которого входит Расчетный код Участника клиринга с признаком «запрет необеспеченных покупок» и/или Торгово-клирингового счета 2-го или 3-го уровня, соответствующего Торгово-клиринговому счету Участника клиринга, в состав которого входит Расчетный код Участника клиринга с признаком «запрет необеспеченных покупок», стороной по которой будет являться Участник клиринга, стала доступной Клиринговому центру посредством ПТК ТЦ, Клиринговый центр:

- 13.2.1. проверяет, что значение цены, указанной в заявке, больше либо равно Нижней границе ценового коридора и меньше либо равно Верхней границе ценового коридора, установленных Клиринговым центром;
- 13.2.2. проверяет, что значения в иностранной валюте, являющейся сопряженной валютой, рассчитанные в соответствии с общей частью Правил клиринга для проверки возможности исполнения операции, проводимой по Расчетному коду Участника клиринга/Торгово-клиринговому счету Участника клиринга при наличии признака «запрет необеспеченных покупок» / «запрет коротких продаж», и/или Участника клиринга категории «В», с учетом обязательства в сопряженной валюте по Сделке, которая может быть заключена на основании поданной заявки, для каждой Даты исполнения не станут отрицательными;
- 13.2.3. рассчитывает значение Единого лимита по Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета Участника клиринга / соответствующему Торгово-клиринговому счету 2-го или 3-го уровня, указанному в заявке, с учетом поданной заявки, и осуществляет проверку достаточности Единого лимита по Расчетному коду для подачи заявки и проверку достаточности Единого лимита по Расчетному коду для исполнения обязательств по уплате оборотных частей комиссионных вознаграждений в порядке, установленном пунктом 13.4 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.
- 13.3. Немедленно после того, как информация о поданной Участником торгов заявке, направленной на заключение Сделки, по которой осуществляется клиринг с частичным обеспечением, стороной по которой будет являться Участник клиринга, стала доступной Клиринговому центру посредством ПТК ТЦ, Клиринговый центр:
  - 13.3.1. проверяет, что значение цены, указанной в заявке, больше либо равно Нижней границе ценового коридора и меньше либо равно Верхней границе ценового коридора, установленных Клиринговым центром для инструмента, по которому подана заявка;
  - 13.3.2. рассчитывает значение Единого лимита по Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета Участника клиринга / соответствующему Торгово-клиринговому счету 2-го или 3-го уровня, указанному в заявке, с учетом поданной заявки, и осуществляет проверку достаточности Единого лимита по Расчетному коду для подачи заявки и проверку достаточности Единого лимита по Расчетному коду для исполнения обязательств по уплате оборотных частей комиссионных вознаграждений в порядке, установленном пунктом 13.4 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.
- 13.4. Единый лимит по Расчетному коду является достаточным для подачи заявки при условии, что значение Единого лимита по Расчетному коду 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 был отрицательным до момента подачи заявки, при условии, что Единый лимит по такому Расчетному коду, рассчитанный с учетом обязательств по Сделке, которая может быть заключена на основании поданной заявки, не станет меньше, чем Единый лимит по этому Расчетному коду, 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.

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

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.

- 13.5. При проведении проверок, указанных в подпунктах 13.1.2, 13.1.3, 13.2.2, 13.2.3, 13.3.2 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, для заявок на заключение сделок своп и своп контрактов указанные проверки осуществляются для первой и второй частей сделки своп / своп контракта с учетом одновременности возникновения обязательств по первой и второй частям сделки своп / своп контракта.
- 13.6. Проверки, указанные в подпунктах 13.1.1, 13.2.1, 13.3.1 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, не осуществляются для заявок на заключение сделок фикс, заявок на заключение средневзвешенных сделок и заявок по фиксингу.
- 13.7. Для заявок на заключение сделок фикс, заявок на заключение средневзвешенных сделок и заявок по фиксингу дополнительно проверяется, что такая заявка подана с указанием в качестве стороны по сделке Участника клиринга категории «А», «К», «Б», «Б2» или «О».
- 13.8. В случае, если установлен признак, указывающий на необходимость контроля Единого лимита по Расчетному коду 2-го уровня, Клиринговый центр:
  - 13.8.1. рассчитывает значение Единого лимита по Расчетному коду 2-го уровня, входящему в состав Торгово-клирингового счета 2-го уровня / соответствующему Торгово-клиринговому счету 3-го уровня, указанному в заявке, с учетом поданной заявки, и осуществляет контроль рассчитанного Единого лимита по Расчетному коду 2-го уровня в порядке, установленном пунктом 13.10 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.
- 13.9. В случае, если установлен признак, указывающий на необходимость контроля Единого лимита по Расчетному коду 3-го уровня, Клиринговый центр:
  - 13.9.1. рассчитывает значение Единого лимита по Расчетному коду 3-го уровня, входящему в состав Торгово-клирингового счета 3-го уровня, указанного в заявке, с учетом поданной заявки, и осуществляет контроль рассчитанного Единого лимита по Расчетному коду 3-го уровня в порядке, установленном пунктом 13.10 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.
- 13.10. Контроль Единого лимита по Расчетному коду 2-го или 3-го уровня по заявке

считается пройденным при условии, что значение Единого лимита по Расчетному коду соответствующего 2-го или 3-го уровня с учетом обязательств по Сделке, которая может быть заключена на основании поданной заявки не станет отрицательным, или, если Единый лимит по такому Расчетному коду 2-го или 3-го уровня был отрицательным до момента подачи заявки, при условии, что Единый лимит по такому Расчетному коду 2-го или 3-го уровня, рассчитанный с учетом указанных обязательств, не станет меньше, чем Единый лимит по этому Расчетному коду 2-го или 3-го уровня, рассчитанный до момента подачи заявки.

- 13.11. По заявке, поданной с указанием Торгово-клирингового счета 2-го уровня, в первую очередь, осуществляется контроль Единого лимита по Расчетному коду 2-го уровня, во вторую очередь, - Единого лимита по Расчетному коду Участника клиринга.
- По заявке, поданной с указанием Торгово-клирингового счета 3-го уровня, в первую очередь, осуществляется контроль Единого лимита по Расчетному коду 3-го уровня, во вторую очередь, - Единого лимита по Расчетному коду 2-го уровня, в третью очередь, - Единого лимита по Расчетному коду Участника клиринга.
- 13.11.1. Контроль Единого лимита по Расчетному коду 2-го и 3-го уровня не осуществляется в случае снятия соответствующего признака Участником клиринга / Участником торгов.
- 13.11.2. Контроль Единого лимита по Расчетному коду Участника клиринга является обязательным.
- 13.11.3. Контроль Единого лимита по заявке считается пройденным при условии прохождения контроля Единого лимита на всех уровнях контроля.
- 13.11.4. В случае если контроль Единого лимита по заявке не пройден на любом из уровней контроля, контроль Единого лимита на последующих уровнях контроля не осуществляется.
- 13.12. В случае установки Участником клиринга / Участником торгов для Торгово-клирингового счета 2-го уровня / 3-го уровня признака «запрет коротких продаж» и/или для Расчетного кода 2-го уровня / 3-го уровня признака «запрет необеспеченных покупок» в соответствии с пунктом 6.3 / 6.4 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, при подаче заявки с указанием Торгово-клирингового счета 2-го уровня / 3-го уровня осуществляются проверки, аналогичные проверкам, указанным в подпунктах 13.1.2 / 13.2.2 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, с учетом Единого лимита, Обеспечения и обязательств, учитываемых по соответствующему Расчетному коду 2-го или 3-го уровня.
- 13.13. При подаче заявки с указанием Торгово-клирингового счета 1-го, 2-го или 3-го уровней, в состав которого входит Расчетный код соответствующего уровня, которому при открытии были поставлены в соответствие идентификационные данные клиента Участника клиринга / клиента Участника торгов, дополнительно осуществляется проверка соответствия указанных идентификационных данных клиента Участника клиринга, в том числе Обособленного клиента / клиента Участника торгов, идентификационным данным клиента Участника торгов, в интересах которого подана такая заявка, или идентификационным данным Участника торгов.

- 13.13.1. Проверка, указанная в настоящем пункте Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, осуществляется, в первую очередь, по Торгово-клиринговому счету 3-го уровня, во вторую очередь, - по Торгово-клиринговому счету 2-го уровня, в третью очередь, - по Торгово-клиринговому счету Участника клиринга (при наличии установленного соответствия между Расчетным кодом соответствующего уровня и идентификационными данными клиента Участника клиринга / клиента Участника торгов).
- 13.13.2. Проверка, указанная в настоящем пункте Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, по заявке считается пройденной при условии прохождения указанной проверки на всех уровнях.
- 13.13.3. В случае если указанная проверка по заявке не пройдена на любом из уровней, проверка на последующих уровнях не осуществляется.
- 13.14. Немедленно после проведения Клиринговым центром проверок, предусмотренных настоящей статьей Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов для соответствующих заявок, информация о результате таких проверок становится доступной Бирже посредством ПТК ТЦ: в случае положительного результата всех необходимых проверок – информация о возможности регистрации заявки, в случае отрицательного результата хотя бы одной из необходимых проверок – информация о невозможности регистрации заявки.
  - 13.14.1. Отчет о невозможности регистрации заявки может быть направлен Клиринговым центром Бирже в иных случаях, установленных Правилами клиринга.
  - 13.14.2. В случае возможности регистрации заявки, 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 заявки, в качестве новых значений Единого лимита по таким Расчетным кодам соответствующего уровня.
  - 13.14.3. В случае невозможности регистрации заявки, Клиринговый центр не изменяет значений Единого лимита по Расчетному коду, Единого лимита по Расчетному коду 2-го уровня и/или Единого лимита по Расчетному коду 3-го уровня.
- 13.15. После того, как информация о снятии зарегистрированной заявки, в которой Участник клиринга был указан в качестве стороны Сделки, стала доступной Клиринговому центру посредством ПТК ТЦ, 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, указанного в заявке, или соответствующему Торгово-клиринговому счету 2-го или 3-го уровня, указанному в заявке, без учета снятой заявки.
- 13.16. При регистрации заявки, являющейся в соответствии с Правилами торгов на валютном рынке допустимой встречной по отношению к ранее зарегистрированной заявке, Клиринговый центр заключает Сделку с каждым из Участников клиринга, указанным в заявке в качестве стороны по Сделке.
- 13.17. После того, как информация о регистрации Сделки стала доступной Клиринговому центру посредством ПТК ТЦ, 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, указанного в заявке, и/или соответствующему Торгово-клиринговому счету 2-го или 3-го уровня, указанному в заявке, на основании которой заключена Сделка, без учета такой заявки (части такой заявки) и с учетом заключенной Сделки;
- допускает к клирингу обязательства по заключенной Сделке;
- по Сделке, заключенной с указанием Торгово-клирингового счета Участника клиринга, изменяет с учетом заключенной Сделки Нетто-обязательство и/или Нетто-требование Участника клиринга по Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета Участника клиринга, указанного в заявке, на основании которой заключена Сделка, с Датами исполнения, соответствующими Дате (Датам) исполнения обязательств по заключенной Сделке;
- по Сделке, заключенной с указанием Торгово-клирингового счета 2-го уровня, изменяет с учетом заключенной Сделки Нетто-обязательство и/или Нетто-требование, учитываемое по Расчетному коду 2-го уровня, входящему в состав Торгово-клирингового счета 2-го уровня, указанного в заявке, и Нетто-обязательство и/или Нетто-требование Участника клиринга по Расчетному коду, соответствующему Торгово-клиринговому счету 2-го уровня, указанному в заявке, на основании которой заключена Сделка, с Датами исполнения, соответствующими Дате (Датам) исполнения обязательств по заключенной Сделке;
- по Сделке, заключенной с указанием Торгово-клирингового счета 3-го уровня, изменяет с учетом заключенной Сделки Нетто-обязательство и/или Нетто-требование, учитываемое по Расчетному коду 3-го уровня, входящему в состав Торгово-клирингового счета 3-го уровня, указанного в заявке, и Нетто-обязательство и/или Нетто-требование, учитываемое по Расчетному коду / Расчетному коду 2-го уровня, соответствующему Торгово-клиринговому счету 3-го уровня, указанному в заявке, на основании которой заключена Сделка, с Датами исполнения, соответствующими Дате (Датам) исполнения обязательств по заключенной Сделке.

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

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

- 14.1. В ходе клиринговой сессии mark-to-market, проводимой каждый Расчетный день в срок, установленный Временным регламентом на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, Клиринговый центр кроме действий, указанных в общей части Правил клиринга, выполняет следующие действия:
- 14.1.1. определяет Расчетные цены в соответствии с пунктом 14.2 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов;
- 14.1.2. для каждого Участника клиринга рассчитывает и устанавливает новые значения Единых лимитов по Расчетному коду, Единых лимитов по Расчетному коду 2-го уровня;
- 14.1.3. 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;
- 14.1.4. определяет обязательства Участников клиринга и Клирингового центра по уплате вариационной маржи в соответствии со статьей 15 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов;
- 14.1.5. учитывает прекращение встречных однородных обязательств по фьючерсным контрактам и своп контрактам;
- 14.1.6. формирует и направляет каждому Участнику клиринга, имеющему обязательства по фьючерсным контрактам и/или своп контрактам, Отчет об обязательствах по ПФИ;
- 14.1.7. формирует и направляет каждому Участнику торгов, заключившему с Клиринговым центром договор о ведении клиринговых регистров, по Расчетному коду 2-го уровня, открытого для которого, учитывается информация об обязательствах по фьючерсным контрактам и/или своп контрактам, Отчет об обязательствах по ПФИ.
- 14.2. Расчетная цена для определенного базисного актива и определенной Даты исполнения определяется как сумма Центрального курса сделок купли-продажи иностранной валюты / драгоценного металла, являющейся / являющегося таким базисным активом, за российские рубли, установленного Клиринговым центром на текущий Расчетный день, и центрального значения Индикативного курса сделок своп на дату, соответствующую такой Дате исполнения.
- 14.3. Под встречными однородными обязательствами по фьючерсным контрактам и/или своп контрактам, подлежащими прекращению в ходе клиринговой сессии, понимаются обязательства по фьючерсному контракту и/или по второй части своп контракта, удовлетворяющие всем следующим требованиям:
- являются обязательствами по производным финансовым инструментам одного типа (поставочным или расчетным);
  - являются обязательствами противоположной направленности;

- имеют одинаковые валюту лота и сопряженную валюту;
- являются обязательствами с одной Датой исполнения;
- являются обязательствами с одинаковыми лотами;
- являются обязательствами по фьючерсным контрактам и/или своп контрактам, заключенным на основании заявок / Предложений, в которых указан один и тот же код клиента Участника торгов (либо код клиента Участника торгов в обеих заявках / обоих Предложениях не указан) и один и тот же Торгово-клиринговый счет 1-го, 2-го или 3-го уровня.

- 14.4. В ходе клиринговой сессии mark-to-market, после определения обязательств по уплате вариационной маржи и выполнения иных действий, предусмотренных статьей 15 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, Клиринговый центр среди обязательств по фьючерсным контрактам и своп контрактам определяет обязательства, являющиеся встречными и однородными в соответствии с пунктом 14.3 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, и учитывает прекращение встречных и однородных обязательств по фьючерсным контрактам и своп контрактам, при этом в первую очередь прекращаются обязательства по фьючерсным контрактам и своп контрактам с более ранней датой и временем заключения (метод ФИФО).
- 14.4.1. При указании в заявке / Предложении на заключение фьючерсного контракта или своп контракта Торгово-клирингового счета 2-го уровня Клиринговый центр также учитывает информацию о прекращении обязательств по указанным контрактам по Расчетному коду 2-го уровня, входящему в состав Торгово-клирингового счета 2-го уровня, указанного в заявке / Предложении.
- 14.4.2. При указании в заявке / Предложении на заключение фьючерсного контракта или своп контракта Торгово-клирингового счета 3-го уровня, Клиринговый центр также учитывает информацию о прекращении обязательств по указанным контрактам по Расчетному коду 2-го уровня, соответствующему Торгово-клиринговому счету 3-го уровня, указанному в заявке / Предложении, и по Расчетному коду 3-го уровня, входящему в состав Торгово-клирингового счета 3-го уровня, указанного в заявке / Предложении.
- 14.4.3. Информация о прекращении обязательств по фьючерсным контрактам и своп контрактам, учитываемым по Расчетным кодам 1-го и 2-го уровня, предоставляется Участнику клиринга в составе Отчета об обязательствах по ПФИ, направляемого Участнику клиринга в соответствии с подпунктом 14.1.6 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.
- 14.4.4. Информация о прекращении обязательств по фьючерсным контрактам и своп контрактам, учитываемым по Расчетным кодам 2-го и 3-го уровня, предоставляется Участнику торгов в составе Отчета об обязательствах по ПФИ, направляемого Участнику торгов в соответствии с подпунктом 14.1.7 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.
- 14.5. Порядок возникновения и исполнения Маржинальных требований определен общей частью Правил клиринга.



## **Статья 15. Вариационная маржа**

- 15.1. В Расчетный день, следующий за датой заключения своп контракта, вариационная маржа по своп контракту рассчитывается по формуле:

$$VM_O = (R_c - (BR + SR)) \times L, \text{ где}$$

$VM_O$  – вариационная маржа по своп контракту;

$R_c$  – Расчетная цена, определенная в текущий Расчетный день;

$BR$  – базовый курс своп контракта;

$SR$  – цена своп контракта;

$L$  – лот своп контракта.

Начиная со 2 (второго) Расчетного дня, следующего за датой заключения своп контракта и до Даты исполнения обязательств по второй части своп контракта включительно, вариационная маржа по своп контракту, обязательства по которому не прекращены, рассчитывается по формуле:

$$VM_T = (R_c - R_{c_p}) \times L, \text{ где}$$

$VM_T$  – вариационная маржа по своп контракту;

$R_c$  – Расчетная цена, определенная в текущий Расчетный день;

$R_{c_p}$  – Расчетная цена, определенная в предыдущий Расчетный день;

$L$  – лот своп контракта.

- 15.2. В Расчетный день, следующий за датой заключения фьючерсного контракта, вариационная маржа по фьючерсному контракту рассчитывается по формуле:

$$VM_O = (R_c - Price) \times L, \text{ где}$$

$VM_O$  – вариационная маржа по фьючерсному контракту;

$R_c$  – Расчетная цена, определенная в текущий Расчетный день;

$Price$  – цена фьючерсного контракта;

$L$  – лот фьючерсного контракта.

Начиная со 2 (второго) Расчетного дня, следующего за датой заключения фьючерсного контракта и до Даты исполнения обязательств по фьючерсному контракту включительно, вариационная маржа по фьючерсному контракту, обязательства по которому не прекращены, рассчитывается по формуле:

$$VM_T = (R_c - R_{c_p}) \times L, \text{ где}$$

$VM_T$  – вариационная маржа по фьючерсному контракту;

$R_c$  – Расчетная цена, определенная в текущий Расчетный день;

$R_{c_p}$  – Расчетная цена, определенная в предыдущий Расчетный день;

$L$  – лот фьючерсного контракта.

В целях расчета вариационной маржи по поставочным и расчетным фьючерсным контрактам, заключенным на основании заявки по фиксингу, Расчетная цена, определенная в текущий Расчетный день, принимается равной:

- до даты определения курса фиксинга Московской Биржи, рассчитанного на дату, определенную в соответствии с условиями поставочных и расчетных фьючерсных контрактов, заключенных на основании заявки по фиксингу (далее в данной статье Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов – дата фиксинга), включая эту дату, по поставочным и расчетным фьючерсным контрактам, заключенным на основании заявки по фиксингу, - форвардной цене данной иностранной валюты, соответствующей дате, следующей за датой фиксинга;
- в дату, следующую за датой фиксинга, по поставочным фьючерсным контрактам, заключенным на основании заявки по фиксингу, - Центральному курсу соответствующей иностранной валюты;
- в дату, следующую за датой фиксинга, по расчетным фьючерсным контрактам, заключенным на основании заявки по фиксингу, - цене фиксинга соответствующей иностранной валюты, определенной в дату фиксинга.

15.3. Для Участника клиринга – продавца по своп контракту / фьючерсному контракту Клиринговый центр рассчитывает величину  $VM_S$  по формуле:

$VM_S = -VOL_i \times VM$ , где

$VOL_i$  – количество заключенных своп контрактов / фьючерсных контрактов с  $i$ -м базисным активом, обязательства по которым не прекращены и по которым Участник клиринга является продавцом;

$VM$  – вариационная маржа по своп контракту / фьючерсному контракту, рассчитанная в соответствии с пунктами 15.1-15.2 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.

15.4. Для Участника клиринга – покупателя по своп контракту / фьючерсному контракту Клиринговый центр рассчитывает величину  $VM_B$  по формуле:

$VM_B = VOL_i \times VM$ , где

$VOL_i$  – количество заключенных своп контрактов / фьючерсных контрактов с  $i$ -м базисным активом, обязательства по которым не прекращены и по которым Участник клиринга является покупателем;

$VM$  – вариационная маржа по своп контракту / фьючерсному контракту, рассчитанная в соответствии с пунктами 15.1-15.2 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.

15.5. Если значение, рассчитанное в соответствии с пунктом 15.3 или 15.4 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, отрицательное, это означает наличие обязательства Участника клиринга по уплате вариационной маржи Клиринговому центру в размере, равном абсолютному значению  $VM_S$  или  $VM_B$ , если положительное – наличие требования Участника клиринга к Клиринговому центру по получению вариационной маржи в размере, равном значению  $VM_S$  или  $VM_B$ .

15.5.1. Обязательства по уплате / требования по получению вариационной маржи учитываются по Расчетному коду Участника клиринга, входящему в состав Торгово-клирингового счета Участника клиринга, указанного в заявке / Предложении / соответствующему Торгово-клиринговому счету 2-го или 3-го уровня, указанному в заявке / Предложении.

- 15.5.2. При указании в заявке / Предложении на заключение фьючерсного контракта или своп контракта Торгово-клирингового счета 2-го уровня, Клиринговый центр также учитывает информацию об обязательствах по уплате / требования по получению вариационной маржи по Расчетному коду 2-го уровня, входящему в состав Торгово-клирингового счета 2-го уровня, указанного в заявке / Предложении.
- 15.5.3. При указании в заявке / Предложении на заключение фьючерсного контракта или своп контракта Торгово-клирингового счета 3-го уровня, Клиринговый центр также учитывает информацию об обязательствах по уплате / требования по получению вариационной маржи по Расчетному коду 2-го уровня, соответствующему Торгово-клиринговому счету 3-го уровня, указанному в заявке / Предложении, и по Расчетному коду 3-го уровня, входящему в состав Торгово-клирингового счета 3-го уровня, указанного в заявке / Предложении.
- 15.5.4. Информация о размере обязательств по уплате / требований по получению вариационной маржи, учитываемая по Расчетному коду Участника клиринга / Расчетному коду 2-го уровня, предоставляется Участнику клиринга в составе Отчета об обязательствах по ПФИ, направляемого Участнику клиринга в соответствии с подпунктом 14.1.6 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.
- 15.5.5. Информация о размере обязательств по уплате / требований по получению вариационной маржи, учитываемая по Расчетному коду 2-го и/или 3-го уровня предоставляется Участнику торгов в составе Отчета об обязательствах по ПФИ, направляемого Участнику торгов в соответствии с подпунктом 14.1.7 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.
- 15.6. После определения обязательств по уплате / требований по получению вариационной маржи в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов и до учета прекращения обязательств по фьючерсным контрактам и своп контрактам в соответствии со статьей 14 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, Клиринговый центр:
- 15.6.1. для каждого своп контракта с определенным базисным активом и Датой исполнения обязательств по второй части своп контракта рассчитывает сумму в российских рублях, которую покупатель по своп контракту обязан уплатить продавцу по своп контракту по второй части своп контракта, как произведение Расчетной цены, определенной в текущий Расчетный день, на количество заключенных своп контрактов, обязательства по которым не прекращены;
- 15.6.2. для каждого фьючерсного контракта с определенным базисным активом и Датой исполнения рассчитывает сумму в российских рублях, которую покупатель по фьючерсному контракту обязан уплатить продавцу по фьючерсному контракту, как произведение Расчетной цены, определенной в текущий Расчетный день, на количество заключенных фьючерсных контрактов, обязательства по которым не прекращены;
- 15.6.3. пересчитывает Нетто-обязательства / Нетто-требования в российских рублях с соответствующей Датой исполнения, учитываемые по Расчетным кодам Участника клиринга, с учетом изменения суммы обязательств по второй части своп контрактов / по фьючерсным контрактам, рассчитанной в соответствии с подпунктами 15.6.1,

15.6.2 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов;

- 15.6.4. пересчитывает значения Нетто-обязательств / Нетто-требований в российских рублях с соответствующей Датой исполнения, информация о которых учитывается по Расчетным кодам 2-го и/или 3-го уровня, с учетом изменения суммы обязательств по второй части своп контрактов / по фьючерсным контрактам, рассчитанной в соответствии с подпунктами 15.6.1, 15.6.2 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов;
- 15.6.5. допускает к клирингу определенные в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов обязательства по уплате / требования по получению вариационной маржи, учитываемые по Расчетному коду Участника клиринга;
- 15.7. Определенные в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов обязательства по уплате / требования по получению вариационной маржи, учитываемые по Расчетному коду Участника клиринга, открытому для валютного рынка и рынка драгоценных металлов и не являющемуся Расчетным кодом Единого пула, включаются в клиринговый пул в соответствии со статьей 16 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.
- 15.8. Проценты на сумму уплаченной и/или полученной вариационной маржи Клиринговым центром не начисляются и не уплачиваются.

**Статья 16. Порядок определения обязательств, подлежащих исполнению. Порядок исполнения обязательств, определенных по итогам клиринга**

- 16.1. На валютном рынке и рынке драгоценных металлов 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).  
Порядок и условия такой замены определены общей частью Правил клиринга.
- 16.2. 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 в соответствии с таким нормативным (правовым) актом 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 с Участниками клиринга Сделкам перестанет являться Расчетным днем по соответствующей валюте / соответствующему драгоценному металлу, 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 заключенным Сделкам на ближайший следующий Расчетный день.
- 16.2.1. Размеры обязательства по второй части сделок своп / своп контрактов

пересчитываются с учетом такого изменения Даты исполнения.

- 16.2.2. После изменения Даты исполнения обязательств по Сделкам в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, 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.
- 16.2.3. Суммы рассчитанных комиссионных вознаграждений по Сделкам, Дата исполнения обязательств по которым изменена, не меняются.
- 16.2.4. После изменения Дат исполнения обязательств по Сделкам, а также размеров обязательств по второй части сделок своп / своп контрактов Клиринговый центр формирует и передает Участникам клиринга Отчеты о сделках, Дата исполнения которых перенесена.
- 16.2.5. Об изменении Дат исполнения обязательств по Сделкам, а также размеров обязательств по второй части сделок своп / своп контрактов Клиринговый центр уведомляет Биржу посредством ПТК ТЦ.
- 16.3. В сроки, установленные Временным регламентом, являющимся приложением к общей части Правил клиринга (после окончания торгов соответствующей иностранной валютой / драгоценными металлами, на которых заключаются Сделки с исполнением обязательств в дату их заключения), Клиринговый центр определяет подлежащие исполнению обязательства, учитываемые по Расчетным кодам, открытым для валютного рынка и рынка драгоценных металлов и не являющимся Расчетными кодами Единого пула:
  - 16.3.1. включает в клиринговый пул:
    - Задолженности Участника клиринга в российских рублях, возникшие в предыдущий Расчетный день и не погашенные на момент определения Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований по денежным средствам в российских рублях, установленный Временным регламентом, являющимся приложением к общей части Правил клиринга (для первого в течение Расчетного дня определения Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований по денежным средствам в российских рублях);
    - предыдущее определенное в течение Расчетного дня Итоговое нетто-обязательство / Итоговое нетто-требование по денежным средствам в соответствующей валюте (для второго и последующих в течение Расчетного дня определения Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований по денежным средствам в соответствующей валюте);
    - непрекращенные обязательства и требования Участника клиринга и Клирингового центра по Сделкам с наступившей Датой исполнения, в том числе обязательства / требования в российских рублях по Сделкам, являющимся производными финансовыми инструментами, определенные в соответствии с подпунктами 15.6.1, 15.6.2 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов;
    - обязательства по уплате / требования по получению вариационной маржи, определенные в соответствии со статьей 15 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов;

- обязательства Участника клиринга по уплате комиссионных вознаграждений, определенные в соответствии со статьей 18 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов;
- обязательства Участника клиринга по уплате штрафов, определенные в предыдущий Расчетный день;
- обязательства Участника клиринга по уплате пеней, неустоек, отступного, определенные в соответствии с общей частью Правил клиринга;
- обязательство Участника клиринга – Нерезидента по уплате суммы, соответствующей сумме налога на прибыль организаций с доходов иностранных организаций от источников в Российской Федерации, определенной Клиринговым центром в соответствии с требованиями российского налогового законодательства, в Расчетный день, следующий за днем получения доходов Участником клиринга – Нерезидентом;
- в случае непредоставления Участником клиринга – Нерезидентом налогового сертификата на очередной налоговый период (календарный год) (за исключением банков, постоянное местонахождение которых подтверждается сведениями общедоступных информационных справочников) в срок, указанный в приложении № 4 к общей части Правил клиринга, в дату окончания срока предоставления указанных документов, - обязательство Участника клиринга по уплате суммы, равной разнице между суммой, соответствующей сумме налога на прибыль организаций с доходов иностранных организаций от источников в Российской Федерации, рассчитанной по максимальной ставке, установленной российским налоговым законодательством, и суммой, соответствующей сумме налога, рассчитанной по действующей в календарном году налоговой ставке, установленной соглашением об избежании двойного налогообложения, заключенным с государством, налоговым резидентом которого являлся Участник клиринга в предыдущем календарном году (налоговом периоде).

16.3.2. прекращает однородные обязательства и требования Участника клиринга и Клирингового центра, включенные в клиринговый пул, по каждому Расчетному коду Участника клиринга и определяет Итоговое нетто-обязательство или Итоговое нетто-требование по денежным средствам / драгоценным металлам каждого Участника клиринга в каждой валюте / каждом драгоценном металле, возникшее в связи с прекращением обязательств и требований, указанных в настоящем подпункте Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов;

16.3.3. формирует и направляет Участникам клиринга Отчеты об Итоговых нетто-обязательствах / Итоговых нетто-требованиях и Клиринговые отчеты.

16.4. Участники клиринга вправе подавать Запросы на проведение ранних расчетов и Постоянные поручения на проведение ранних расчетов, Постоянные поручения на ограничение времени начала заключения сделок с Клиринговым центром, Запросы на ограничение времени окончания заключения сделок с Клиринговым центром и Постоянные поручения на ограничение времени окончания заключения сделок с Клиринговым центром в отношении Расчетных кодов, открытых для валютного рынка и рынка драгоценных металлов.

Порядок подачи и исполнения указанных запросов и поручений определен общей

частью Правил клиринга.

- 16.5. Исполнение / прекращение Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований по денежным средствам / драгоценным металлам, определенных в соответствии с подпунктом 16.3.2 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, учитываемых по Расчетным кодам, открытым для валютного рынка и рынка драгоценных металлов и не являющимся Расчетными кодами Единого пула, осуществляется в порядке, определенном общей частью Правил клиринга.
- 16.6. Исполнение (прекращение) следующих обязательств и требований, учитываемых по Расчетным кодам Единого пула:
- обязательств и требований Участника клиринга и Клирингового центра по Сделкам с наступившей Датой исполнения, в том числе обязательств / требований в российских рублях по Сделкам, являющимся производными финансовыми инструментами, определенных в соответствии с подпунктами 15.6.1, 15.6.2 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов;
  - обязательств по уплате / требований по получению вариационной маржи, определенных в соответствии со статьей 15 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов;
  - обязательств Участника клиринга по уплате комиссионных вознаграждений, определенных в соответствии со статьей 18 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов;
  - обязательств Участника клиринга по уплате штрафов, пеней, неустоек, отступного, определенных в соответствии с общей частью Правил клиринга;
- осуществляется в Едином клиринговом пуле в порядке, определенном общей частью Правил клиринга.
- 16.7. В срок, установленный Временным регламентом на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, Клиринговый центр определяет подлежащие исполнению обязательства по Сделкам с Датой исполнения в дату заключения, заключенным после 19:00 в рамках одного Расчетного кода:
- 16.7.1. включает в клиринговый пул непрекращенные обязательства и требования Участника клиринга и Клирингового центра по Сделкам с наступившей Датой исполнения;
- 16.7.2. прекращает однородные обязательства и требования Участника клиринга и Клирингового центра, включенные в клиринговый пул, по каждому Расчетному коду Участника клиринга;
- 16.7.3. формирует и направляет Участникам клиринга Клиринговые отчеты, содержащие информацию о Сделках, обязательства по которым прекращены.

## **Статья 17. Особенности возврата Обеспечения Участникам клиринга категории «К»**

- 17.1. Клиринговый центр ежедневно осуществляет возврат Обеспечения в денежных средствах Участнику клиринга категории «К» в сумме своп-разницы по сделкам

своп, стороной по которым является Участник клиринга категории «К», в порядке, предусмотренном общей частью Правил клиринга, без подачи поручений / запросов Участником клиринга категории «К».

- 17.2. Постоянное поручение на возврат обеспечения, поданное Участником клиринга категории «К», исполняется в порядке, предусмотренном общей частью Правил клиринга, в сумме Нетто-требования по сделкам с наступившей Датой исполнения, за вычетом суммы своп-разницы, указанной в пункте 17.1 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.



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

### **Статья 18. Особенности оплаты услуг Клирингового центра, Биржи и Технического центра**

- 18.1. На валютном рынке и рынке драгоценных металлов Клиринговый центр взимает:
- комиссионное вознаграждение в пользу Клирингового центра за клиринговое обслуживание (далее – комиссионное вознаграждение Клирингового центра);
  - комиссионное вознаграждение за клиринговые услуги по открытию и ведению Торгово-клирингового счета 3-го уровня в пользу Клирингового центра;
  - комиссионное вознаграждение в пользу Биржи за организацию торгов;
  - абонентскую плату в пользу Биржи;
  - Дополнительный комиссионный сбор в пользу Технического центра.
- 18.2. Размер оборотной и постоянной частей комиссионного вознаграждения Биржи за организацию торгов по сделкам с иностранной валютой рассчитывается с учетом действующего для Участника торгов тарифного плана.  
Размер оборотной и постоянной частей комиссионного вознаграждения Клирингового центра за клиринговое обслуживание по сделкам с иностранной валютой рассчитывается с учетом действующего для Участника клиринга тарифного плана.
- 18.3. Оборотная часть комиссионного вознаграждения Биржи за организацию торгов и оборотная часть комиссионного вознаграждения Клирингового центра за клиринговое обслуживание по сделкам с иностранной валютой / драгоценными металлами рассчитываются после заключения Сделки в дату ее заключения.
- 18.4. 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, Дополнительного комиссионного сбора в пользу Технического центра, а также комиссионного вознаграждения Клирингового центра за оказание Участнику торгов клиринговых услуг по открытию и/или ведению Торгово-клирингового счета 3-го уровня.
- 18.5. Абонентская плата определяется в соответствии с Тарифами Биржи, учитывается по основному Расчетному коду для списания комиссионных вознаграждений, порядок определения которого установлен общей частью Правил клиринга, и взимается в первый рабочий день календарного квартала, следующего за кварталом, за который взимается абонентская плата.
- 18.6. Дополнительный комиссионный сбор, рассчитанный в отношении Участника торгов / клиента Участника торгов в соответствии с Тарифами Технического центра, определяется в Расчетный день, в течение которого Участником торгов были поданы заявки на заключение сделок за свой счет или за счет указанного Клиента и учитывается по Расчетному коду, входящему в состав / соответствующему Торгово-

клиринговому счету соответствующего уровня, с указанием которого Участником торгов в течение данного Расчетного дня были поданы заявки на заключение Сделок за свой счет или за счет указанного клиента Участника торгов (в случае если такой Торгово-клиринговый счет соответствующего уровня – единственный) либо по основному Расчетному коду для списания комиссионных вознаграждений, порядок определения которого установлен общей частью Правил клиринга.

- 18.7. 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.
- 18.8. 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.
- 18.9. Информация о размере рассчитанного комиссионного вознаграждения Биржи и Клирингового центра, вознаграждения Технического центра, подлежащего уплате Участником торгов / Участником клиринга, указывается в Отчете о комиссионных вознаграждениях, направляемом Клиринговым центром Участникам клиринга в сроки, установленные Временным регламентом, являющимся приложением к общей части Правил клиринга.
- 18.10. Обязательства Участника торгов / Участника клиринга по уплате комиссионных вознаграждений, учитываемые по Расчетному коду, являющемуся Расчетным кодом Единого пула, включаются в состав Единого клирингового пула и исполняются в порядке, определенном общей частью Правил клиринга.
- Обязательства Участника торгов / Участника клиринга по уплате комиссионных вознаграждений, учитываемые по Расчетному коду, не являющемуся Расчетным кодом Единого пула, включаются в состав клирингового пула, формируемого в соответствии с пунктом 16.1 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, и исполняются в порядке, определенном общей частью Правил клиринга.
- 18.11. Клиринговый центр также учитывает информацию об исполнении обязательств по уплате оборотных частей комиссионных вознаграждений по Сделкам, заключенным с указанием Торгово-клирингового счета 2-го уровня, по Расчетному коду 2-го уровня, входящему в состав Торгово-клирингового счета 2-го уровня, указанного в заявке на заключение такой Сделки, без учета проверки достаточности Обеспечения, информация о котором учитывается по Расчетному коду 2-го уровня.
- Клиринговый центр также учитывает информацию об исполнении обязательств по

уплате оборотных частей комиссионных вознаграждений по Сделкам, заключенным с указанием Торгово-клирингового счета 3-го уровня, по Расчетному коду 3-го уровня, входящему в состав Торгово-клирингового счета 3-го уровня, указанного в заявке на заключение такой Сделки, и по Расчетному коду 2-го уровня, соответствующему Торгово-клиринговому счету 3-го уровня, указанного в заявке на заключение такой Сделки, без учета проверки достаточности Обеспечения, информация о котором учитывается по Расчетному коду 2-го и/или 3-го уровня.

При этом размер Обеспечения в российских рублях, информация о котором учитывается по Расчетному коду 2-го / 3-го уровня, уменьшается / увеличивается на сумму обязательств по уплате оборотных частей комиссионных вознаграждений по Сделкам, информация о которых учитывается по соответствующему Расчетному коду 2-го / 3-го уровня.

18.12. Информация о рассчитанном Клиринговым центром размере оборотной части комиссионного вознаграждения Биржи за организацию торгов и оборотной части комиссионного вознаграждения Клирингового центра за клиринговое обслуживание по каждой заключенной Сделке становится доступной Бирже посредством ПТК ТЦ немедленно после его расчета.

18.13. 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.

## **Статья 19. Порядок предоставления информации и отчетов по итогам клиринга**

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

- о Сделках, стороной по которым является Участник клиринга;
- о размере Обеспечения, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, в каждой валюте / каждом драгоценном металле (по каждому Расчетному коду Участника клиринга);
- о Профилях активов, учитываемых по Расчетному коду Единого пула Участника клиринга в Клиринговой системе валютного рынка и рынка драгоценных металлов, в разрезе Расчетных кодов Участников клиринга, кодов валют / драгоценных металлов / ценных бумаг;

- о размере Единого лимита по Расчетному коду;
- о значении Нетто-обязательства и/или Нетто-требования, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, в каждой валюте / каждом драгоценном металле и с каждой Датой исполнения (по каждому Расчетному коду Участника клиринга);
- об обязательствах по уплате вариационной маржи (суммарно по каждому Расчетному коду Участника клиринга);
- о размере Обеспечения, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, в каждой валюте / каждом драгоценном металле, 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 наличии / отсутствии Маржинального требования Участника клиринга, о сумме Маржинального требования в российских рублях (в случае наличия) (по каждому Расчетному коду Участника клиринга);
- о наличии / отсутствии Задолженности Участника клиринга перед Клиринговым центром, о сумме Задолженности Участника клиринга (в случае наличия) (по каждому Расчетному коду Участника клиринга).

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

- Выписку из реестра Внебиржевых сделок с иностранной валютой и Внебиржевых сделок с драгоценными металлами;
- Выписку из реестра Предложений;
- Выписка из реестра сделок, принятых в клиринг, содержащая информацию об обязательствах по Сделкам, допущенных к клирингу, стороной по которым является Участник клиринга;
- Отчет об обязательствах по ПФИ, содержащий информацию о допущенных к клирингу обязательствах по своп контрактам и фьючерсным контрактам и обязательствах по уплате вариационной маржи;
- Клиринговый отчет, содержащий информацию об обязательствах, включенных в клиринговый пул;
- Отчет о сделках, дата исполнения которых перенесена;
- Отчет об Обеспечении, содержащий информацию о размере Обеспечения в денежных средствах / драгоценных металлах, учитываемую по Расчетному коду 2-го уровня, и об изменении размера такого Обеспечения;
- Отчет о комиссионных вознаграждениях;
- Отчет о торгово-клиринговых счетах, содержащий информацию о зарегистрированных Торгово-клиринговых счетах 1-го и 2-го уровня;
- Отчет об оценке обеспечения, содержащий информацию о российских рублях и об оценочной стоимости (в российских рублях) иностранной валюты и драгоценных металлов, составляющих индивидуальное и иное обеспечение, свободных от обязательств Участников клиринга и обремененных обязательствами Участника клиринга.

19.3. Клиринговый центр предоставляет Участнику клиринга с использованием Клиринговой системы информацию об Итоговых нетто-обязательствах и/или Итоговых нетто-требованиях Участника клиринга в соответствующей валюте / соответствующем драгоценном металле.

В случае несоответствия информации, полученной Участником клиринга с использованием Клиринговой системы, и информации, содержащейся в Отчете об Итоговых нетто-обязательствах / Итоговых нетто-требованиях, расчеты должны осуществляться Участником клиринга на основании Отчета об Итоговых нетто-обязательствах / Итоговых нетто-требованиях.

19.4. 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, информация о котором учитывается по Расчетному коду 2-го уровня, в каждой валюте / каждом драгоценном металле (по каждому Расчетному коду 2-го уровня);
- о размере Единого лимита по Расчетному коду 2-го уровня;
- о значении Нетто-обязательства и/или Нетто-требования, информация о котором учитывается по Расчетному коду 2-го уровня, в каждой валюте / каждом драгоценном металле и с каждой Датой исполнения (по каждому Расчетному коду 2-го уровня);
- об обязательствах по уплате вариационной маржи, информация о которых учитывается по Расчетному коду 2-го уровня (суммарно по каждому Расчетному коду 2-го уровня);
- о размере Обеспечения, информация о котором учитывается по Расчетному коду 2-го уровня, в каждой валюте / каждом драгоценном металле, недостающего для исполнения Нетто-обязательства 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).

19.5. 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, информация о котором учитывается по Расчетному коду 2-го и 3-го уровня, в каждой валюте / каждом драгоценном металле (по каждому Расчетному коду 2-го и 3-го уровня);
- о размере Единого лимита по Расчетному коду 2-го и 3-го уровня;
- о значении Нетто-обязательства и/или Нетто-требования, информация о котором учитывается 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);

- об обязательствах по уплате вариационной маржи, информация о которых учитывается по Расчетному коду 2-го и 3-го уровня (суммарно по каждому Расчетному коду 2-го и 3-го уровня);
- о размере Обеспечения, информация о котором учитывается по Расчетному коду 2-го уровня и 3-го уровня, в каждой валюте / каждом драгоценном металле, недостающего для исполнения Нетто-обязательства 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).

19.6. 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 обязательствах по ПФИ, содержащий информацию о допущенных к клирингу обязательствах по своп контрактам и фьючерсным контрактам и обязательствах по уплате вариационной маржи, учитываемую по Расчетным кодам 2-го и 3-го уровня;
- Отчет о сделках, дата исполнения которых перенесена, содержащий информацию об обязательствах, исключенных из клирингового пула, по Сделкам, 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, учитываемую по Расчетному коду 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.

## **РАЗДЕЛ VII. ПРОЧИЕ УСЛОВИЯ**

### **Статья 20. Особенности перевода обязательств и Обеспечения одного Участника клиринга другому Участнику клиринга**

20.1. Согласие на прием, предоставляемое Участником клиринга - реципиентом, помимо информации, предусмотренной общей частью Правил клиринга, должно содержать информацию о Расчетных кодах Участника клиринга – реципиента, по которым необходимо учесть переводимые обязательства и Обеспечение.

Согласие на прием может содержать информацию о Расчетных кодах, открытых Базовым Участником клиринга для Обособленного клиента, и информацию о соответствующих им клиентских Расчетных кодах / Расчетных кодах ДУ, открытых для Обособленного клиента Участником клиринга - реципиентом, или информацию о клиентском Расчетном коде / Расчетном коде ДУ Участника клиринга – реципиента, по которому необходимо учесть переводимые обязательства и Обеспечение.

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

- списывает драгоценные металлы с торгового банковского счета в соответствующем драгоценном металле Базового Участника клиринга, соответствующего Расчетному коду, 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 Участника клиринга – реципиента.

### **Статья 21. Порядок действий при возникновении обстоятельств, которые могут повлиять на возможность заключения Внебиржевых сделок с иностранной валютой / Внебиржевых сделок с драгоценными металлами**

21.1. 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 иностранной валютой/ Внебиржевых сделок с драгоценными металлами 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 иностранной валютой/ Внебиржевых сделок с драгоценными металлами;
- удалить Предложения из Клиринговой системы.

- 21.2. При прекращении действия обстоятельств, которые повлекли приостановку возможности подачи Предложений и заключения Внебиржевых сделок с иностранной валютой / Внебиржевых сделок с драгоценными металлами, Клиринговый центр возобновляет возможность подачи Предложений и заключения Внебиржевых сделок с иностранной валютой / Внебиржевых сделок с драгоценными металлами.

## **Статья 22. Особенности возврата обеспечения в драгоценных металлах.**

- 22.1. Учет информации о драгоценных металлах, слитки которых подлежат выдаче клиентам Участника клиринга - физическим лицам, являющимся резидентами Российской Федерации в соответствии с законодательством Российской Федерации о валютном регулировании и валютном контроле, осуществляется на отдельном клиентском Расчетном коде, который может являться Расчетным кодом Единого пула, соответствующим торговому банковскому счету, открытому Участником клиринга в соответствии с пунктом 4.7 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов для совершения сделок с драгоценными металлами в интересах и/или за счет клиентов-физических лиц. Участником клиринга – Резидентом может быть открыто несколько клиентских Расчетных кодов физических лиц.
- 22.2. Возврат обеспечения в драгоценных металлах, переданных Участнику клиринга его клиентами-физическими лицами, указанными в пункте 22.1 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, а также полученных Участником клиринга по сделкам, которые совершены Участником клиринга в интересах и/или за счет клиентов-физических лиц, указанных в пункте 22.1 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, осуществляется только с клиентского Расчетного кода, указанного в пункте 22.1 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.
- 22.3. Участник клиринга дает заверение, что учет драгоценных металлов по Расчетному коду, указанному в пункте 22.1 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, производится только в отношении драгоценных металлов переданных Участнику клиринга его клиентами-физическими лицами, указанными в пункте 22.1 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, а также полученных Участником клиринга по сделкам, которые совершены Участником клиринга в интересах и/или за счет клиентов-физических лиц, указанных в пункте 22.1 Правил клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.
- 22.4. Для выдачи слитков драгоценных металлов Участник клиринга обязан предоставить Клиринговому центру информацию, предусмотренную Правилами открытия, ведения и закрытия банковских счетов, и счетов по вкладам (депозитам) в НКО НКЦ (АО).



**Приложение № 1**

к Правилам клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов

**Временной регламент на валютном рынке и рынке драгоценных металлов**

| <b>№ п/п</b> | <b>Наименование операции</b>   | <b>Время (московское)</b>   |
|--------------|--|---|
| <b>1.</b>    | <b>Время (сроки) проведения клиринговых операций в Клиринговой системе валютного рынка и рынка драгоценных металлов</b>  |   |
| 1.1.         | Заключение сделок с иностранной валютой / драгоценными металлами в случае неисполнения Участником клиринга Маржинального требования.                                   | с 17:30 дня возникновения Маржинального требования  |
| <b>2.</b>    | <b>Сроки прекращения обязательств</b>  |   |
| 2.1.         | Прекращение обязательств и требований по денежным средствам / драгоценным металлам по Сделкам с Датой исполнения в дату их заключения, заключенным после 19:00.        | 23:50 Даты исполнения   |
| <b>3.</b>    | <b>Сроки предоставления отчетов по итогам клиринга</b>   |   |
| 3.1.         | Передача Клиринговым центром Участникам клиринга Отчетов об обязательствах, Отчетов об обязательствах по ПФИ.  | до 7:00 Расчетного дня  |
| 3.2.         | Передача Клиринговым центром Клиринговых отчетов.  | совместно с соответствующими Отчетами об Итоговых нетто-обязательствах / Итоговых нетто-требованиях в срок, установленный Временным регламентом, являющимся приложением к общей части Правил клиринга |
| 3.3.         | Передача Клиринговым центром Клиринговых отчетов, содержащих информацию о Сделках с Датой исполнения в дату их заключения, заключенных после 19:00.                    | до 09:00 Расчетного дня, следующего за датой заключения сделок  |
| <b>4.</b>    | <b>Время (сроки) подачи Предложений и заключения Внебиржевых сделок с иностранной валютой и Внебиржевых сделок с драгоценными металлами (общий период)<sup>1</sup></b> |   |
| 4.1.         | Подача Предложений   | с 7:00 до 22:59 Расчетного дня  |

---

<sup>1</sup> Время подачи Предложений и заключения Внебиржевых сделок с иностранной валютой и Внебиржевых сделок с драгоценными металлами в зависимости от режима заключения сделок / инструмента определяется в Расписании заключения внебиржевых сделок с иностранной валютой и драгоценными металлами и направления отчетов (выписок) по ним (далее - Расписание), раскрываемом на Сайте Клирингового центра. Время подачи Предложений и заключения Внебиржевых сделок с иностранной валютой и Внебиржевых сделок с драгоценными металлами установленное в Расписании, может быть изменено решением Клирингового центра. Принятое Клиринговым центром решение раскрывается на Сайте Клирингового центра не позднее дня его вступления в силу, если иное не установлено решением Клирингового центра.

| <b>№ п/п</b> | <b>Наименование операции</b>  | <b>Время (московское)</b>      |
|--------------|---|--------------------------------|
| <b>4.2.</b>  | Заключение Внебиржевых сделок с иностранной валютой и Внебиржевых сделок с драгоценными металлами | с 7:00 до 23:50 Расчетного дня |

## Приложение № 2

к Правилам клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов

### Правила заключения внебиржевых сделок НКО НКЦ (АО)

#### РАЗДЕЛ I. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ

##### Статья 1. Назначение Правил заключения внебиржевых сделок НКО НКЦ (АО)

1.1. Правила заключения внебиржевых сделок НКО НКЦ (АО) (далее – Правила) определяют порядок подачи Предложений на заключение Внебиржевых сделок с иностранной валютой и драгоценными металлами, проведения Аукционов RFS, заключения Внебиржевых сделок с иностранной валютой и драгоценными металлами, порядок осуществления контроля за соблюдением Пользователями системы Правил, а также порядок формирования алгоритмического пакета Предложений на заключение Внебиржевых сделок с иностранной валютой и драгоценными металлами с Провайдером ликвидности.

##### Статья 2. Термины и определения

|   |   |
|---|---|
| <i>Алгоритмический пакет Предложений на заключение Внебиржевых сделок с иностранной валютой и драгоценными металлами с Провайдером ликвидности (алгоритмический пакет Предложений, пакет Предложений) –</i> | сообщение, подаваемое в Систему Участником клиринга, содержащее определенное Участником клиринга в порядке, установленном настоящими Правилами, количество Предложений на заключение сделок с Провайдером ликвидности по одному Инструменту на установленный Участником клиринга совокупный объем с условием подачи Предложений в Клиринговую систему в течение заданного им периода времени.<br><br>Все Предложения, содержащиеся в пакете Предложений, должны быть Предложениями одного вида и иметь одну направленность. |
| <i>Аукцион RFS (Аукцион) –</i>  | механизм определения цены Инструмента в заявленном объеме.  |
| <i>Биржа –</i>  | Публичное акционерное общество «Московская Биржа ММВБ-РТС» (ПАО Московская Биржа)   |
| <i>Внебиржевая сделка –</i>   | сделка, заключенная на основании Предложений Участников клиринга, в т.ч. Участников клиринга, являющихся Поставщиком и Потребителем ликвидности, в порядке, предусмотренном Правилами клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, в том числе Правилами, а так же сделка, заключаемая Клиринговым центром с Участником клиринга / Провайдером ликвидности на основании Предложений Участников клиринга / Провайдеров ликвидности.  |
| <i>Запрос котировок RFS</i>   | сообщение с установленными параметрами, подаваемое  |

|  |   |
|--|---|
| <b>(Запрос котировок) –</b>  | Потребителем ликвидности в Систему для инициирования (открытия) Аукциона.   |
| <b>Идентификационные данные клиента –</b>                                      | информация, полученная Биржей от Участника торгов, совпадающего с Участником клиринга и являющегося Пользователем, при регистрации клиента Участника торгов в соответствии с законодательством Российской Федерации и Правилами допуска Биржи.  |
| <b>Инструмент –</b>  | заключаемые с использованием Системы Внебиржевые сделки спот, сделки своп или своп контракты, совокупность условий заключения каждой из которых определена в соответствующей спецификации.  |
| <b>Котировка –</b>   | сообщение, подаваемое в Систему Поставщиком ликвидности в ответ на Запрос котировок, содержащее цены покупки и/или продажи Инструмента в указанном в запросе объеме, а также иную информацию в соответствии с Правилами.  |
| <b>Кросс-сделки (внебиржевые кросс-сделки) –</b>                               | Внебиржевые сделки, заключаемые в Клиринговой системе с участием Центрального контрагента на основании Предложений, поданных за счет одного и того же лица.   |
| <b>Пользователь внебиржевой системы (Пользователь системы, Пользователь) –</b> | лицо, являющееся Участником клиринга, и присоединившееся к Правилам в установленном порядке. Пользователь системы, в том числе, может быть Поставщиком ликвидности и/или Потребителем ликвидности.  |
| <b>Поставщик ликвидности (Поставщик) –</b>                                     | Пользователь системы, предоставляющий ликвидность Потребителям ликвидности путем направления Котировок.   |
| <b>Потребитель ликвидности (Потребитель) –</b>                                 | Пользователь системы, иницирующий Аукцион путем подачи Запроса котировок.   |
| <b>Предложение на заключение внебиржевой сделки (Предложение) –</b>            | (1) подаваемое в Систему сообщение Участника клиринга на заключение Внебиржевой сделки, содержащее указание на другого Участника клиринга, Предложение которого может быть признано Предложением с совпадающими условиями, (2) подаваемое в Систему сообщение Потребителя ликвидности в ответ на Котировки Поставщиков ликвидности / Клирингового центра, а также (3) не оозванная Поставщиком ликвидности / Провайдером ликвидности Котировка, которая была выбрана Потребителем ликвидности. Каждое из подаваемых Предложений является адресованной Клиринговому центру офертой на заключение Внебиржевой сделки. |
| <b>Режим «Аукцион RFS» –</b>   | режим заключения внебиржевых сделок с центральным контрагентом с использованием Системы посредством Аукциона RFS.   |
| <b>Режим «Сделки с ЦК» –</b>   | режим заключения внебиржевых сделок с центральным   |

|  |   |
|--|---|
|  | контрагентом с использованием Системы путем подачи Пользователем системы Предложений, содержащих указания на других Пользователей системы, Предложения которых могут быть признаны Предложениями с совпадающими условиями.  |
| <b>Система заключения внебиржевых сделок (Система) –</b> | совокупность технических средств и программного обеспечения, являющаяся частью Клиринговой системы, обеспечивающая возможность Пользователям системы и Клиринговому центру подавать Запросы котировок, Котировки и Предложения, а также осуществлять иные действия, предусмотренные Правилами клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, в том числе Правилами. |

### Статья 3. Права и обязанности Пользователей системы

- 3.1. Пользователи системы вправе:
- 3.1.1. При выполнении условий, определенных Правилами, иметь доступ к Системе, инициировать Аукционы и подавать Котировки с целью заключения Внебиржевых сделок в Режиме «Аукцион RFS», а также подавать Предложения с целью заключения Внебиржевых сделок в Режиме «Сделки с ЦК»;
  - 3.1.2. Использовать Систему для подачи Предложений, Котировок и Запросов котировок в порядке, предусмотренных Правилами;
  - 3.1.3. Получать отчетные и иные документы по итогам проведения Аукционов и заключения Внебиржевых сделок, форматы которых установлены соответствующими внутренними документами Клирингового центра (соответствующими частями внутренних документов Клирингового центра).
  - 3.1.4. Заключать Кросс-сделки при условии соблюдения ограничений, установленных Правилами.
- 3.2. Пользователи системы не вправе подавать Котировки и Запросы котировок в Режиме «Аукцион RFS» с целью заключения Внебиржевых сделок за счет клиента Пользователя, являющегося физическим лицом.
- 3.3. Пользователи системы обязаны:
- 3.3.1. Иметь допуск к клиринговому обслуживанию на валютном рынке и рынке драгоценных металлов и соответствовать требованиям, предъявляемым к Участникам клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов;
  - 3.3.2. Использовать Систему только в целях заключения Внебиржевых сделок в порядке, предусмотренных Правилами клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, в том числе Правилами;
  - 3.3.3. Своевременно оплачивать вознаграждение и иные платежи, устанавливаемые Клиринговым центром в размере, установленном в Тарифах Клирингового центра;
  - 3.3.4. Соблюдать режим конфиденциальности информации, которая становится доступной Пользователю системы в связи с его доступом в Систему.

#### **Статья 4. Порядок оповещения Пользователей системы**

- 4.1. Информация, касающаяся вопросов предоставления Пользователям доступа к Системе и функционирования Системы, доводится до сведения Пользователей путем направления им информационного сообщения любым из следующих способов:
  - 4.1.1. в электронной форме посредством Системы;
  - 4.1.2. в форме электронного сообщения или электронного документа с использованием СЭД ПАО Московская Биржа (далее – СЭД);
  - 4.1.3. в форме сообщения по электронной почте;
  - 4.1.4. в письменной форме курьером;
  - 4.1.5. посредством раскрытия информации на Сайте Клирингового центра;
  - 4.1.6. иным способом, позволяющим однозначно идентифицировать дату направления информационного сообщения.
- 4.2. Днем оповещения Пользователей системы при предоставлении информации способами, предусмотренными подпунктами 4.1.1 - 4.1.4 Правил, является день получения Пользователями системы информационного сообщения. При предоставлении информации способом, предусмотренным подпунктом 4.1.5 Правил, днем оповещения Пользователей системы является день раскрытия информации на Сайте Клирингового центра.

#### **Статья 5. Порядок предоставления документов Клиринговому центру / получения документов от Клирингового центра в форме электронного документа**

- 5.1. Предоставление документов Клиринговому центру / получение документов от Клирингового центра в форме электронного документа осуществляется Пользователем системы в соответствии с Порядком ЭДО.
- 5.2. Сформированный файл с электронным документом должен быть подписан электронной подписью Пользователя системы и направлен в адрес Клирингового центра посредством СЭД.

#### **Статья 6. Порядок раскрытия информации**

- 6.1. Клиринговый центр обязан обеспечить сохранность информации, содержащейся в Системе.
- 6.2. Клиринговый центр вправе публиковать на Сайте Клирингового центра обобщенную информацию об инициированных Аукционах и заключенных Внебиржевых сделках.

## **РАЗДЕЛ II. ДОСТУП К СИСТЕМЕ**

### **Статья 7. Порядок предоставления доступа к Системе**

- 7.1. Присоединение к Правилам в качестве Пользователя системы с целью подачи Предложений и заключения Внебиржевых сделок в Режиме «Сделки с ЦК» осуществляется путем подачи Участником клиринга, допущенным к клиринговому обслуживанию на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, соответствующего заявления о присвоении указанным в таком заявлении клиринговым идентификаторам полномочий на заключение Внебиржевых сделок в Режиме «Сделки с ЦК». Доступ к Режиму «Сделки с ЦК» предоставляется не позднее 5 (пяти) Расчетных дней после предоставления соответствующего заявления.
- 7.2. Клиринговый центр предоставляет доступ к Системе с целью заключения Пользователем Внебиржевых сделок в порядке, установленном Правилами клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, в том числе Правилами. Заключение договора о пользовании Системой осуществляется путем присоединения к указанному договору, условия которого предусмотрены Правилами.
- 7.3. Присоединение к Правилам в качестве Потребителя ликвидности осуществляется при первом инициировании лицом, являющимся Участником клиринга, допущенным к клиринговому обслуживанию на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, Аукциона путем подачи Запроса котировок в Режиме «Аукцион RFS». Подача такого Запроса котировок, подписанного ПЭП Участника клиринга, является акцептом оферты Клирингового центра о присоединении к Правилам, который должен быть осуществлен не позднее, чем в течение 1 (одного) года с момента вступления Правил в силу. Указанный срок для акцепта продлевается на 1 (один) год после вступления в силу каждой новой редакции Правил.  
При присоединении к Правилам в порядке, предусмотренном настоящим пунктом Правил, Потребителю ликвидности по умолчанию предоставляется доступ ко всем Инструментам, с которыми допускается заключение Внебиржевых сделок в соответствии с Правилами.
- 7.4. Присоединение к Правилам в качестве Поставщика ликвидности осуществляется путем подачи лицом, являющимся Участником клиринга, допущенным к клиринговому обслуживанию на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, соответствующего заявления о присвоении указанным в таком заявлении клиринговым идентификаторам полномочий Поставщика ликвидности. Доступ к Системе в качестве Поставщика ликвидности предоставляется не позднее 5 (пяти) Расчетных дней после предоставления соответствующего заявления.
- 7.5. Клиринговый центр вправе без объяснения причин отказать Участнику клиринга в доступе к Системе в качестве Поставщика ликвидности.

## **Статья 8. Порядок приостановления и прекращения доступа к Системе**

- 8.1. На основании заявления Пользователя системы Клиринговый центр приостанавливает / прекращает доступ Пользователя к Системе или к отдельным Инструментам для подачи Котировок и/или Запроса котировок в Режиме «Аукцион RFS» путем приостановления соответствующих полномочий для клиринговых идентификаторов, указанных в соответствующем заявлении.
- На основании заявления Пользователя системы Клиринговый центр приостанавливает / прекращает доступ Пользователя к Системе для подачи Предложений в Режиме «Сделки с ЦК» путем приостановления соответствующих полномочий для клиринговых идентификаторов, указанных в соответствующем заявлении.
- Клиринговый центр вправе приостановить / прекратить доступ Пользователя к Системе или к отдельным Инструментам для подачи Предложений, Котировок и/или Запроса котировок по иным основаниям, предусмотренным Правилами.
- 8.2. Для возобновления доступа к Системе или к отдельным Инструментам для подачи Предложений, Котировок и/или Запроса котировок Участнику клиринга необходимо направить заявление о присвоении указанным в таком заявлении клиринговым идентификаторам полномочий на заключение Внебиржевых сделок в Режиме «Сделки с ЦК» и/или полномочий Потребителя и/или Поставщика ликвидности.
- 8.3. В случае если Пользователю как Участнику клиринга Клиринговым центром прекращен или приостановлен допуск к клиринговому обслуживанию, допуск Пользователя к Системе также прекращается или приостанавливается соответственно.
- 8.4. Клиринговый центр вправе в одностороннем порядке приостановить допуск Потребителя ликвидности к Системе в случае, если количество Аукционов, инициированных Потребителем ликвидности, не приведших к заключению Внебиржевой сделки, превысило лимит, установленный решением Клирингового центра.
- 8.5. Клиринговый центр вправе в одностороннем порядке приостановить допуск Поставщика ликвидности к Системе в случае, если количество Предложений Поставщика ликвидности, не прошедших проверку в соответствии с Правилами клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, превысило лимит, установленный решением Клирингового центра.
- 8.6. Клиринговый центр вправе без объяснения причин в одностороннем порядке прекратить допуск Пользователя к Системе.



### **РАЗДЕЛ III. ИНИЦИИРОВАНИЕ АУКЦИОНА, ПОРЯДОК ПОДАЧИ КОТИРОВОК И ЗАКЛЮЧЕНИЯ ВНЕБИРЖЕВЫХ СДЕЛОК**

#### **Статья 9. Общие условия и порядок подачи Предложений, инициирования Аукциона, подачи Котировок и заключения Внебиржевых сделок**

- 9.1. Пользователи системы, допущенные к Режиму «Сделки с ЦК» имеют право направлять с использованием Системы Предложения, содержащих указания на других Пользователей системы, Предложения которых могут быть признаны Предложениями с совпадающими условиями.
- 9.2. Клиринговым центром установлен запрет на заключение сделок в Режиме «Сделки с ЦК» с одним Идентификатором Участника клиринга. В случае, если Предложения в Режиме «Сделки с ЦК» были поданы в Систему с одного Идентификатора Участника клиринга, такая Котировка не принимается Системой.
- 9.3. Потребитель ликвидности путем подачи Запроса котировок инициирует Аукцион с целью заключения Внебиржевой сделки купли-продажи иностранной валюты с Поставщиком ликвидности в Режиме «Аукцион RFS». При открытии Аукциона Потребитель ликвидности указывает следующие параметры:
- код Инструмента купли-продажи иностранной валюты;
  - объем сделки по Инструменту (в валюте лота);
  - продолжительность Аукциона;
  - видимость Котировок: (1) все Котировки Поставщиков ликвидности или (2) только лучшие Котировки;
  - видимость наименования Потребителя ликвидности: (1) раскрывать наименование Потребителя ликвидности или (2) не раскрывать наименование Потребителя ликвидности.
- Потребителю ликвидности доступна информация только об инициированных им Аукционах.
- Поставщику ликвидности доступна информация обо всех инициированных и не завершенных Аукционах.
- 9.4. После подачи в Систему Потребителем ликвидности Запроса котировок Поставщики ликвидности получают сообщение об открытии Аукциона и возможности подачи Котировок с учетом установленных Потребителем параметров.
- Потребителю ликвидности не доступна информация о Поставщиках ликвидности, подавших Котировки.
- Поставщикам ликвидности не доступна информация о Потребителе ликвидности, инициировавшем Аукцион, за исключением случаев, когда Потребитель ликвидности дает согласие на такое раскрытие путем выбора в Системе соответствующей опции при открытии Аукциона.
- 9.5. В ответ на инициированный Потребителем Аукцион Поставщики ликвидности подают Котировки с ценами на продажу и/или покупку Инструмента в соответствии с параметрами, указанными при открытии Аукциона.

В ходе проведения каждого Аукциона Поставщик ликвидности имеет право направить одновременно не более одной Котировки на продажу и одной Котировки на покупку Инструмента.

Поставщик ликвидности имеет право в любой момент до окончания Аукциона и до выбора его Котировки Потребителем ликвидности снимать или изменять свои Котировки, при этом в Системе в рамках одного Аукциона в каждый момент времени могут находиться не более одной Котировки на продажу и не более одной Котировки на покупку каждого Поставщика ликвидности.

9.6. Поставщику ликвидности доступна информация о всех его Котировках, а также о Котировках, которые в данный момент являются лучшими, без раскрытия информации о подавших их Поставщиках ликвидности.

9.7. С момента начала Аукциона и до его завершения Потребитель ликвидности вправе выбрать удовлетворяющую его Котировку на покупку и/или на продажу путем направления соответствующего Предложения. Выбранная Потребителем ликвидности Котировка Поставщика ликвидности приобретает статус Предложения Поставщика ликвидности.

Содержание Предложений должно соответствовать требованиям, установленным Правилами клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.

Предложение может содержать краткий код клиента Участника торгов, совпадающего с Участником клиринга и являющегося Пользователем.

9.8. После выбора Потребителем ликвидности Котировки путем направления Предложения Аукцион продолжается до момента заключения Внебиржевой сделки. Поставщики ликвидности, чьи Котировки не были выбраны Потребителем ликвидности, вправе продолжать подавать Котировки до момента завершения Аукциона (с учетом ограничений, установленных п. 9.5). При этом Потребитель ликвидности не вправе подавать новое Предложение в ходе этого же Аукциона или отменить Аукцион.

Поставщик ликвидности не вправе отозвать свое Предложение.

9.9. Аукцион завершается в момент наступления одного из следующих событий (в зависимости от того, что наступило ранее):

- заключение Внебиржевой сделки;
- отрицательный результат проверки Предложения, поданного Потребителем ликвидности, проводимой в соответствии с Правилами клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов;
- истечение времени, установленного Потребителем ликвидности при открытии Аукциона.

9.10. Клиринговый центр осуществляет проверку и регистрацию Предложений Участников клиринга, Поставщика и Потребителя ликвидности и заключение Внебиржевых сделок в порядке и на условиях, предусмотренных Правилами клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.

- 9.11. Потребитель ликвидности путем подачи Запроса котировок инициирует Аукцион с целью заключения Внебиржевой сделки своп с иностранной валютой или драгоценным металлом в Режиме «Аукцион RFS». При открытии Аукциона Потребитель ликвидности указывает следующие параметры:
- код Инструмента своп с иностранной валютой или драгоценным металлом;
  - объем сделки по Инструменту (в валюте лота);
  - продолжительность Аукциона;
  - видимость Котировок: (1) все Котировки Провайдеров ликвидности или (2) только лучшие Котировки.
- Потребителю ликвидности доступна информация только об инициированных им Аукционах.
- Провайдерам ликвидности доступна информация обо всех инициированных и не завершенных Аукционах.
- 9.12. После подачи в Систему Потребителем ликвидности Запроса котировок Клиринговый центр направляет Провайдерам ликвидности запросы котировок, условия которых соответствуют параметрам Запроса котировок Участника клиринга. Клиринговый центр посредством Клиринговой системы предоставляет Участнику клиринга, инициировавшему Аукцион, без изменений получаемую от Провайдеров ликвидности информацию (котировки Провайдеров ликвидности), необходимую для направления Участником клиринга Предложения Клиринговому центру в целях заключения Внебиржевой сделки своп с иностранной валютой или драгоценным металлом с Провайдером ликвидности в Режиме «Аукцион RFS».
- 9.13. Потребителю ликвидности не доступна информация о Провайдерах ликвидности, подавших котировки Провайдера ликвидности.
- 9.14. Провайдерам ликвидности не доступна информация о Потребителе ликвидности, инициировавшем Аукцион.
- 9.15. С момента начала Аукциона и до его завершения Потребитель ликвидности вправе выбрать удовлетворяющую его котировку Провайдера ликвидности на покупку и/или на продажу путем направления соответствующего Предложения.
- 9.16. После выбора Потребителем ликвидности котировки Провайдера ликвидности путем направления Предложения Аукцион продолжается до момента заключения Внебиржевой сделки.
- 9.17. Аукцион завершается в момент наступления одного из следующих событий (в зависимости от того, что наступило ранее):
- заключение Внебиржевой сделки;
  - отрицательный результат проверки Предложения, поданного Потребителем ликвидности, проводимой в соответствии с Правилами клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов;
  - истечение времени, установленного Потребителем ликвидности при открытии Аукциона.

- 9.18. Клиринговый центр осуществляет проверку и регистрацию Предложений Потребителя и заключение Внебиржевых сделок в порядке и на условиях, предусмотренных Правилами клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.
- 9.19. Время подачи Предложений, Запросов котировок, Котировок, выбора Потребителем ликвидности Котировки, время предоставления выписок из реестра Внебиржевых сделок, а также продолжительность Аукционов RFS в отношении конкретных Инструментов устанавливается в Расписании заключения внебиржевых сделок с иностранной валютой и драгоценными металлами и направления отчетов (выписок) по ним..
- 9.20. Заключение Внебиржевых сделок и проведение Аукциона RFS для заключения Внебиржевых сделок с иностранной валютой с датой исполнения обязательств в дату заключения сделки, приходящийся на день, не являющийся Расчетным днем по такой иностранной валюте, не допускается.

#### **Статья 10. Порядок продолжения неисполненных Аукционов. Ограничения для участия в Аукционе**

- 10.1. В случае если Предложение Поставщика ликвидности не прошло проверку в соответствии с Правилами клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов (далее – отрицательный результат проверки, проводимой в соответствии с Правилами клиринга), такой Поставщик ликвидности не вправе далее подавать Котировки в ходе данного Аукциона. Аукцион продолжается, и Потребитель ликвидности вправе выбрать иную Котировку на покупку и/или на продажу.
- 10.2. Клиринговый центр вправе своим решением установить максимально допустимое количество отрицательных результатов проверок Предложений Поставщика ликвидности, проводимых в соответствии с Правилами клиринга, после достижения которого Поставщик ликвидности не вправе подавать Котировки в Аукционах по всем доступным Инструментам до конца данного Расчетного дня.
- 10.3. В случае отрицательного результата проверки, проводимой в соответствии с Правилами клиринга, Предложения, поданного Потребителем ликвидности, Аукцион прекращается.
- 10.4. Клиринговый центр вправе своим решением установить максимально допустимое количество отрицательных результатов проверок Предложений Потребителей ликвидности, проводимых в соответствии с Правилами клиринга, после достижения которого Потребитель ликвидности не вправе инициировать Аукционы до конца данного Расчетного дня.

#### **Статья 11. Ограничения на заключение Кросс-сделок**

- 11.1. Заключение Кросс-сделок запрещено за исключением случая, установленного пунктом 11.2 Правил.

- 11.2. Пользователь вправе заключать Кросс-сделки в случае наличия у Клирингового центра полученной от Биржи информации об имеющемся разрешении на заключение Пользователем, являющимся Участником торгов, кросс-сделок на валютном рынке и рынке драгоценных металлов Биржи, на основании заявок, поданных данным Пользователем как Участником торгов за свой счет или за счет лица, зарегистрированного в качестве клиента такого Участника торгов.
- 11.2.1. Факт подачи Пользователем, являющимся Участником торгов, Предложений за счет одного и того же лица, зарегистрированного в качестве клиента такого Участника торгов устанавливается Клиринговым центром на основании полученных от Биржи Идентификационных данных клиента, соответствующих краткому коду клиента, указанному в Предложении.

#### **РАЗДЕЛ IV. ПОРЯДОК ФОРМИРОВАНИЯ АЛГОРИТМИЧЕСКОГО ПАКЕТА ПРЕДЛОЖЕНИЙ НА ЗАКЛЮЧЕНИЕ ВНЕБИРЖЕВЫХ СДЕЛОК С ИНОСТРАННОЙ ВАЛЮТОЙ И ДРАГОЦЕННЫМИ МЕТАЛЛАМИ С ПРОВАЙДЕРОМ ЛИКВИДНОСТИ**

##### **Статья 12. Особенности подачи алгоритмического пакета Предложений на заключение Внебиржевых сделок с иностранной валютой и драгоценными металлами с Провайдером ликвидности**

- 12.1. Участники клиринга вправе подавать алгоритмические пакеты Предложений на заключение Внебиржевых сделок с иностранной валютой и драгоценными металлами с Провайдером ликвидности. Предложения, содержащиеся в алгоритмическом пакете Предложений, автоматически подаются в Систему в течение заданного им периода времени.
- 12.2. Клиринговый центр осуществляет проверку и регистрацию Предложений Участников клиринга, подаваемых с использованием Алгоритмического пакета Предложений, и заключение Внебиржевых сделок в порядке и на условиях, предусмотренных Правилами клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.
- 12.3. Алгоритмический пакет Предложений, подаваемый Участником клиринга, должен содержать следующие параметры (условия алгоритмического пакета Предложений):
- краткий код клиента (при подаче Участником клиринга алгоритмического пакета Предложений на заключение сделок в интересах клиента);
  - Торгово-клиринговый счет Участника клиринга;
  - идентификатор Участника клиринга;
  - направленность Предложений, подаваемых в рамках алгоритмического пакета Предложений: на продажу или на покупку;
  - суммарное количество лотов всех Предложений, содержащихся в алгоритмическом пакете Предложений;
  - дату исполнения обязательств по сделкам купли-продажи иностранной валюты / драгоценного металла;

- вид Предложений в рамках алгоритмического пакета Предложений:
  - Предложения на заключение Внебиржевой сделки, содержащие не требующего дополнительного подтверждения согласие купить или продать определенное количество лотов по лучшим ценам, указанным в таком Предложении, зарегистрированном в Системе;
  - Предложения на заключение Внебиржевой сделки, содержащие не требующего дополнительного подтверждения согласие купить определенное количество лотов по цене, не выше указанной в таком Предложении максимальной цены покупки, или продать определенное количество лотов по цене, не ниже указанной в таком Предложении минимальной цены продажи;
- для алгоритмического пакета, содержащего Предложения на заключение Внебиржевой сделки, содержащие не требующего дополнительного подтверждения согласие купить определенное количество лотов по цене, не выше указанной в таком Предложении максимальной цены покупки, или продать определенное количество лотов по цене, не ниже указанной в таком Предложении минимальной цены продажи: предельную цену продажи или покупки;
- максимальное допустимое отклонение от текущей лучшей цены покупки/продажи встречного Предложения;
- тип ограничения предельной цены (для Предложений, которые исполняется в максимально возможном объеме сразу же после его подачи в Систему):
  - процентный – максимальное допустимое отклонение цены Предложения, подаваемого в Систему, в процентах от текущей лучшей цены покупки/продажи встречного Предложения,
  - курсовой – максимальное допустимое отклонение цены Предложения, подаваемого в Систему, в абсолютных значениях курса от текущей лучшей цены покупки/продажи встречного Предложения;
- период времени, в течение которого Предложения из алгоритмического пакета Предложений должны подаваться в Систему;
- количество Предложений, определяемое следующим образом:
  - путем указания Участником клиринга конкретного числа Предложений в пакете Предложений или
  - путем деления указанного Участником клиринга периода времени подачи Предложений на указанный им временной интервал, с которым Предложения, входящие в алгоритмический пакет Предложений, должны подаваться в Систему;
- коэффициент случайного отклонения временного интервала в рамках установленного периода времени и случайного отклонения объема Предложений, входящих в алгоритмический пакет Предложений.

- 12.4. Каждое Предложение, содержащееся в алгоритмическом пакете Предложений, содержит условия, предусмотренные Правилами клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, в том числе Правилами для Предложений на заключение Внебиржевых сделок по соответствующему Инструменту с учетом вида и типа Предложения.
- 12.5. При наступлении указанного в алгоритмическом пакете Предложений периода времени, Предложения, содержащиеся в пакете Предложений, подаются в Систему с учетом установленных в условиях данного пакета Предложений количества Предложений, интервалов и иных параметров. Каждое последующее Предложение из алгоритмического пакета Предложений может быть подано в Систему после получения ответа от Системы об исполнении или об отказе от исполнения предыдущего Предложения из данного алгоритмического пакета Предложений.
- 12.6. Предложения, содержащиеся в пакете Предложений/ алгоритмические пакеты Предложений, поданные в Систему с нарушением настоящих Правил, в том числе в результате возникновения обстоятельств, вызывающих и/или создающих предпосылки к возникновению сбоев (отказов) при эксплуатации Системы и/или иных программно-технических средств используемых при заключении Внебиржевых сделок с иностранной валютой/ Внебиржевых сделок с драгоценными металлами 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, а также иные обстоятельства, такие как случаи нарушения правил разграничения доступа и/или попыток несанкционированного доступа к Системе, не регистрируются Системой.

### **Статья 13. Порядок определения параметров алгоритмического пакета Предложений**

- 13.1. Объем Предложения (в лотах) из алгоритмического пакета Предложений определяется в соответствии со следующим порядком:
- 13.1.1. Используемые функции:
- Round – функция математического округления до заданного порядка округления;
  - Floor (Ceil) - функции округления вниз (вверх) до заданного порядка округления;
  - Random - функция выборки случайной величины из диапазона;
  - Min (Max) – функции выборки минимального (максимального) значения.
- 13.1.2. Остаток объема алгоритмического пакета Предложений на  $i$ -й итерации:
- $$V_{ост} = V - j = 1i - 1V_{факт}J,$$
- где
- $V_{CP} \in C, j$  – объем, фактически исполненный при выставлении связанного Предложения на  $j$ -й итерации. На итерации  $i=1$   $V_{Ps} \in C, i=V$ .
- 13.1.3. Планируемое количество итераций, оставшееся до завершения алгоритма (включая текущую итерацию  $i$ ):

$$M_i = \text{Min} \left( N - i + 1, \text{Floor} \left( \frac{VPsCfC_{,i}}{Vmin} \right) \right)$$

13.1.4. Средний объем Предложения из алгоритмического пакета Предложений:

$$Vcp_i = \text{Floor} \left( \begin{cases} M_i = 0 : VPsCfC_{,i} \\ M_i \text{ в } \%_00 : \frac{VPsCfC_{,i}}{M_i} \end{cases} \right)$$

13.1.5. Минимальный объем Предложения из алгоритмического пакета Предложений:

$$Vmin_i = \begin{cases} VCsCb_i = 0 : 0 \\ VCsCb_i \text{ в } \%_00 : \text{Max} \left( \text{Floor} \left( VCsCb_i \Gamma - \left( 1 - \frac{K_r \text{exp}}{2} \right) \right), Vmin \right) \end{cases}$$

где

$K_{r\text{exp}} = e^{K_r - 1} e^{-1}$  - величина случайного отклонения Предложения из алгоритмического пакета Предложений.

13.1.6. Максимальный объем Предложения из алгоритмического пакета Предложений:

$$Vmax_i = \text{Ceil} \left( VCsCb_i \Gamma - \left( 1 + \frac{K_r \text{exp}}{2} \right) \right)$$

13.1.7. Нормализация по минимальному остатку (гарантированно оставить объем  $Vmin$  для каждой последующей итерации алгоритмического пакета – при условии, что все Предложения из него будут исполнены в Системе полностью):

$$Vmax_i = \text{Min} \left( Vmax_i, VPsCfC_{,i} - Vmin \Gamma - \text{Max}(M_i - 1, 0) \right)$$

13.1.8. Случайный объем Предложений из алгоритмического пакета Предложений:

$$Vrand_i = \text{Random}(Vmin_i, Vmax_i)$$

Границы диапазона включаются.

В случае если  $Vmin_i > Vmax_i$ , вместо вызова функции  $\text{Random}()$  возвращается 0.

13.1.9. Дополнение остатка (если в результате исполнения  $i$ -й итерации (при условии полного исполнения Предложения в Системе) в алгоритмическом пакете остается объем  $< Vmin$ , то остаток прибавляется к объему текущей итерации):

$$VPrPsPi_i = \begin{cases} VPsCfC_{,i} - Vmin \text{ в } \%_00 \Gamma Vmin : Vmin \text{ в } \%_00 \Gamma Vmin \\ VPsCfC_{,i} - Vmin \text{ в } \%_00 \Gamma Vmin : VPsCfC_{,i} \end{cases}$$

13.1.10. Финальный расчет объема Предложения из алгоритмического пакета Предложений, запланированный к вводу на  $i$ -й итерации:

$$VPrPsPi_i = \begin{cases} VPrPsPi_i \text{ в } \%_00 \Gamma Vmin : VPrPsPi_i \\ VPrPsPi_i < Vmin : 0 \end{cases}$$

13.2. Участник клиринга при вводе параметров алгоритмического пакета вправе указать коэффициент случайного отклонения Предложений из алгоритмического пакета Предложений по времени их ввода и объему –  $K_r = 0, \dots, 1$  с шагом 0,1, где

- 0 – нет отклонений (равномерное распределение заявок по времени ввода и объему);



- 1 – максимальное отклонение ( $\pm 50\%$  от величины рассчитанного среднего временного интервала и от величины рассчитанного среднего объема - VСГСЪi).

Величина случайного отклонения заявок рассчитывается следующим образом:

$$K_{\text{exр}} = e^{K_{\text{r}} - 1} e^{-1},$$

где

$K_{\text{exр}}$  – случайное отклонение Предложений,

$K_{\text{r}}$  – коэффициент случайного отклонения Предложений, задаваемый Участником клиринга (0, ..., 1),

$e$  – экспонента заданного числа.

## **Статья 14. Прочее**

- 14.1. Клиринговый центр не несет ответственности за потери, убытки, издержки или расходы, вне зависимости от причины их возникновения (включая их возникновение из-за дефектов, ошибок, неисправностей или погрешностей при доступе к Системе, либо по причине отсутствия доступа к Системе или любой ее части), а также при использовании Системы, понесенные или полученные Пользователями системы, за исключением случаев, когда такие потери возникают напрямую в результате допущенной Клиринговым центром грубой небрежности, умышленного неисполнения обязанностей или мошенничества.
- 14.2. Пользователи системы гарантируют Клиринговому центру полное возмещение любых убытков, ущерба, исков, издержек или расходов, понесенных Клиринговым центром каким бы то ни было образом в связи с осуществлением Пользователем системы доступа к Системе, либо использования Пользователем системы, вне зависимости от причины их возникновения, кроме случаев, когда такие убытки возникли по причине допущенной Клиринговым центром грубой небрежности, умышленного неисполнения обязанностей или мошенничества.
- 14.3. Пользователь системы соглашается с тем, что периодически доступ к Системам по какой-либо причине не будет работать или будет иным образом закрыт для Пользователя системы в связи с техническим обслуживанием, неисправностями в работе оборудования, ошибками программного обеспечения, перерывами в обслуживании клиентов или работе сетей передачи данных или иным причинам, а также с тем, что Клиринговый центр не несет ответственности перед Пользователями системы за убытки, ущерб, издержки или расходы, вне зависимости от причины их возникновения, полученные в результате неработающего доступа к Системам.