

ФЕДЕРАЛЬНАЯ СЛУЖБА ПО  
ФИНАНСОВЫМ РЫНКАМ  
ЗАРЕГИСТРИРОВАНО  
Дата: "28" ноября 2012 г.  
в реестре №: 12-2862/12-4



УТВЕРЖДЕНЫ  
Наблюдательным советом  
ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр»

22 октября 2012 г., Протокол № 7

Председатель Наблюдательного совета ЗАО АКБ  
«Национальный Клиринговый Центр»



Лыков С.П.

**ПРАВИЛА КЛИРИНГА  
ЗАО АКБ «НАЦИОНАЛЬНЫЙ КЛИРИНГОВЫЙ ЦЕНТР»  
(новая редакция)**

Москва, 2012 г.



## Оглавление

I.	ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ .....	7
Статья 1.	Термины и определения, используемые в настоящей части Правил клиринга ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр» .....	7
Статья 2.	Способы и иные условия осуществления клиринга.....	23
Статья 3.	Договор об оказании клиринговых услуг .....	27
Статья 4.	Конфиденциальность и персональные данные.....	28
Статья 5.	Место и порядок разрешения споров .....	29
Статья 6.	Принципы осуществления клиринговой деятельности .....	29
Статья 7.	Порядок использования Аналога собственноручной подписи .....	31
II.	ТРЕБОВАНИЯ К УЧАСТНИКАМ КЛИРИНГА, ИХ КЛИЕНТАМ И ДЕРЖАТЕЛЯМ. ПОРЯДОК РЕГИСТРАЦИИ УЧАСТНИКОВ КЛИРИНГА И ИХ КЛИЕНТОВ. ДОПУСК К КЛИРИНГОВОМУ ОБСЛУЖИВАНИЮ .....	33
Статья 8.	Требования к Участникам клиринга.....	33
Статья 9.	Условия клирингового обслуживания. Порядок предоставления и прекращения (приостановления) допуска к клиринговому обслуживанию....	34
Статья 10.	Порядок регистрации Участников клиринга и их Клиентов.....	38
Статья 11.	Требования к клиентам Участника клиринга .....	40
Статья 12.	Требования к Держателям. Порядок получения (лишения) статуса Держателя .....	41
Статья 13.	Требования к Банкам.....	42
Статья 14.	Требования к Участникам клиринга по предоставлению отчетности Клиринговому центру .....	43
Статья 15.	Требования к финансовому состоянию Участников клиринга.....	45
Статья 16.	Порядок урегулирования неисполненных обязательств в случае прекращения клирингового обслуживания .....	45
III.	ТРЕБОВАНИЯ К ПОРЯДКУ ВЗАИМОДЕЙСТВИЯ УЧАСТНИКОВ КЛИРИНГА С РАСЧЕТНОЙ ОРГАНИЗАЦИЕЙ, ДЕПОЗИТАРИЕМ И БИРЖЕЙ .....	54
Статья 17.	Требования к порядку взаимодействия Участников клиринга и/или их клиентов с Расчетной организацией .....	54
Статья 18.	Требования к порядку взаимодействия Участников клиринга и/или их клиентов с Депозитарием .....	54
Статья 19.	Требования к порядку взаимодействия Клирингового центра и Биржи, а также Участников клиринга с Биржей .....	54
IV.	ПОРЯДОК ВЗАИМОДЕЙСТВИЯ КЛИРИНГОВОГО ЦЕНТРА С РАСЧЕТНОЙ ОРГАНИЗАЦИЕЙ, ДЕПОЗИТАРИЕМ И БИРЖЕЙ.....	57
Статья 20.	Порядок взаимодействия с Расчетной организацией.....	57
Статья 21.	Порядок взаимодействия с Депозитарием .....	59
Статья 22.	Порядок взаимодействия с Биржей при подаче заявок и заключении сделок	61
Статья 23.	Порядок взаимодействия с Биржей при регистрации Сводного реестра сделок с ценными бумагами и Сводного реестра компенсационных взносов .....	63
V.	ПОРЯДОК ОСУЩЕСТВЛЕНИЯ КЛИРИНГА.....	65

Статья 24.	Порядок внесения и возврата Обеспечения .....	65
Статья 25.	Порядок внесения и возврата взноса в Коллективный фонд .....	69
Статья 26.	Единый лимит и риск-параметры .....	70
Статья 27.	Порядок проведения клиринговых сессий.....	72
Статья 28.	Процедура контроля обеспечения по биржевым сделкам с ценными бумагами, осуществляемая при подаче заявок или заключении сделок .....	76
Статья 29.	Порядок подачи и регистрации Поручений на клиринг по внебиржевым сделкам с ценными бумагами.....	78
Статья 30.	Порядок исполнения сделок и обязательств по внесению Гарантийных переводов.....	79
Статья 31.	Порядок подачи и регистрации Отчетов на исполнение .....	80
Статья 32.	Порядок подачи и регистрации поручений на внесение компенсационных взносов и поручений на отказ от компенсационных взносов .....	82
Статья 33.	Порядок подачи и регистрации Специальных отчетов на исполнение.....	84
Статья 34.	Порядок подачи и регистрации Срочных отчетов на исполнение .....	85
Статья 35.	Порядок исполнения / прекращения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением и обязательств по возврату Гарантийных переводов.....	87
Статья 36.	Порядок урегулирования случаев неисполнения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением.....	92
Статья 37.	Порядок использования и возмещения Коллективного фонда.....	97
Статья 38.	Порядок определения подлежащих исполнению обязательств и требований Участников клиринга и Клирингового центра .....	99
Статья 39.	Порядок определения подлежащих исполнению обязательств Участников клиринга по уплате Комиссионного вознаграждения .....	103
Статья 40.	Порядок определения подлежащих исполнению обязательств Участников клиринга по уплате Возмещения .....	108
Статья 41.	Порядок взаимодействия Клирингового центра с Расчетной организацией и Депозитарием при проведении расчетов по итогам клиринга.....	109
Статья 42.	Порядок удержания Комиссионного вознаграждения.....	113
Статья 43.	Порядок удержания Возмещения.....	114
Статья 44.	Порядок представления Участникам клиринга отчетных документов и иных отчетов по итогам клиринга .....	115
Статья 45.	Порядок формирования реестров Клирингового центра.....	118
Статья 46.	Условия Договора займа Клирингового центра, порядок его заключения и исполнения .....	119
Статья 47.	Порядок передачи Доходов по сделкам, заключенным с Клиринговым центром.....	121
Статья 48.	Взаимодействие с Биржей при возникновении обстоятельств, которые могут повлиять на возможность проведения Торгов.....	123
Статья 49.	Чрезвычайные ситуации .....	123
ПРИЛОЖЕНИЕ 1 .....		126
ПРИЛОЖЕНИЕ 2 .....		129
ПРИЛОЖЕНИЕ 3 .....		136

ПРИЛОЖЕНИЕ 4 .....	144
ПРИЛОЖЕНИЕ 5 .....	151
ПРИЛОЖЕНИЕ 6 .....	153
ПРИЛОЖЕНИЕ 7 .....	172
ПРИЛОЖЕНИЕ 8 .....	174
ПРИЛОЖЕНИЕ 9 .....	179

## I. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ

Настоящие Правила осуществления клиринговой деятельности ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр» на рынке ценных бумаг регулируют отношения, связанные с заключением и исполнением сделок купли-продажи ценных бумаг и сделок репо, заключаемых в Секторе рынка Основной рынок Закрытого акционерного общества «Фондовая биржа ММВБ», а также исполнением внебиржевых сделок купли-продажи ценных бумаг и сделок репо.

### Статья 1. Термины и определения, используемые в настоящей части Правил клиринга ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр»

#### 1.1. Общие понятия

**Аналог собственноручной подписи / АСП** – реквизит электронного сообщения, направляемого с использованием Клиринговой системы, подтверждающий идентификацию направившего электронное сообщение лица, целостность и неизменность электронных сообщений за счет использования специализированных программно-технических средств и организационных мероприятий. Аналогом собственноручной подписи признается Клиринговый идентификатор, позволяющий однозначно идентифицировать Участника клиринга или Клиринговый центр, направивший электронное сообщение и достоверно установить, что электронное сообщение исходит от Участника клиринга / Клирингового центра, которому присвоен данный Клиринговый идентификатор.

**Аутентификация** – процедура подтверждения принадлежности АСП Участнику клиринга / Клиринговому центру.

**Банк** – Участник клиринга, являющийся кредитной организацией.

**Биржа** – фондовая биржа или организатор торговли на рынке ценных бумаг, осуществляющие профессиональную деятельность на рынке ценных бумаг на основании выданных им соответствующих лицензий и заключившие договор о взаимодействии с Клиринговым центром.

**Биржевая сделка с ценными бумагами / Биржевая сделка** – сделка купли-продажи ценных бумаг или сделка РЕПО, заключенная на Бирже, и информация о которой передана Биржей Клиринговому центру в порядке, предусмотренном Правилами клиринга.

**Внебиржевая сделка с ценными бумагами / Внебиржевая сделка** – сделка купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов В0-В30 или сделка РЕПО с кодом расчетов S0-S2, заключенная между Участниками клиринга, информация о которой получена Клиринговым центром в порядке, предусмотренном Правилами клиринга. Значения кодов расчетов, используемых при заключении внебиржевых сделок, соответствуют значениям кодов расчетов, определенных Правилами торговли.

**Возмещение** – переменное возмещение и фиксированное возмещение.

**Фиксированное возмещение** – сумма денежных средств, подлежащая уплате одним Участником клиринга другому Участнику клиринга, являющемуся его контрагентом по биржевой сделке с ценными бумагами, в размере, определенном ими при заключении сделки, и в случае, установленном Правилами торговли.

**Переменное возмещение** – сумма денежных средств, подлежащая уплате одним Участником клиринга другому Участнику клиринга, являющемуся его

контрагентом по биржевой сделке с ценными бумагами, в случае и размере, установленных Правилами торговли.

**Гарантийный перевод** - переменная часть обеспечения Участника клиринга или Клирингового центра, рассчитываемая в порядке, предусмотренном Правилами клиринга и являющаяся обеспечением исполнения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением, заключенным между данным Участником клиринга и Клиринговым центром.

**Дата внесения компенсационного взноса** – дата, в которую Участник клиринга обязан исполнить обязательство по внесению компенсационного взноса в соответствии с условиями заключенной сделки с ценными бумагами в порядке, определенном Правилами клиринга.

В случае неисполнения Участником клиринга обязательств по внесению компенсационного взноса, предусмотренного условиями биржевой сделки РЕПО, Участники клиринга обязаны исполнить свои обязательства по второй части биржевой сделки РЕПО в первый расчетный день, следующий за Датой внесения компенсационного взноса (поскольку Дата исполнения второй части биржевой сделки РЕПО переносится на вышеуказанный расчетный день согласно Правилам торговли).

**Дата исполнения** - дата, в которую Участники клиринга и/или Клиринговый центр обязаны исполнить свои обязательства в соответствии с условиями заключенной сделки с ценными бумагами в порядке, определенном Правилами клиринга.

В случае, если определяемая в настоящем пункте дата выпадает не на Расчетный день, то Датой исполнения сделки считается следующий Расчетный день (с учетом этого пересчитываются обязательства по сделке, в том числе накопленный купонный доход по облигациям (далее – НКД)).

**Дата прекращения исполнения** – дата, начиная с которой не допускается исполнение в натуре обязательств / нетто-обязательств по сделкам с ценными бумагами:

- первый Расчетный день после Даты исполнения сделки с ценными бумагами с кодом расчетов T0, Z0, K0, Yn;
- второй Расчетный день после Даты исполнения сделки с ценными бумагами с кодом расчетов B0-B30, за исключением сделок, заключаемых на торгах Биржи в процессе размещения;
- первый Расчетный день после Даты исполнения сделки с ценными бумагами с кодом расчетов B0-B30 для сделок, заключаемых на торгах Биржи в процессе размещения;
- первый Расчетный день после Даты исполнения первой части сделки РЕПО, заключенной с кодом расчетов Rb, Z0, T0/Yn, Y0/Yn в случае неисполнения обязательств по первой части сделки РЕПО;
- второй Расчетный день после Даты исполнения первой части сделки РЕПО, заключенной с кодом расчетов S0-S2 и не являющейся внутридневной, в случае неисполнения обязательств по первой части сделки РЕПО (за исключением сделки РЕПО, заключенной в режиме торгов «РЕПО с Банком России: Аукцион РЕПО» или «РЕПО с Банком России: фикс.ставка»);
- первый Расчетный день после Даты исполнения первой части внутридневной сделки РЕПО и сделки РЕПО, заключенной в режиме торгов «РЕПО с Банком России: Аукцион РЕПО» или «РЕПО с Банком России: фикс.ставка», заключенной с кодом расчетов S0-S2, в случае неисполнения обязательств по первой части сделки РЕПО;

- первый Расчетный день после Даты исполнения второй части внутрисуточной сделки РЕПО, заключенной с кодом расчетов Rb или S0-S2;
- первый Расчетный день после Даты исполнения второй части сделки РЕПО, заключенной с кодом расчетов T0/Yn, Y0/Yn;
- второй Расчетный день после Даты исполнения второй части сделки РЕПО, не являющейся внутрисуточной и заключенной с кодом расчетов Z0, Rb или S0-S2.

До Даты прекращения исполнения каждый Расчетный день пересчитываются обязательства по сделкам РЕПО (в том числе с учетом НКД и подлежащего уплате купонного дохода, если фактическая дата исполнения второй части сделки РЕПО относится к следующему купонному периоду, и внесенных компенсационных взносов).

**Депозитарий** — расчетный депозитарий, осуществляющий расчеты по ценным бумагам по результатам клиринга, осуществленного Клиринговым центром, на основании соответствующих поручений Клирингового центра, в порядке, предусмотренном договором между Клиринговым центром и Депозитарием, а также Правилами клиринга.

**Держатель** – организация, получившая статус Держателя в соответствии с Правилами клиринга с целью использования ценных бумаг, учитываемых на торговых разделах корреспондентских счетов депо Держателя для проведения Клиринговым центром Процедуры контроля обеспечения по сделкам и расчетов по итогам клиринга сделок Участников клиринга, депозитарное обслуживание которых и/или их клиентов осуществляется Держателем.

**Добросовестный участник клиринга** - Участник клиринга, надлежащим образом исполнивший свои Итоговые нетто-обязательства по денежным средствам / ценным бумагам перед Клиринговым центром и не имеющий задолженности перед Клиринговым центром.

**Договор займа Клирингового центра** - договор займа ценных бумаг, заключаемый Клиринговым центром с Участником клиринга в порядке, определенном Правилами клиринга, с целью исполнения обязательств Клирингового центра по Сделкам с частичным обеспечением.

**Доход** - суммы денежных средств, соответствующие любым дивидендам, процентам, доходу или иному распределению на ценные бумаги, являющиеся предметом сделок РЕПО, заключенных с Клиринговым центром.

**Единый лимит** - величина, рассчитываемая Клиринговым центром в российских рублях для каждого Участника клиринга, ограничивающая риски по Сделкам с частичным обеспечением, заключаемым Клиринговым центром с Участником клиринга, для которого рассчитан Единый лимит.

**Задолженность** – Итоговое нетто-обязательство в российских рублях, не прекращенное после проведения зачета по итогам прекращения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением в порядке, определенном Правилами клиринга.

**Задолженность по гарантийным переводам** - неисполненное обязательство (неисполненная часть обязательства) Участника клиринга в российских рублях по уплате Гарантийных переводов.

**Заявление на регистрацию ТКС** – Заявление Участника клиринга на регистрацию торгового клирингового счета.

**Индикативные ставки РЕПО** – ставки РЕПО, определяемые в соответствии с Методикой определения риск-параметров рынка ценных бумаг и используемые для корректировки

Единого лимита Участников клиринга и для определения обязательств по уплате Гарантийных переводов по Сделкам с частичным обеспечением, Дата исполнения которых отстоит от текущей даты более, чем на 1 (один) Расчетный день.

**Итоговое нетто-обязательство по денежным средствам** - денежное обязательство в российских рублях Участника клиринга перед Клиринговым центром, не прекращенное по итогам зачета в ходе клиринга в соответствии с Правилами клиринга обязательств с наступившей Датой исполнения по Сделкам с частичным обеспечением и обязательств / требований Участника клиринга по возврату Гарантийных переводов.

**Итоговое нетто-обязательство по ценным бумагам** - обязательство в ценных бумагах Участника клиринга перед Клиринговым центром, не прекращенное по итогам зачета в ходе клиринга в соответствии с Правилами клиринга обязательств с наступившей Датой исполнения по Сделкам с частичным обеспечением;

**Итоговое нетто-требование по денежным средствам** - денежное требование в российских рублях Участника клиринга к Клиринговому центру, не прекращенное по итогам зачета в ходе клиринга в соответствии с Правилами клиринга обязательств с наступившей Датой исполнения по Сделкам с частичным обеспечением и обязательств / требований Участника клиринга по возврату Гарантийных переводов.

**Итоговое нетто-требование по ценным бумагам** – требование в ценных бумагах Участника клиринга перед Клиринговым центром, не прекращенное по итогам зачета в ходе клиринга в соответствии с Правилами клиринга обязательств с наступившей Датой исполнения по Сделкам с частичным обеспечением;

**Категория Участников клиринга** – совокупность Участников клиринга, к которым Клиринговый центр предъявляет единые требования и для которых Клиринговый центр устанавливает особенности клирингового обслуживания.

**Клиент Участника клиринга** – юридическое или физическое лицо, зарегистрированное Клиринговым центром в качестве клиента Участника клиринга. Клиентом Участника клиринга может быть как клиент Участника клиринга, так и клиент брокера (управляющего), являющегося клиентом Участника клиринга.

**Клиринговая комиссия / комиссия за клиринг** – плата, взимаемая Клиринговым центром с Участников клиринга в соответствии с Тарифами Клирингового центра (приложение № 1 к Правилам клиринга). Клиринговая комиссия взимается в российских рублях.

**Клиринговая система** – совокупность программно-технических средств, баз данных, телекоммуникационных средств, иного оборудования и программного обеспечения Клирингового центра, предназначенных для осуществления клиринговой деятельности в соответствии с Правилами клиринга.

**Клиринговый пул для расчетов в ходе торгов** - клиринговый пул, состоящий из обязательств по обеспеченным сделкам с ценными бумагами, подлежащих исполнению в ходе торгов.

**Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов** - клиринговый пул, состоящий из обязательств по обеспеченным сделкам с ценными бумагами, подлежащих исполнению по итогам торгов.

**Клиринговый идентификатор** – условное обозначение, однозначно определяющее Участника клиринга / Клиринговый центр.

**Клиринговый лист для Сделок с частичным обеспечением** – перечень ценных бумаг, с которыми возможно заключение и клиринг Сделок с частичным обеспечением.



**Клиринговый счет** – счет в российских рублях и/или в иностранной валюте, открытый Расчетной организацией для Клирингового центра, предназначенный для учета операций с денежными средствами Участников клиринга и клиентов Участников клиринга при осуществлении Клиринговым центром клиринга по заключенным сделкам, а также предназначенный для списания и зачисления денежных средств при проведении расчетов в Секторе «Фондовый рынок ММВБ» в соответствии с Правилами клиринга (в случаях, определенных договором между Клиринговым центром и Расчетной организацией).

**Клиринговый счет депо** – счет депо, открытый Депозитарием для Клирингового центра, предназначенный для учета операций с ценными бумагами Участников клиринга, клиентов Участников клиринга и Клирингового центра при осуществлении Клиринговым центром многостороннего клиринга, а также предназначенный для списания и зачисления ценных бумаг при проведении расчетов по ценным бумагам в соответствии с Правилами клиринга.

**Клиринговый центр** – клиринговая организация ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр».

**Код ценной бумаги** - код, позволяющий однозначно идентифицировать ценную бумагу в Клиринговой системе.

**Коллективный фонд** - фонд, формируемый в соответствии с Правилами клиринга в целях обеспечения исполнения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением любого из Участников клиринга, внесших взнос в Коллективный фонд в размере, установленном Клиринговым центром.

**Комиссионное вознаграждение** – клиринговая комиссия и иные виды комиссионного вознаграждения Биржи, включая абонентскую плату, установленную внутренними документами Биржи, и вознаграждения Технического центра включая дополнительное вознаграждение, установленное внутренними документами Технического центра, а также плата по тарифному плану «Размещения-фиксированный», в отношении которых на Клиринговый центр возложены функции по определению соответствующих обязательств Участников клиринга и контролю за порядком их исполнения. Комиссионное вознаграждение взимается в российских рублях. Возложение на Клиринговый центр функций по определению обязательств Участников клиринга по уплате комиссионного вознаграждения (за исключением клиринговой комиссии) и контролю за порядком их исполнения осуществляется на основании соответствующих договоров.

**Корреспондентский счет депо Держателя** - счет депо, открытый Депозитарием Держателю и предназначенный, в том числе, для учета ценных бумаг Участников клиринга и/или их клиентов, депозитарное обслуживание которых осуществляется Держателем.

**Корреспондентский счет депо Участника клиринга** – счет депо, открытый Депозитарием Участнику клиринга, имеющему лицензию профессионального участника рынка ценных бумаг на осуществление депозитарной деятельности, предназначенный для учета ценных бумаг клиентов Участника клиринга.

**Маржинальное требование** - требование Клирингового центра к Участнику клиринга об обеспечении обязательств по Сделкам с частичным обеспечением, заключенным Клиринговым центром с Участником клиринга, предъявляемое в порядке и случае, определенных Правилами клиринга.

**Методика определения риск-параметров рынка ценных бумаг** - внутренний документ Клирингового центра, устанавливающий порядок определения риск-параметров фондового и денежного рынков ОАО Московская Биржа.

**Недобросовестный участник клиринга** - Участник клиринга, не исполнивший или ненадлежащим образом исполнивший свои Итоговые нетто-обязательства по денежным средствам / ценным бумагам и/или имеющий Задолженность перед Клиринговым центром.

**Необеспеченная сделка** – сделка с ценными бумагами, не прошедшая Процедуру контроля обеспечения.

**Нетто-обязательство по денежным средствам / ценным бумагам по сделкам клирингового пула** - обязательства Участника клиринга или Клирингового центра по оплате / передаче ценных бумаг по всем сделкам клирингового пула, обязательства по которым не прекращены в результате неттинга в ходе клиринга в соответствии с Правилами клиринга, определяемые в отношении позиции Участника клиринга (Клирингового центра) по денежным средствам / ценным бумагам.

**Нетто-обязательство по денежным средствам / ценным бумагам по Сделкам с частичным обеспечением** - сумма денежных средств в российских рублях или количество ценных бумаг, представляющие собой превышение обязательств Участника клиринга по Сделкам с частичным обеспечением над его требованиями к Клиринговому центру по Сделкам с частичным обеспечением в российских рублях или ценных бумагах, определяемые по каждой Дате исполнения;

**Нетто-требование по денежным средствам / ценным бумагам по сделкам клирингового пула** - требования Участника клиринга или Клирингового центра по оплате / передаче ценных бумаг по всем сделкам клирингового пула, обязательства по которым не прекращены в результате неттинга в ходе клиринга в соответствии с Правилами клиринга, определяемые в отношении позиции Участника клиринга (Клирингового центра) по денежным средствам / ценным бумагам.

**Нетто-требование по денежным средствам / ценным бумагам по Сделкам с частичным обеспечением** - сумма денежных средств в российских рублях или количество ценных бумаг, представляющие собой превышение требований Участника клиринга по Сделкам с частичным обеспечением над его обязательствами перед Клиринговым центром по Сделкам с частичным обеспечением в российских рублях или ценных бумагах, определяемые по каждой Дате исполнения;

**Обеспечение** - денежные средства и ценные бумаги, которые используются для обеспечения исполнения обязательств Участника клиринга по Сделкам с частичным обеспечением. Обеспечение может использоваться для исполнения обязательств Участника клиринга по Сделкам с частичным обеспечением.

**Обеспеченная сделка** – сделка с ценными бумагами, прошедшая Процедуру контроля обеспечения.

**Отчет на исполнение** – поручение Участника клиринга, направляемое Клиринговому центру с использованием Клиринговой системы в форме электронного сообщения, подписанного АСП Участника клиринга, и инициирующее Процедуру контроля обеспечения по сделке с ценными бумагами (первой/второй части сделки РЕПО), по которой осуществляется клиринг без предварительного обеспечения, для включения обязательств по такой сделке в клиринговый пул для расчетов по итогам торгов.

**Отчет на исполнение специальный / Специальный отчет на исполнение** – поручение Участника клиринга, направляемое Клиринговому центру с использованием Клиринговой системы в форме электронного сообщения, подписанного АСП Участника клиринга, и инициирующее Процедуру контроля обеспечения одновременно по нескольким сделкам с ценными бумагами (первым/вторым частям сделок РЕПО), по которым осуществляется

клиринг без предварительного обеспечения, и/или компенсационным взносам для включения обязательств по таким сделкам и/или обязательств по внесению компенсационных взносов в клиринговый пул для расчетов по итогам торгов.

**Отчет на исполнение срочный / Срочный отчет на исполнение** – поручение Участника клиринга, направляемое Клиринговому центру с использованием Клиринговой системы в форме электронного сообщения, подписанного АСП Участника клиринга, и инициирующее Процедуру контроля обеспечения одновременно по одной или нескольким сделкам с ценными бумагами (первым/вторым частям сделок РЕПО), по которым осуществляется клиринг без предварительного обеспечения, и/или компенсационным взносам для включения обязательств по таким сделкам и/или обязательств по внесению компенсационных взносов в клиринговый пул для расчетов в ходе торгов, а также формирование и отправку в Депозитарий и Расчетную организацию расчетных документов с целью исполнения обязательств, включенных в клиринговый пул для расчетов в ходе торгов.

**Пароль** – уникальная последовательность случайных чисел, используемая для аутентификации Участника клиринга / Клирингового центра.

**Период регистрации поручений** - период расчетного дня, установленный в соответствии с приложением № 2 к Правилам клиринга, в течение которого Клиринговый центр регистрирует поручения от Участников клиринга и/или Клиринговых организаций.

**Положения Банка России** – нормативные правовые акты Банка России, устанавливающие требования к порядку осуществления денежных расчетов на Организованном рынке ценных бумаг (далее – ОРЦБ).

**Поручение на внесение компенсационного взноса** - поручение Участника клиринга, направляемое Клиринговому центру с использованием Клиринговой системы в форме электронного сообщения, подписанного АСП Участника клиринга, и инициирующее Процедуру контроля обеспечения по компенсационному взносу для включения обязательства по внесению компенсационного взноса в клиринговый пул для расчетов по итогам торгов.

**Поручение на клиринг внебиржевой сделки** - поручение Участника клиринга, направляемое Клиринговому центру с целью осуществления клиринга по внебиржевой сделке и регистрации в Клиринговой системе параметров внебиржевой сделки, в том числе внебиржевой сделки РЕПО.

**Поручение на отказ от компенсационного взноса** - поручение Участника клиринга, / направляемое Клиринговому центру с использованием Клиринговой системы в форме электронного сообщения, подписанного АСП Участника клиринга, с целью отказа от получения компенсационного взноса.

**Порядок предоставления информации и отчетности** - внутренний документ Клирингового центра, устанавливающий состав, сроки и форматы предоставления информации и отчетности Участниками клиринга Клиринговому центру.

**Порядок ЭДО** – Порядок организации электронного документооборота ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр».

**Правила торговли** – правила проведения торгов по ценным бумагам Биржи, утвержденные уполномоченным органом Биржи.

**Правила клиринга** – настоящая часть Правил клиринга ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр».

**Процедура контроля обеспечения по сделке с ценными бумагами / Процедура контроля обеспечения** — механизм контроля достаточности денежных средств и ценных бумаг, необходимых для исполнения обязательств по денежным средствам и ценным бумагам, возникающих в результате заключения сделки с ценными бумагами, а также в иных случаях, предусмотренных Правилами клиринга.

**Расчетная организация** – расчетная организация, осуществляющая расчеты по денежным средствам по результатам клиринга, осуществленного Клиринговым центром, на основании соответствующих поручений Клирингового центра, в порядке, предусмотренном договором между Клиринговым центром и Расчетной организацией, а также Правилами клиринга.

**Расчетная цена** - цена, используемая для установления значений Верхней и Нижней границы ценового коридора, а также Верхней и Нижней границы диапазона оценки рыночных рисков.

**Расчетный день** - день, в который Клиринговым центром проводится клиринг по сделкам с соответствующей ценной бумагой, который одновременно является днем, включая выходной и праздничный нерабочий день по законодательству Российской Федерации, в который Биржа проводит Торги, и в который Депозитарий и Расчетная организация осуществляют расчеты по итогам клиринга.

**Расчетный код** – сектор аналитического учета во внутреннем учете Клирингового центра, предназначенный для учета обязательств по Сделкам с частичным обеспечением и Обеспечения. Каждый Расчетный код соответствует одному Торговому счету, информация о котором получена Клиринговым центром от Расчетной организации. Значение Расчетного кода соответствует пяти последним цифрам в номерах счетов, открытых Участнику клиринга в бухгалтерском учете Клирингового центра для учета обязательств по Сделкам с частичным обеспечением и Обеспечения.

**Регламент клиринга на фондовом рынке ММВБ-РТС / Регламент клиринга** – внутренний документ Клирингового центра, устанавливающий порядок кодификации и регистрации в Клиринговой системе Торгово-клиринговых счетов, особенности проведения операций, осуществляемых в Клиринговой системе в соответствии с Правилами клиринга, а также форматы и формы отчетных документов и иных отчетов по итогам клиринга, предоставляемых Участникам клиринга.

**Сайт Клирингового центра** – сайт в сети Интернет по адресу [www.nkcbank.ru](http://www.nkcbank.ru).

**Сделка с ценными бумагами / Сделка** – биржевая сделка, внебиржевая сделка.

**Сделка с частичным обеспечением** – сделка РЕПО с кодом расчетов T0/Yn, Y0/Yn или сделка купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов Yn, заключенная с Центральным контрагентом в соответствии с Правилами торговли или Правилами клиринга.

**Сектор «Фондовый рынок ММВБ»** — Сектор ОРЦБ в том смысле, в каком он понимается в Положениях Банка России, созданный для проведения денежных расчетов в Расчетной организации по сделкам с ценными бумагами, обязательства по которым включены в клиринговый пул.

**Спот-сделка** – сделка с ценными бумагами, предусматривающая передачу и оплату ценных бумаг в течение не более пяти дней со дня заключения сделки. Сделки РЕПО не относятся к спот-сделкам.

**Счет депо владельца** — счет депо, открытый Депозитарием Участнику клиринга или Клиринговому центру, предназначенный для учета ценных бумаг, принадлежащих

Участнику клиринга или Клиринговому центру на праве собственности или ином вещном праве.

**Счет депо доверительного управления** - счет депо, открытый Депозитарием Участнику клиринга, предназначенный для учета ценных бумаг, находящихся в доверительном управлении Участника клиринга.

**Счет депо клиента Участника клиринга** - счет депо, открытый Депозитарием клиенту Участника клиринга.

**Технический центр** – ОАО Московская Биржа, обеспечивающее Участникам клиринга технический доступ к Клиринговой системе на основании соответствующего договора.

**Торгово-клиринговый счет / ТКС** – учетный регистр в Клиринговой системе, устанавливающий однозначное соответствие между позицией по денежным средствам и позицией по ценным бумагам Участника клиринга.

**Торговые разделы:**

**Торговый раздел** – раздел счета депо владельца Участника клиринга или Клирингового центра и/или корреспондентского счета депо Участника клиринга и/или счета депо доверительного управления и/или эмиссионного счета депо и/или счета депо клиента Участника клиринга, предназначенный для учета ценных бумаг, которые могут быть использованы при проведении Клиринговым центром Процедуры контроля обеспечения по сделкам, заключаемым за российские рубли, а также предназначенный для осуществления списания и зачисления ценных бумаг при проведении расчетов по ценным бумагам в соответствии с Правилами клиринга.

**Валютный торговый раздел XXX<sup>1</sup> / Валютный торговый раздел** – раздел счета депо владельца Участника клиринга или Клирингового центра и/или корреспондентского счета депо Участника клиринга и/или счета депо доверительного управления и/или эмиссионного счета депо и/или счета депо клиента Участника клиринга, предназначенный для учета ценных бумаг, которые могут быть использованы при проведении Клиринговым центром Процедуры контроля обеспечения по сделкам, заключаемым в иностранной валюте, а также предназначенный для осуществления списания и зачисления ценных бумаг при проведении расчетов по ценным бумагам в соответствии с Правилами клиринга.

**Дополнительный торговый раздел** – раздел на корреспондентском счете депо Держателя в Депозитарии, предназначенный для учета ценных бумаг, которые могут быть использованы при проведении Клиринговым центром Процедуры контроля обеспечения, а также предназначенный для осуществления списания и зачисления ценных бумаг при проведении расчетов по ценным бумагам в соответствии с Правилами клиринга.

Существуют следующие типы дополнительного торгового раздела для расчетов по сделкам за российские рубли:

---

<sup>1</sup> XXX - здесь и далее – код валюты, определенный в Регламенте

- **Тип «А»** - для учета ценных бумаг, принадлежащих на праве собственности или ином вещном праве Участнику клиринга, депозитарное обслуживание которого осуществляется Держателем;
- **Тип «В»** - для учета ценных бумаг клиентов Участника клиринга, депозитарное обслуживание которых осуществляется Держателем;
- **Тип «С»** - для учета ценных бумаг, находящихся в доверительном управлении Участника клиринга, депозитарное обслуживание которого осуществляется Держателем.

Существуют следующие типы дополнительного торгового раздела для расчетов по сделкам в иностранной валюте:

- Тип «D\_XXX» - для учета ценных бумаг, принадлежащих на праве собственности или ином вещном праве Участнику клиринга, депозитарное обслуживание которого осуществляется Держателем;
- Тип «E\_XXX» - для учета ценных бумаг клиентов Участника клиринга, депозитарное обслуживание которых осуществляется Держателем;
- Тип «F\_XXX» - для учета ценных бумаг, находящихся в доверительном управлении Участника клиринга, депозитарное обслуживание которого осуществляется Держателем.

#### **Торговые счета:**

**Торговый счет** – счет, открытый Расчетной организацией для учета в соответствии с Положениями Банка России денежных средств Участника клиринга или Клирингового центра в российских рублях, которые могут быть использованы при проведении Клиринговым центром Процедуры контроля обеспечения, а также предназначенный для осуществления списания и зачисления на него денежных средств в российских рублях при проведении в соответствии с Правилами клиринга расчетов по денежным средствам в Секторе «Фондовый рынок ММВБ».

Торговый счет, открытый Банку, может быть использован для исполнения его обязательств по сделкам, заключенным с расчетами в российских рублях за свой счет и за счет его клиентов, для исполнения обязательств Банка по уплате Комиссионного вознаграждения и Возмещения, либо для исполнения обязательств другого Участника клиринга (в случае открытия Банком для Участника клиринга дополнительной позиции по денежным средствам, определяемой в отношении этого Торгового счета) по сделкам, заключенным с расчетами в российских рублях, а также для исполнения обязательств такого Участника клиринга по уплате Комиссионного вознаграждения в соответствии с Правилами клиринга.

В отношении Торгового счета может определяться только одна позиция по денежным средствам, основная или дополнительная.

Участник клиринга, не являющийся кредитной организацией в соответствии с законодательством Российской Федерации, вправе использовать торговый счет только для исполнения обязательств по сделкам, заключенным Участником клиринга с расчетами в российских рублях за свой счет, а также для исполнения обязательств Участника клиринга по уплате Комиссионного вознаграждения и Возмещения в соответствии с Правилами клиринга.

**Торговый счет доверительного управления / Торговый счет ДУ** – счет, открытый Расчетной организацией в соответствии с Положениями Банка России для учета

денежных средств Участника клиринга в российских рублях, которые могут быть использованы при проведении Клиринговым центром Процедуры контроля обеспечения по сделкам, заключаемым Участником клиринга с расчетами в российских рублях за счет средств, находящихся в доверительном управлении этого Участника клиринга, а также предназначенный для исполнения его обязательств по уплате Комиссионного вознаграждения и осуществления списания и зачисления денежных средств в российских рублях при проведении расчетов по денежным средствам в Секторе «Фондовый рынок ММВБ» в соответствии с Правилами клиринга.

**Клиентский торговый счет** — счет, открытый Расчетной организацией для учета в соответствии с Положениями Банка России денежных средств Участника клиринга, не являющегося кредитной организацией, в российских рублях, которые могут быть использованы при проведении Клиринговым центром Процедуры контроля обеспечения по сделкам, заключаемым Участником клиринга с расчетами в российских рублях за счет его клиентов, а также предназначенный для исполнения обязательств Участника клиринга по уплате Комиссионного вознаграждения и осуществления списания и зачисления денежных средств в российских рублях при проведении расчетов по денежным средствам в Секторе «Фондовый рынок ММВБ» в соответствии с Правилами клиринга.

**Торговый счет клиента Участника клиринга / Торговый счет клиента** – счет, открытый Расчетной организацией для учета в соответствии с Положениями Банка России денежных средств клиента Участника клиринга в российских рублях, которые могут быть использованы при проведении Клиринговым центром Процедуры контроля обеспечения по сделкам, заключаемым Участником клиринга с расчетами в российских рублях за счет этого клиента, а также предназначенный для исполнения обязательств Участника клиринга по уплате Комиссионного вознаграждения и осуществления списания и зачисления денежных средств в российских рублях при проведении расчетов по денежным средствам в Секторе «Фондовый рынок ММВБ» в соответствии с Правилами клиринга.

**Валютный торговый счет\_XXX / Валютный торговый счет** – счет, открытый Расчетной организацией для учета в соответствии с Положениями Банка России денежных средств Участника клиринга или Клирингового центра в иностранной валюте, которые могут быть использованы при проведении Клиринговым центром Процедуры контроля обеспечения, а также предназначенный для осуществления списания и зачисления денежных средств в иностранной валюте при проведении расчетов по денежным средствам в Секторе «Фондовый рынок ММВБ» в соответствии с Правилами клиринга.

Уполномоченный банк вправе использовать валютный торговый счет для исполнения обязательств по сделкам, заключенным с расчетами в иностранной валюте за свой счет и за счет клиентов, либо для исполнения обязательств другого Участника клиринга (в случае открытия Банком для Участника клиринга дополнительной валютной позиции по денежным средствам, определяемой в отношении этого Торгового счета) по сделкам, заключенным с расчетами в иностранной валюте.

В отношении Валютного торгового счета может определяться только одна валютная позиция по денежным средствам, основная или дополнительная.

Участник клиринга, не являющийся Уполномоченным банком, вправе использовать валютный торговый счет только для исполнения обязательств по сделкам, заключенным с расчетами в иностранной валюте за свой счет.

**Валютный торговый счет доверительного управления\_XXX / Валютный торговый счет ДУ** - счет, открытый Расчетной организацией для учета в соответствии с Положениями Банка России денежных средств Участника клиринга, в иностранной валюте, находящихся у него в доверительном управлении, которые могут быть использованы при проведении Клиринговым центром Процедуры контроля обеспечения по сделкам, заключаемым с расчетами в иностранной валюте, а также предназначенный для осуществления списания и зачисления денежных средств в иностранной валюте при проведении расчетов по денежным средствам в Секторе «Фондовый рынок ММВБ» в соответствии с Правилами клиринга.

**Валютный клиентский торговый счет** – счет, открытый Расчетной организацией для учета в соответствии с Положениями Банка России денежных средств Участника клиринга, не являющегося кредитной организацией, в иностранной валюте, которые могут быть использованы при проведении Клиринговым центром Процедуры контроля обеспечения по сделкам, заключаемым Участником клиринга с расчетами в иностранной валюте за счет его клиентов, а также предназначенный для осуществления списания и зачисления денежных средств в иностранной валюте при проведении расчетов по денежным средствам в Секторе «Фондовый рынок ММВБ» в соответствии с Правилами клиринга.

**Валютный торговый счет клиента** – счет, открытый Расчетной организацией для учета в соответствии с Положениями Банка России денежных средств клиента Участника клиринга в иностранной валюте, которые могут быть использованы при проведении Клиринговым центром Процедуры контроля обеспечения по сделкам, заключаемым Участником клиринга с расчетами в иностранной валюте за счет этого клиента, а также предназначенный для осуществления списания и зачисления денежных средств в иностранной валюте при проведении расчетов по денежным средствам в Секторе «Фондовый рынок ММВБ» в соответствии с Правилами клиринга.

**Уполномоченный банк** – Участник клиринга, являющийся уполномоченным банком в соответствии с законодательством Российской Федерации о валютном регулировании и валютном контроле.

**Участник клиринга** – юридическое лицо, заключившее с Клиринговым центром Договор об оказании клиринговых услуг. Участник клиринга может быть отнесен к категории «А» или к категории «Б».

**Ценные бумаги /акции /облигации / инвестиционные паи / депозитарные расписки** – ценные бумаги, в том смысле, в котором они определяются законодательством Российской Федерации.

**Эмиссионный счет депо** - счет депо, открытый Депозитарием эмитенту в соответствии с договором эмиссионного счета депо.

**Эмиссионный счет эмитента** – эмиссионный счет эмитента, открытый реестродержателем эмитенту.

## 1.2. Клиринговые регистры и разделы клиринговых регистров



**Позиция по ценным бумагам / Позиция депо** – клиринговый регистр, предназначенный для учета данных о количестве ценных бумаг при проведении Клиринговым центром Процедуры контроля обеспечения. Позиции депо в Клиринговой системе имеют начальные, контрольные и плановые значения.

**Разделы клирингового регистра «Позиция по ценным бумагам»:**

**Позиция «Депо-1» Участника клиринга / Клирингового центра** — позиция депо, определяемая в отношении торгового раздела счета депо владельца Участника клиринга или Клирингового центра в Депозитарии и/или дополнительного торгового раздела - тип А. Позиция «Депо-1» Участника клиринга (Клирингового центра) определяется по каждой ценной бумаге в отношении каждого торгового раздела счета депо владельца Участника клиринга (Клирингового центра) в Депозитарии и каждого дополнительного торгового раздела - тип А, открытого для Участника клиринга на корреспондентских счетах депо Держателей в Депозитарии.

**Позиция «Депо-2» Участника клиринга** — позиция депо, определяемая в отношении торгового раздела корреспондентского счета депо Участника клиринга в Депозитарии и/или торгового раздела счета депо клиента Участника клиринга в Депозитарии и/или дополнительного торгового раздела - тип В. Позиция «Депо-2» Участника клиринга определяется по каждой ценной бумаге в отношении каждого торгового раздела корреспондентского счета депо Участника клиринга в Депозитарии, каждого торгового раздела счета депо клиента Участника клиринга в Депозитарии и каждого дополнительного торгового раздела - тип В, открытого для Участника клиринга на корреспондентских счетах депо Держателей в Депозитарии.

**Позиция «Депо-3» Участника клиринга** – позиция депо, определяемая в отношении открытого для Участника клиринга торгового раздела эмиссионного счета депо. Позиция «Депо-3» Участника клиринга определяется по каждой ценной бумаге в отношении каждого торгового раздела, открытого для Участника клиринга на эмиссионных счетах депо.

**Позиция «Депо-4» Участника клиринга** — позиция депо, определяемая в отношении торгового раздела счета депо доверительного управления Участника клиринга в Депозитарии и/или дополнительного торгового раздела - тип С. Позиция «Депо-4» Участника клиринга определяется по каждой ценной бумаге в отношении каждого торгового раздела счета депо доверительного управления Участника клиринга в Депозитарии и каждого дополнительного торгового раздела - тип С, открытого для Участника клиринга на корреспондентских счетах депо Держателей в Депозитарии.

**Позиция «Депо-5» Участника клиринга** — позиция депо, определяемая в отношении валютного торгового раздела счета депо владельца Участника клиринга в Депозитарии и/или дополнительного торгового раздела - тип D\_XXX. Позиция «Депо-5» Участника клиринга определяется по каждой ценной бумаге в отношении каждого валютного торгового раздела счета депо владельца Участника клиринга в Депозитарии и каждого дополнительного торгового раздела - тип D, открытого для Участника клиринга на корреспондентских счетах депо Держателей в Депозитарии.

**Позиция «Депо-6» Участника клиринга** — позиция депо, определяемая в отношении валютного торгового раздела корреспондентского счета депо Участника клиринга в Депозитарии и/или валютного торгового раздела счета депо клиента-нерезидента Участника клиринга в Депозитарии и/или дополнительного торгового раздела - тип E\_XXX. Позиция «Депо-6» Участника клиринга

определяется по каждой ценной бумаге в отношении каждого валютного торгового раздела корреспондентского счета депо Участника клиринга в Депозитарии, каждого валютного торгового раздела счета депо клиента-нерезидента Участника клиринга в Депозитарии и каждого дополнительного торгового раздела - тип Е, открытого для Участника клиринга на корреспондентских счетах депо Держателей в Депозитарии.

**Позиция «Депозит-7» Участника клиринга** — позиция депо, определяемая в отношении валютного торгового раздела счета депо доверительного управления Участника клиринга в Депозитарии и/или дополнительного торгового раздела - тип F\_XXX. Позиция «Депозит-7» Участника клиринга определяется по каждой ценной бумаге в отношении каждого валютного торгового раздела счета депо доверительного управления Участника клиринга в Депозитарии и каждого дополнительного торгового раздела - тип F, открытого для Участника клиринга на корреспондентских счетах депо Держателей в Депозитарии.

**Позиция «Депозит-8» Участника клиринга** – позиция депо, определяемая в отношении открытого для Участника клиринга валютного торгового раздела эмиссионного счета депо. Позиция «Депозит-8» Участника клиринга определяется по каждой ценной бумаге в отношении каждого валютного торгового раздела, открытого для Участника клиринга на эмиссионных счетах депо.

**Учетная позиция «1» Участника клиринга** — клиринговый регистр, предназначенный для учета требований Участника клиринга по ценным бумагам, возникающих в результате заключения биржевых сделок с акциями в ходе проведения торгов по их размещению. Учетная позиция «1» Участника клиринга определяется по каждой ценной бумаге в отношении каждого лицевого счета, а также торгового и/или дополнительного торгового раздела в Депозитарии.

**Учетная позиция «2» Участника клиринга** — клиринговый регистр, предназначенный для учета обязательств Участника клиринга по ценным бумагам, возникающих в результате заключения биржевых сделок с акциями в ходе проведения торгов по их размещению. Учетная позиция «2» Участника клиринга определяется по каждой ценной бумаге.

**Позиция по денежным средствам** – клиринговый регистр, предназначенный для учета данных о денежных средствах при проведении Клиринговым центром Процедуры контроля обеспечения. Позиции по денежным средствам в Клиринговой системе имеют начальные, контрольные и плановые значения.

**Разделы клирингового регистра «Позиция по денежным средствам»:**

**Денежная позиция Участника клиринга / Клирингового центра** – позиция по денежным средствам, определяемая в отношении Торгового счета Участника клиринга или Клирингового центра. Денежная позиция Участника клиринга (Клирингового центра) определяется в отношении каждого его Торгового счета.

**Клиентская денежная позиция Участника клиринга** – позиция по денежным средствам, определяемая в отношении Клиентского торгового счета Участника клиринга и/или Торгового счета клиента Участника клиринга. Клиентская денежная позиция Участника клиринга определяется в отношении каждого его Клиентского торгового счета и каждого Торгового счета клиента Участника клиринга.

**Денежная позиция ДУ Участника клиринга** – позиция по денежным средствам, определяемая в отношении Торгового счета ДУ Участника клиринга. Денежная позиция Участника клиринга определяется в отношении каждого его Торгового счета ДУ.

**Валютная денежная позиция Участника клиринга** – позиция по денежным средствам, определяемая в отношении Валютного торгового счета Участника клиринга. Валютная денежная позиция Участника клиринга определяется в отношении каждого его Валютного торгового счета.

**Валютная клиентская денежная позиция Участника клиринга** – позиция по денежным средствам, определяемая в отношении Валютного клиентского торгового счета и/или Валютного торгового счета клиента. Валютная клиентская денежная позиция Участника клиринга определяется в отношении каждого его Валютного клиентского торгового счета и каждого Валютного торгового счета клиента Участника клиринга.

**Валютная денежная позиция ДУ Участника клиринга** – позиция по денежным средствам, определяемая в отношении Валютного торгового счета ДУ Участника клиринга. Валютная денежная позиция Участника клиринга определяется в отношении каждого его Валютного торгового счета ДУ.

**Основные позиции по денежным средствам** – Денежные позиции, Клиентские денежные позиции, Денежные позиции ДУ, Валютные денежные позиции, Валютные клиентские денежные позиции, Валютные денежные позиции ДУ Участника клиринга.

**Дополнительная собственная денежная позиция Участника клиринга** – позиция по денежным средствам, определяемая в отношении Торгового счета Банка, осуществляющего расчетное обслуживание Участника клиринга и/или его клиентов. Дополнительная собственная денежная позиция Участника клиринга, не являющегося кредитной организацией, предназначена для учета данных о денежных средствах при проведении Клиринговым центром Процедуры контроля обеспечения по сделкам, заключаемым Участником клиринга с расчетами в российских рублях за свой счет. Дополнительная собственная денежная позиция Участника клиринга, являющегося кредитной организацией, предназначена для учета данных о денежных средствах при проведении Клиринговым центром Процедуры контроля обеспечения по сделкам, заключаемым Участником клиринга с расчетами в российских рублях за свой счет и/или за счет его клиентов.

**Дополнительная клиентская денежная позиция Участника клиринга** – позиция по денежным средствам, определяемая в отношении Торгового счета Банка, осуществляющего расчетное обслуживание клиентов Участника клиринга, не являющегося кредитной организацией. Дополнительная клиентская денежная позиция предназначена для учета данных о денежных средствах при проведении Клиринговым центром Процедуры контроля обеспечения по сделкам, заключаемым Участником клиринга с расчетами в российских рублях за счет клиентов Участника клиринга.

**Дополнительная денежная позиция ДУ Участника клиринга** – позиция по денежным средствам, определяемая в отношении Торгового счета ДУ Банка, осуществляющего расчетное обслуживание Участника клиринга при выполнении им функций доверительного управляющего. Дополнительная денежная позиция ДУ предназначена для учета данных о денежных средствах при проведении

Клиринговым центром Процедуры контроля обеспечения по сделкам, заключаемым Участником клиринга с расчетами в российских рублях за счет средств, находящихся в доверительном управлении Участника клиринга.

**Дополнительные рублевые денежные позиции** - Дополнительные собственные денежные позиции Участника клиринга, Дополнительные клиентские денежные позиции Участника клиринга и Дополнительные денежные позиции ДУ Участника клиринга.

**Дополнительная собственная валютная денежная позиция Участника клиринга** – позиция по денежным средствам, определяемая в отношении Валютного торгового счета Уполномоченного банка, осуществляющего расчетное обслуживание Участника клиринга и/или его клиентов. Дополнительная собственная валютная денежная позиция Участника клиринга, не являющегося кредитной организацией, предназначена для учета данных о денежных средствах при проведении Клиринговым центром Процедуры контроля обеспечения по сделкам, заключаемым Участником клиринга с расчетами в иностранной валюте за свой счет. Дополнительная собственная валютная денежная позиция Участника клиринга, являющегося кредитной организацией, предназначена для учета данных о денежных средствах при проведении Клиринговым центром Процедуры контроля обеспечения по сделкам, заключаемым Участником клиринга с расчетами в иностранной валюте за свой счет и/или за счет его клиентов.

**Дополнительная клиентская валютная денежная позиция Участника клиринга** – позиция по денежным средствам, определяемая в отношении Валютного торгового счета Уполномоченного банка, осуществляющего расчетное обслуживание клиентов Участника клиринга. Дополнительная клиентская валютная денежная позиция предназначена для учета данных о денежных средствах при проведении Клиринговым центром Процедуры контроля обеспечения по сделкам, заключаемым Участником клиринга с расчетами в иностранной валюте за счет его клиентов

**Дополнительная валютная денежная позиция ДУ Участника клиринга** – позиция по денежным средствам, определяемая в отношении Валютного торгового счета ДУ Уполномоченного банка, осуществляющего расчетное обслуживание Участника клиринга при выполнении им функций доверительного управляющего. Дополнительная валютная денежная позиция ДУ предназначена для учета данных о денежных средствах при проведении Клиринговым центром Процедуры контроля обеспечения по сделкам, заключаемым Участником клиринга с расчетам в иностранной валюте за счет средств, находящихся в доверительном управлении Участника клиринга.

**Дополнительные валютные денежные позиции** - Дополнительные собственные валютные денежные позиции Участника клиринга, Дополнительные клиентские валютные денежные позиции Участника клиринга и Дополнительные валютные денежные позиции ДУ Участника клиринга.

**Дополнительные позиции по денежным средствам** – Дополнительная собственная денежная позиция, Дополнительная клиентская денежная позиция, Дополнительная денежная позиция ДУ, Дополнительная собственная валютная денежная позиция, Дополнительная клиентская валютная денежная позиция и Дополнительная валютная денежная позиция ДУ Участника клиринга.

**Ограничительные лимиты** - Ограничительный лимит по уплате комиссионного вознаграждения и/или Ограничительный лимит по уплате возмещения.

**Ограничительный лимит по уплате комиссионного вознаграждения** – клиринговый регистр, предназначенный для учета неисполненных обязательств Участников клиринга по уплате Комиссионного вознаграждения.

**Ограничительный лимит по уплате возмещения** – клиринговый регистр, предназначенный для учета неисполненных обязательств Участников клиринга по уплате Возмещения.

Термины, специально не определенные в Правилах клиринга, используются в значениях, установленных иными внутренними документами Клирингового центра, включая Методику определения риск-параметров рынка ценных бумаг, Правилами торговли, законами, нормативными правовыми актами федерального органа исполнительной власти по рынку ценных бумаг и иными нормативными правовыми актами Российской Федерации.

## **Статья 2. Способы и иные условия осуществления клиринга**

2.1. С учетом требований нормативных правовых актов федерального органа исполнительной власти по рынку ценных бумаг, Клиринговый центр осуществляет клиринг следующими способами:

2.1.1. Определение обязательств Участников клиринга в соответствии с Правилами клиринга осуществляется в порядке простого клиринга и многостороннего клиринга.

Клиринговый центр осуществляет определение обязательств Участников клиринга в порядке простого клиринга только по спот-сделкам, заключенным с кодом расчетов Z0, по первым частям сделок РЕПО, заключенных с кодом расчетов Z0.

По всем иным сделкам и обязательствам Клиринговый центр осуществляет определение обязательств Участников клиринга в порядке многостороннего клиринга.

2.1.2. Клиринговый центр осуществляет централизованный клиринг по заключенным с Клиринговым центром:

- сделкам купли-продажи с кодом расчетов T0 (за исключением сделок размещения и выкупа), K0, Yn;
- сделкам РЕПО с кодом расчетов T0/Yn, Y0/Yn.

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

Клиринговый центр осуществляет клиринг с полным обеспечением:

- по сделкам купли-продажи с кодом расчетов T0, K0, Z0;
- по первым частям сделок РЕПО с кодом расчетов Rb, Z0, T0/Yn;

Клиринговый центр осуществляет клиринг с частичным обеспечением:

- по сделкам купли-продажи с кодом расчетов Yn;
- сделкам РЕПО с кодом расчетов Y0/Yn;
- по вторым частям сделок РЕПО с кодом расчетов T0/Yn.

Клиринговый центр осуществляет клиринг без предварительного обеспечения:

- по сделкам купли-продажи с кодом расчетов B0-B30;
  - по первым частям сделок РЕПО с кодом расчетов S0-S2;
  - по вторым частям сделок РЕПО с кодом расчетов Rb, S0-S2, Z0.
- 2.1.4. Клиринговый центр осуществляет контроль наличия денежных средств на Торговых счетах, Клиентских торговых счетах, Торговых счетах ДУ, Валютных торговых счетах, Валютных клиентских торговых счетах, Валютных торговых счетах ДУ Участников клиринга, а также Торговых счетах клиентов и Валютных торговых счетах клиентов Участников клиринга в Расчетной организации (далее - **Счета**), необходимых для проведения расчетов:
- по каждой сделке с ценными бумагами (при проведении простого клиринга);
  - по всем заключенным Участником клиринга сделкам, включенным в Клиринговый пул для расчетов в ходе торгов или Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов (при проведении многостороннего клиринга).
- 2.1.5. Клиринговый центр осуществляет контроль наличия ценных бумаг на Торговых разделах, Дополнительных торговых разделах, Валютных торговых разделах, открытых на счетах депо в Депозитарии (далее - **Разделы**), необходимых для проведения расчетов:
- по каждой сделке с ценными бумагами (при проведении простого клиринга);
  - по всем заключенным Участником клиринга сделкам, включенным в Клиринговый пул для расчетов в ходе торгов или Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов (при проведении многостороннего клиринга).
- 2.1.6. Для учета Обеспечения в ценных бумагах и для исполнения обязательств по сделкам клирингового пула используются разные (отдельные) Разделы.
- 2.1.7. Контроль за наличием необходимого количества ценных бумаг и денежных средств, зачисленных Участниками клиринга на Счета или Разделы либо приобретенных (приобретаемых) ими на Торгах Биржи, осуществляется Клиринговым центром до регистрации заявок и/или заключения сделок в порядке, предусмотренном разделом V Правил клиринга.
- 2.1.8. В соответствии с Правилами клиринга Клиринговый центр осуществляет клиринг по спот-сделкам, сделкам РЕПО и иным сделкам с ценными бумагами.
- 2.2. В процессе осуществления клиринговой деятельности Клиринговый центр исполняет функции клирингового центра.
- 2.3. Существует две категории Участников клиринга: Участники клиринга категории «А» и Участники клиринга категории «Б». Требования к Участникам клиринга каждой из категорий предусмотрены разделом II Правил клиринга. Особенности обслуживания каждой из категорий предусмотрены приложением № 1 к Правилам клиринга.
- 2.4. Для обеспечения исполнения сделок с ценными бумагами, в отношении которых осуществляется клиринг, Клиринговый центр формирует гарантийный (-ые) фонд (-ы), порядок создания, размещения и использования которого (-ых) утверждается уполномоченным органом Клирингового центра.
- 2.5. Для обеспечения исполнения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением Клиринговый центр формирует Коллективный фонд.

Коллективный фонд формируется за счет взносов всех Участников клиринга, допущенных к заключению Сделок с частичным обеспечением.

Размер взноса в Коллективный фонд каждого Участника клиринга составляет 2 000 000 (два миллиона) рублей.

- 2.6. Клиринговый центр вправе размещать денежные средства, составляющие Коллективный фонд, во вклады в кредитных организациях.  
Доходы по таким вкладам не включаются в состав Коллективного фонда.
- 2.7. К расчетным депозитариям, расчетным организациям и организаторам торговли (фондовым биржам), с которыми Клиринговым центром заключены договоры о взаимодействии, относятся:
- 2.7.1. Расчетный депозитарий:
- Небанковская кредитная организация закрытое акционерное общество «Национальный расчетный депозитарий».
- 2.7.2. Расчетная организация:
- Небанковская кредитная организация закрытое акционерное общество «Национальный расчетный депозитарий».
- 2.7.3. Биржа:
- Закрытое акционерное общество «Фондовая биржа ММВБ»;
  - Открытое акционерное общество «Московская Биржа ММВБ-РТС».
- 2.8. Клиринговый центр осуществляет определение обязательств Участников клиринга по сделкам, заключенным с расчетами в российских рублях и иностранной валюте, в порядке многостороннего клиринга и в порядке простого клиринга.
- 2.9. Клиринговый центр осуществляет клиринг по сделкам, расчеты по которым осуществляются за счет Участников клиринга, или за счет клиентов Участников клиринга, или за счет средств, находящихся в доверительном управлении Участника клиринга.  
Клиринговый центр не осуществляет клиринг по сделкам, расчеты по которым осуществляются за счет клиентов Участников клиринга, не зарегистрированных Клиринговым центром.
- 2.10. Клиринговый центр не осуществляет клиринг по Необеспеченным сделкам, начиная с Даты прекращения исполнения.
- 2.11. Клиринговый центр не осуществляет клиринг по сделкам с ценными бумагами с кодами расчетов, отличными от кодов расчетов, предусмотренных Правилами торговли.
- 2.12. Операции по объединению выпусков эмиссионных ценных бумаг и/или аннулированию индивидуальных номеров (кодов) дополнительных выпусков эмиссионных ценных бумаг осуществляются в Клиринговой системе на следующий Расчетный день после получения соответствующего уведомления от Депозитария и по окончании расчетов по сделкам с ценными бумагами по итогам клиринга этого дня. Проведение операций по объединению выпусков эмиссионных ценных бумаг и/или аннулированию индивидуальных номеров (кодов)

дополнительных выпусков эмиссионных ценных бумаг в Клиринговой системе сопровождается корректировкой информации по сделкам с ценными бумагами и сделкам РЕПО, Дата исполнения которых еще не наступила. Коды объединяемых выпусков ценных бумаг в реквизитах указанных сделок заменяются кодом объединенного выпуска, а аннулируемый код дополнительного выпуска ценных бумаг - кодом выпуска, по отношению к которому данный выпуск является дополнительным.

- 2.13. Перечень клиринговых регистров и разделов клиринговых регистров, используемых в Клиринговой системе при осуществлении простого и многостороннего клиринга, а также их назначение предусмотрен пунктом 1.2 Правил клиринга. Порядок использования клиринговых регистров определен в разделах IV-V Правил клиринга.
- 2.14. Сроки передачи документов Клиринговому центру и сроки выдачи документов Клиринговым центром в процессе взаимодействия с Участниками клиринга, Расчетной организацией, Депозитарием и Биржей установлены приложением № 2 к Правилам клиринга (далее – Временной регламент).
- Установленное Временным регламентом время (сроки) в отношении отдельных операций может быть изменено по решению Правления Клирингового центра. Об изменении времени (сроков) проведения отдельных операций Участники клиринга извещаются средствами Клиринговой системы не менее чем за 2 (два) Расчетных дня, если иной порядок и сроки не определены решением Правления Клирингового центра.
- 2.15. Клиринговый центр незамедлительно информирует федеральный орган исполнительной власти по рынку ценных бумаг о следующих случаях:
- расхождении данных, обнаруженном при осуществлении процедуры сверки информации, предусмотренной разделом V Правил клиринга, если такое расхождение привело к нарушению сроков проведения операций по итогам клиринга более чем на 3 (три) часа;
  - расхождении данных, обнаруженном при осуществлении процедуры сверки информации, предусмотренной пунктом 41.6 Правил клиринга, если такое расхождение привело к нарушению сроков проведения операций по итогам клиринга более чем на 3 (три) часа;
  - недостаточности у Участника клиринга ценных бумаг и/или денежных средств, выявленной при проведении расчетов, для исполнения его обязательств по сделкам с ценными бумагами, прошедшим в Клиринговой системе Процедуру контроля обеспечения, если такая недостаточность привела к нарушению сроков проведения операций по итогам клиринга более чем на 3 (три) часа.
  - использовании средств гарантийного (-ых) фонда (-ов).
- 2.16. Клиринговый центр вправе на своем Сайте раскрывать информацию о нарушениях Участниками клиринга требований Правил клиринга, в том числе, о фактах неисполнения ими обязательств в порядке, предусмотренном Правилами клиринга.
- 2.17. В случае отмены доверенностей, оформленных в соответствии с Правилами клиринга, лица, выдавшие такие доверенности в пользу Клирингового центра, или



лица, уполномоченные такими доверенностями и предоставившие их Клиринговому центру для подтверждения своих полномочий, обязаны письменно уведомить Клиринговый центр об отмене доверенностей не позднее дня, предшествующего дате прекращения действия доверенности. Обязанности указанных лиц по уведомлению Клирингового центра об отмене доверенностей считаются исполненными надлежащим образом при условии получения Клиринговым центром такого уведомления не позднее дня, предшествующего дате прекращения действия доверенности.

### **Статья 3. Договор об оказании клиринговых услуг**

- 3.1. Образец Договора об оказании клиринговых услуг, заключаемого Клиринговым центром с Участниками клиринга, приведен в приложении №5 к Правилам клиринга.
- 3.2. Заключение Договора об оказании клиринговых услуг осуществляется путем присоединения к указанному договору, условия которого определены Правилами клиринга.
- 3.3. Размер оплаты клиринговых и иных связанных с клирингом услуг Клирингового центра предусмотрен приложением № 1 к Правилам клиринга «Тарифы Клирингового центра».
- 3.4. Порядок оплаты клиринговых и иных связанных с клирингом услуг Клирингового центра определен в статье 42 Правил клиринга.
- 3.5. Клиринговые и иные связанные с клирингом услуги Клирингового центра считаются оказанными надлежащим образом, если в течение 5 (пяти) рабочих дней после окончания месяца, в течение которого оказывались услуги, Участник клиринга письменно не заявит об обратном.
- 3.6. В случае нарушения Клиринговым центром своих обязательств, установленных Правилами клиринга, Клиринговый центр обязан возместить Участнику клиринга понесенные им убытки.
- 3.7. Участник клиринга вправе отказаться от исполнения Договора об оказании клиринговых услуг только при отсутствии у него имущественных обязательств по указанному договору, а также неисполненных им обязательств, допущенных к клирингу, письменно уведомив об этом Клиринговый центр не позднее, чем за 7 (семь) дней до даты расторжения Договора об оказании клиринговых услуг.
- 3.8. Клиринговый центр вправе отказаться от исполнения Договора об оказании клиринговых услуг с Участником клиринга в случае нарушения им требований, предъявляемых Правилами клиринга к Участнику клиринга.
- 3.9. Действие Договора об оказании клиринговых услуг прекращается в следующих случаях:
  - прекращения допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию в соответствии со всеми правилами клиринга, утвержденными Клиринговым центром;

- ликвидации Участника клиринга, а также в случае реорганизации Участника клиринга при условии, что деятельность Участника клиринга в результате реорганизации прекращается;
  - отзыва (аннулирования) лицензии на осуществление банковских операций у Участника клиринга (для кредитных организаций).
- 3.10. Прекращение действия Договора об оказании клиринговых услуг не освобождает Участника клиринга и Клиринговый центр от исполнения обязательств, возникших до прекращения действия Договора об оказании клиринговых услуг.
- 3.11. В случае прекращения Договора об оказании клиринговых услуг, Клиринговый центр возвращает Участнику клиринга денежные средства, составляющие взнос Участника клиринга в Коллективный фонд, учитываемый на дату прекращения договора, в течение 3 (трех) банковских дней после получения Клиринговым центром письма от Участника клиринга о возврате вклада в Коллективный фонд, содержащего платежные реквизиты.

#### **Статья 4. Конфиденциальность и персональные данные**

- 4.1. Участник клиринга и Клиринговый центр обязуются рассматривать содержание Договора об оказании клиринговых услуг и условия заключенных сделок с ценными бумагами и сделок РЕПО, как конфиденциальную информацию и не будут раскрывать ее третьим лицам (за исключением аудиторов Участника клиринга или Клирингового центра, уполномоченных государственных органов, клиентов Участников клиринга, в интересах которых заключены указанные сделки, а также случаев раскрытия информации в соответствии с требованиями действующего законодательства Российской Федерации), если иное не будет специально согласовано между Участником клиринга и Клиринговым центром.
- 4.2. Любые документы, предоставленные и подготовленные Участником клиринга и/или Клиринговым центром для исполнения Договора об оказании клиринговых услуг и сделок с ценными бумагами / сделок РЕПО, заключенных в рамках Договора об оказании клиринговых услуг, будут рассматриваться как конфиденциальные.
- 4.3. Положения, содержащиеся в пунктах 4.4-4.5 Правил клиринга, не распространяются на информацию, которая является общедоступной.
- 4.4. Участник клиринга / юридическое лицо подтверждают, что все персональные данные, упоминаемые в Правилах клиринга, Договоре об оказании клиринговых услуг, а также передаваемые Участником клиринга / юридическим лицом и Клиринговым центром друг другу, в случае если это требуется в целях исполнения Договора об оказании клиринговых услуг, достоверны и получены от субъекта персональных данных в законном порядке и передаются с согласия субъекта персональных данных, в случае если такое согласие предусмотрено законодательством Российской Федерации.
- 4.5. Участник клиринга / юридическое лицо и/или Клиринговый центр обязуются не допускать распространения указанных персональных данных без согласия субъекта персональных данных или наличия иного законного основания, обеспечивать

конфиденциальность персональных данных и безопасность персональных данных при их обработке в случаях, предусмотренных Правилами клиринга и законодательством Российской Федерации.

## **Статья 5. Место и порядок разрешения споров**

- 5.1. Все гражданско-правовые споры и разногласия, возникшие между Участниками клиринга, Участником клиринга и Клиринговым центром в связи с проведением клиринга (оказанием клиринговых и иных связанных с клирингом услуг) и/или с исполнением обязательств по итогам клиринга в соответствии с Правилами клиринга, подлежат рассмотрению и разрешению в Арбитражной комиссии при ОАО ММВБ-РТС в соответствии с документами, определяющими ее правовой статус и порядок разрешения споров, действующими на момент подачи искового заявления.
- 5.2. Решения Арбитражной комиссии при ОАО ММВБ-РТС являются окончательными и обязательными для сторон. Неисполненное добровольно решение Арбитражной комиссии при ОАО ММВБ-РТС подлежит принудительному исполнению в соответствии с законодательством Российской Федерации или законодательством иной страны места принудительного исполнения и/или международными соглашениями.

## **Статья 6. Принципы осуществления клиринговой деятельности**

- 6.1. Клиринговый центр в соответствии с Правилами клиринга:
  - открывает и ведет клиринговые регистры и разделы клиринговых регистров, определенные в пункте 1.2 Правил клиринга;
  - обеспечивает исполнение включенных в клиринговый пул обязательств на условиях «поставка против платежа», если иное не предусмотрено Правилами клиринга;
  - осуществляет определение и учет обязательств Участников клиринга;
  - осуществляет контроль за исполнением Депозитарием и Расчетной организацией расчетных документов, направляемых им Клиринговым центром по итогам клиринга, на основании получаемых от них отчетов, реквизиты которых предусмотрены приложением № 4 к Правилам клиринга;
  - использует неттинг при проведении многостороннего клиринга;
  - осуществляет сбор и сверку информации по сделкам с ценными бумагами в целях проведения по ним процедур, предусмотренных Правилами клиринга;
  - осуществляет контроль и управление рисками по Сделкам с частичным обеспечением;
  - контролирует исполнение Участниками клиринга обязательств по Сделкам с частичным обеспечением и обеспечивает исполнение требований Участников клиринга по Сделкам с частичным обеспечением;
  - формирует Коллективный фонд, ведет учет взносов Участников клиринга в Коллективный фонд, распоряжается средствами Коллективного фонда;
  - осуществляет формирование и предоставление Участникам клиринга отчетов по итогам клиринга.

- 6.2. Определение обязательств и требований Участников клиринга по сделкам с ценными бумагами осуществляется Клиринговым центром на основании Сводных реестров сделок с ценными бумагами и Выписок из Реестров сделок, получаемых от Биржи в соответствии с Правилами клиринга.

Определение обязательств и требований Участников клиринга по внебиржевым сделкам осуществляется Клиринговым центром на основании зарегистрированных в Клиринговой системе данных о внебиржевых сделках, содержащихся в поступивших от Участников клиринга Поручениях на клиринг внебиржевой сделки.

Участник клиринга несет ответственность за последствия, связанные с включением в Поручение на клиринг внебиржевой сделки недостоверных или ошибочных сведений, а также иных сведений, не соответствующих условиям внебиржевой сделки.

- 6.3. Проведение операций с денежными средствами по результатам клиринга осуществляется по Счетам в Расчетной организации с использованием соответствующих Клиринговых счетов (в случаях, предусмотренных Договором между Клиринговым центром и Расчетной организацией) в порядке, предусмотренном Правилами клиринга.

Проведение операций с ценными бумагами по результатам клиринга осуществляется по Разделам в Депозитарии с использованием Клирингового счета депо (в случаях, предусмотренных Договором между Клиринговым центром и Депозитарием) в порядке, предусмотренном Правилами клиринга.

- 6.4. Клиринговый центр осуществляет контроль достаточности денежных средств и ценных бумаг по каждому Участнику клиринга в процессе заключения им сделок, за исключением Сделок с частичным обеспечением, путем ведения в Клиринговой системе позиций депо и позиций по денежным средствам в порядке, предусмотренном Правилами клиринга.

В Клиринговой системе помимо установления и изменения начальных значений основных позиций по денежным средствам, дополнительных позиций по денежным средствам и позиций депо Участника клиринга осуществляется установление и изменение их контрольных и плановых значений.

Порядок и случаи изменения значений позиций по денежным средствам и позиций по ценным бумагам приведен в приложении № 8 к Правилам клиринга.

- 6.5. Клиринговый центр осуществляет контроль Единого лимита каждого Участника клиринга, учитываемого по Расчетному коду, в процессе заключения им Сделок с частичным обеспечением и исполнения (прекращения) обязательств по Сделкам с частичным обеспечением в порядке, предусмотренном Правилами клиринга.

Принципы расчета Единого лимита определены в статье 26 Правил клиринга.

- 6.6. Заключение Сделок с частичным обеспечением возможно только с ценными бумагами, включенными в Клиринговый лист для Сделок с частичным обеспечением.

Включение ценной бумаги в Клиринговый лист для Сделок с частичным обеспечением осуществляется по решению Клирингового центра на основании информации, полученной от Биржи.

- 6.7. Расчеты по результатам клиринга осуществляются в ходе торгов и по итогам торгов.

## **Статья 7. Порядок использования Аналога собственноручной подписи**

- 7.1. Аналог собственноручной подписи (АСП) используется при подаче (направлении) с использованием Клиринговой системы электронных сообщений, предусмотренных Правилами клиринга. Электронное сообщение, подписанное АСП, признается электронным документом, равнозначным документу на бумажном носителе, подписанному уполномоченным лицом Участника клиринга / Клирингового центра.

- 7.2. Клиринговый центр обеспечивает защищенность и целостность электронных сообщений Участника клиринга и Клирингового центра в результате применения комплекса организационных и технических мер.

- 7.3. Электронное сообщение считается подписанным АСП, с момента отправки Участником клиринга / Клиринговым центром в Клиринговую систему такого электронного сообщения при условии успешного прохождения Участником клиринга / Клиринговым центром процедуры аутентификации в порядке, предусмотренном настоящей статьей.

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

Уведомление о присвоении Клирингового идентификатора Участнику клиринга передается Участнику клиринга в составе Отчета о торгово-клиринговых счетах и иных реквизитах Участника клиринга, направляемого в соответствии со статьей 44 Правил клиринга.

Сведения о присвоенных Клиринговых идентификаторах относятся к конфиденциальным и не подлежат передаче третьим лицам, за исключением Технического центра, которому такие сведения доступны в связи с проведением процедуры аутентификации. Участник клиринга и Клиринговый центр обеспечивают соблюдение требований о конфиденциальности и несут риск последствий, связанных с нарушением таких требований.

- 7.5. Процедура аутентификации осуществляется Техническим центром с использованием Клиринговой системы при осуществлении технического доступа Участника клиринга или Клирингового центра в Клиринговую систему через удаленное рабочее место Участника клиринга или Клирингового центра путем сопоставления введенных Клирингового идентификатора и пароля соответствующим Клиринговому идентификатору и паролю Участника клиринга / Клирингового центра, информация о которых содержится в базе данных Клиринговой системы.

В случае успешного прохождения процедуры аутентификации Участник клиринга / Клиринговый центр получает возможность осуществления операций в Клиринговой системе.

- 7.6. Участник клиринга и Клиринговый центр соглашаются с тем, что Клиринговым центром могут быть изготовлены (распечатаны) копии электронных сообщений (подписанных АСП) на бумажном носителе, которые удостоверяются подписью уполномоченного лица Клирингового центра и являются бесспорным доказательством факта направления электронного сообщения с использованием Клиринговой системы, а также подтверждают соответствие электронного сообщения содержанию копии электронного сообщения, изготовленного (распечатанного) на бумажном носителе.
- 7.7. По письменному запросу Участника клиринга Клиринговый центр предоставляет Участнику клиринга копию направленного Участником (Участнику) клиринга электронного сообщения, изготовленного (распечатанного) на бумажном носителе. Запрос Участника клиринга должен содержать дату, на которую, либо период времени, за который предоставляются электронные сообщения.
- 7.8. Участник клиринга и Клиринговый центр соглашаются с тем, что все возникшие конфликтные ситуации, связанные с использованием АСП, будут стремиться решить в досудебном порядке.
- 7.9. В случае возникновения конфликтных ситуаций в связи с использованием АСП проводится техническая экспертиза в соответствии с приложением 7 к Правилам клиринга.
- 7.10. В случае, если по результатам технической экспертизы, проведенной в соответствии с приложением 7 к Правилам клиринга, конфликтная ситуация остается неурегулированной, то такая конфликтная ситуация подлежит рассмотрению в порядке, предусмотренном статьей 5 Правил клиринга.

## **II. ТРЕБОВАНИЯ К УЧАСТНИКАМ КЛИРИНГА, ИХ КЛИЕНТАМ И ДЕРЖАТЕЛЯМ. ПОРЯДОК РЕГИСТРАЦИИ УЧАСТНИКОВ КЛИРИНГА И ИХ КЛИЕНТОВ. ДОПУСК К КЛИРИНГОВОМУ ОБСЛУЖИВАНИЮ**

### **Статья 8. Требования к Участникам клиринга**

8.1. Участниками клиринга могут быть юридические лица, заключившие с Клиринговым центром Договор об оказании клиринговых услуг.

8.2. Для заключения Договора об оказании клиринговых услуг юридическое лицо предоставляет Клиринговому центру:

- Договор об оказании клиринговых услуг по форме, предусмотренной приложением № 5 к Правилам клиринга, в 2 (двух) экземплярах, подписанный уполномоченным лицом юридического лица и скрепленный печатью юридического лица;
- перечень документов в соответствии с приложением № 9 к Правилам клиринга.

8.3. В случае если какой-либо из документов, указанных в пункте 8.2 Правил клиринга ранее уже предоставлялся Клиринговому центру и имеется в наличии у Клирингового центра, то юридическое лицо по предварительному согласованию с Клиринговым центром может быть освобождено от обязанности повторного предоставления этого документа.

Юридическое лицо обязано предоставить иные документы, которые могут быть запрошены Клиринговым центром в необходимых случаях в целях, не противоречащих действующему законодательству Российской Федерации.

В случае если между юридическим лицом и Клиринговым центром заключен Договор об оказании клиринговых услуг по форме, установленной приложением №5 к Правилам клиринга, для осуществления клирингового обслуживания на других рынках, то заключение нового Договора об оказании клиринговых услуг в соответствии с настоящими Правилами клиринга не требуется.

8.4. Юридические лица, соответствующие требованиям, предусмотренным пунктом 8.2 Правил клиринга, относятся к Участникам клиринга категории «Б».

8.5. Клиринговый центр может отнести Участника клиринга к категории «А», если в дополнение к требованиям, предусмотренным пунктом 8.2 Правил клиринга, юридическое лицо действует на основании федерального закона, регулирующего деятельность такого юридического лица, и выполняет функции, возложенные на него таким федеральным законом.

Отнесение Участника клиринга к категории «А» осуществляется на основании решения Клирингового центра. Клиринговый центр уведомляет Участника клиринга об отнесении его к категории «А» в случае принятия Клиринговым центром соответствующего решения.

8.6. Участник клиринга обязан ежегодно предоставлять Клиринговому центру Анкету Участника клиринга (клиента) (Регистрационную карточку) в форме электронного документа.

В случае изменения сведений, содержащихся в Анкете Участника клиринга (клиента) (Регистрационной карточке) или в иных представленных Клиринговому центру документах, Участник клиринга обязан в течение 5 (пяти) рабочих дней после таких изменений предоставить Клиринговому центру Анкету Участника клиринга (клиента) (Регистрационную карточку) с обновленной информацией в форме электронного документа и соответствующие документы, подтверждающие такие изменения.

8.7. Форматы предоставления Участником клиринга Анкеты Участника клиринга (клиента) (Регистрационной карточки) определены Порядком предоставления информации и отчетности.

## **Статья 9. Условия клирингового обслуживания. Порядок предоставления и прекращения (приостановления) допуска к клиринговому обслуживанию**

9.1. Допуск к клиринговому обслуживанию в соответствии с Правилами клиринга предоставляется Участнику клиринга, который соответствует следующим требованиям:

- имеет действующий Договор об оказании клиринговых услуг, заключенный с Клиринговым центром;
- имеет действующую лицензию на осуществление банковских операций, выданную Банком России (для кредитных организаций);
- является участником Подсистемы ЭДО НКЦ;
- имеет возможность проведения операций по торговому счету в Расчетной организации согласно информации об открытии торгового счета, полученной Клиринговым центром от Расчетной организации в соответствии с разделом III Правил клиринга, или иметь возможность проведения операций с использованием дополнительной собственной денежной позиции Участника клиринга согласно информации об открытии дополнительной собственной денежной позиции Участника клиринга, полученной Клиринговым центром от Банка в соответствии со статьей 13 Правил клиринга;
- имеет хотя бы один зарегистрированный в Клиринговом центре Торгово-клиринговый счет;
- предоставил Клиринговому центру Заявление о ТКС для внебиржевых сделок по форме, предусмотренной пунктом 1.7 приложения № 6 к Правилам клиринга (данное требование относится только к клиринговому обслуживанию Участников клиринга при осуществлении клиринга по внебиржевым сделкам прямого РЕПО с Банком России);
- выполняет требования Клирингового центра по предоставлению информации и отчетности, предусмотренные статьей 14 Правил клиринга;
- выполняет требования Клирингового центра к финансовому состоянию Участника клиринга, предусмотренные статьей 15 Правил клиринга;
- в деятельности Участника клиринга отсутствуют факты ухудшения его финансового состояния и/или отсутствует информация, дающая основания считать возможными ухудшение финансового состояния Участника клиринга



и/или неспособность Участника клиринга своевременно и в полном объеме исполнять свои обязательства по Сделкам с частичным обеспечением, Маржинальные требования и/или иные обязательства Участника клиринга, возникающие из Правил клиринга.

9.2. О факте предоставления Участнику клиринга допуска к клиринговому обслуживанию Клиринговый центр извещает Участника клиринга и Биржу не позднее рабочего дня, следующего за днем предоставления допуска к клиринговому обслуживанию, направляя соответствующие уведомления в форме электронного документа.

9.3. Для получения возможности заключения Сделок с частичным обеспечением Участник клиринга обязан внести взнос в Коллективный фонд в размере, установленном решением Клирингового центра.

Клиринговый центр уведомляет Биржу о выполнении Участником клиринга требования о внесении взноса в Коллективный фонд.

9.4. Передача Клиринговому центру полномочий со стороны Участника клиринга на получение информации о суммах денежных средств, учитываемых на Счетах в Расчетной организации, а также на составление, подписание и подачу в Расчетную организацию поручений (распоряжений) на списание со Счета и / или поручений на зачисление на Счет денежных средств осуществляется в соответствии с российским законодательством.

9.5. Для передачи Клиринговому центру полномочий со стороны Участника клиринга на получение информации о количестве ценных бумаг, учитываемых на Разделах, открытых на счете депо владельца и/или корреспондентском счете депо Участника клиринга и/или счете депо доверительного управления в Депозитарии, а также на передачу Депозитарию информации, на основании которой Депозитарий осуществляет списание и/или зачисление ценных бумаг с Разделов и/или на Разделы по итогам клиринга сделок с ценными бумагами, осуществляемого Клиринговым центром, Участник клиринга обязан предоставить в Депозитарий условное поручение депо, предусмотренное условиями осуществления депозитарной деятельности Депозитария.

9.6. Для регистрации Торгово-клирингового счета Участника клиринга, устанавливающего однозначное соответствие между определенной позицией по ценным бумагам и определенной позицией по денежным средствам, а также в случае необходимости изменения такого соответствия Участник клиринга обязан предоставить Клиринговому центру Заявление на регистрацию ТКС по форме, предусмотренной пунктом 1.5 приложения № 6 к Правилам клиринга, или в форме электронного документа в соответствии с Порядком ЭДО, реквизиты которого предусмотрены пунктом 1.5 приложения № 4 к Правилам клиринга, если иной порядок предоставления и форма указанного заявления не согласованы Участником клиринга и Клиринговым центром.

Каждой позиции по ценным бумагам может соответствовать только одна позиция по денежным средствам в составе Торгово-клиринговых счетов.

При регистрации Торгово-клирингового счета Участника клиринга в Клиринговой системе контролируется соответствие идентификатора данного Участника

клиринга, указанного в полученной от Депозитария информации по Разделам, идентификатору Участника клиринга, указанному в полученной от Расчетной организации информации по Счетам, или идентификатору Участника клиринга, указанному в содержащейся в Клиринговой системе информации об открытых ему дополнительных позициях по денежным средствам.

9.7. Для заключения Сделок с частичным обеспечением Участник клиринга должен предварительно открыть в Расчетном депозитарии Раздел для учета ценных бумаг в Обеспечении. Между Разделом для учета ценных бумаг в Обеспечении и Разделом для исполнения обязательств по сделкам клирингового пула устанавливается взаимнооднозначное соответствие. Разделы для учета ценных бумаг в Обеспечении относятся к Расчетному коду, соответствующему Счету, входящему в состав того же Торгово-клирингового счета, в состав которого входит Раздел для исполнения обязательств по сделкам клирингового пула, соответствующий Разделу для учета ценных бумаг в Обеспечении.

9.8. В случае возможности проведения операций Участником клиринга по единственному Счету, Ограничительный лимит по уплате возмещения устанавливается в Клиринговой системе в отношении денежной позиции Участника клиринга, соответствующей данному Счету. В случае возможности проведения операций Участником клиринга по более чем одному Счету, Ограничительный лимит по уплате возмещения устанавливаются в Клиринговой системе в отношении денежной позиции Участника клиринга, соответствующей Счету с наиболее ранней датой открытия.

С этого же Счета Участником клиринга уплачивается Комиссионное вознаграждение по сделкам с ценными бумагами, заключенным им в иностранной валюте, абонентская плата, постоянная часть Комиссионного вознаграждения по сделкам РЕПО, плата за повторную выдачу отчетных документов, предусмотренных Правилами клиринга, по запросам Участников клиринга, плата по тарифному плану «Размещения-фиксированный» и дополнительное вознаграждение. На этот же Счет зачисляется Возмещение, причитающееся Участнику клиринга в соответствии с Правилами клиринга.

В случае возможности проведения операций Участником клиринга по более чем одному Счету, Участник клиринга может предоставить Клиринговому центру Заявление о торговом счете для возмещения и комиссии по форме, предусмотренной пунктом 1.6 приложения № 6 к Правилам клиринга, с указанием Счета, с которого должно взиматься / на который должно зачисляться Возмещение и с которого должны взиматься Комиссионное вознаграждение по сделкам с ценными бумагами, заключенным им в иностранной валюте, абонентская плата, постоянная часть Комиссионного вознаграждения по сделкам РЕПО, плата за повторную выдачу отчетных документов, предусмотренных Правилами клиринга, по запросам Участников клиринга, плата по тарифному плану «Размещения-фиксированный» и дополнительное вознаграждение в случае, предусмотренном пунктом 39.15 Правил клиринга.

9.9. В случае отсутствия у Участника клиринга Счета, Участник клиринга, имеющий возможность проведения операций по дополнительной собственной денежной позиции, обязан предоставить Клиринговому центру Заявление о торговом счете для возмещения и комиссии по форме, предусмотренной пунктом 1.6 приложения № 6 к Правилам клиринга, с указанием дополнительной собственной

денежной позиции Участника клиринга, с которой / на которую должно взиматься / зачисляться Возмещение и взиматься Комиссионное вознаграждение по сделкам с ценными бумагами, заключенным им в иностранной валюте, абонентская плата, постоянная часть Комиссионного вознаграждения по сделкам РЕПО, дополнительное вознаграждение в случае, предусмотренном пунктом 39.15 Правил клиринга, и плата за повторную выдачу отчетных документов, предусмотренных Правилами клиринга, по запросам Участников клиринга.

9.10. В случае возможности проведения операций Участником клиринга:

- по более чем одному Счету, в отношении денежной позиции одного из которых установлен Ограничительный лимит по уплате возмещения, и/или
- по более чем одной дополнительной собственной денежной позиции, в отношении одной из которых установлен Ограничительный лимит по уплате возмещения,

данный Ограничительный лимит по уплате возмещения может быть установлен в отношении любой другой денежной позиции (дополнительной собственной денежной позиции) до начала или в ходе Процедуры контроля обеспечения.

9.11. Клиринговый центр вправе приостановить допуск к клиринговому обслуживанию Участника клиринга по любому из следующих оснований:

- в случае невозможности проведения операций ни по одному из Счетов, согласно информации о закрытии Счета, полученной Клиринговым центром от Расчетной организации в соответствии с пунктом 17.2 Правил клиринга;
- при отсутствии хотя бы одного зарегистрированного Торгово-клирингового счета;
- при невозможности осуществления операций с использованием Торгово-клирингового счета, указанного в Заявлении о ТКС для внебиржевых сделок (в части осуществления клирингового обслуживания по внебиржевым сделкам прямого РЕПО с Банком России);
- при поступлении в Клиринговый центр уведомления от Биржи о приостановлении допуска Участника клиринга к участию в торгах на Бирже;
- при нарушении Участником клиринга установленных Правилами клиринга требований, в том числе, предусмотренных статьями 14 и 15 Правил клиринга;
- при применении к Участнику клиринга санкций надзорных органов за нарушение законодательства Российской Федерации, в том числе: наложение административных взысканий, ограничений и введение запрета на проведение Участником клиринга отдельных операций;
- при наличии фактов ухудшения финансового состояния Участника клиринга и/или информации, дающей основания считать возможными ухудшение финансового состояния Участника клиринга и/или неспособность Участника клиринга своевременно и в полном объеме исполнять свои обязательства по Сделкам, Маржинальные требования и/или иные обязательства Участника клиринга, возникающие из Правил клиринга.

9.12. Клиринговый центр приостанавливает допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию при получении Клиринговым центром от Участника клиринга письма о приостановлении допуска к клиринговому обслуживанию.

- 9.13. Клиринговый центр прекращает допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию (независимо от его категории) по любому из следующих оснований:
- в случае расторжения Договора об оказании клиринговых услуг при условии отсутствия неисполненных обязательств, возникших до прекращения его действия;
  - в случае отзыва (аннулирования) Банком России лицензии на осуществление банковских операций у Участника клиринга – кредитной организации;
  - в случае назначения временной администрации или принятия арбитражным судом решения о введении в отношении Участника клиринга одной из процедур банкротства;
  - ликвидации Участника клиринга, а также в случае реорганизации Участника клиринга при условии, что деятельность Участника клиринга в результате реорганизации прекращается.
- 9.14. Клиринговый центр вправе прекратить допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию при поступлении в Клиринговый центр уведомления от Биржи о прекращении допуска Участника клиринга к участию в торгах на Бирже.
- 9.15. О факте приостановления / прекращения допуска к клиринговому обслуживанию Клиринговый центр извещает Участника клиринга и Биржу в день приостановления / прекращения допуска к клиринговому обслуживанию, направляя соответствующие уведомления в форме электронного документа.

## **Статья 10. Порядок регистрации Участников клиринга и их Клиентов**

- 10.1. Клиринговый центр осуществляет регистрацию Участников клиринга и их Клиентов и присваивает каждому Участнику клиринга / Клиенту код Участника клиринга и/или код Клиента Участника клиринга, соответственно. Код Участника клиринга присваивается при заключении Участником клиринга с Клиринговым центром Договора об оказании клиринговых услуг.
- 10.2. Регистрация Клиентов Участников клиринга осуществляется на основании информации, полученной от Участника клиринга, или на основании информации, предоставленной Клиринговому центру Биржами в виде Уведомления с информацией о кодах клиентов Участника клиринга (реквизиты которого предусмотрены пунктом 4.2 приложения № 4 к Правилам клиринга).
- 10.3. Регистрация Участников клиринга и Клиентов осуществляется Клиринговым центром в соответствии с требованиями нормативных правовых актов федерального органа исполнительной власти по рынку ценных бумаг. Участнику клиринга может быть присвоен в Клиринговой системе только один код Участника клиринга.
- 10.4. Сведения, необходимые для регистрации Участника клиринга / Клиента предоставляются Участником клиринга в Клиринговый центр в форме электронного документа.
- 10.5. Процедура регистрации Участника клиринга предусматривает присвоение Участнику клиринга следующих кодов и идентификаторов:

- код Участника клиринга (присваивается в соответствии с нормативными правовыми актами федерального органа исполнительной власти по рынку ценных бумаг);
  - идентификатор (присваивается Клиринговым центром);
  - специальный код (присваивается Участником клиринга самостоятельно).
- 10.6. После присвоения Участнику клиринга кода и заключения Участником клиринга с Техническим центром договора о предоставлении интегрированного технологического сервиса Клиринговый центр присваивает Участнику клиринга идентификатор Участника клиринга. Участнику клиринга может быть присвоено в Клиринговой системе более одного идентификатора Участника клиринга. При этом для каждого Участника клиринга устанавливается однозначное соответствие всех идентификаторов присвоенному коду Участника клиринга.
- 10.7. Участник клиринга, имеющий более одного идентификатора, при открытии в Расчетной организации Счета обязан предоставить Клиринговому центру Заявление о соответствии Счета идентификатору по форме, предусмотренной пунктом 1.4 приложения № 6 к Правилам клиринга. Одному Счету может соответствовать только один идентификатор Участника клиринга.
- 10.8. Участник клиринга - управляющий также указывает Клиринговому центру специальный код Участника клиринга. Специальный код должен соответствовать формату (набору символов), используемому в Клиринговой системе, и является уникальным для данного Участника клиринга. При этом для каждого Участника клиринга Клиринговый центр устанавливает однозначное соответствие специального кода коду Участника клиринга.
- 10.9. Процедура регистрации Клиентов Участников клиринга предусматривает присвоение Клиринговым центром таким Клиентам следующих уникальных кодов:
- код Клиента (присваивается в соответствии с нормативными правовыми актами федерального органа исполнительной власти по рынку ценных бумаг);
  - краткий код Клиента (указывается Участником клиринга самостоятельно).
- 10.10. Краткий код Клиента присваивается Клиенту при условии, что:
- Участнику клиринга присвоен идентификатор;
  - Клиенту Участника клиринга присвоен код Клиента в соответствии с Правилами клиринга;
  - краткий код Клиента, предложенный Участником клиринга, соответствует формату (набор символов), используемому в Клиринговой системе, и является уникальным для данного Участника клиринга.
- 10.11. Клиенту Участника клиринга может быть присвоено в Клиринговой системе более одного краткого кода Клиента. Для каждого Клиента устанавливается однозначное соответствие всех кратких кодов Клиента коду Клиента.
- 10.12. В целях регистрации кодов Клиентов Участник клиринга может дополнительно к сведениям, установленным нормативными правовыми актами федерального органа исполнительной власти по рынку ценных бумаг, предоставлять иные сведения, в том числе, сведения о номере лицензии на осуществление банковских операций,

выданной Клиенту, сведения о том, является ли Клиент квалифицированным инвестором.

- 10.12.1. При получении от Участника клиринга сведений о номере лицензии на осуществление банковских операций, выданной Клиенту, Клиринговый центр регистрирует Клиента с отметкой «кредитная организация», если соответствующая лицензия является действительной.
- 10.12.2. В случае если Участник клиринга не укажет при регистрации Клиента номер лицензии на осуществление банковских операций, либо указанная лицензия отозвана (аннулирована), такой Клиент регистрируется с отметкой «некредитная организация».
- 10.12.3. Если после регистрации Клиринговым центром Клиента – кредитной организации, Банк России отзовет (аннулирует) лицензию на осуществление банковских операций, номер которой был указан Участником клиринга при регистрации данного Клиента, Участник клиринга обязан представить в Клиринговый центр соответствующую информацию в порядке и по форме, установленным Клиринговым центром. Клиринговый центр после получения соответствующей информации проставляет такому Клиенту отметку «некредитная организация».
- 10.13. Клиринговый центр информирует Участников клиринга о присвоении им, а также Клиентам кодов (в том числе, кратких или специальных), а также о присвоении идентификатора путем направления соответствующего уведомления.
- 10.14. Для регистрации Биржей Участника клиринга / Клиента в качестве Участника торгов / клиента Участника торгов Клиринговый центр вправе передавать имеющуюся у него информацию об Участниках клиринга и Клиентах, а также о присвоенных им кодах Бирже.
- 10.15. Клиринговый центр вправе самостоятельно аннулировать регистрацию Клиентов в случае несоблюдения требований, установленных Правилами клиринга.
- 10.16. Участник клиринга самостоятельно отслеживает полноту и актуальность информации, предоставляемой в целях регистрации кодов Участника клиринга и кодов Клиента. Клиринговый центр не несет ответственности за актуальность и достоверность информации, предоставленной Участником клиринга, а также за нарушение Участником клиринга порядка предоставления таких сведений.

## **Статья 11. Требования к клиентам Участника клиринга**

- 11.1. Для передачи Клиринговому центру полномочий со стороны эмитента, являющегося клиентом Участника клиринга, на получение информации о количестве ценных бумаг, учитываемых на Разделах, открытых на эмиссионном счете депо в Депозитарии, а также на передачу Депозитарию информации, на основании которой Депозитарий осуществляет списание и/или зачисление ценных бумаг с Разделов и/или на Разделы по итогам клиринга сделок с ценными бумагами, осуществляемого Клиринговым центром, эмитент обязан предоставить в Депозитарий условное поручение депо, предусмотренное условиями осуществления депозитарной деятельности Депозитария.

- 11.2. Для передачи Клиринговому центру полномочий со стороны клиента Участника клиринга на получение информации о количестве ценных бумаг, учитываемых на Разделах, открытых на счете депо клиента Участника клиринга в Депозитарии, а также на передачу Депозитария информации, на основании которой Депозитарий осуществляет списание и/или зачисление ценных бумаг с Разделов и/или на Разделы по итогам клиринга сделок с ценными бумагами, осуществляемого Клиринговым центром, клиент Участника клиринга обязан предоставить в Депозитарий условное поручение депо, предусмотренное условиями осуществления депозитарной деятельности Депозитария.
- 11.3. При открытии Расчетной организацией торгового счета клиента Участника клиринга Участник клиринга обязан предоставить Клиринговому центру Уведомление по форме, предусмотренной пунктом 2.1 приложения № 6 к Правилам клиринга, от соответствующего клиента.

## **Статья 12. Требования к Держателям. Порядок получения (лишения) статуса Держателя**

- 12.1. Для получения статуса Держателя юридические лица, являющиеся Участниками клиринга, предоставляют Клиринговому центру:
- заявление по форме, предусмотренной пунктом 3.1 приложения № 6 к Правилам клиринга;
  - нотариально удостоверенную копию лицензии профессионального участника рынка ценных бумаг на осуществление депозитарной деятельности, выданной федеральным органом исполнительной власти по рынку ценных бумаг (для организаций, являющихся резидентами РФ).
- 12.2. Для получения статуса Держателя юридические лица, не являющиеся Участниками клиринга, помимо документов, указанных в пункте 12.1 Правил клиринга, предоставляют Клиринговому центру:
- юридические лица, являющиеся резидентами РФ, - документы, указанные в разделе I приложения № 9 к Правилам клиринга (за исключением отчетности, предусмотренной статьей 14 Правил клиринга);
  - юридические лица, являющиеся нерезидентами РФ, - документы, указанные в разделе II приложения № 9 к Правилам клиринга.
- Юридические лица, являющиеся резидентами РФ и не являющиеся Участниками клиринга, для получения /поддержания статуса Держателя обязаны выполнить условия для получения в соответствии с Порядком ЭДО отчетных документов по итогам клиринга в форме электронных документов.
- 12.3. Решение о предоставлении (лишении) организации статуса Держателя принимается Клиринговым центром.
- 12.4. Юридическое лицо / Участник клиринга может быть лишен статуса Держателя по любому из следующих оснований:
- в случае аннулирования, приостановления или истечения срока действия лицензии профессионального участника рынка ценных бумаг на осуществление депозитарной деятельности,

- в случае отзыва (аннулирования) Банком России лицензии на осуществление банковских операций;
  - при невыполнении условий для получения в соответствии с Порядком ЭДО отчетных документов по итогам клиринга в форме электронных документов,
  - нарушения Держателем требований по представлению документов, указанных в подпункте 12.5 Правил клиринга,
  - письма Держателя о лишении его статуса Держателя;
  - ликвидации Держателя, а также в случае реорганизации Держателя при условии, что деятельность Держателя в результате реорганизации прекращается;
  - по иным основаниям.
- 12.5. Держатель обязан ежегодно предоставлять Клиринговому центру Анкету Участника клиринга (клиента) (Регистрационную карточку) в форме электронного документа.
- В случае изменения сведений, содержащихся в Анкете Участника клиринга (клиента) (Регистрационной карточке) или в иных представленных Клиринговому центру документах, Держатель обязан в течение 5 (пяти) рабочих дней после таких изменений предоставить Клиринговому центру Анкету Участника клиринга (клиента) (Регистрационную карточку) с обновленной информацией в форме электронного документа и соответствующие документы, подтверждающие такие изменения.
- 12.6. Форматы предоставления Держателем Анкеты Участника клиринга (клиента) (Регистрационной карточки) определены Порядком предоставления информации и отчетности.
- 12.7. Клиринговый центр извещает юридическое лицо / Участника клиринга о получении им статуса Держателя, а также о лишении его статуса Держателя путем размещения соответствующей информации на Сайте Клирингового центра в течение 3 (трех) рабочих дней со дня принятия соответствующего решения.
- 12.8. Для передачи Клиринговому центру полномочий со стороны Держателя на получение информации о количестве ценных бумаг, учитываемых на дополнительных торговых разделах, открытых на корреспондентском счете депо Держателя в Депозитарии, а также на передачу Депозитарию информации, на основании которой Депозитарий осуществляет списание и/или зачисление ценных бумаг с Разделов и/или на Разделы по итогам клиринга сделок с ценными бумагами, осуществляемого Клиринговым центром, Держатель обязан предоставить в Депозитарий условное поручение депо, предусмотренное условиями осуществления депозитарной деятельности Депозитария.

### **Статья 13. Требования к Банкам**

- 13.1. Для открытия в Клиринговой системе дополнительной рублевой денежной позиции Участника клиринга Банк обязан предоставить Клиринговому центру Уведомление по форме, предусмотренной пунктом 1.2 приложения № 6 к Правилам клиринга.



Направление Банком Клиринговому центру Уведомления, предусмотренного настоящим подпунктом, означает согласие Банка на проведение расчетов через соответствующий Счет Банка:

- по обязательствам и требованиям Участника клиринга по денежным средствам, а также обязательствам Участника клиринга по уплате Комиссионного вознаграждения по сделкам, заключенным с использованием его соответствующей дополнительной рублевой денежной позиции, обязательства по которым включены в клиринговый пул для расчетов в ходе торгов или по итогам торгов.

- 13.2. Для открытия в Клиринговой системе дополнительной валютной денежной позиции Участника клиринга Уполномоченный банк обязан предоставить Клиринговому центру Уведомление по форме, предусмотренной пунктом 1.2 приложения № 6 к Правилам клиринга.

Направление Уполномоченным банком Клиринговому центру Уведомления, предусмотренного настоящим подпунктом, означает согласие Уполномоченного банка на проведение расчетов через соответствующий Счет Уполномоченного банка:

- по обязательствам и требованиям Участника клиринга по денежным средствам по сделкам, заключенным с использованием его соответствующей дополнительной валютной денежной позиции, обязательства по которым включены в клиринговый пул для расчетов в ходе торгов или по итогам торгов.

- 13.3. Банки и Уполномоченные банки, инициировавшие открытие в Клиринговой системе дополнительных позиций по денежным средствам для Участников клиринга, далее по тексту Правил клиринга именуются также Клиринговыми банками.

#### **Статья 14. Требования к Участникам клиринга по предоставлению отчетности Клиринговому центру**

- 14.1. Участники клиринга – кредитные организации обязаны предоставлять Клиринговому центру следующую отчетность:

- оборотную ведомость по счетам бухгалтерского учета кредитной организации (форма 0409101) – ежемесячно;
- информацию об обязательных нормативах и о других показателях деятельности кредитной организации (форма 0409135) – ежемесячно;
- расчет собственных средств (капитала) (форма 0409134) – ежемесячно;
- отчет о прибылях и убытках кредитной организации (форма 0409102) – ежеквартально;
- справку о численном значении норматива максимального размера риска на одного заемщика или группу связанных заемщиков (Н6) (по данным формы 0409118) – ежемесячно;
- квартальный отчет профессионального участника рынка ценных бумаг (форма №1100) – ежеквартально.

- 14.2. Участники клиринга – некредитные организации обязаны предоставлять Клиринговому центру следующую отчетность:
- бухгалтерский баланс (форма 0710001) – ежеквартально;
  - отчет о прибылях и убытках (форма 0710002) – ежеквартально;
  - расчет размера собственных средств (капитала) для профессиональных участников рынка ценных бумаг – ежемесячно;
  - квартальный отчет профессионального участника рынка ценных бумаг (форма №1100) – ежеквартально.
- 14.3. Участники клиринга обязаны предоставлять отчетность, указанную в пунктах 14.1-14.2 Правил клиринга, в следующие сроки:
- расчет размера собственных средств:
    - не позднее 15 рабочего дня месяца, следующего за отчетным месяцем (кредитными организациями);
    - не позднее одного календарного месяца, следующего за отчетным месяцем (некредитными организациями);
  - оборотную ведомость по счетам бухгалтерского учета кредитной организации (форма 0409101) - не позднее 15 рабочего дня месяца, следующего за отчетным месяцем;
  - отчет о прибылях и убытках кредитной организации (форма 0409102) - не позднее 15 рабочего дня месяца, следующего за отчетным кварталом;
  - бухгалтерский баланс некредитной организации (форма 0710001), отчет о прибылях и убытках некредитной организации (форма 0710002) - не позднее 45 (сорока пяти) календарных дней, следующих за отчетным кварталом, за исключением отчетности по состоянию на 1 января, которая предоставляется не позднее 15 апреля года, следующего за отчетным;
  - информацию об обязательных нормативах и о других показателях деятельности кредитной организации (форма 0409135), справку о численном значении норматива максимального размера риска на одного заемщика или группу связанных заемщиков (Н6) кредитной организации (по данным формы 0409118) - не позднее 15 рабочего дня месяца, следующего за отчетным месяцем;
  - квартальный отчет профессионального участника рынка ценных бумаг (форма №1100) - не позднее 45 (сорока пяти) календарных дней, следующих за отчетным кварталом, за исключением отчетности по состоянию на 01 января, которая предоставляется не позднее 15 апреля года, следующего за отчетным.
- 14.4. Форматы предоставления отчетности, указанной в пунктах 14.1-14.2 Правил клиринга, определены Порядком предоставления информации и отчетности.
- 14.5. Клиринговый центр вправе потребовать от Участника клиринга другие документы, необходимые для оценки финансового состояния Участника клиринга.

## **Статья 15. Требования к финансовому состоянию Участников клиринга**

15.1. Участники клиринга - кредитные организации должны соответствовать следующим требованиям:

- соблюдать обязательные нормативы Банка России, установленные для кредитных организаций;
- иметь по балансу на последнюю отчетную дату положительный финансовый результат текущего года, определяемый как разница между суммой остатков, числящихся на балансовых счетах по учету доходов текущего года, и суммой остатков, числящихся на балансовых счетах по учету расходов текущего года;
- в деятельности Участников клиринга - кредитных организаций должны отсутствовать основания для осуществления мер по предупреждению банкротства в соответствии с законодательством Российской Федерации о несостоятельности (банкротстве) кредитных организаций, а также основания для отзыва Банком России лицензии на осуществление банковских операций в соответствии с законодательством Российской Федерации о банковской деятельности.

15.2. Участники клиринга - некредитные организации должны соответствовать следующим требованиям:

- иметь по балансу на последнюю отчетную дату положительный финансовый результат, определяемый как остаток по строке "Нераспределенная прибыль (непокрытый убыток)" бухгалтерского баланса (формы 0710001).

## **Статья 16. Порядок урегулирования неисполненных обязательств в случае прекращения клирингового обслуживания**

16.1. В случае отзыва (аннулирования) Банком России у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций, клиринговое обслуживание Участника клиринга - кредитной организации прекращается с даты отзыва (аннулирования) Банком России у такого Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций.

16.1.1. Подтверждением факта отзыва (аннулирования) лицензии на осуществление банковских операций у Участника клиринга - кредитной организации является письменное уведомление Банка России, направленное Клиринговому центру (в том числе, посредством факсимильной связи) и/или размещенная Пресс-центром Банка России на сайте Банка России в сети Интернет информация о решении Банка России об отзыве (аннулировании) выданной Участнику клиринга - кредитной организации лицензии на осуществление банковских операций и/или направленное Пресс-центром Банка России по электронному адресу Клирингового центра электронное сообщение, содержащее информацию об отзыве (аннулировании) у Участника клиринга - кредитной организации лицензии на осуществление банковских операций.

16.1.2. В случае отзыва лицензии на осуществление банковских операций у Участника клиринга – кредитной организации, обязательства по сделкам, заключенным до даты отзыва такой лицензии, прекращаются полностью на дату, предшествующую дате отзыва лицензии на осуществление банковских операций у Участника клиринга – кредитной организации.

Указанные обязательства по Сделкам с частичным обеспечением прекращаются возникновением нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга – кредитной организации, рассчитанного в соответствии с пунктом 16.3 Правил клиринга, если Участник клиринга решением суда признан несостоятельным (банкротом), или рассчитанного в соответствии с пунктом 16.4 Правил клиринга, если в отношении Участника клиринга принято решение суда о его ликвидации. Такое нетто-обязательство / нетто-требование Участника клиринга – кредитной организации подлежит исполнению не ранее дня вступления в силу решения арбитражного суда о признании Участника клиринга несостоятельным (банкротом) или о ликвидации Участника клиринга.

Указанные обязательства по сделкам купли-продажи с кодом расчетов В0-В30, сделкам РЕПО с кодом расчетов Rb, S0-S2, Z0 прекращаются возникновением нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга – кредитной организации в отношении других Участников клиринга – его контрагентов по указанным сделкам. Размер указанных нетто-обязательств / нетто-требований рассчитывается в соответствии с пунктом 16.5 Правил клиринга. Такие нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга – кредитной организации подлежат исполнению не ранее дня вступления в силу решения арбитражного суда о признании Участника клиринга несостоятельным (банкротом) или о ликвидации Участника клиринга.

- 16.1.3. В случае отзыва (аннулирования) лицензии на осуществление банковских операций у Участника клиринга – кредитной организации, сделки, заключенные в дату отзыва (аннулирования) такой лицензии и (или) после нее, являются недействительными.

Клиринговый центр или Участник клиринга – его контрагент по указанным сделкам вправе предъявить к Участнику клиринга – кредитной организации требование о взыскании убытков, связанных с недействительностью указанных сделок, а также неустоек (штрафов, пеней), и комиссионных вознаграждений, подлежащих уплате в соответствии с Правилами клиринга, в общем порядке, предусмотренном законодательством о несостоятельности (банкротстве).

- 16.1.4. Клиринговый центр направляет Участнику клиринга - кредитной организации, у которого отозвана (аннулирована) лицензия на осуществление банковских операций, в форме электронного документа уведомление о прекращении обязательств по сделкам не позднее рабочего дня, следующего за датой прекращения обязательств по этим сделкам. Указанное уведомление также содержит информацию о рассчитанных в соответствии с пунктом 16.5 Правил клиринга нетто-обязательствах / нетто-требованиях Участника клиринга – кредитной организации в отношении его контрагентов по сделкам купли-продажи с кодом расчетов В0-В30, сделкам РЕПО с кодом расчетов Rb, S0-S2, Z0.

Уведомления о прекращении обязательств по сделкам купли-продажи с кодом расчетов В0-В30, сделкам РЕПО с кодом расчетов Rb, S0-S2, Z0, содержащие информацию о рассчитанных в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга нетто-обязательствах / нетто-требованиях Участников клиринга - контрагентов Участника клиринга – кредитной организации, у которого отозвана (аннулирована) лицензия на осуществление банковских операций, по указанным сделкам, направляются указанным Участникам клиринга – контрагентам в том же порядке и в те же сроки.

- 16.1.5. Клиринговый центр в порядке, предусмотренном пунктом 16.3 или 16.4 Правил клиринга, рассчитывает сумму нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга – кредитной организации и направляет такому Участнику клиринга в форме электронного документа уведомление о рассчитанной в соответствии с пунктом 16.3 или 16.4 Правил клиринга сумме нетто-обязательства или нетто-требования Участника клиринга.
- 16.1.6. Возврат денежных средств Участнику клиринга – кредитной организации осуществляется Клиринговым центром в течение 3 (трех) банковских дней после получения Клиринговым центром письма о возврате денежных средств от уполномоченного органа кредитной организации, содержащего платежные реквизиты, а также документов, подтверждающих полномочия указанного органа (если они ранее не были переданы Клиринговому центру), но не ранее дня вступления в силу решения арбитражного суда о признании Участника клиринга несостоятельным (банкротом) или о ликвидации Участника клиринга.  
Возврат денежных средств Участнику клиринга – кредитной организации осуществляется Клиринговым центром в сумме нетто-требования Участника клиринга, рассчитанного соответственно в порядке, предусмотренном пунктом 16.3 или 16.4 Правил клиринга.
- 16.1.7. Клиринговый центр вправе предъявить к Участнику клиринга – кредитной организации требование о взыскании нетто-обязательства Участника клиринга, рассчитанного соответственно в порядке, предусмотренном пунктом 16.3 или 16.4 Правил клиринга, в общем порядке, предусмотренном законодательством о несостоятельности (банкротстве).
- 16.1.8. После принятия арбитражным судом решения о признании Участника клиринга – кредитной организации несостоятельным (банкротом) или о ликвидации Участника клиринга – кредитной организации и направления ему уведомления о рассчитанных нетто-обязательствах / нетто-требованиях Клиринговый центр направляет такому Участнику клиринга в форме электронного документа уведомление о расторжении Договора об оказании клиринговых услуг.
- 16.2. В случае назначения временной администрации или принятия арбитражным судом решения о введении в отношении Участника клиринга одной из процедур банкротства, клиринговое обслуживание Участника клиринга, не являющегося кредитной организацией, прекращается с даты назначения временной администрации или даты принятия арбитражным судом решения о введении в отношении Участника клиринга одной из процедур банкротства, в зависимости от того, какая дата наступила ранее.
- 16.2.1. В случае назначения временной администрации или принятия арбитражным судом решения о введении в отношении Участника клиринга, не являющегося кредитной организацией, одной из процедур банкротства, обязательства по сделкам прекращаются полностью в дату прекращения клирингового обслуживания.  
Указанные обязательства по Сделкам с частичным обеспечением прекращаются возникновением нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга, не являющегося кредитной организацией, рассчитанных в соответствии с пунктом 16.4 Правил клиринга.  
Указанные обязательства по сделкам купли-продажи с кодом расчетов В0-В30, сделкам РЕПО с кодом расчетов Rb, S0-S2, Z0 прекращаются возникновением нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга, не являющегося

кредитной организацией, в отношении других Участников клиринга – его контрагентов по указанным сделкам. Размер указанных нетто-обязательств / нетто-требований рассчитывается в соответствии с пунктом 16.5 Правил клиринга. Такие нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга – кредитной организации подлежат исполнению не ранее дня вступления в силу решения арбитражного суда о признании Участника клиринга несостоятельным (банкротом) или о ликвидации Участника клиринга.

- 16.2.2. Клиринговый центр направляет такому Участнику клиринга, не являющемуся кредитной организацией, в форме электронного документа уведомление о прекращении обязательств по сделкам не позднее Рабочего дня, следующего за датой прекращения обязательств по указанным сделкам. Указанное уведомление также содержит информацию о рассчитанных в соответствии с пунктом 16.5 Правил клиринга нетто-обязательствах / нетто-требованиях Участника клиринга, не являющегося кредитной организацией, в отношении его контрагентов по сделкам купли-продажи с кодом расчетов В0-В30, сделкам РЕПО с кодом расчетов Rb, S0-S2, Z0.

Уведомления о прекращении обязательств по сделкам купли-продажи с кодом расчетов В0-В30, сделкам РЕПО с кодом расчетов Rb, S0-S2, Z0, содержащие информацию о рассчитанных в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга нетто-обязательствах / нетто-требованиях Участников клиринга - контрагентов Участника клиринга, не являющегося кредитной организацией, в отношении которого назначена временная администрация или введена одна из процедур банкротства, по указанным сделкам, направляются указанным Участникам клиринга – контрагентам в том же порядке и в те же сроки.

- 16.2.3. Клиринговый центр в порядке, предусмотренном пунктом 16.4 Правил клиринга, рассчитывает сумму нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга, не являющегося кредитной организацией, и направляет такому Участнику клиринга в форме электронного документа уведомление о рассчитанной в соответствии с пунктом 16.4 Правил клиринга сумме нетто-обязательства или нетто-требования Участника клиринга.

- 16.2.4. Возврат денежных средств Участнику клиринга, не являющемуся кредитной организацией, осуществляется Клиринговым центром в течение 3 (трех) банковских дней после получения Клиринговым центром письма о возврате денежных средств от уполномоченного органа Участника клиринга, не являющегося кредитной организацией, содержащего платежные реквизиты, а также документов, подтверждающих полномочия указанного органа (если они ранее не были переданы Клиринговому центру).

Возврат денежных средств Участнику клиринга, не являющемуся кредитной организацией, осуществляется Клиринговым центром в сумме нетто-требования Участника клиринга, рассчитанного в порядке, предусмотренном пунктом 16.4 Правил клиринга.

- 16.2.5. Клиринговый центр вправе предъявить к Участнику клиринга, не являющемуся кредитной организацией, требование о взыскании нетто-обязательства Участника клиринга, рассчитанного в порядке, предусмотренном пунктом 16.4 Правил клиринга, а также неустоек (штрафов, пеней), и комиссионных вознаграждений, подлежащих уплате в соответствии с Правилами клиринга, в общем порядке, предусмотренном законодательством о несостоятельности (банкротстве).

- 16.2.6. После назначения временной администрации или принятия арбитражным судом решения о введении в отношении Участника клиринга, не являющегося кредитной организацией, одной из процедур банкротства и направления ему уведомления о рассчитанных нетто-обязательствах / нетто-требованиях Клиринговый центр направляет такому Участнику клиринга в форме электронного документа уведомление о расторжении Договора об оказании клиринговых услуг.
- 16.3. В случае принятия арбитражным судом решения о признании Участника клиринга – кредитной организации несостоятельным (банкротом) Клиринговый центр рассчитывает размер нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в российских рублях следующим образом:
- 1) по каждой ценной бумаге, включенной в Клиринговый лист для Сделок с частичным обеспечением, рассчитывает нетто-позицию Участника клиринга по ценной бумаге как сумму (с учетом знака) Нетто-обязательств / Нетто-требований Участника клиринга по Сделкам с частичным обеспечением по всем Разделам для учета ценных бумаг в Обеспечении и Датах исполнения по ценной бумаге, учитываемых на конец дня, предшествующего дате отзыва (аннулирования) у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций;
  - 2) если нетто-позиция Участника клиринга по ценной бумаге является позицией на продажу, Клиринговый центр рассчитывает произведение абсолютной величины нетто-позиции Участника клиринга по ценной бумаге и разности последней определенной Расчетной цены ценной бумаги, и цены сделки, заключенной Клиринговым центром в соответствии с пунктом 36.8 Правил клиринга в объеме, равном нетто-позиции Участника клиринга по ценной бумаге, с направленностью, противоположной направленности нетто-позиции Участника клиринга по ценной бумаге (на покупку);
  - 3) если нетто-позиция Участника клиринга по ценной бумаге является позицией на покупку, Клиринговый центр рассчитывает произведение нетто-позиции Участника клиринга по ценной бумаге и разности цены сделки, заключенной Клиринговым центром в соответствии с пунктом 36.8 Правил клиринга в объеме, равном нетто-позиции Участника клиринга по ценной бумаге, с направленностью, противоположной направленности нетто-позиции Участника клиринга по ценной бумаге (на продажу) и последней определенной Расчетной цены ценной бумаги;
  - 4) для каждого Участника клиринга рассчитывает сумму с учетом знака:
    - по всем ценным бумагам, включенным в Клиринговый лист для Сделок с частичным обеспечением, произведений, рассчитанных в соответствии с подпунктами 2, 3 настоящего пункта Правил клиринга;
    - Обеспечения Участника клиринга в российских рублях (учитывается со знаком «плюс»);
    - Обеспечения Участника клиринга в иностранной валюте, пересчитанного в российские рубли по курсу, установленному Банком России на день отзыва у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций (учитывается со знаком «плюс»);
    - взноса Участника клиринга в Коллективный фонд (учитывается со знаком «плюс»);

- значения (с учетом знака) обязательства / требования Участника клиринга в российских рублях по возврату Гарантийных переводов, рассчитанного на дату, предшествующую дате отзыва (аннулирования) у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций, и
- Задолженности и/или Задолженности по гарантийным переводам (со знаком «минус») Участника клиринга в российских рублях, возникшей до даты отзыва (аннулирования) у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций.

Если указанная сумма отрицательная, это означает наличие нетто-обязательства Участника клиринга по отношению к Клиринговому центру, если положительная – наличие нетто-требования Участника клиринга по отношению к Клиринговому центру.

16.4. В случае принятия арбитражным судом решения о ликвидации Участника клиринга – кредитной организации или в случае назначения временной администрации или принятия арбитражным судом решения о введении в отношении Участника клиринга, не являющегося кредитной организацией, одной из процедур банкротства (за исключением конкурсного управления), Клиринговый центр рассчитывает размер нетто-обязательства Участника клиринга в российских рублях в порядке, предусмотренном пунктом 16.3 Правил клиринга, но с учетом параметров Сделок с частичным обеспечением, заключенных Участником клиринга до момента отзыва (аннулирования) у него лицензии на осуществление банковских операций в день отзыва (аннулирования) указанной лицензии, а также неустоек (штрафов, пеней) и комиссионных вознаграждений, подлежащих уплате Участником клиринга в соответствии с Правилами клиринга.

16.5. Клиринговый центр рассчитывает размер нетто-обязательств / нетто-требований в российских рублях Участника клиринга (далее – Ликвидант) в отношении других Участников клиринга – его контрагентов по сделкам купли-продажи с кодом расчетов В0-В30, сделкам РЕПО с кодом расчетов Rb, S0-S2, Z0 следующим образом.

16.5.1. Нетто-обязательство (нетто-требование) Ликвиданта по денежным средствам в каждой валюте в отношении каждого Участника клиринга – контрагента по сделкам, рассчитывается по сделкам в соответствующей валюте, заключенным с данным Участником клиринга, по формуле:

**НОД = СТ - СО**, где:

**НОД** - нетто-обязательство (нетто-требование) Ликвиданта по денежным средствам в соответствующей валюте;

**СТ** - сумма требований, а **СО** – сумма обязательств Ликвиданта по денежным средствам по:

- сделкам с кодом расчетов В0-В30;
- первым частям сделок РЕПО с кодом расчетов S0-S2;
- вторым частям сделок РЕПО с кодом расчетов Rb, S0-S2, Z0.

Отрицательное значение **НОД** означает нетто-обязательство Ликвиданта по денежным средствам в соответствующей валюте, положительное значение **НОД** - нетто-требование Ликвиданта по денежным средствам.



16.5.2. Нетто-обязательство (нетто-требование) Ликвиданта по ценным бумагам в отношении каждого Участника клиринга – контрагента по сделкам, рассчитывается по сделкам, заключенным с данным Участником клиринга, по формуле:

**НОЦ = СТЦ - СОЦ**, где:

**НОЦ** - нетто-обязательство (нетто-требование) Ликвиданта по ценной бумаге;

**СТЦ** - сумма требований, а **СОЦ** – сумма обязательств Ликвиданта по соответствующей ценной бумаге по:

- сделкам с кодом расчетов В0-В30;
- первым частям сделок РЕПО с кодом расчетов S0-S2;
- вторым частям сделок РЕПО с кодом расчетов Rb, S0-S2, Z0.

Отрицательное значение НОЦ означает нетто-обязательство Ликвиданта по ценной бумаге, положительное значение НОЦ - нетто-требование Ликвиданта по ценной бумаге.

16.5.3. Определенное в соответствии с подпунктом 16.5.1 Правил клиринга нетто-обязательство (нетто-требование) Ликвиданта по денежным средствам в российских рублях в отношении каждого Участника клиринга – контрагента по сделкам складывается с учетом знака с определенным в соответствии с подпунктом 16.5.1 Правил клиринга нетто-обязательство (нетто-требование) Ликвиданта по денежным средствам в иностранной валюте в отношении того же Участника клиринга – контрагента по сделкам, пересчитанным в российские рубли по курсу, установленному Банком России на дату прекращения клирингового обслуживания Участника клиринга, а также - с определенным в соответствии с подпунктом 16.5.2 Правил клиринга нетто-обязательством (нетто-требованием) Ликвиданта по ценным бумагам в отношении того же Участника клиринга – контрагента по сделкам, пересчитанным в российские рубли по рыночной цене ценной бумаги, определенной на дату прекращения обязательств по сделкам.

Если значение, определенное в соответствии с настоящим подпунктом Правил клиринга, отрицательное, это означает наличие нетто-обязательства в российских рублях Ликвиданта по отношению к Участнику клиринга – контрагенту, если положительное – наличие нетто-требования в российских рублях Ликвиданта по отношению к Участнику клиринга – контрагенту.

16.6. В случае отзыва (аннулирования) лицензии на осуществление банковских операций у Клирингового центра, обязательства по Сделкам с частичным обеспечением, заключенным до даты отзыва (аннулирования) такой лицензии, прекращаются полностью на дату, предшествующую дате отзыва (аннулирования) лицензии на осуществление банковских операций у Клирингового центра.

Указанные обязательства прекращаются возникновением нетто-обязательства / нетто-требования Клирингового центра, рассчитанного в соответствии с пунктом 16.7 Правил клиринга, если Клиринговый центр решением суда признан несостоятельным (банкротом), или рассчитанного в соответствии с пунктом 16.8 Правил клиринга, если в отношении Клирингового центра принято решение суда о его ликвидации. Такое нетто-обязательство Клирингового центра подлежит исполнению после вступления в силу соответствующего решения арбитражного суда.

16.6.1. В случае отзыва (аннулирования) лицензии на осуществление банковских операций у Клирингового центра, обязательства по Сделкам с частичным обеспечением, заключенным в дату отзыва (аннулирования) такой лицензии, являются недействительными.

Участник клиринга вправе предъявить к Клиринговому центру требование о взыскании убытков, связанных с недействительностью указанных сделок, а также неустоек (штрафов, пеней), подлежащих уплате в соответствии с Правилами клиринга, в общем порядке, предусмотренном законодательством о несостоятельности (банкротстве).

16.7. В случае принятия арбитражным судом решения о признании Клирингового центра несостоятельным (банкротом) размер нетто-обязательства / нетто-требования Клирингового центра в российских рублях в отношении каждого Участника клиринга рассчитывается как сумма с учетом знака:

- по каждой ценной бумаге, включенной в Клиринговый лист для Сделок с частичным обеспечением, произведения нетто-позиция Участника клиринга по ценной бумаге, рассчитанной как сумма (с учетом знака) Нетто-обязательств / Нетто-требований Участника клиринга по Сделкам с частичным обеспечением по всем Разделам для учета ценных бумаг в Обеспечении и Датах исполнения по ценной бумаге, учитываемых на конец дня, предшествующего дате отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций, и последней определенной Расчетной цены ценной бумаги;
- Обеспечения Участника клиринга в российских рублях (учитывается со знаком «плюс»);
- Обеспечения Участника клиринга в иностранной валюте, пересчитанного в российские рубли по курсу, установленному Банком России на день отзыва у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций (учитывается со знаком «плюс»);
- неисполненных Маржинальных требований, возникших до даты отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций (учитываются со знаком «минус»);
- взноса Участника клиринга в Коллективный фонд (учитывается со знаком «плюс»);
- значения (с учетом знака) обязательства / требования Участника клиринга в российских рублях по возврату Гарантийных переводов, рассчитанного на дату, предшествующую дате отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций, и
- Задолженности и/или Задолженности по гарантийным переводам (учитывается со знаком «минус») Участника клиринга в российских рублях, возникшей до даты отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций.

Если величина, рассчитанная в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга, отрицательная, это означает наличие нетто-требования Клирингового центра по отношению к Участнику клиринга, если положительная – наличие нетто-обязательства Клирингового центра по отношению к Участнику клиринга.

- 16.8. В случае принятия арбитражным судом решения о ликвидации Клирингового центра размер нетто-обязательства / нетто-требования Клирингового центра в российских рублях в отношении Участника клиринга рассчитывается в порядке, предусмотренном пунктом 16.7 Правил клиринга, но с учетом неустоек (штрафов, пеней), комиссионных вознаграждений, подлежащих уплате в соответствии с Правилами клиринга.
- 16.9. Информация о размере нетто-обязательства / нетто-требования Клирингового центра в российских рублях в отношении Участника клиринга, определенных в соответствии с пунктами 16.7, 16.8 Правил клиринга направляется Клиринговым центром Участнику клиринга в форме электронного документа.

### **III. ТРЕБОВАНИЯ К ПОРЯДКУ ВЗАИМОДЕЙСТВИЯ УЧАСТНИКОВ КЛИРИНГА С РАСЧЕТНОЙ ОРГАНИЗАЦИЕЙ, ДЕПОЗИТАРИЕМ И БИРЖЕЙ**

#### **Статья 17. Требования к порядку взаимодействия Участников клиринга и/или их клиентов с Расчетной организацией**

17.1. Для учета денежных средств и осуществления расчетов по денежным средствам по итогам клиринга, осуществляемого Клиринговым центром, Участникам клиринга и, при необходимости, их клиентам Расчетной организацией открываются соответствующие Счета. Порядок зачисления и списания денежных средств по Счетам определяется Правилами клиринга, а также соответствующими договорами банковского счета, заключаемыми между Расчетной организацией и Участниками клиринга и/или клиентами Участников клиринга.

17.2. После открытия Расчетной организацией Счета и начала проведения по нему операций, Расчетная организация направляет Клиринговому центру Уведомление об открытии Счета (реквизиты которого предусмотрены подпунктом 2.1.1 приложения № 4 к Правилам клиринга).

В случае закрытия Счета Расчетная организация направляет Клиринговому центру Уведомление о закрытии Счета (реквизиты которого предусмотрены подпунктом 2.1.2 приложения № 4 к Правилам клиринга).

#### **Статья 18. Требования к порядку взаимодействия Участников клиринга и/или их клиентов с Депозитарием**

18.1. Для учета ценных бумаг и осуществления расчетов по ценным бумагам по итогам клиринга, осуществляемого Клиринговым центром, на счетах депо Держателей, Участников клиринга и, при необходимости, на счетах депо клиентов (в том числе, эмитентов) Участников клиринга в Депозитарии открываются соответствующие Разделы. Порядок зачисления и списания ценных бумаг по Разделам в Депозитарии определяется Правилами клиринга, а также соответствующими договорами счетов депо, заключаемыми между Депозитарием и Держателями, Участниками клиринга и/или клиентами Участников клиринга.

#### **Статья 19. Требования к порядку взаимодействия Клирингового центра и Биржи, а также Участников клиринга с Биржей**

19.1. Биржа уведомляет Клиринговый центр обо всех организациях, включенных в состав / исключенных из состава Участников торгов в форме Уведомления об Участниках торгов, реквизиты которого предусмотрены подпунктом 4.1.2 приложения № 4 к Правилам клиринга. Биржа путем направления соответствующих письменных уведомлений в произвольной форме информирует Клиринговый центр о ставших ей известными случаях изменения организационно-правовой формы, наименования и иных изменениях, касающихся Участника торгов, наличие информации о которых необходимо для осуществления клирингового обслуживания Участников клиринга.

- 19.2. Клиринговый центр уведомляет Биржу обо всех Участниках клиринга, допущенных Клиринговым центром к клиринговому обслуживанию, в форме Уведомления о допуске Участников клиринга, реквизиты которого предусмотрены подпунктом 4.1.2 приложения № 3 к Правилам клиринга. В случае прекращения (приостановления) допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию Клиринговый центр информирует об этом Биржу. Клиринговый центр информирует путем направления соответствующих письменных уведомлений в произвольной форме Биржу о ставших ей известных случаях изменения организационно-правовой формы, наименования и иных изменениях, касающихся Участника клиринга, наличие информации о которых необходимо для оказания Участникам торгов услуг по организации торговли на рынке ценных бумаг.
- 19.3. Биржа уведомляет Клиринговый центр о прекращении допуска Участника клиринга к Торгам Биржи в дату прекращения указанного допуска в форме Уведомления о прекращении допуска к торгам Участника торгов, реквизиты которого предусмотрены подпунктом 4.1.4 приложения № 4 к Правилам клиринга.
- 19.4. Клиринговый центр уведомляет Биржу о фактах неисполнения биржевых сделок с ценными бумагами, заключенных на этой Бирже, путем направления Уведомления о неисполнении обязательств по сделкам с ценными бумагами в форме электронного документа, реквизиты которого предусмотрены пунктом 4.2 приложения № 3 к Правилам клиринга, и документа на бумажном носителе, реквизиты которого предусмотрены подпунктом 4.1.4 приложения № 3 к Правилам клиринга.
- 19.5. Биржа уведомляет Клиринговый центр обо всех случаях отказа Участника торгов от получения Переменного возмещения или Фиксированного возмещения, подлежащего уплате в его пользу в соответствии с условиями заключенной биржевой сделки с ценными бумагами.
- 19.6. Биржа передает Клиринговому центру Биржевую информацию, реквизиты которой предусмотрены пунктом 4.2 приложения № 4 к Правилам клиринга.
- 19.7. В срок, установленный Временным регламентом, Клиринговый центр информирует Биржу об изменениях в списках ценных бумаг, находящихся на обслуживании в Депозитарии, в форме Уведомления о ценных бумагах, реквизиты которого предусмотрены подпунктом 4.1.3 приложения № 3 к Правилам клиринга.
- 19.8. Биржа уведомляет Клиринговый центр о дате начала (прекращения) торгов ценной бумагой (ценными бумагами), включенными в Список ценных бумаг, допущенных к торгам на Бирже, а также изменении параметров таких ценных бумаг в форме Уведомления о ценных бумагах, реквизиты которого предусмотрены подпунктом 4.1.3 приложения № 4 к Правилам клиринга.
- 19.9. В случае осуществления операций по объединению выпусков эмиссионных ценных бумаг и/или аннулированию индивидуальных номеров (кодов) дополнительных выпусков эмиссионных ценных бумаг (при получении соответствующего уведомления от Депозитария) Клиринговый центр информирует об этом Биржу путем направления Уведомления об объединении выпусков эмиссионных ценных бумаг и/или аннулировании индивидуальных номеров (кодов) дополнительных

выпусков эмиссионных ценных бумаг, реквизиты которого предусмотрены подпунктом 4.1.1 приложения № 3 к Правилам клиринга.

#### **IV. ПОРЯДОК ВЗАИМОДЕЙСТВИЯ КЛИРИНГОВОГО ЦЕНТРА С РАСЧЕТНОЙ ОРГАНИЗАЦИЕЙ, ДЕПОЗИТАРИЕМ И БИРЖЕЙ**

##### **Статья 20. Порядок взаимодействия с Расчетной организацией**

- 20.1. Сроки передачи документов (информации), осуществляемой в процессе взаимодействия Клирингового центра с Расчетной организацией предусмотрены Временным регламентом.
- 20.2. Расчетная организация блокирует зарезервированные денежные средства на Счетах. Блокировка Расчетной организацией зарезервированных денежных средств на Счетах означает, что списание денежных средств с этих Счетов производится только на основании документов, направляемых Клиринговым центром в Расчетную организацию в соответствии с Правилами клиринга.
- 20.3. Расчетная организация передает Клиринговому центру Сведения о денежных средствах, зарезервированных на Счетах (реквизиты документа предусмотрены пунктом 2.2 приложения № 4 к Правилам клиринга).
- 20.4. На основании данных, полученных от Расчетной организации, Клиринговый центр устанавливает в Клиринговой системе начальные значения основных и дополнительных позиций по денежным средствам Участников клиринга. Начальными значениями основных и дополнительных позиций Участников клиринга по денежным средствам являются суммы денежных средств, зарезервированные на соответствующих этим позициям Счетах.
- 20.5. При увеличении суммы денежных средств, зарезервированных на Счете в Расчетной организации, Расчетная организация блокирует дополнительно зарезервированные денежные средства на данном Счете и передает Клиринговому центру Уведомление об увеличении денежных средств на Счетах (реквизиты которого предусмотрены пунктом 2.2 приложения № 4 к Правилам клиринга). По результатам обработки в Клиринговой системе полученного от Расчетной организации Уведомления об увеличении денежных средств на Счетах, Клиринговый центр передает Расчетной организации Сообщение об обработке / о невозможности обработки Уведомления об увеличении денежных средств на Счетах (реквизиты которого предусмотрены пунктом 2.2 приложения № 3 к Правилам клиринга).
- 20.6. В случае поступления в Расчетную организацию платежного документа на уменьшение суммы денежных средств, зарезервированных на Счете, Расчетная организация направляет Клиринговому центру Запрос о возможности уменьшения суммы денежных средств на Счетах (реквизиты которого предусмотрены пунктом 2.2 приложения № 4 к Правилам клиринга). Уменьшение суммы денежных средств на Счетах на основании запроса, полученного от Расчетной организации, осуществляется при условии, что сумма уменьшения не превышает планового значения соответствующей позиции по денежным средствам Участника клиринга за вычетом соответствующих Ограничительных лимитов по уплате комиссионного вознаграждения и Ограничительных лимитов по уплате возмещения.

Если условие, требуемое для уменьшения суммы денежных средств на Счетах соблюдается, и при этом сумма уменьшения превышает начальное значение соответствующей позиции по денежным средствам Участника клиринга, Клиринговый центр направляет Расчетной организации Распоряжение на списание денежных средств с Клирингового счета (реквизиты которого предусмотрены пунктом 2.2 приложения № 3 к Правилам клиринга) и увеличивает начальное значение соответствующей позиции по денежным средствам Участника клиринга на разницу между суммой уменьшения, указанной в Запросе о возможности уменьшения суммы денежных средств на Счетах, и начальным значением соответствующей позиции по денежным средствам.

В случае возможности уменьшения суммы денежных средств на Счетах, Клиринговый центр уменьшает начальное значение соответствующей позиции по денежным средствам Участника клиринга.

- 20.7. После уменьшения начального значения позиции по денежным средствам Участника клиринга, предусмотренного пунктом 20.6 Правил клиринга, Клиринговый центр направляет Расчетной организации Уведомление о возможности уменьшения суммы денежных средств (реквизиты которого предусмотрены пунктом 2.2 приложения № 3 к Правилам клиринга).
- 20.8. В случае невозможности произвести уменьшение начального значения позиции по денежным средствам Участника клиринга в Клиринговой системе, предусмотренного пунктом 20.6 Правил клиринга, Клиринговый центр направляет Расчетной организации Уведомление о невозможности уменьшения суммы денежных средств (реквизиты которого предусмотрены пунктом 2.2 приложения № 3 к Правилам клиринга).
- 20.9. После получения от Клирингового центра уведомления в соответствии с пунктом 20.7 Правил клиринга, Расчетная организация осуществляет разблокировку денежных средств на соответствующем Счете в соответствии с уведомлением, полученным от Клирингового центра. После получения от Клирингового центра уведомления в соответствии с подпунктом 20.8 Правил клиринга, Расчетная организация не осуществляет разблокировку денежных средств на соответствующем Счете.
- 20.10. При заключении сделки с кодом расчетов Z0 на основании заявки на покупку, в которой сумма сделки больше начального значения денежной позиции, Клиринговый центр направляет Расчетной организации Распоряжение на списание денежных средств с Клирингового счета (реквизиты которого предусмотрены пунктом 2.2 приложения № 3 к Правилам клиринга) и увеличивает начальное значение соответствующей позиции по денежным средствам Участника клиринга на разницу между суммой сделки (с учетом Комиссионного вознаграждения и НКД) и начальным значением соответствующей позиции по денежным средствам.
- 20.11. При прохождении Процедуры контроля обеспечения сделками, включенными в Срочный отчет на исполнение, в котором нетто-обязательство по денежным средствам больше начального значения денежной позиции, Клиринговый центр направляет Расчетной организации Распоряжение на списание денежных средств с Клирингового счета (реквизиты которого предусмотрены пунктом 2.2 приложения № 3 к Правилам клиринга) и увеличивает начальное значение



соответствующей позиции по денежным средствам Участника клиринга на разницу между указанным нетто-обязательством по денежным средствам и начальным значением соответствующей позиции по денежным средствам.

## **Статья 21. Порядок взаимодействия с Депозитарием**

21.1. Сроки передачи документов (информации), осуществляемой в процессе взаимодействия Клирингового центра с Депозитарием предусмотрены Временным регламентом.

21.2. В Депозитарии блокируются Разделы и зарезервированные ценные бумаги на Разделах.

Блокировка Разделов в Депозитарии означает, что административные операции, приводящие к изменениям анкет счетов депо, а также других учетных регистров Депозитария, за исключением ценных бумаг, зарезервированных на этих Разделах, могут осуществляться в Депозитарии только после получения от Клирингового центра Распоряжения на разблокировку Разделов и ценных бумаг, находящихся на Разделах (реквизиты которого предусмотрены пунктом 3.2 приложения № 3 к Правилам клиринга).

Блокировка зарезервированных ценных бумаг на Разделах в Депозитарии означает, что их списание с этих Разделов производится на основании условного поручения депо только в соответствии с информацией, направляемой Клиринговым центром Депозитарию в соответствии с Правилами клиринга.

21.3. Депозитарий передает Клиринговому центру Информацию о состоянии Разделов и Отчет об остатках на Разделах (реквизиты которых предусмотрены пунктом 3.1 приложения № 4 к Правилам клиринга).

21.4. На основании данных, полученных от Депозитария, Клиринговый центр устанавливает в Клиринговой системе начальные значения позиций депо Участников клиринга. Начальным значением позиции депо Участника клиринга в Клиринговой системе является количество ценных бумаг, учитываемое на соответствующем этой позиции депо Разделе.

21.5. Формирование начальных значений учетных позиций Участников клиринга осуществляется только в дату размещения акций, определяемую в соответствии с зарегистрированными в установленном порядке Решением о выпуске и/или Проспектом ценных бумаг. При этом начальные значения учетных позиций Участников клиринга устанавливаются равными нулю.

Одновременно с установлением начального значения учетной позиции «2» Участника клиринга Клиринговый центр формирует по этой позиции в Клиринговой системе лимит ее возможного максимального значения в размере, определенном либо в договоре, заключенном между Клиринговым центром и Эмитентом акций, либо в зарегистрированных в установленном порядке Решении о выпуске и/или Проспекте ценных бумаг. При этом указанный лимит не может превышать остатка по эмиссионному счету эмитента в соответствии с выпиской реестродержателя на дату, предшествующую дате размещения акций.

21.6. При увеличении количества ценных бумаг, зарезервированных на Разделе, Депозитарий блокирует дополнительно зарезервированные ценные бумаги на

данном Разделе и передает Клиринговому центру Уведомление об увеличении остатков на Разделе (реквизиты которого предусмотрены пунктом 3.1 приложения № 4 к Правилам клиринга). По результатам обработки в Клиринговой системе полученного от Депозитария Уведомления об увеличении остатков на Разделе, Клиринговый центр передает в Депозитарий Сообщение об обработке Уведомления об увеличении остатков на Разделе (реквизиты которого предусмотрены пунктом 3.2 приложения № 3 к Правилам клиринга).

- 21.7. В случае поступления в Депозитарий поручений депо, приводящих к уменьшению количества ценных бумаг, зарезервированных на Разделах, Депозитарий направляет Клиринговому центру Перечень поручений депо, приводящих к уменьшению зарезервированных ценных бумаг (реквизиты которого предусмотрены пунктом 3.1 приложения № 4 к Правилам клиринга). Указанный Перечень является запросом Депозитария о возможности уменьшения количества зарезервированных ценных бумаг на соответствующих Разделах.

В случае получения запроса о возможности уменьшения количества ценных бумаг на Разделе для исполнения обязательств по сделкам клирингового пула, Клиринговый центр на основании полученного от Депозитария запроса производит уменьшение значений соответствующей позиции депо Участника клиринга в Клиринговой системе, при условии, что величина уменьшения не превышает меньшую из трех следующих величин:

- начальное значение позиции депо Участника клиринга в Клиринговой системе;
- контрольное значение позиции депо Участника клиринга в Клиринговой системе;
- плановое значение позиции депо Участника клиринга в Клиринговой системе.

В случае получения запроса о возможности уменьшения количества ценных бумаг на Разделе для учета ценных бумаг в Обеспечении, Клиринговый центр на основании полученного от Депозитария запроса производит уменьшение Единого лимита Участника клиринга по Расчетному коду, к которому относится указанный Раздел для учета ценных бумаг в Обеспечении, при условии, что в результате такого уменьшения указанный Единый лимит не станет отрицательным. При этом количество ценных бумаг, учитываемых на Разделе для учета ценных бумаг в Обеспечении, уменьшается на количество ценных бумаг, указанное в запросе.

- 21.8. После уменьшения значений позиции депо Участника клиринга в Клиринговой системе / уменьшения Единого лимита Участника клиринга по Расчетному коду, предусмотренного пунктом 21.7 Правил клиринга, Клиринговый центр направляет в Депозитарий Распоряжение на разблокировку ценных бумаг, зарезервированных на Разделе (реквизиты которого предусмотрены пунктом 3.2 приложения № 3 к Правилам клиринга).

- 21.9. В случае невозможности произвести уменьшение значений позиции депо Участника клиринга в Клиринговой системе / уменьшения Единого лимита Участника клиринга по Расчетному коду, предусмотренного пунктом 21.7 Правил клиринга, Клиринговый центр направляет в Депозитарий Распоряжение на неразблокировку ценных бумаг, зарезервированных на Разделе (реквизиты которого предусмотрены пунктом 3.2 приложения № 3 к Правилам клиринга).

21.10. После получения от Клирингового центра распоряжения в соответствии с пунктом 21.8 Правил клиринга Депозитарий осуществляет разблокировку ценных бумаг на соответствующем Разделе в количестве, указанном в поступившем от Клирингового центра распоряжении. После получения от Клирингового центра распоряжения в соответствии с пунктом 21.9 Правил клиринга Депозитарий не осуществляет разблокировку ценных бумаг на соответствующем Разделе.

## **Статья 22. Порядок взаимодействия с Биржей при подаче заявок и заключении сделок**

22.1. При подаче Участником клиринга заявки Биржа с использованием Системы торгов направляет Клиринговому центру информацию о поданной заявке (реквизиты которой предусмотрены пунктом 4.2 приложения № 4 к Правилам клиринга).

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

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

- 1) активного состояния<sup>2</sup> в Клиринговой системе Торгово-клирингового счета, указанного в заявке;
- 2) для заявок на заключение сделок с кодом расчетов Yn, если значение цены, указанной в заявке, больше либо равно Нижней границе ценового коридора и меньше либо равно Верхней границе ценового коридора, установленных Клиринговым центром для ценной бумаги, по которой подана заявка;
- 3) для заявок на заключение сделок РЕПО с кодом расчетов T0/Yn, Y0/Yn, если значение ставки РЕПО, указанной в заявке, больше либо равно Нижней границе коридора ставок РЕПО и меньше либо равно Верхней границе коридора ставок РЕПО, установленных Клиринговым центром для ценной бумаги, по которой подана заявка;
- 4) прохождения заявкой Процедуры контроля обеспечения в соответствии со статьей 27 Правил клиринга, за исключением заявок на заключение сделок с кодом расчетов K0.

22.3. При выполнении условий, указанных в пункте 22.2 настоящей статьи, Клиринговый центр с использованием Системы торгов направляет Бирже Отчет о возможности регистрации заявки, при невыполнении хотя бы одного из условий, указанных в пункте 22.2 настоящей статьи, - Отчет о невозможности регистрации заявки (реквизиты указанных отчетов предусмотрены пунктом 4.2 приложения № 3 к Правилам клиринга).

22.4. При снятии в Системе торгов заявки с любым кодом расчетов, за исключением кода расчетов K0, Биржа с использованием Системы торгов направляет

---

<sup>2</sup> Активное состояние торгово-клирингового счета в Системе клиринга определяется в соответствии с Регламентом клиринга («А» - торгово-клиринговый счет, по которому проводятся операции).

Клиринговому центру Уведомление о снятии заявки (реквизиты которого предусмотрены пунктом 4.2 приложения № 4 к Правилам клиринга).

22.4.1. После получения Уведомления о снятии заявки на заключение сделки с кодом расчетов  $Y_n$ ,  $T0/Y_n$ ,  $Y0/Y_n$ , поданной Участником клиринга, Клиринговый центр рассчитывает Единый лимит Участника клиринга по Расчетному коду, соответствующему Торговому счету, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в отозванной заявке, без учета отозванной заявки.

22.5. В случае регистрации в Системе торгов заявки, являющейся в соответствии с Правилами торговли допустимой встречной по отношению к ранее зарегистрированной в Системе торгов заявке на заключение сделок с Клиринговым центром, Клиринговый центр с использованием Системы торгов направляет Участникам клиринга, подавшим допустимые встречные заявки (за исключением заявок на заключение сделок с кодом расчетов  $K0$ ), Подтверждения Клирингового центра (реквизиты которых предусмотрены пунктом 4.2 приложения № 3 к Правилам клиринга).

Цена и количество ценных бумаг в заключаемых сделках определяется в соответствии с Правилами торговли.

22.6. В целях создания условий для исполнения обязательств по сделкам Клиринговый центр вправе подавать в Систему торгов заявки от своего имени и за свой счет и/или формировать в Системе торгов Подтверждение Клирингового центра (реквизиты которого предусмотрены пунктом 4.2 приложения № 3 к Правилам клиринга) по зарегистрированной в Системе торгов заявке на продажу или заявке на покупку, поданной Участником клиринга, в отношении которой отсутствует зарегистрированная в Системе торгов допустимая встречная заявка.

22.7. Заключение сделок с кодом расчетов  $K0$  осуществляется Клиринговым центром только по заявкам, прошедшим Процедуру контроля обеспечения, путем направления Участникам клиринга, подавшим заявки на заключение сделок с кодом расчетов  $K0$ , являющиеся допустимыми встречными заявками и прошедшими Процедуру контроля обеспечения, Подтверждений Клирингового центра.

Процедура контроля обеспечения по заявкам на заключение сделок с кодом расчетов  $K0$  осуществляется на основании Запроса о возможности заключения сделок, полученного от Биржи (реквизиты которого предусмотрены пунктом 4.2 приложения № 4 к Правилам клиринга), немедленно после его получения.

22.8. При регистрации на Бирже биржевой сделки с кодом расчетов  $T0$ ,  $B0$ ,  $S0$ ,  $Rb$ ,  $K0$ ,  $Y_n$ ,  $T0/Y_n$ ,  $Y0/Y_n$  Биржа с использованием Системы торгов направляет Клиринговому центру Уведомление о заключении сделки (реквизиты которого предусмотрены пунктом 4.2 приложения № 4 к Правилам клиринга).

22.8.1. После получения Уведомления о заключении сделки с кодом расчетов  $Y_n$ ,  $T0/Y_n$ ,  $Y0/Y_n$ , Клиринговый центр:

- рассчитывает соответствующий Единый лимит Участника клиринга без учета заявки (части заявки), на основании которой была заключена указанная сделка, и с учетом указанной заключенной сделки;
- изменяет с учетом заключенной сделки Нетто-обязательство и/или Нетто-

требование Участника клиринга по Сделкам с частичным обеспечением в российских рублях и ценных бумагах с Датами исполнения, соответствующими Дате (Датам) исполнения обязательств по заключенной сделке, по Расчетному коду, соответствующему Торговому счету, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в заявке, на основании которой заключена сделка (для денежных средств), и/или по Разделу для учета ценных бумаг в Обеспечении, соответствующему Разделу для исполнения обязательств по сделкам клирингового пула, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в заявке, на основании которой заключена сделка (для ценных бумаг).

- 22.9. При регистрации на Бирже биржевой сделки (первой части сделки РЕПО) с кодом расчетов Z0 Биржа формирует и передает Клиринговому центру Выписку из реестра сделок (реквизиты которой предусмотрены пунктом 4.2 приложения № 4 к Правилам клиринга).

После получения от Биржи указанной Выписки из реестра сделок в Клиринговой системе определяются обязательства/требования Участников клиринга по оплате и передаче ценных бумаг, подлежащие включению в клиринговый пул для расчетов в ходе торгов, порядок проведения которых определен в статье 35 Правил клиринга.

### **Статья 23. Порядок взаимодействия с Биржей при регистрации Сводного реестра сделок с ценными бумагами и Сводного реестра компенсационных взносов**

- 23.1. После окончания торгов (в период времени, установленный Временным регламентом) в каждый торговый день Биржа формирует и передает Клиринговому центру Сводный реестр сделок с ценными бумагами (реквизиты которого предусмотрены пунктом 4.2 приложения № 4 к Правилам клиринга), в который включена информация обо всех биржевых сделках, заключенных на Бирже в течение торгов в данный торговый день и условиями которых предусмотрено осуществление клиринга Клиринговым центром, и/или о сделках, расчетные параметры которых были изменены. В случае отсутствия таких сделок Биржа не передает Клиринговому центру Сводный реестр сделок с ценными бумагами.

- 23.1.1. При получении от Биржи Сводного реестра сделок с ценными бумагами в Клиринговой системе проводится сверка данных Сводного реестра сделок с данными уже поступивших от Биржи Уведомлений о заключении сделки (по биржевым сделкам с кодами расчетов T0, B0, S0, Rb, K0, Yn, T0/Yn, Y0/Yn) и Выписок из реестра сделок (по биржевым сделкам (первым частям сделок РЕПО) с кодами расчетов Z0).

- 23.1.2. В случае если параметры и номера биржевых сделок, содержащиеся в Сводном реестре сделок с ценными бумагами, за исключением биржевых сделок с кодами расчетов B01-B30, S1 и S2, полностью совпадают с параметрами и номерами биржевых сделок, содержащимися в Уведомлениях о заключении сделки (по биржевым сделкам с кодами расчетов T0, B0, S0, Rb, K0, Yn, T0/Yn, Y0/Yn), а также в Выписках из реестра сделок (по биржевым сделкам (первым частям биржевых сделок РЕПО) с кодами расчетов Z0), Клиринговый центр регистрирует Сводный реестр сделок с ценными бумагами. В случае обнаружения несоответствий в полученных от Биржи документах Клиринговый центр информирует Биржу об отказе в регистрации Сводного реестра сделок с ценными

бумагами путем передачи соответствующего Уведомления (реквизиты которого предусмотрены пунктом 4.2 приложения № 3 к Правилам клиринга) и не проводит в Клиринговой системе никаких операций в связи с получением данного документа.

- 23.2. После окончания торгов на Бирже в дату, предшествующую дате внесения компенсационных взносов (в период времени, установленный Временным регламентом), Биржа формирует и передает Клиринговому центру Сводный реестр компенсационных взносов (реквизиты которого предусмотрены пунктом 4.2 приложения № 4 к Правилам клиринга). Сводный реестр компенсационных взносов содержит информацию о подлежащих исполнению Участниками клиринга обязательствах по внесению компенсационных взносов. В случае отсутствия указанных обязательств Участников клиринга по внесению компенсационных взносов Биржа не передает Клиринговому центру Сводный реестр компенсационных взносов.
- 23.2.1. Клиринговый центр регистрирует Сводный реестр компенсационных взносов и в соответствии с содержащейся в нем информацией определяет в Клиринговой системе обязательства и требования Участников клиринга по внесению компенсационных взносов.
- 23.2.2. В дату внесения компенсационных взносов в период времени, установленный Временным регламентом, Клиринговый центр формирует и передает Бирже Сводную ведомость об исполнении обязательств по внесению компенсационных взносов (реквизиты которой предусмотрены пунктом 4.2 приложения № 3 к Правилам клиринга). Сводная ведомость об исполнении обязательств по внесению компенсационных взносов содержит информацию о результатах исполнения Участниками клиринга обязательств по внесению компенсационных взносов.

## **V. ПОРЯДОК ОСУЩЕСТВЛЕНИЯ КЛИРИНГА**

### **Статья 24. Порядок внесения и возврата Обеспечения**

- 24.1. Внесение Обеспечения в российских рублях Участником клиринга возможно двумя способами:
- 1) путем перечисления денежных средств на счет Клирингового центра, открытый в Расчетной организации;
  - 2) путем подачи Участником клиринга с использованием Клиринговой системы распоряжения на внесение денежных средств в Обеспечение.
- 24.2. Внесение Обеспечения в ценных бумагах возможно двумя способами:
- 1) путем подачи в Расчетный депозитарий поручения на перечисление ценных бумаг на Раздел для учета ценных бумаг в Обеспечении;
  - 2) путем подачи с использованием Клиринговой системы распоряжения на внесение ценных бумаг в Обеспечение.
- 24.3. В качестве Обеспечения могут быть внесены ценные бумаги, включенные в Клиринговый лист для Сделок с частичным обеспечением, и иные ценные бумаги.
- Перечень иных ценных бумаг, внесение которых в Обеспечение возможно, устанавливается решением Клирингового центра.
- 24.4. Перечисление денежных средств на счет Клирингового центра, открытый в Расчетной организации, с целью их учета в качестве Обеспечения должно осуществляться с обязательным указанием в назначении платежа соответствующего Расчетного кода Участника клиринга.
- 24.4.1. Клиринговый центр учитывает в Клиринговой системе денежные средства, перечисленные Участником клиринга на счет Клирингового центра, открытый в Расчетной организации, в качестве Обеспечения Участника клиринга и увеличивает Единый лимит Участника клиринга по Расчетному коду, указанному в назначении платежа, с учетом перечисленной суммы денежных средств.
- 24.5. Распоряжение на внесение денежных средств / ценных бумаг в Обеспечение, подаваемое Участником клиринга с использованием Клиринговой системы, содержит указание на Торгово-клиринговый счет, по которому должна быть исполнена данная операция, и сумму денежных средств / количество ценных бумаг, которые необходимо внести в Обеспечение.
- 24.5.1. Распоряжение на внесение денежных средств в Обеспечение, поданное Участником клиринга, исполняется в Клиринговой системе в случае достаточности планового значения позиции по денежным средствам по Счету, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в распоряжении.
- 24.5.2. Распоряжение на внесение ценных бумаг в Обеспечение, поданное Участником клиринга, исполняется в Клиринговой системе в случае достаточности планового значения позиции по ценным бумагам по Разделу для исполнения обязательств по сделкам клирингового пула, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в распоряжении.

- 24.5.3. Частичное исполнение распоряжения на внесение денежных средств / ценных бумаг в Обеспечение невозможно.
- 24.5.4. Увеличение суммы денежных средств / количества ценных бумаг, учитываемых в качестве Обеспечения по Расчетному коду Участника клиринга / Разделу для учета ценных бумаг в Обеспечении, осуществляется сразу после исполнения распоряжения на внесение денежных средств / ценных бумаг в Обеспечение в Клиринговой системе.
- 24.5.5. Обязательства по перечислению денежных средств со Счетов на счет Клирингового центра и/или по перечислению ценных бумаг с Разделов для исполнения обязательств по сделкам клирингового пула на Разделы для учета ценных бумаг в Обеспечении, соответствующие исполненным в Клиринговой системе распоряжениям на внесение денежных средств / ценных бумаг в Обеспечение включаются в клиринговый пул для расчетов по итогам торгов и учитываются при определении нетто-обязательств / нетто-требований Участников клиринга по денежным средствам / ценным бумагам в соответствии со статьей 38 Правил клиринга.
- 24.6. Денежные средства и ценные бумаги, учитываемые в качестве Обеспечения Участника клиринга, используются для расчета Единого лимита, обеспечения исполнения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением по Расчетному коду, по которому учитывается указанное Обеспечение в денежных средствах / по Расчетному коду, к которому относятся Разделы для учета ценных бумаг в Обеспечении, по которым учитывается указанное Обеспечение в ценных бумагах.
- 24.7. Участник клиринга может перевести денежные средства, учитываемые в качестве Обеспечения, между своими Расчетными кодами, подав в Клиринговый центр Заявление о переводе денежных средств в электронном виде с использованием Клиринговой системы или в форме электронного документа (реквизиты заявления предусмотрены пунктом 1.7 приложения № 4 к Правилам клиринга).
- Данное заявление не принимается Клиринговым центром к исполнению, если сумма денежных средств в российских рублях, указанная Участником клиринга в заявлении, превышает сумму денежных средств, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга по Расчетному коду, с которого денежные средства должны быть списаны, или если Единый лимит Участника клиринга по Расчетному коду, с которого денежные средства, учитываемые в качестве Обеспечения Участника клиринга, должны быть списаны, в результате такого списания станет отрицательным, или отрицательный Единый лимит Участника клиринга по такому Расчетному коду в результате такого списания уменьшится.
- При исполнении Заявления о переводе денежных средств, сумма денежных средств Участника клиринга в соответствующей валюте, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга по Расчетному коду, с которого списываются денежные средства, уменьшается, а по Расчетному коду, на который зачисляются денежные средства, - увеличивается на сумму переводимых денежных средств.
- 24.8. Обеспечение Участника клиринга в российских рублях используется в следующей очередности:
- 1) для погашения Задолженности Участника клиринга перед Клиринговым центром;
  - 2) для погашения Задолженности по гарантийным переводам Участника



- клиринга перед Клиринговым центром;
- 3) для обеспечения исполнения обязательств Участника клиринга по Сделкам с частичным обеспечением;
  - 4) для исполнения обязательств Участника клиринга в российских рублях по Сделкам с частичным обеспечением с наступившей Датой исполнения;
  - 5) для исполнения обязательства Участника клиринга по возврату Гарантийных переводов.
- 24.9. Обеспечение Участника клиринга в ценных бумагах используется в следующей очередности:
- 6) для обеспечения исполнения обязательств Участника клиринга по Сделкам с частичным обеспечением;
  - 7) для исполнения обязательств Участника клиринга по передаче ценных бумаг по Сделкам с частичным обеспечением с наступившей Датой исполнения.
- 24.10. После перечисления Участником клиринга денежных средств на счет Клирингового центра, открытый в Расчетной организации, и учета их в качестве Обеспечения Участника клиринга, у Клирингового центра возникает обязательство вернуть денежные средства Участнику клиринга в размере, определяемом в соответствии с пунктами 24.12, 24.13 Правил клиринга.
- 24.11. Возврат Клиринговым центром Участнику клиринга денежных средств и ценных бумаг, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга, осуществляется после прекращения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением в соответствии со статьей 35 Правил клиринга, или на основании Запроса о возврате денежных средств / ценных бумаг из Обеспечения.
- Возврат ценных бумаг из Обеспечения также возможен путем подачи в Расчетный депозитарий поручения на списание ценных бумаг с Раздела для учета ценных бумаг в Обеспечении. Исполнение указанного поручения будет осуществляться в порядке, установленном статьей 21 Правил клиринга.
- 24.11.1. Денежные средства, учитываемые в качестве Обеспечения по Расчетному коду Участника клиринга, возвращаются на Счет, соответствующий Расчетному коду Участника клиринга, или на счет, предварительно зарегистрированный в Клиринговом центре (далее – Счет для возврата денежных средств).
- Регистрация Счета для возврата денежных средств осуществляется на основании заявления, предоставляемого Участником клиринга в Клиринговый центр в форме электронного документа (реквизиты которого предусмотрены пунктом 1.8 приложения № 4 к Правилам клиринга).
- В случае если владельцем Счета для возврата денежных средств является Клиент Участника клиринга, Участник клиринга обязан предоставить Клиринговому центру письмо по форме, установленной пунктом 1.14 приложения № 6 к Правилам клиринга.
- 24.11.2. Ценные бумаги, учитываемые в качестве Обеспечения по Разделу для учета ценных бумаг в Обеспечении, относящемуся к Расчетному коду, возвращаются на Раздел для исполнения обязательств по сделкам клирингового пула, соответствующий Разделу для учета ценных бумаг в Обеспечении.

24.11.3. Запрос о возврате денежных средств из Обеспечения содержит указание на Расчетный код Участника клиринга и сумму денежных средств, которые необходимо вернуть.

Запрос о возврате ценных бумаг из Обеспечения содержит указание на Раздел для учета ценных бумаг в Обеспечении и количество ценных бумаг, которые необходимо вернуть.

Запрос о возврате денежных средств из Обеспечения направляется Участником клиринга в электронном виде с использованием Клиринговой системы или в форме электронного документа (реквизиты которого предусмотрены пунктом 1.9 приложения № 4 к Правилам клиринга). В случае если между Участником клиринга и Клиринговым центром предусмотрен обмен сообщениями по системе S.W.I.F.T., Участник клиринга вправе направить Запрос о возврате денежных средств из Обеспечения в форме сообщения по системе S.W.I.F.T.

Запрос о возврате ценных бумаг из Обеспечения направляется Участником клиринга в электронном виде с использованием Клиринговой системы (реквизиты запроса предусмотрены пунктом 1.9 приложения № 4 к Правилам клиринга).

Сроки предоставления Запросов о возврате денежных средств / ценных бумаг из Обеспечения установлены Временным регламентом.

При предоставлении Запроса о возврате денежных средств / ценных бумаг из Обеспечения позднее времени, указанного во Временном регламенте, Запрос о возврате денежных средств / ценных бумаг из Обеспечения не исполняется.

Запрос о возврате денежных средств / ценных бумаг из Обеспечения действует в день его предоставления.

Запрос о возврате денежных средств / ценных бумаг из Обеспечения, полученный в сроки, установленные Временным регламентом, исполняется после его получения при соблюдении условия, указанного в пункте 24.12 Правил клиринга.

24.12. Возврат Клиринговым центром Участнику клиринга денежных средств / ценных бумаг в соответствии с Запросом о возврате денежных средств / ценных бумаг из Обеспечения исполняется в Клиринговой системе в случае, если Единый лимит по Расчетному коду Участника клиринга, указанному в запросе, или Единый лимит по Расчетному коду, к которому относится Раздел для учета ценных бумаг в Обеспечении, указанный в запросе, рассчитанный без учета возвращаемой суммы денежных средств / количества ценных бумаг соответственно, не станет отрицательным.

24.13. Возврат Клиринговым центром Участнику клиринга денежных средств / ценных бумаг после прекращения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением в соответствии со статьей 35 Правил клиринга исполняется в Клиринговой системе в сумме / количестве, без учета которого Единый лимит по Расчетному коду Участника клиринга не станет отрицательным.

24.14. Обеспечение Участника клиринга по Расчетному коду / Разделу для учета ценных бумаг в Обеспечении уменьшается, а плановые значения позиций по денежным средствам / ценным бумагам по Счету / Разделу для исполнения обязательств по сделкам клирингового пула увеличиваются на возвращаемую сумму денежных средств / количество ценных бумаг сразу после исполнения Запроса о возврате денежных средств / ценных бумаг из Обеспечения в Клиринговой системе.

- 24.14.1. Обязательства по перечислению денежных средств со счета Клирингового центра на Счета, соответствующие Расчетным кодам Участника клиринга, и/или по перечислению ценных бумаг с Разделов для учета ценных бумаг в Обеспечении, относящихся к Расчетному коду Участника клиринга, на Раздел для исполнения обязательств по сделкам клирингового пула, соответствующий Разделу для учета ценных бумаг в Обеспечении, соответствующие исполненным в Клиринговой системе Запросам о возврате денежных средств / ценных бумаг из Обеспечения, включаются в клиринговый пул для расчетов по итогам торгов и учитываются при определении нетто-обязательств / нетто-требований Участников клиринга по денежным средствам / ценным бумагам в соответствии со статьей 38 Правил клиринга.
- 24.15. Клиринговый центр вправе осуществить в любое время зачет денежных требований Участника клиринга по возврату ему денежных средств, учитываемых в качестве Обеспечения, с денежными требованиями Клирингового центра к этому Участнику клиринга.
- 24.16. Информация об операциях с Обеспечением Участника клиринга передается Участнику клиринга в составе Отчета об обеспечении, реквизиты которого предусмотрены пунктом 1.12 приложения № 3 к Правилам клиринга.  
Отчет об обеспечении, содержащий информацию об операциях с Обеспечением, выполненных в течение предыдущего Расчетного дня, направляется Участнику клиринга в форме электронного документа в срок, установленный Временным регламентом.
- 24.17. Клиринговый центр осуществляет ежегодную сверку остатков Обеспечения Участника клиринга в российских рублях путем направления соответствующего уведомления Участнику клиринга не позднее десятого рабочего дня года, следующего за отчетным годом.  
Если в течение десяти рабочих дней после направления Участнику клиринга указанного уведомления, Участник клиринга не уведомит Клиринговый центр о наличии расхождений, остатки Обеспечения Участника клиринга в российских рублях считаются подтвержденными.

## **Статья 25. Порядок внесения и возврата взноса в Коллективный фонд**

- 25.1. Для учета денежных средств в качестве взноса в Коллективный фонд Участник клиринга обязан перечислить денежные средства в российских рублях в сумме, не меньшей установленного Клиринговым центром размера взноса в Коллективный фонд, на счет Клирингового центра, открытый в Расчетной организации, с обязательным указанием в назначении платежа слова «фонд» и после него без пробелов Расчетного кода Участника клиринга.

Пример назначения платежа: «Перечисление в фондXXXXX», где XXXXX – Расчетный код.

В случае внесения в Коллективный фонд денежных средств в сумме, превышающей установленный Клиринговым центром размер взноса в Коллективный фонд, в качестве взноса в Коллективный фонд данного Участника клиринга учитываются денежные средства в сумме, равной установленному Клиринговым центром размеру взноса в Коллективный фонд.

Денежные средства Участника клиринга, перечисленные на счет Клирингового центра, предназначенный для учета средств Коллективного фонда, в сумме, превышающей установленный Клиринговым центром размер взноса в Коллективный фонд, возвращаются Клиринговым центром Участнику клиринга по письменному требованию Участника клиринга.

- 25.2. После перечисления Участником клиринга денежных средств на счет Клирингового центра, открытый в Расчетной организации, и учета их в качестве взноса Участника клиринга в Коллективный фонд, у Клирингового центра возникает обязательство вернуть Участнику клиринга денежные средства в размере взноса Участника клиринга в Коллективный фонд.
- 25.3. Возврат Участнику клиринга его взноса в Коллективный фонд осуществляется при прекращении Договора об оказании клиринговых услуг в соответствии с пунктом 3.11 Правил клиринга.
- 25.4. Участник клиринга вправе предоставить Клиринговому центру Заявление о возврате взноса в Коллективный фонд по форме, предусмотренной пунктом 1.13 приложения № 6 к Правилам клиринга.
- При получении от Участника клиринга Заявления о возврате взноса в Коллективный фонд Клиринговый центр незамедлительно информирует об этом Биржу с целью прекращения допуска Участника клиринга к заключению Сделок с частичным обеспечением.
- Заявление Участника клиринга о возврате взноса в Коллективный фонд исполняется Клиринговым центром в случае отсутствия у Участника клиринга Задолженности и/или неисполненных обязательств по Сделкам с частичным обеспечением не позднее Расчетного дня, следующего за датой получения указанного заявления.

## **Статья 26. Единый лимит и риск-параметры**

- 26.1. Единый лимит рассчитывается Клиринговым центром при изменении размера Обеспечения Участника клиринга, при подаче Участником клиринга заявок, заключении им Сделок с частичным обеспечением, исполнении / прекращении обязательств по Сделкам с частичным обеспечением, изменении риск-параметров.
- 26.2. Единый лимит Участника клиринга используется для проверки возможности подачи Участником клиринга заявок, исполнения / прекращения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением, возврата Участнику клиринга Обеспечения, а также выполнения иных операций, предусмотренных Правилами клиринга. Указанная проверка осуществляется, исходя из анализа изменения значения Единого лимита Участника клиринга до и после проведения операции.
- 26.3. Единый лимит Участника клиринга по Расчетному коду рассчитывается с учетом:
- Обеспечения Участника клиринга в российских рублях, учитываемого по Расчетному коду;
  - Обеспечения Участника клиринга в ценных бумагах, учитываемого по всем Разделам для учета ценных бумаг в Обеспечении, относящимся к Расчетному коду;

- Нетто-обязательств / Нетто-требований Участника клиринга по Сделкам с частичным обеспечением в российских рублях и ценных бумагах, учитываемых по Расчетному коду / всем Разделам для учета ценных бумаг в Обеспечении, относящимся к Расчетному коду, по всем Датам исполнения;
  - Задолженности Участника клиринга перед Клиринговым центром в российских рублях, учитываемой по Расчетному коду;
  - Задолженности по гарантийным переводам Участника клиринга перед Клиринговым центром в российских рублях, учитываемой по Расчетному коду;
  - корректировки Единого лимита с учетом Индикативных ставок РЕПО.
- 26.4. Единый лимит Участника клиринга в ходе торгов рассчитывается Клиринговым центром с учетом зарегистрированных в Системе торгов заявок на заключение Сделок с частичным обеспечением, поданных Участником клиринга.
- 26.5. Базовыми риск-параметрами, используемыми Клиринговым центром для контроля и управления рисками, являются:
- Расчетная цена;
  - Верхняя и Нижняя границы ценового коридора;
  - Верхняя и Нижняя границы диапазона оценки рыночных рисков;
  - дисконт;
  - Расчетная ставка РЕПО;
  - Верхняя и Нижняя границы коридора ставок РЕПО;
  - Верхняя и Нижняя граница диапазона оценки процентных рисков.
- Помимо базовых риск-параметров Клиринговым центром используются дополнительные риск-параметры, приведенные в Методике определения риск-параметров рынка ценных бумаг.
- 26.6. Расчет и изменение риск-параметров осуществляется Клиринговым центром по состоянию на 19:00 по московскому времени.
- Клиринговый центр может принять решение об изменении риск-параметров до начала и в ходе торгов.
- Изменения риск-параметров в ходе торгов, проводимых после 19:00 по московскому времени, не производится.
- Порядок расчета и изменения риск-параметров установлен Методикой определения риск-параметров рынка ценных бумаг.
- 26.7. Единый лимит Участника клиринга рассчитывается Клиринговым центром исходя из оценки в российских рублях максимально возможного уменьшения в течение срока, необходимого для прекращения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением по основаниям, установленным подпунктом 36.1.2 Правил клиринга, общей стоимости:
- Обеспечения Участника клиринга в российских рублях и ценных бумагах;
  - Задолженности Участника клиринга перед Клиринговым центром в российских рублях;
  - Задолженности по гарантийным переводам Участника клиринга перед

Клиринговым центром в российских рублях;

- Нетто-обязательств / Нетто-требований Участника клиринга по Сделкам с частичным обеспечением в российских рублях и ценных бумагах по всем Датам исполнения;
- обязательств и требований по Сделкам с частичным обеспечением, которые могут быть заключены на основании зарегистрированных в Системе торгов заявок, направленных на заключение Сделок с частичным обеспечением, в связи с изменением Расчетных цен ценных бумаг, являющихся предметом Сделок с частичным обеспечением, и/или изменением процентных ставок по сделкам РЕПО.

При расчете Единого лимита Участника клиринга обязательства по Сделкам с частичным обеспечением, которые могут быть заключены на основании зарегистрированных в Системе торгов заявок, Нетто-обязательства Участника клиринга по Сделкам с частичным обеспечением в российских рублях и ценных бумагах и задолженности учитываются со знаком «минус», требования по Сделкам с частичным обеспечением, которые могут быть заключены на основании зарегистрированных в Системе торгов заявок, Нетто-требования Участника клиринга по Сделкам с частичным обеспечением в российских рублях и ценных бумагах и Обеспечение Участника клиринга в российских рублях и ценных бумагах – со знаком «плюс».

Для целей расчета Единого лимита Участника клиринга Нетто-обязательства и Нетто-требования Участника клиринга по Сделкам с частичным обеспечением в российских рублях или по ценной бумаге с одним кодом с разными Датами исполнения складываются с учетом знака.

Указанная оценка проводится с использованием Верхней и Нижней границ диапазона оценки рыночных и процентных рисков.

Рассчитанный в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга Единый лимит корректируется (складывается с учетом знака) с итоговой корректировкой Единого лимита с учетом Расчетных ставок РЕПО, рассчитанной как сумма с учетом знака корректировок Единого лимита с учетом Расчетных ставок РЕПО по каждой Дате исполнения, кроме текущей.

- 26.8. Верхняя и Нижняя границы диапазона оценки рыночных и процентных рисков, используемые при расчете Единого лимита Участника клиринга, зависят от объема обязательств Участника клиринга по Сделкам с частичным обеспечением.

## **Статья 27. Порядок проведения клиринговых сессий**

- 27.1. До начала торгов в установленное Временным регламентом время Клиринговый центр проводит клиринговую сессию, в ходе которой Клиринговый центр:

- устанавливает риск-параметры в соответствии с Методикой определения риск-параметров рынка ценных бумаг;
- для каждого Участника клиринга по каждому Расчетному коду рассчитывает и устанавливает новые значения Единых лимитов Участника клиринга;
- определяет обязательства Участников клиринга и Клирингового центра по уплате Гарантийных переводов;
- формирует и передает каждому Участнику клиринга, имеющему

обязательства по Сделкам, Дата исполнения которых не наступила, Отчет об Обеспечении, реквизиты которого предусмотрены пунктом 1.12 приложения № 3 к Правилам клиринга;

- формирует и передает Участникам клиринга, у которых возникли Задолженность и/или Задолженность по гарантийным переводам, Отчет «Требование о погашении задолженности» (реквизиты которого предусмотрены пунктом 1.13 приложения № 3 к Правилам клиринга);
- определяет Участников клиринга, у которых возникли Маржинальные требования и суммы указанных Маржинальных требований: Маржинальное требование возникает у Участника клиринга, Единый лимит которого стал отрицательным; сумма Маржинального требования равна абсолютному значению текущего Единого лимита Участника клиринга;
- формирует и передает Участникам клиринга, у которых возникли Маржинальные требования, Отчет о Маржинальном требовании, содержащий информацию о его сумме (реквизиты которого предусмотрены пунктом 1.14 приложения № 3 к Правилам клиринга).

27.2. Клиринговый центр с использованием Системы торгов передает Бирже информацию об установленных риск-параметрах.

27.3. Размер обязательства Участника клиринга и Клирингового центра по уплате Гарантийного перевода по Расчетному коду рассчитывается по обязательствам по Сделкам с частичным обеспечением, Дата исполнения которых не наступила, по формуле:

$$\text{COM\_RUB} = \sum_i (\sum_j \text{OBL}_{ij} \times (\text{Rc}_j + \text{RepoRate}_{ij}) + \text{OBL\_RUB}_i) + \text{RET\_RUB}, \text{ где}$$

COM\_RUB – размер обязательства по уплате Гарантийного перевода, рассчитанный в ходе текущей клиринговой сессии;

OBL<sub>ij</sub> – Нетто-обязательства / Нетто-требования Участника клиринга (с учетом знака) по j-м ценным бумагам по Сделкам с частичным обеспечением с i-ой Датой исполнения, учитываемые по Разделам для учета ценных бумаг в Обеспечении, относящимся к Расчетному коду;

OBL\_RUB<sub>i</sub> - Нетто-обязательство / Нетто-требование Участника клиринга (с учетом знака) в российских рублях по Сделкам с частичным обеспечением с i-ой Датой исполнения, учитываемое по Расчетному коду;

Rc<sub>j</sub> – Расчетная цена j-ой ценной бумаги, рассчитанная в предыдущий Расчетный день (в российских рублях);

RepoRate<sub>ij</sub> - Расчетная ставка РЕПО, установленная в предыдущий Расчетный день для i-ой Даты исполнения и j-ой ценной бумаги (в российских рублях);

RET\_RUB – размер непрекращенного обязательства по возврату Гарантийных переводов (с учетом знака), рассчитанный в предыдущий Расчетный день по Расчетному коду;

$\sum_i$  – сумма по Датам исполнения;

$\sum_j$  - сумма по ценным бумагам.

Если значение COM\_RUB отрицательное, это означает наличие обязанности Участника клиринга по уплате Гарантийного перевода по Расчетному коду Клиринговому центру в размере, равном абсолютному значению COM\_RUB, если положительное – наличие требования Участника клиринга к Клиринговому центру

по получению Гарантийного перевода по Расчетному коду в размере, равном значению COM\_RUB.

Информация о размере обязательства Участника клиринга по уплате Гарантийного перевода по Расчетному коду указывается в Отчете об обязательствах по Сделкам с частичным обеспечением.

- 27.4. Размер обязательства Участника клиринга и Клирингового центра по возврату Гарантийных переводов по Расчетному коду рассчитывается по формуле:

$RET\_RUB_{new} = RET\_RUB - COM\_RUB$ , где

RET\_RUB<sub>new</sub> – размер обязательства по возврату Гарантийных переводов по Расчетному коду (с учетом знака);

RET\_RUB – размер непрекращенного обязательства по возврату Гарантийных переводов по Расчетному коду (с учетом знака), рассчитанный в предыдущий Расчетный день;

COM\_RUB – размер обязательства (с учетом знака) по уплате Гарантийного перевода по Расчетному коду, рассчитанный в ходе текущей клиринговой сессии.

Если значение RET\_RUB<sub>new</sub> отрицательное, это означает наличие обязанности Участника клиринга по возврату Клиринговому центру Гарантийных переводов по Расчетному коду в размере, равном абсолютному значению RET\_RUB<sub>new</sub>, если положительное – наличие обязанности Клирингового центра по возврату Участнику клиринга Гарантийных переводов по Расчетному коду в размере, равном значению RET\_RUB<sub>new</sub>.

- 27.5. Если размер обязательства Участника клиринга по уплате Гарантийных переводов по Расчетному коду, определенный в ходе клиринговой сессии, отрицательный, на его абсолютное значение уменьшается размер Обеспечения Участника клиринга в российских рублях, учитываемый по Расчетному коду, если положительный, на его значение увеличивается размер Обеспечения Участника клиринга в российских рублях, учитываемый по Расчетному коду.

- 27.6. Если Обеспечения Участника клиринга в российских рублях, учитываемого по Расчетному коду, недостаточно для исполнения обязательства Участника клиринга по уплате Гарантийных переводов по Расчетному коду в полном объеме, неисполненное обязательство (неисполненная часть обязательства) Участника клиринга по уплате Гарантийных переводов по Расчетному коду учитывается Клиринговым центром как Задолженность по гарантийным переводам Участника клиринга перед Клиринговым центром, учитываемая по Расчетному коду.

Указанная Задолженность по гарантийным переводам должна быть погашена Участником клиринга до установленного Временным регламентом времени текущего Рабочего дня.

Информация о наличии Задолженности по гарантийным переводам по Расчетному коду и ее размере передается Участнику клиринга в составе отчета «Требование о погашении Задолженности».

Отчет «Требование о погашении Задолженности» направляется Участнику клиринга в форме электронного документа в срок, установленный Временным регламентом.



- 27.7. Порядок действий Клирингового центра при неисполнении Участником клиринга Задолженности по гарантийным переводам в срок, установленный в пункте 27.6 Правил клиринга, определен в статье 36 Правил клиринга.
- 27.8. Проценты на сумму уплаченных и/или полученных Гарантийных переводов не начисляются и не уплачиваются.
- 27.9. Маржинальное требование, возникшее у Участника клиринга по итогам клиринговой сессии, должно быть исполнено Участником клиринга не позднее установленного Временным регламентом времени текущего Расчетного дня.
- 27.10. Маржинальное требование должно быть исполнено Участником клиринга путем внесения денежных средств и/или ценных бумаг в Обеспечение в порядке, установленном статьей 24 Правил клиринга.  
Маржинальное требование может быть также прекращено полностью или в части в случаях:
- исполнения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением с наступившей Датой исполнения;
  - заключения Сделок с частичным обеспечением, приводящих к увеличению Единого лимита Участника клиринга;
- 27.11. Маржинальное требование по Расчетному коду, возникшее у Участника клиринга, считается прекращенным в момент времени, когда Единый лимит Участника клиринга по такому Расчетному коду станет неотрицательным.
- 27.12. В случае неисполнения Участником клиринга Маржинального требования по Расчетному коду в срок, установленный Временным регламентом, между Клиринговым центром и Участником клиринга, не исполнившим Маржинальное требование, без подачи заявок заключаются Сделки с частичным обеспечением, в том числе сделки РЕПО, приводящие к увеличению Единого лимита данного Участника клиринга по Расчетному коду.  
Указанные сделки заключаются до момента исполнения Маржинального требования Участника клиринга по Расчетному коду.  
Указанные сделки не заключаются в случае, если у Участника клиринга, не исполнившего Маржинальное требование, отозвана (аннулирована) лицензия Банка России на осуществление банковских операций или в случае, если в отношении такого Участника клиринга действуют иные обстоятельства, предусмотренные пунктом 9.13 Правил клиринга.  
Сделки с частичным обеспечением, заключенные в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга, учитываются при расчете Нетто-обязательств / Нетто-требований Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам по Сделкам с ценными бумагами с соответствующими Датами исполнения.

## **Статья 28. Процедура контроля обеспечения по биржевым сделкам с ценными бумагами, осуществляемая при подаче заявок или заключении сделок**

28.1. Процедура контроля обеспечения, осуществляемая при подаче заявок на заключение биржевых сделок с ценными бумагами, считается пройденной для сделки, которая будет заключена на основании такой заявки, в следующих случаях:

28.1.1. Для заявки на покупку ценных бумаг с кодом расчетов T0, Z0, Rb, T0/Yn в случае, если сумма денежных средств, которая может служить обеспечением для полного удовлетворения заявки (за исключением заявок, дата активации которых не наступила), включая уплату НКД и Комиссионного вознаграждения по сделке, не превышает планового значения соответствующей позиции по денежным средствам за вычетом соответствующих Ограничительных лимитов.

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

28.1.2. Для заявки на продажу ценных бумаг с кодом расчетов T0, Rb, T0/Yn в случае, если количество ценных бумаг, которые могут служить обеспечением для полного удовлетворения заявки (за исключением заявок, дата активации которых не наступила), не превышает планового значения соответствующей позиции депо, а также (в отношении заявок на заключение сделок в иностранной валюте) в случае если сумма денежных средств, которая может служить обеспечением для уплаты Комиссионного вознаграждения по сделке, не превышает планового значения соответствующей позиции по денежным средствам за вычетом соответствующих Ограничительных лимитов.

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

28.1.3. Для заявки на продажу ценных бумаг с кодом расчетов Z0 в случае, если количество ценных бумаг, которые могут служить обеспечением для полного удовлетворения заявки, не превышает контрольного и планового значения соответствующей позиции депо, а также (в отношении заявок на заключение сделок в иностранной валюте) в случае если сумма денежных средств, которая может служить обеспечением для уплаты Комиссионного вознаграждения по сделке, не превышает планового значения соответствующей позиции по денежным средствам за вычетом соответствующих Ограничительных лимитов.

28.1.4. Для заявки на покупку или на продажу с кодом расчетов B0-B30 или S0-S2 в случае, если сумма денежных средств, которая может служить обеспечением для уплаты Комиссионного вознаграждения по сделке, не превышает планового значения соответствующей позиции по денежным средствам за вычетом соответствующих Ограничительных лимитов.

28.1.5. Для заявки на покупку или на продажу с кодом расчетов Yn, T0/Yn, Y0/Yn в случае, если значение Единого лимита Участника клиринга по Расчетному коду, соответствующему Счету, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в заявке, с учетом поданной заявки не стало отрицательным, или, если Единый лимит Участника клиринга по такому Расчетному коду был отрицательным до момента подачи заявки, - проверку того, что Единый лимит Участника клиринга по такому Расчетному коду, рассчитанный с учетом поданной заявки, не стал меньше, чем Единый лимит Участника клиринга по этому Расчетному коду, рассчитанный до момента подачи заявки.

Для заявок на заключение сделок РЕПО с кодом расчетов Т0/Уп, проверка, указанная в настоящем подпункте Правил клиринга, осуществляется для второй части сделки РЕПО.

Если указанное значение Единого лимита с учетом поданной заявки – отрицательное, Клиринговый центр формирует в Клиринговой системе распоряжение на внесение денежных средств в Обеспечение на сумму абсолютного значения указанного Единого лимита, которое исполняется в порядке, определенном статьей 24 Правил клиринга

В случае предоставления Участником клиринга Клиринговому центру Заявления о неиспользовании денежных средств, учитываемых на торговых счетах, при подаче заявок на заключение Сделок с частичным обеспечением, указанное в настоящем подпункте Правил клиринга распоряжение на внесение денежных средств в Обеспечение Клиринговым центром не формируется.

Заявление о неиспользовании денежных средств, учитываемых на торговых счетах, при подаче заявок на заключение Сделок с частичным обеспечением, предоставляется Участником клиринга на бумажном носителе по форме, предусмотренной пунктом 1.18 приложения № 6 к Правилам клиринга, или в форме электронного документа.

Заявление о неиспользовании денежных средств, учитываемых на торговых счетах, при подаче заявок на заключение Сделок с частичным обеспечением, исполняется Клиринговым центром, начиная с Расчетного дня, следующего за датой предоставления указанного заявления.

Заявление о неиспользовании денежных средств, учитываемых на торговых счетах, при подаче заявок на заключение Сделок с частичным обеспечением, действует до его отмены Участником клиринга.

Отмена Заявления о неиспользовании денежных средств, учитываемых на торговых счетах, при подаче заявок на заключение Сделок с частичным обеспечением, осуществляется путем направления Участником клиринга Клиринговому центру документа на бумажном носителе в свободной форме или электронного документа.

- 28.2. В случае прохождения заявки на покупку или на продажу с кодом расчетов Уп, Т0/Уп, У0/Уп Процедуры контроля обеспечения, Клиринговый центр начинает учитывать значение Единого лимита Участника клиринга по Расчетному коду, соответствующему Счету, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в заявке, рассчитанное в соответствии с подпунктом 28.1.5 Правил клиринга, в качестве нового значения Единого лимита Участника клиринга, в случае непрохождения - Клиринговый центр не изменяет учитываемое по такому Расчетному коду значение Единого лимита Участника клиринга.
- 28.3. Процедура контроля обеспечения, осуществляемая при заключении биржевых сделок с ценными бумагами, считается пройденной в следующих случаях:
- 28.3.1. Для заявки на покупку с кодом расчетов К0 в случае если сумма денежных средств, которая может служить обеспечением для полного удовлетворения заявки, включая суммы, необходимые для уплаты НКД и Комиссионного вознаграждения по сделке, не превышает планового значения соответствующей позиции по денежным средствам за вычетом соответствующих Ограничительных лимитов.

Для заявки на продажу ценных бумаг с кодом расчётов К0 в случае если количество ценных бумаг, которые могут служить обеспечением для полного удовлетворения заявки, не превышает планового значения соответствующей позиции депо.

## **Статья 29. Порядок подачи и регистрации Поручений на клиринг по внебиржевым сделкам с ценными бумагами**

29.1. Для исполнения обязательств по внебиржевым сделкам Участники клиринга, являющиеся сторонами данных сделок, до Даты исполнения внебиржевых сделок в ходе периода регистрации поручений обязаны направить Клиринговому центру Поручение на клиринг внебиржевой сделки.

Поручение на клиринг внебиржевой сделки направляется с использованием Клиринговой системы в форме электронного сообщения, подписанного АСП, реквизиты указанного электронного сообщения предусмотрены пунктом 1.4 приложения № 4 к Правилам клиринга, или в форме документа на бумажном носителе по форме, предусмотренной пунктом 1.9 приложения № 6 к Правилам клиринга.

В Поручении на клиринг внебиржевой сделки могут содержаться данные по одной и более внебиржевым сделкам. При получении от Участника клиринга Поручения на клиринг внебиржевой сделки Клиринговый центр регистрирует его в Клиринговой системе за исключением случая, приведенного в абзаце четвертом настоящего пункта.

Клиринговый центр не регистрирует в Клиринговой системе Поручения на клиринг внебиржевой сделки до получения от Участника клиринга Заявления о ТКС для внебиржевых сделок (данное требование относится только к клирингу по внебиржевым сделкам прямого РЕПО с Банком России).

Поручение на клиринг внебиржевой сделки в форме документа на бумажном носителе оформляется как единый документ, подписанный уполномоченными лицами обоих Участников клиринга – сторон внебиржевой сделки.

29.2. В Клиринговой системе после регистрации Поручений на клиринг внебиржевой сделки, полученных от Участников клиринга – сторон внебиржевой сделки, проводится сверка данных, содержащихся в Поручении на клиринг внебиржевой сделки, полученном от каждого из них.

29.3. Клиринговый центр регистрирует данные по внебиржевой сделке в Клиринговой системе и учитывает обязательства и требования по ней на соответствующих клиринговых регистрах, если реквизиты внебиржевой сделки, содержащиеся в Поручениях на клиринг внебиржевой сделки Участников клиринга - контрагентов, совпадают.

29.4. Клиринговый центр не регистрирует данные по внебиржевой сделке в Клиринговой системе и не учитывает обязательства и требования по ней на соответствующих клиринговых регистрах:

- если реквизиты внебиржевой сделки, содержащиеся в Поручении на клиринг внебиржевой сделки одного Участника клиринга, не совпадают с реквизитами

внебиржевой сделки, содержащимися в Поручении на клиринг внебиржевой сделки Участника клиринга – его контрагента;

- если до окончания периода регистрации поручений Клиринговый центр получил Поручение на клиринг внебиржевой сделки только от одного Участника клиринга.

29.5. После регистрации данных по внебиржевой сделке в Клиринговой системе Участника клиринга обязаны совершить действия, необходимые для исполнения обязательств по ней, в порядке, предусмотренном статьей 30 Правил клиринга.

### **Статья 30. Порядок исполнения сделок и обязательств по внесению Гарантийных переводов**

30.1. Для целей обеспечения надлежащего исполнения обязательств, возникающих в результате заключения сделок с ценными бумагами, Участник клиринга обязан обеспечивать наличие денежных средств на Счетах в Расчетной организации и/или ценных бумаг на Разделах в Депозитарии, которые могут быть использованы при прохождении сделками с ценными бумагами Процедуры контроля обеспечения в порядке, определенном Правилами клиринга.

30.2. Участник клиринга, имеющий обязательство по сделке с ценными бумагами (первой или второй части сделки РЕПО), не прошедшей Процедуру контроля обеспечения до момента окончания периода получения Клиринговым центром от Участников клиринга Специальных и/или Срочных отчетов на исполнение (по сделкам с расчетами в российских рублях время указано в строке 2.2 таблицы 1 приложения № 2 к Правилам клиринга, по сделкам с расчетами в иностранной валюте - в строке 3.2 таблицы 1 приложения № 2 к Правилам клиринга) Даты ее исполнения, обязан до момента окончания периода регистрации поручений (по сделкам с расчетами в российских рублях время указано в строках 2.3, 2.5 таблицы 1 приложения № 2 к Правилам клиринга, по сделкам с расчетами в иностранной валюте - в строках 3.3, 3.5 таблицы 1 приложения № 2 к Правилам клиринга) в Дату исполнения данной сделки (первой или второй части сделки РЕПО) зарегистрировать по ней в Клиринговой системе Отчет на исполнение.

Порядок подачи и регистрации в Клиринговой системе Отчетов на исполнение определен в статье 31 Правил клиринга.

30.3. Участник клиринга, имеющий обязательство по внесению компенсационного взноса, обязан до момента окончания периода регистрации поручений (по сделкам за российские рубли время указано в строках 2.3, 2.5 таблицы 1 приложения № 2 к Правилам клиринга, по сделкам в иностранной валюте - в строках 3.3, 3.5 таблицы 1 приложения № 2 к Правилам клиринга) в Дату внесения компенсационного взноса зарегистрировать в Клиринговой системе Поручение на внесение данного компенсационного взноса, за исключением случая отказа контрагента от получения компенсационного взноса.

Порядок подачи и регистрации в Клиринговой системе поручений на внесение компенсационных взносов и поручений на отказ от компенсационных взносов определен в статье 32 Правил клиринга.

30.4. Для прохождения сделкой с ценными бумагами с кодом расчетов В0-В30, S0-S2, вторым частям сделок РЕПО с кодом расчетов Z0 или Rb и компенсационным взносам Процедуры контроля обеспечения Участник клиринга вправе вместо Отчета на исполнение использовать Срочный отчет на исполнение или Специальный отчет на исполнение.

Порядок подачи и регистрации в Клиринговой системе Специального отчета на исполнение приведен в статье 33 Правил клиринга, Срочного отчета на исполнение – в статье 34 Правил клиринга.

30.5. Участник клиринга, имеющий обязательства по внесению компенсационных взносов и/или по сделкам с ценными бумагами (первым или вторым частям сделок РЕПО), по которым при подаче заявки не проводилась Процедура контроля обеспечения и которые включены им в Специальный или Срочный отчет на исполнение, но не прошли Процедуру контроля обеспечения до момента окончания периода регистрации поручений (по сделкам за российские рубли время указано в строке 2.2 таблицы 1 приложения № 2 к Правилам клиринга, по сделкам в иностранной валюте время указано в строке 3.2 таблицы 1 приложения № 2 к Правилам клиринга), обязан исполнить обязательства по сделкам (первым или вторым частям сделок РЕПО), Дата исполнения которых наступила, или обязательства по внесению компенсационных взносов, Дата внесения которых наступила, в соответствии с пунктами 30.2, 30.3 Правил клиринга соответственно.

30.6. По сделкам, не прошедшим Процедуру контроля обеспечения, Участник клиринга до момента окончания периода регистрации поручений по указанным сделкам (по сделкам с расчетами в российских рублях время указано в строках 2.3, 2.5 таблицы 1 приложения № 2 к Правилам клиринга, по сделкам с расчетами в иностранной валюте - в строках 3.3, 3.5 таблицы 1 приложения № 2 к Правилам клиринга) вправе заменить Торгово-клиринговый счет, с использованием которого должны быть исполнены обязательства по сделкам.

Для осуществления указанной замены Участник клиринга предоставляет Клиринговому центру с использованием Клиринговой системы Поручение на замену Торгово-клирингового счета (реквизиты которого предусмотрены пунктом 1.6 приложения № 4 к Правилам клиринга).

Информация о замене Торгово-клирингового счета, выполненной по инициативе Участника клиринга, доводится до сведения Участника клиринга путем предоставления Уведомления о замене Торгово-клирингового счета (реквизиты которого предусмотрены пунктом 1.9 приложения № 3 к Правилам клиринга).

30.7. После замены Торгово-клирингового счета в сделке обязательства по уплате компенсационных взносов по такой сделке также исполняются с использованием нового Торгово-клирингового счета.

30.8. Порядок исполнения (прекращения) обязательств по Сделкам с частичным обеспечением определен статьей 35 Правил клиринга.

### **Статья 31. Порядок подачи и регистрации Отчетов на исполнение**

31.1. Для прохождения сделкой с ценными бумагами с кодом расчетов В0-В30, первой части сделки РЕПО с кодом расчетов S0-S2, второй части сделки РЕПО с кодом

- расчетов S0-S2, Z0 и Rb Процедуры контроля обеспечения Участники клиринга, являющиеся сторонами по данной сделке, формируют и подают в Клиринговую систему Отчеты на исполнение (реквизиты которых предусмотрены пунктом 1.1 приложения № 4 к Правилам клиринга).
- 31.2. Отчет на исполнение сделки с ценными бумагами с кодом расчетов B0, может быть подан в Клиринговую систему в ходе периода регистрации поручений, начиная для биржевой сделки с кодом расчетов B0 с даты ее заключения, для внебиржевой сделки с кодом расчетов B0 - с даты регистрации данных о сделке в Клиринговой системе, до Даты прекращения ее исполнения, на основании данных о сделке с ценными бумагами, полученных из Системы торгов, от Биржи или от Участника клиринга.
- 31.3. Отчет на исполнение сделки с ценными бумагами с кодом расчетов B01-B30 может быть подан в Клиринговую систему в ходе периода регистрации поручений, начиная (для биржевой сделки с кодом расчетов B01-B30 с Расчетного дня, следующего за датой ее заключения, для внебиржевой сделки с кодом расчетов B01-B30 с Расчетного дня, следующего за датой регистрации данных о сделке в Клиринговой системе) до Даты прекращения ее исполнения, на основании данных о сделке с ценными бумагами, полученных от Биржи или от Участника клиринга.
- 31.4. Отчет на исполнение первой части сделки РЕПО с кодом расчетов S0-S2 может быть подан в Клиринговую систему в ходе периода регистрации поручений (по первой части внебиржевой сделки РЕПО с кодом расчетов S0-S2 при условии регистрации данных о ней в Клиринговой системе), начиная с Даты исполнения первой части сделки РЕПО до Даты прекращения ее исполнения, на основании данных о сделке РЕПО, полученных от Биржи или от Участника клиринга.
- 31.5. Отчет на исполнение второй части сделки РЕПО с кодом расчетов S0-S2, Z0 и Rb (при условии того, что первая часть сделки РЕПО уже прошла Процедуру контроля обеспечения), может быть подан в Клиринговую систему в ходе периода регистрации поручений, начиная с Даты исполнения первой части сделки РЕПО до Даты прекращения исполнения второй части сделки РЕПО, на основании данных о сделке РЕПО, полученных от Биржи или от Участника клиринга.
- 31.6. Отсутствие в Клиринговой системе информации об успешном проведении Процедуры контроля обеспечения по первой части сделки РЕПО ведет к невозможности регистрации Участниками клиринга, являющимися сторонами данной сделки, Отчетов на исполнение (Срочных отчетов на исполнение, Специальных отчетов на исполнение) второй части данной сделки РЕПО.
- 31.7. Отчет на исполнение сделки с ценными бумагами (первой или второй части сделки РЕПО), поданный Участником клиринга - покупателем, регистрируется в Клиринговой системе только при условии превышения (равенства) планового значения соответствующей позиции по денежным средствам данного Участника клиринга в момент подачи Отчета на исполнение, за вычетом соответствующих Ограничительных лимитов, величины(е) обязательства данного Участника клиринга по денежным средствам, возникшего по данной сделке (первой или второй части сделки РЕПО) (с учетом НКД).

- 31.8. Отчет на исполнение сделки с ценными бумагами (первой или второй части сделки РЕПО), поданный Участником клиринга - продавцом, регистрируется в Клиринговой системе только при условии превышения (равенства) планового значения соответствующей позиции депо данного Участника клиринга в момент подачи Отчета на исполнение величины(е) обязательства данного Участника клиринга по ценным бумагам, возникшего по данной сделке (первой или второй части сделки РЕПО).
- 31.9. Отсутствие в Клиринговой системе зарегистрированного Отчета на исполнение по сделке с ценными бумагами с кодом расчетов В0-В30, первой части сделки РЕПО с ценными бумагами с кодом расчетов S0-S2, второй части сделки РЕПО с кодом расчетов S0-S2, Z0 и Rb в Дату ее исполнения по состоянию на момент окончания периода регистрации поручений в соответствии с пунктом 30.2 Правил клиринга признается нарушением со стороны Участника клиринга требований Правил клиринга, повлекшим неисполнение обязательств по данной сделке с ценными бумагами (первой или второй части сделки РЕПО) в Дату исполнения.
- 31.10. Участнику клиринга в Клиринговой системе раскрывается информация о регистрации Отчета на исполнение по сделке с ценными бумагами (первой или второй части сделки РЕПО), поданного в Клиринговую систему его контрагентом.
- 31.11. Участники клиринга вправе до окончания периода регистрации поручений отзывать зарегистрированные Отчеты на исполнение по сделкам с ценными бумагами (первой или второй части сделки РЕПО) и подавать новые Отчеты на исполнение по этим сделкам при условии, что указанные сделки (первые или вторые части сделки РЕПО) еще не прошли Процедуру контроля обеспечения в соответствии с пунктом 31.12 настоящей статьи.
- 31.12. При условии регистрации в Клиринговой системе Отчетов на исполнение по сделке с ценными бумагами (первой или второй части сделки РЕПО) обоих Участников клиринга, являющихся сторонами данной сделки, данная сделка (первая или вторая часть сделки РЕПО) считается обеспеченной (прошедшей Процедуру контроля обеспечения), и обязательства по данной сделке (первой или второй части сделки РЕПО) включаются в клиринговый пул для расчетов по итогам торгов.
- 31.13. В случае прохождения второй частью биржевой сделки РЕПО Процедуры контроля обеспечения до Даты исполнения Клиринговый центр формирует и передает Бирже Отчет о досрочном исполнении сделок РЕПО (реквизиты которого предусмотрены пунктом 4.2 приложения № 3 к Правилам клиринга).

## **Статья 32. Порядок подачи и регистрации поручений на внесение компенсационных взносов и поручений на отказ от компенсационных взносов**

- 32.1. Для прохождения компенсационным взносом Процедуры контроля обеспечения Участник клиринга, имеющий обязательство по внесению компенсационного взноса, в Дату внесения компенсационного взноса формирует и подает в Клиринговую систему Поручение на внесение компенсационного взноса (реквизиты которого предусмотрены пунктом 1.3 приложения № 4 к Правилам клиринга).



- 32.2. Поручение на внесение компенсационных взносов может быть подано в Клиринговую систему в ходе периода регистрации поручений в Дату внесения компенсационных взносов на основании данных, полученных от Биржи.
- 32.2.1. Поручение на внесение компенсационного взноса в виде денежных средств, поданное Участником клиринга, регистрируется в Клиринговой системе только при условии превышения (равенства) планового значения соответствующей позиции по денежным средствам данного Участника клиринга в момент подачи Поручения, за вычетом соответствующих Ограничительных лимитов, величины(е) обязательства данного Участника клиринга по внесению компенсационного взноса.
- Поручение на внесение компенсационного взноса в виде ценных бумаг, поданное Участником клиринга, регистрируется в Клиринговой системе только при условии превышения (равенства) планового значения соответствующей позиции депо данного Участника клиринга в момент подачи Поручения величины(е) обязательства данного Участника клиринга по внесению компенсационного взноса.
- 32.3. При условии регистрации в Клиринговой системе Поручения на внесение компенсационного взноса, поданного Участником клиринга, компенсационный взнос считается обеспеченным (прошедшим Процедуру контроля обеспечения), и обязательства по внесению данного компенсационного взноса включаются в клиринговый пул для проведения расчетов по итогам торгов.
- 32.4. Участнику клиринга в Клиринговой системе раскрывается информация о регистрации Поручения на внесение компенсационного взноса, поданного в Клиринговую систему его контрагентом по соответствующей сделке.
- 32.5. Участник клиринга при наличии технической возможности вправе отказаться от получения компенсационного взноса. Для этого Участники клиринга, являющиеся контрагентами по биржевой сделке РЕПО, до окончания периода регистрации поручений в Дату внесения компенсационного взноса формируют и подают в Клиринговую систему Поручения на отказ от компенсационного взноса (реквизиты которого предусмотрены пунктом 1.3 приложения № 4 к Правилам клиринга).
- Поручения на отказ от компенсационного взноса может быть подано при условии, что компенсационный взнос еще не прошел Процедуру контроля обеспечения в соответствии с пунктом 32.3 Правил клиринга.
- При регистрации в Клиринговой системе Поручений на отказ от компенсационного взноса со стороны каждого из Участников клиринга – контрагентов по биржевой сделке РЕПО, внесение компенсационного взноса по данной сделке не осуществляется и факт неисполнения обязательств по внесению компенсационного взноса со стороны Участника клиринга, имеющего обязательство по внесению компенсационного взноса, не регистрируется.
- 32.6. Участнику клиринга в Клиринговой системе раскрывается информация о регистрации Поручения на отказ от компенсационного взноса, поданного в Клиринговую систему его контрагентом.
- 32.7. Отзыв Участником клиринга ранее зарегистрированного в Клиринговой системе Поручения на отказ от компенсационного взноса возможен только до момента регистрации его контрагентом в Клиринговой системе Поручения на отказ от компенсационного взноса.

### Статья 33. Порядок подачи и регистрации Специальных отчетов на исполнение

33.1. Два Участника клиринга, являющиеся сторонами по сделкам, заключенным с кодами расчетов В0-В30, первой части сделки РЕПО с кодом расчетов S0-S2, второй части сделки РЕПО с кодом расчетов S0-S2, Z0 и Rb, обязательства по которым могут быть исполнены в данный Расчетный день, могут использовать одновременную Процедуру контроля обеспечения по данным сделкам и компенсационным взносам, начисленным в соответствии с условиями данных сделок РЕПО (биржевых и внебиржевых).

Для этого Участники клиринга формируют и подают в Клиринговую систему Специальные отчеты на исполнение (реквизиты Специальных отчетов на исполнение предусмотрены пунктом 1.2 приложения № 4 к Правилам клиринга).

Специальный отчет на исполнение может быть подан в Клиринговой системе в ходе периода регистрации поручений.

33.2. По всем сделкам и компенсационным взносам, включенным в Специальный отчет на исполнение, Клиринговый центр для каждой позиции, входящей в состав торгово-клиринговых счетов, указанных в сделках и компенсационных взносах, включенных в Специальный отчет на исполнение, рассчитывает условное двустороннее нетто-обязательство (нетто-требование) Участника клиринга по денежным средствам или ценным бумагам.

В целях Правил клиринга условное двустороннее нетто-обязательство (нетто-требование) Участника клиринга по денежным средствам определяется как отрицательная (положительная) разница между суммой требований и суммой обязательств Участника клиринга по денежным средствам по сделкам с кодами расчетов В0-В30, вторым частям сделок РЕПО с кодами расчетов Z0 и Rb, по первым и вторым частям сделок РЕПО с кодами расчетов S0-S2, а также по компенсационным взносам в виде денежных средств по биржевым и внебиржевым сделкам РЕПО, заключенным с одним контрагентом, отвечающих требованиям, указанным в пункте 33.1 Правил клиринга, включенным в Специальный отчет на исполнение.

В целях Правил клиринга условное двустороннее нетто-обязательство (нетто-требование) Участника клиринга по ценным бумагам определяется как отрицательная (положительная) разница между суммой требований и суммой обязательств Участника клиринга по ценным бумагам по сделкам с кодами расчетов В0-В30, вторым частям сделок РЕПО с кодами расчетов Z0 и Rb, по первым и вторым частям сделок РЕПО с кодами расчетов S0-S2, а также по компенсационным взносам в виде ценных бумаг по биржевым и внебиржевым сделкам РЕПО, заключенным с одним контрагентом, отвечающих требованиям, указанным в пункте 33.1 Правил клиринга, включенным в Специальный отчет на исполнение.

33.3. Специальный отчет на исполнение Участника клиринга, имеющего условное двустороннее нетто-обязательство по денежным средствам, регистрируется в Клиринговой системе только при условии превышения (равенства) планового значения соответствующей позиции по денежным средствам данного Участника клиринга в момент подачи Специального отчета на исполнение, за вычетом соответствующих Ограничительных лимитов, величины(е) условного

двустороннего нетто-обязательства данного Участника клиринга по денежным средствам.

Специальный отчет на исполнение Участника клиринга, имеющего условное двустороннее нетто-обязательство по ценным бумагам, регистрируется в Клиринговой системе только при условии превышения (равенства) планового значения соответствующей позиции депо данного Участника клиринга в момент подачи Специального отчета на исполнение величины(е) условного двустороннего нетто-обязательства данного Участника клиринга по ценным бумагам.

- 33.4. Участнику клиринга в Клиринговой системе раскрывается информация о регистрации Специального отчета на исполнение, поданного в Клиринговую систему его контрагентом.
- 33.5. Участники клиринга вправе до окончания периода регистрации поручений отзывать зарегистрированные Специальные отчеты на исполнение и подавать новые Специальные отчеты на исполнение при условии, что сделки и/или компенсационные взносы, включенные в Специальный отчет на исполнение, еще не прошли Процедуру контроля обеспечения в соответствии с подпунктом 33.6 Правил клиринга. Специальные отчеты, не прошедшие Процедуру контроля обеспечения до окончания периода регистрации поручений, после его окончания исключаются из Клиринговой системы.
- 33.6. При совпадении номеров сделок в зарегистрированных в Клиринговой системе Специальных отчетах на исполнение обоих Участников клиринга, являющихся сторонами сделок с кодами расчетов B0-B30, вторых частей сделок РЕПО с кодами расчетов Z0 и Rb, первых и вторых частей сделок РЕПО с кодами расчетов S0-S2, а также компенсационных взносов, включенных в Специальные отчеты на исполнение, указанные сделки (компенсационные взносы) считаются обеспеченными (прошедшими Процедуру контроля обеспечения), и обязательства по указанным сделкам и/или обязательства по внесению указанных компенсационных взносов включаются в клиринговый пул для проведения расчетов по итогам торгов.

#### **Статья 34. Порядок подачи и регистрации Срочных отчетов на исполнение**

- 34.1. Два Участника клиринга, являющиеся сторонами по сделкам, заключенным с кодами расчетов B0-B30, первой части сделки РЕПО с кодом расчетов S0-S2, второй части сделки РЕПО с кодом расчетов S0-S2, Z0 и Rb, обязательства по которым могут быть исполнены в данный Расчетный день, могут использовать одновременную Процедуру контроля обеспечения по данным сделкам и компенсационным взносам, начисленным в соответствии с условиями данных сделок РЕПО (биржевых и внебиржевых), после прохождения которой эти сделки и/или компенсационные взносы считаются обеспеченными, и обязательства по данным сделкам и/или обязательства по внесению данных компенсационных взносов включаются в клиринговый пул для расчетов в ходе торгов, порядок проведения которых определен в статье 35 Правил клиринга.

Для этого Участники клиринга формируют и подают в Клиринговую систему Срочные отчеты на исполнение (реквизиты Срочных отчетов на исполнение предусмотрены пунктом 1.2 приложения № 4 к Правилам клиринга).

Срочный отчет на исполнение может быть подан в Клиринговую систему в ходе периода регистрации поручений.

34.2. Клиринговый центр для каждой позиции, входящей в состав торгово-клиринговых счетов, указанных в сделках и компенсационных взносах, включенных в Срочный отчет на исполнение, рассчитывает нетто-обязательство (нетто-требование) Участника клиринга по денежным средствам или ценным бумагам.

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

**НОД = СТ - СО**, где:

**НОД** - нетто-обязательство (нетто-требование) Участника клиринга по денежным средствам;

**СТ** - сумма требований, а **СО** – сумма обязательств Участника клиринга по денежным средствам по:

- сделкам с кодом расчетов В0-В30, включенным в Срочный отчет на исполнение;
- первым частям сделок РЕПО с кодом расчетов S0-S2, включенным в Срочный отчет на исполнение;
- вторым частям обеспеченных сделок РЕПО с кодом расчетов Z0, S0-S2 или Rb, включенным в Срочный отчет на исполнение;
- компенсационным взносам в денежных средствах, включенным в Срочный отчет на исполнение.

Отрицательное значение НОД означает нетто-обязательство Участника клиринга по денежным средствам, положительное значение НОД — нетто-требование Участника клиринга по денежным средствам.

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

**НОЦ = СТЦ - СОЦ**, где:

**НОЦ** - нетто-обязательство (нетто-требование) Участника клиринга по ценной бумаге;

**СТЦ** - сумма требований, а **СОЦ** – сумма обязательств Участника клиринга по соответствующей ценной бумаге по:

- обеспеченным сделкам с кодом расчетов В0-В30, включенным в Срочный отчет на исполнение;
- первым частям обеспеченных сделок РЕПО с кодом расчетов S0-S2, включенным в Срочный отчет на исполнение;
- вторым частям обеспеченных сделок РЕПО с кодом расчетов Z0, S0-S2 или Rb, включенным в Срочный отчет на исполнение;
- компенсационным взносам в ценных бумагах, включенным в Срочный отчет на исполнение.

Отрицательное значение НОЦ означает нетто-обязательство Участника клиринга по ценной бумаге, положительное значение НОЦ — нетто-требование Участника клиринга по ценной бумаге.

- 34.5. Срочный отчет на исполнение Участника клиринга, имеющего нетто-обязательство по денежным средствам, регистрируется в Клиринговой системе только при условии превышения (равенства) в момент подачи Срочного отчета на исполнение планового значения соответствующей позиции по денежным средствам данного Участника клиринга, за вычетом соответствующих Ограничительных лимитов, величины(е) данного нетто-обязательства по денежным средствам.
- 34.6. Срочный отчет на исполнение Участника клиринга, имеющего нетто-обязательство по ценным бумагам, регистрируется в Клиринговой системе только при условии превышения (равенства) в момент подачи Срочного отчета на исполнение:
- меньшей из двух величин (планового или контрольного значения соответствующей позиции по ценным бумагам данного Участника клиринга) величины(е) данного нетто-обязательства по ценным бумагам.
- 34.7. Участнику клиринга в Клиринговой системе раскрывается информация о регистрации Срочного отчета на исполнение, поданного в Клиринговую систему его контрагентом.
- 34.8. Участники клиринга вправе до окончания периода регистрации поручений отзывать зарегистрированные Срочные отчеты на исполнение и подавать новые Срочные отчеты на исполнение при условии, что сделки и/или компенсационные взносы, включенные в Срочный отчет на исполнение, еще не прошли Процедуру контроля обеспечения в соответствии с пунктом 34.9 Правил клиринга. Срочные отчеты, не прошедшие Процедуру контроля обеспечения до окончания периода регистрации поручений, после его окончания исключаются из Клиринговой системы.
- 34.9. При совпадении номеров сделок в зарегистрированных в Клиринговой системе Срочных отчетах на исполнение обоих Участников клиринга, являющихся сторонами сделок с кодами расчетов B0-B30, вторых частей сделок РЕПО с кодами расчетов Z0 и Rb, первых и вторых частей сделок РЕПО с кодами расчетов S0-S2, а также компенсационных взносов, включенных в Срочные отчеты на исполнение, указанные сделки (компенсационные взносы) считаются обеспеченными (прошедшими Процедуру контроля обеспечения), и нетто-обязательства (нетто-требования) Участников клиринга по денежным средствам или ценным бумагам, рассчитанные по указанным сделкам и/или компенсационным взносам, включаются в клиринговый пул для проведения расчетов в ходе торгов.

**Статья 35. Порядок исполнения / прекращения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением и обязательств по возврату Гарантийных переводов**

- 35.1. В срок, установленный Временным регламентом, Клиринговый центр:
- 35.1.1. рассчитывает обязательство каждого Участника клиринга и Клирингового центра по возврату Гарантийных переводов с наступившей Датой исполнения по каждому Расчетному коду по формуле:

$$RET\_RUB = -(\sum_j OBL_j \times Rc_j + OBL\_RUB), \text{ где}$$

RET\_RUB – размер обязательства Участника клиринга или Клирингового центра по возврату Гарантийных переводов по Расчетному коду (в российских рублях);

OBL<sub>j</sub> – Нетто-обязательства / Нетто-требования Участника клиринга (с учетом знака) по j-м ценным бумагам по Сделкам с частичным обеспечением с наступившей Датой исполнения, учитываемые по Разделам для учета ценных бумаг в Обеспечении, относящимся к Расчетному коду, рассчитанные без учета Сделок с частичным обеспечением, обязательства по уплате Гарантийных переводов по которым в соответствии с Правилами клиринга не возникают;

OBL\_RUB - Нетто-обязательство / Нетто-требование Участника клиринга (с учетом знака) в российских рублях по Сделкам с частичным обеспечением с наступившей Датой исполнения, учитываемое по Расчетному коду, рассчитанное без учета Сделок с частичным обеспечением, обязательства по уплате Гарантийных переводов по которым в соответствии с Правилами клиринга не возникают;

Rc<sub>j</sub> – Расчетная цена j-ой ценной бумаги, рассчитанная в день T-2, где T – текущий Расчетный день (в российских рублях);

$\sum_j$  - сумма по ценным бумагам.

Если значение RET\_RUB отрицательное, это означает наличие обязанности Участника клиринга по возврату Клиринговому центру Гарантийных переводов по Расчетному коду в размере, равном абсолютному значению RET\_RUB, если положительное – наличие обязанности Клирингового центра по возврату Участнику клиринга Гарантийных переводов по Расчетному коду в размере, равном значению RET\_RUB.

- 35.1.2. зачитывает встречные однородные обязательства и требования Участника клиринга и Клирингового центра по денежным средствам и ценным бумагам по Сделкам с частичным обеспечением с наступившей Датой исполнения, обязательства по которым учитываются по определенному Расчетному коду / Разделу для учета ценных бумаг в Обеспечении, и обязательства / требования Участника клиринга по возврату Гарантийных переводов, учитываемые по тому же Расчетному коду и определенные в соответствии с пунктом 35.1.1 Правил клиринга, а в части, в которой обязательства и требования не были зачтены – определяет Итоговые нетто-обязательства и/или Итоговые нетто-требования по денежным средствам / ценным бумагам каждого Участника клиринга по каждому Расчетному коду / Разделу для учета ценных бумаг в Обеспечении;
- 35.1.3. формирует и передает Участникам клиринга отчеты, содержащие информацию об Итоговых нетто-обязательствах / Итоговых нетто-требованиях по денежным средствам / ценным бумагам (реквизиты которых приведены в пункте 1.2 приложения № 3 к Правилам клиринга).
- 35.2. Участник клиринга обязан исполнить свои Итоговые нетто-обязательства по денежным средствам или ценным бумагам до времени, установленного Временным регламентом.
- 35.3. Клиринговый центр исполняет Итоговые нетто-требования Участника клиринга, учитываемые по Расчетному коду / Разделу для учета ценных бумаг в

Обеспечении, относящемуся к Расчетному коду, при условии исполнения Участником клиринга своих Итоговых нетто-обязательств, учитываемых по тому же Расчетному коду / по всем Разделам для учета ценных бумаг в Обеспечении, относящимся к тому же Расчетному коду.

- 35.4. Для исполнения Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам, учитываемого по Расчетному коду / Разделу для учета ценных бумаг в Обеспечении, используется Обеспечение Участника клиринга в соответствующих денежных средствах / ценных бумагах, внесенное Участником клиринга в порядке, определенном статьей 24 Правил клиринга, учитываемое по тому же Расчетному коду / Разделу для учета ценных бумаг в Обеспечении. Обеспечение, учитываемое по другим Расчетным кодам / Разделам для учета ценных бумаг в Обеспечении этого же Участника клиринга, не используется.
- 35.4.1. Если Обеспечения в денежных средствах / ценных бумагах, учитываемого по Расчетному коду / Разделу для учета ценных бумаг в Обеспечении, недостаточно для исполнения Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам, учитываемого по Расчетному коду / Разделу для учета ценных бумаг в Обеспечении, Клиринговый центр на недостающую сумму денежных средств / недостающее количество соответствующих ценных бумаг формирует в Клиринговой системе распоряжение на внесение денежных средств / ценных бумаг в Обеспечение, которое исполняется в порядке, определенном статьей 24 Правил клиринга.
- 35.4.2. Если в результате действий, определенных в пункте 35.4.1 Правил клиринга, недостаточность Обеспечения Участника клиринга для исполнения соответствующего Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам и/или ценным бумагам сохраняется, данный Участник клиринга признается Недобросовестным участником клиринга, и Клиринговый центр выполняет действия, направленные на урегулирование указанных неисполненных обязательств, в порядке, определенном статьей 36 Правил клиринга.
- 35.5. В случае достаточности Обеспечения в денежных средствах / ценных бумагах для исполнения Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам и/или по итогам урегулирования неисполненных обязательств по Сделкам с частичным обеспечением в соответствии со статьей 36 Правил клиринга, Клиринговый центр зачитывает Итоговое нетто-обязательство Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам, учитываемое по Расчетному коду / Разделу для учета ценных бумаг в Обеспечении, с требованием Участника клиринга по возврату денежных средств в российских рублях / соответствующих ценных бумаг, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга по тому же Расчетному коду / Разделу для учета ценных бумаг в Обеспечении.
- 35.5.1. Итоговое нетто-обязательство Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам, учитываемое по Расчетному коду / Разделу для учета ценных бумаг в Обеспечении, считается исполненным, если размер Обеспечения Участника клиринга в соответствующих денежных средствах / ценных бумагах по тому же Расчетному коду / Разделу для учета ценных бумаг в Обеспечении не меньше, чем Итоговое нетто-обязательство Участника клиринга по денежным

средствам / ценным бумагам, учитываемое по Расчетному коду / Разделу для учета ценных бумаг в Обеспечении.

При этом размер Обеспечения Участника клиринга в соответствующих денежных средствах / ценных бумагах по Расчетному коду / Разделу для учета ценных бумаг в Обеспечении уменьшается на сумму такого исполненного Итогового нетто-обязательства.

- 35.5.2. Если размер Обеспечения Участника клиринга в российских рублях по Расчетному коду меньше, чем Итоговое нетто-обязательство Участника клиринга по денежным средствам в российских рублях, учитываемое по тому же Расчетному коду, разность между Итовым нетто-обязательством Участника клиринга по денежным средствам в российских рублях по Расчетному коду и размером Обеспечения Участника клиринга в российских рублях по Расчетному коду учитывается как Задолженность Участника клиринга перед Клиринговым центром по Расчетному коду, а размер Обеспечения Участника клиринга в российских рублях по Расчетному коду устанавливается равным нулю.

Указанная Задолженность должна быть погашена Участником клиринга не позднее установленного Временным регламентом времени Расчетного дня, следующего за днем возникновения указанной Задолженности.

Информация о наличии у Участника клиринга Задолженности и ее размере передается Участнику клиринга в составе отчета «Требование о погашении задолженности», направляемом Участнику клиринга в соответствии с пунктом 27.6 Правил клиринга.

- 35.5.3. Если Задолженность Участника клиринга не погашена в установленные Временным регламентом сроки, Клиринговый центр использует средства Коллективного фонда в порядке, определенном статьей 37 Правил клиринга.

- 35.6. Итоговое нетто-требование Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам, учитываемое по Расчетному коду / Разделу для учета ценных бумаг в Обеспечении, прекращается возникновением обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга соответствующих денежных средств / ценных бумаг, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга по тому же Расчетному коду / Разделу для учета ценных бумаг в Обеспечении, в размере Итогового нетто-требования по денежным средствам / ценным бумагам, учитываемого по Расчетному коду / Разделу для учета ценных бумаг в Обеспечении.

При этом размер Обеспечения Участника клиринга в соответствующих денежных средствах / ценных бумагах по Расчетному коду / Разделу для учета ценных бумаг в Обеспечении увеличивается на сумму такого прекращенного Итогового нетто-требования.

- 35.6.1. После прекращения Итогового нетто-требования Участника клиринга по денежным средствам обязательство Клирингового центра по возврату Участнику клиринга денежных средств в российских рублях, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга по Расчетному коду, зачитывается с обязательством Участника клиринга по погашению его Задолженности по гарантийным переводам и Задолженности по сделкам перед Клиринговым центром в российских рублях, учитываемым по Расчетному коду (в случае наличия у Участника клиринга таких обязательств).



При этом размер Обеспечения Участника клиринга в российских рублях по Расчетному коду уменьшается на сумму Задолженности по гарантийным переводам Участника клиринга, а затем - Задолженности по сделкам Участника клиринга, учитываемым по тому же Расчетному коду.

35.6.2. После выполнения действий, указанных в подпункте 35.6.1 Правил клиринга, Клиринговый центр:

- 5) увеличивает плановое значение позиции по денежным средствам по Счету, соответствующему Расчетному коду, на сумму прекращенного Итогового нетто-требования Участника клиринга по денежным средствам, учитываемого по Расчетному коду, но не превышающую сумму Обеспечения Участника клиринга в денежных средствах по тому же Расчетному коду, и при условии, что изъятие этой суммы из Обеспечения не приведет к возникновению у Участника клиринга отрицательного Единого лимита по Расчетному коду, либо на максимально возможную сумму, не превышающую сумму Обеспечения Участника клиринга в денежных средствах по тому же Расчетному коду, изъятие которой из Обеспечения не приведет к возникновению у Участника клиринга отрицательного Единого лимита по Расчетному коду;
- 6) увеличивает плановое значение позиции по ценным бумагам по Разделу для исполнения обязательств по сделкам клирингового пула, соответствующему Разделу для учета ценных бумаг в Обеспечении, относящемуся к Расчетному коду Участника клиринга, на объем прекращенного Итогового нетто-требования Участника клиринга по ценным бумагам, учитываемого по Разделу для учета ценных бумаг в Обеспечении, относящемуся к Расчетному коду, но не превышающую сумму Обеспечения Участника клиринга в ценных бумагах по тому же Разделу для учета ценных бумаг в Обеспечении, и при условии, что изъятие этого количества ценных бумаг из Обеспечения не приведет к возникновению у Участника клиринга отрицательного Единого лимита по Расчетному коду, либо на максимально возможный объем, не превышающий количества соответствующих ценных бумаг в Обеспечении Участника клиринга по тому же Разделу для учета ценных бумаг в Обеспечении, относящемуся к Расчетному коду, изъятие которых из Обеспечения не приведет к возникновению у Участника клиринга отрицательного Единого лимита по Расчетному коду.

При этом размер Обеспечения Участника клиринга в денежных средствах / ценных бумагах по Расчетному коду / Разделу для учета ценных бумаг в Обеспечении уменьшается на сумму денежных средств / количество ценных бумаг, на которые увеличены соответствующие позиции Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам, а обязательства по возврату денежных средств / ценных бумаг из Обеспечения в соответствующем объеме включаются в клиринговый пул для проведения расчетов по итогам торгов.

35.7. В случае предоставления Участником клиринга Клиринговому центру Постоянного поручения на депонирование денежных средств и/или ценных бумаг, увеличение плановых значений соответствующих позиций Участника клиринга по денежным средствам и/или ценным бумагам в соответствии с пунктом 35.6 Правил клиринга не осуществляется. В этом случае возврат Участнику клиринга денежных средств / ценных бумаг из Обеспечения осуществляется только на основании Запроса о возврате денежных средств / ценных бумаг из Обеспечения.

Постоянное поручение на депонирование денежных средств и/или ценных бумаг направляется Участником клиринга на бумажном носителе по форме, предусмотренной пунктом 1.15 приложения № 6 к Правилам клиринга, или в форме электронного документа.

Постоянное поручение на депонирование денежных средств и/или ценных бумаг исполняется Клиринговым центром каждый Расчетный день, начиная с первого Расчетного дня, следующего за датой предоставления указанного поручения.

Постоянное поручение на депонирование денежных средств и/или ценных бумаг действует до его отмены Участником клиринга.

Отмена Постоянного поручения на депонирование денежных средств и/или ценных бумаг осуществляется путем направления Участником клиринга Клиринговому центру документа на бумажном носителе в свободной форме или электронного документа.

### **Статья 36. Порядок урегулирования случаев неисполнения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением**

36.1. В случаях:

36.1.1. частичного неисполнения или неисполнения в полном объеме Участником клиринга своих Итоговых нетто-обязательств по денежным средствам и/или ценным бумагам;

36.1.2. непогашения Участником клиринга до времени, установленного Временным регламентом, Задолженности по гарантийным переводам, возникшей в текущий день, и/или Задолженности, возникшей в предыдущие Расчетные дни или текущий день, и наличия Обеспечения Участника клиринга в ценных бумагах;

в ходе прекращения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением, проводимого в соответствии со статьей 35 Правил клиринга, между Клиринговым центром и Недобросовестным участником клиринга, без подачи заявок заключается сделка РЕПО (две сделки купли-продажи ценных бумаг), являющиеся Сделками с частичным обеспечением.

36.2. Сделки РЕПО (сделки купли-продажи ценных бумаг), указанные в пункте 36.1 Правил клиринга, заключаются при соблюдении следующих условий:

- а) у Участника клиринга не отозвана (не аннулирована) лицензия Банка России на осуществление банковских операций;
- б) у Клирингового центра отсутствует информация об обстоятельствах в отношении Участника клиринга, перечисленных в пункте 9.11 Правил клиринга, при наступлении которых клиринговое обслуживание Участника клиринга может быть приостановлено;
- в) количество Расчетных дней, в течение которых Участник клиринга не исполняет Итоговое нетто-обязательство по денежным средствам по одному Расчетному коду или Итоговое нетто-обязательство по соответствующим ценным бумагам по Разделам для учета ценных бумаг в Обеспечении, относящимся к одному Расчетному коду, не превышает 6 (шести);
- г) отсутствует решение об исключении ценной бумаги, по которой учитывается неисполненное Итоговое нетто-обязательство, из Клирингового листа для Сделок с частичным обеспечением со следующего Расчетного дня.

36.2.1. Сделки купли-продажи, указанные в пункте 36.1 Правил клиринга, заключаются в случае предоставления Участником клиринга Клиринговому центру Заявления о заключении сделок купли-продажи.

Заявление о заключении сделок купли-продажи предоставляется Участником клиринга на бумажном носителе по форме, предусмотренной пунктом 1.16 приложения № 6 к Правилам клиринга.

36.3. Условия сделок РЕПО (двух сделок купли-продажи), заключаемых между Клиринговым центром и Недобросовестным участником клиринга в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга, соответствуют условиям Сделок с частичным обеспечением, определенным Правилами торговли, с учетом следующих особенностей:

- в случае наличия у Участника клиринга неисполненного Итогового нетто-обязательства по ценным бумагам, по первой части сделки РЕПО (по первой сделке купли-продажи) у Участника клиринга возникают требования по соответствующим ценным бумагам, противоположные указанному неисполненному Итоговому нетто-обязательству Участника клиринга по ценным бумагам в объеме, равном неисполненному Итоговому нетто-обязательству Участника клиринга по ценным бумагам;
- в случае наличия у Участника клиринга неисполненного Итогового нетто-обязательства по денежным средствам (в российских рублях), по первой части сделки РЕПО (по первой сделке купли-продажи) у Участника клиринга возникают требования в российских рублях, противоположные указанному неисполненному Итоговому нетто-обязательству Участника клиринга по денежным средствам, и обязательства по ценным бумагам в объеме, равном количеству ценных бумаг, не превышающему суммы объема Итогового нетто-требования по ценным бумагам, соответствующего неисполненному Участником клиринга Итоговому нетто-обязательству по денежным средствам, и размера Обеспечения Участника клиринга в соответствующих ценных бумагах;
- в случае наличия у Участника клиринга Задолженности и/или Задолженности по гарантийным переводам, по первой части сделки РЕПО (по первой сделке купли-продажи) у Участника клиринга возникают требования в российских рублях, противоположные Задолженности и/или Задолженности по гарантийным переводам, и обязательства по ценным бумагам в объеме, не превышающем размера Обеспечения Участника клиринга в ценных бумагах, соответствующем сумме Задолженности и/или Задолженности по гарантийным переводам.
- первая часть сделки РЕПО (первая сделка купли-продажи) исполняется в день ее заключения;
- вторая часть сделки РЕПО (вторая сделка купли-продажи) исполняется в Расчетный день, следующий за днем ее заключения;
- сумма первой части сделки РЕПО (сумма первой сделки купли-продажи) определяется как произведение количества ценных бумаг в сделке и последней определенной Клиринговым центром Расчетной цены ценных бумаг, уменьшенной на последний определенный Клиринговым центром дисконт по ценным бумагам;
- сумма второй части сделки РЕПО (сумма второй сделки купли-продажи)

определяется с учетом ставки РЕПО (штрафной ставки), которая рассчитывается по формуле:

$$\text{Repo\_Price} = K \times R_c \times (1-d) \times S \times n / 365, \text{ где}$$

Repo\_Price – ставка сделки РЕПО (штрафная ставка), в российских рублях,

K – коэффициент, равный 1, в случае если направленность сделки в отношении Недобросовестного участника клиринга - «продажа», а в отношении Добросовестного участника клиринга – «покупка», или равный -1, в случае если направленность сделки в отношении Недобросовестного участника клиринга - «покупка», а в отношении Добросовестного участника клиринга - «продажа»,

R<sub>c</sub> – Расчетная цена ценных бумаг, в российских рублях,

d - дисконт по ценным бумагам, в долях единицы,

S – ставка, установленная Клиринговым центром в соответствии с Методикой определения риск-параметров рынка ценных бумаг,

n – количество календарных дней между датой исполнения первой и второй части сделки РЕПО (между датами исполнения первой и второй сделки купли-продажи);

- при наличии у Участника клиринга неисполненного Итогового нетто-обязательства по денежным средствам, учитываемого по Расчетному коду, сделка РЕПО (сделки купли-продажи) в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга заключаются в отношении ценных бумаг, по которым по у Участника учитывается Итоговое нетто-требование по ценным бумагам, учитываемое по Разделу для учета ценных бумаг в Обеспечении, относящемуся к Расчетному коду;
- при наличии у Участника клиринга Задолженности и/или Задолженности по гарантийным переводам, учитываемых по Расчетному коду, сделка РЕПО (сделки купли-продажи) в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга заключаются в отношении ценных бумаг, учитываемых в качестве Обеспечения Участника по Разделу для учета ценных бумаг в Обеспечении, относящемуся к Расчетному коду.

36.3.1. В случае невозможности исполнения Участником клиринга своих Итоговых нетто-обязательств по денежным средствам / ценным бумагам вследствие непреодолимой силы или сбоя в платежной системе Банка России, между Клиринговым центром и Участником клиринга в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга заключается сделка РЕПО (две сделки купли-продажи) со ставкой РЕПО (штрафной ставкой), равной нулю.

Под обстоятельствами непреодолимой силы понимаются:

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

жизни или здоровью работников Участника клиринга.

О возникновении обстоятельств непреодолимой силы, вследствие которых исполнение Участником клиринга своих Итоговых нетто-обязательств по денежным средствам / ценным бумагам невозможно, Участник клиринга обязан уведомить Клиринговый центр любыми доступными средствами связи до установленного Временным регламентом времени исполнения Итоговых нетто-обязательств по денежным средствам / ценным бумагам.

Участник клиринга обязан предоставить Клиринговому центру документы, подтверждающие обстоятельства непреодолимой силы в течение 7 (семи) дней. В случае непредоставления Участником клиринга Клиринговому центру таких документов в указанный срок с Участника клиринга по решению Клирингового центра взыскивается неустойка по ставке РЕПО (штрафной ставке), рассчитанной в соответствии с подпунктом 36.3 Правил клиринга в расчете на количество календарных дней между датой исполнения первой части сделки РЕПО и датой расчета неустойки (между датами исполнения первой и второй сделки купли-продажи).

36.4. При наличии случаев неисполнения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением, определенных в пункте 36.1 Правил клиринга и несоблюдении хотя бы одного из условий, указанных в подпункте 36.2 Правил клиринга, в ходе прекращения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением, проводимого в соответствии со статьей 35 Правил клиринга, между Клиринговым центром и Недобросовестным участником клиринга, без подачи заявок заключается сделка купли-продажи ценных бумаг, являющаяся Сделкой с частичным обеспечением, условия которой соответствуют условиям первой сделки купли-продажи ценных бумаг, определенным в подпункте 36.3 Правил клиринга, за исключением следующего:

- сумма сделки купли-продажи ценных бумаг определяется как произведение количества ценных бумаг в сделке и последней определенной Клиринговым центром Расчетной цены ценных бумаг с учетом штрафной ставки, порядок расчета которой установлен в подпункте 36.3 Правил клиринга.

36.5. При наличии Недобросовестных участников клиринга, не исполнивших полностью или частично свои Итоговые нетто-обязательства по денежным средствам / ценным бумагам, для исполнения Итоговых нетто-требований по денежным средствам / ценным бумагам Добросовестных участников клиринга Клиринговый центр выполняет действия в следующей последовательности:

- использует собственные денежные средства и/или собственные ценные бумаги;
- в случае недостаточности собственных ценных бумаг заключает Договоры займа Клирингового центра в соответствии со статьей 46 Правил клиринга;
- в случае недостаточности собственных денежных средств и/или невозможности заключения договоров займа в соответствии со статьей Правил клиринга на необходимое недостающее количество ценных бумаг без подачи заявок заключает сделки РЕПО (две сделки купли-продажи), являющиеся Сделками с частичным обеспечением, с Добросовестными участниками клиринга.

- 36.5.1. Сделки купли-продажи в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга заключаются в случае предоставления Участником клиринга Клиринговому центру Заявления о заключении сделок купли-продажи, предусмотренного пунктом 36.2.1 Правил клиринга.
- 36.5.2. Условия сделок РЕПО (двух сделок купли-продажи), заключаемых между Клиринговым центром и Добросовестным участником клиринга в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга, соответствуют условиям Сделок с частичным обеспечением, определенным Правилами торговли, с учетом следующих особенностей:
- в случае недостаточности у Клирингового центра ценных бумаг для исполнения Итоговых нетто-требований Добросовестного участника клиринга по первой части сделки РЕПО (по первой сделке купли-продажи) у Участника клиринга возникают обязательства по соответствующим ценным бумагам, противоположные указанному неисполненному Итоговому нетто-требованию Добросовестного участника клиринга по ценным бумагам в объеме, равном неисполненному Итоговому нетто-требованию Добросовестного участника клиринга по ценным бумагам;
  - в случае недостаточности у Клирингового центра денежных средств для исполнения Итоговых нетто-требований Добросовестного участника клиринга, по первой части сделки РЕПО (по первой сделке купли-продажи) у Участника клиринга возникают обязательства в российских рублях, противоположные указанному неисполненному Итоговому нетто-требованию Добросовестного участника клиринга по денежным средствам, и требования по ценным бумагам в объеме, равном Итоговому нетто-обязательству Добросовестного участника клиринга по ценным бумагам, соответствующему неисполненному Итоговому нетто-требованию Добросовестного участника клиринга по денежным средствам;
  - иные условия заключаемых сделок соответствуют условиям сделок, определенных в пункте 36.3, при этом ставка РЕПО (штрафная ставка) уплачивается в пользу Добросовестного участника клиринга.
- 36.6. Заключение сделок в соответствии с пунктами 36.1-36.4 Правил клиринга осуществляется в отношении всех Участников клиринга, имеющих неисполненные Итоговые нетто-обязательства / Итоговые нетто-требования по денежным средствам / ценным бумагам.
- 36.7. После заключения сделок в соответствии с пунктами 36.1-36.4 Правил клиринга Клиринговый центр зачитывает встречные однородные Итоговые нетто-обязательства / Итоговые нетто-требования по денежным средствам и ценным бумагам и/или Задолженности / Задолженности по гарантийным переводам Участника клиринга с обязательствами и требованиями по указанным заключенным сделкам с наступившей Датой исполнения.
- В результате такого зачета Итоговые нетто-обязательства / нетто-требования Участников клиринга по ценным бумагам прекращаются (становятся равными нулю), у Участника клиринга может учитываться новое Итоговое нетто-обязательство / нетто-требование по денежным средствам, значение которого отлично от нуля.

Порядок прекращения указанного Итогового нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга по денежным средствам определен статьей 35 Правил клиринга.

- 36.7.1. Обязательства и требования по вторым частям сделок РЕПО (вторым сделкам купли-продажи), заключенным в соответствии с пунктами 36.1-36.4 Правил клиринга, учитываются в составе Нетто-обязательств / Нетто-требований Участника клиринга по Сделкам с частичным обеспечением с Датой исполнения, соответствующей дате исполнения указанных обязательств и требований.
- 36.8. В случае заключения Клиринговым центром сделок в соответствии с пунктом 27.12 Правил клиринга с Участником клиринга, не исполнившим Маржинальное требование, и/или сделок в соответствии с пунктом 36.4 Правил клиринга с Недобросовестным участником клиринга, Клиринговый центр на основании пункта 22.6 Правил клиринга подает заявки и/или заключает сделки с целью приведения к нулю суммы обязательств Клирингового центра по передаче ценных бумаг с одной и/или разными Датой исполнения.
- 36.9. Клиринговый центр с использованием Системы торгов уведомляет Биржу о необходимости заключения сделок РЕПО (сделок купли-продажи) в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга и об условиях указанных сделок.

### **Статья 37. Порядок использования и возмещения Коллективного фонда**

- 37.1. Клиринговый центр использует средства Коллективного фонда для исполнения обязательств любого из Участников клиринга по Сделкам с частичным обеспечением с наступившей Датой исполнения в случае, если Задолженность такого Участника клиринга перед Клиринговым центром не погашена в срок, установленный пунктом 35.5.2 Правилам клиринга.
- 37.2. В первую очередь используется взнос в Коллективный фонд Недобросовестного участника клиринга, во вторую – средства Клирингового центра в сумме, не превышающей 1 (один) миллиард рублей, в третью - взносы в Коллективный фонд Добросовестных участников клиринга.  
Взносы в Коллективный фонд Добросовестных участников клиринга используются в случае, если сумма Задолженностей Недобросовестных участников клиринга перед Клиринговым центром превышает величину средств Клирингового центра, установленную в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга.
- 37.3. Взнос в Коллективный фонд Недобросовестного участника клиринга используется для удовлетворения требований Клирингового центра по задолженности Недобросовестного участника клиринга путем передачи денежных средств, составляющих взнос в Коллективный фонд Недобросовестного участника клиринга Клиринговому центру в счет погашения Задолженности Недобросовестного участника клиринга.  
Удовлетворение требований за счет взноса в Коллективный фонд Недобросовестного участника клиринга осуществляется Клиринговым центром без предварительного уведомления Недобросовестного участника клиринга.

Взнос в Коллективный фонд Недобросовестного участника клиринга уменьшается на сумму использованных средств Коллективного фонда из вноса Недобросовестного участника клиринга.

37.4. Взносы в Коллективный фонд Добросовестных участников клиринга используются в размере превышения суммы Задолженностей Недобросовестных участников клиринга величины, установленной в соответствии с пунктом 37.2 Правил клиринга.

37.4.1. Использование взносов в Коллективный фонд Добросовестных участников клиринга осуществляется пропорционально размеру вноса в Коллективный фонд каждого Участника клиринга.

37.4.2. Взнос в Коллективный фонд Добросовестного участника клиринга используется для удовлетворения требований Клирингового центра по Задолженности Недобросовестного участника клиринга путем передачи денежных средств, составляющих взнос в Коллективный фонд Добросовестного участника клиринга Клиринговому центру в счет погашения задолженности Недобросовестного участника клиринга.

Удовлетворение требований за счет вноса в Коллективный фонд Добросовестного участника клиринга осуществляется Клиринговым центром без предварительного уведомления Добросовестного участника клиринга.

Взнос в Коллективный фонд Добросовестного участника клиринга уменьшается на сумму использованных средств Коллективного фонда из вноса Добросовестного участника клиринга.

При этом у Добросовестных участников клиринга не возникает требований к Недобросовестному участнику клиринга по возмещению денежных средств, составлявших взносы в Коллективный фонд Добросовестных участников клиринга.

37.5. Клиринговый центр уведомляет Биржу об использовании вноса в Коллективный фонд Недобросовестного участника клиринга и/или взносов в Коллективный фонд Добросовестных участников клиринга для удовлетворения требований по Задолженности Недобросовестного участника клиринга.

37.6. В случае использования взносов в Коллективный фонд Добросовестных Участников клиринга, Недобросовестный участник клиринга обязан в течение 2 (двух) Расчетных дней возместить использованные средства Коллективного фонда.

Уведомление о необходимости возмещения средств Коллективного фонда, содержащее информацию о сумме использованных средств Коллективного фонда, подлежащей возмещению Участником клиринга, о реквизитах счета для возмещения средств Коллективного фонда, о сроке, в течение которого средства Коллективного фонда должны быть возмещены, направляется Участнику клиринга в форме электронного документа не позднее рабочего дня, следующего за датой использования Коллективного фонда.

В случае невозмещения Недобросовестным участником клиринга средств Коллективного фонда Клиринговый центр вправе требовать от такого Участника клиринга этого возмещения в судебном порядке.

37.7. После возмещения Недобросовестным участником клиринга использованных средств Коллективного фонда, Клиринговый центр возмещает использованные взносы в Коллективный фонд Добросовестных участников клиринга.



Если полученных от Недобросовестного участника клиринга денежных средств недостаточно для полного возмещения взносов в Коллективный фонд Добросовестных участников клиринга, осуществляется частичное возмещение таких взносов в размере, пропорциональном сумме использованных средств Коллективного фонда из взноса каждого Участника клиринга.

При этом размер взноса в Коллективный фонд Добросовестного участника клиринга и размер обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга взноса в Коллективный фонд увеличиваются на сумму возмещенных денежных средств.

- 37.8. После возмещения Недобросовестным участником клиринга использованных средств Коллективного фонда такой Участник клиринга обязан возместить (внести) свой взнос в Коллективный фонд в установленном Клиринговым центром размере.
- 37.9. Клиринговый центр уведомляет Биржу о возмещении Недобросовестным участником клиринга средств Коллективного фонда и его взноса в Коллективный фонд.
- 37.10. В случае использования взносов в Коллективный фонд Добросовестных участников клиринга и невозмещения Недобросовестным участником клиринга использованных средств Коллективного фонда в течение 2 (двух) Расчетных дней после их использования, Добросовестные участники клиринга обязаны в течение 2 (двух) Расчетных дней после направления Клиринговым центром соответствующих уведомлений восполнить свои взносы в Коллективный фонд до размера, установленного Клиринговым центром. Указанная обязанность по восполнению взноса в Коллективный фонд не может возникать у Добросовестного участника клиринга чаще, чем один раз в Расчетный день.

### **Статья 38. Порядок определения подлежащих исполнению обязательств и требований Участников клиринга и Клирингового центра**

- 38.1. Клиринговый центр осуществляет определение и учет обязательств и требований по денежным средствам (по сделкам с ценными бумагами) по каждой позиции по денежным средствам Участника клиринга (Клирингового центра) (в соответствии с условиями заключенных им сделок, обязательства по которым включены в соответствующий клиринговый пул).

Клиринговый центр осуществляет определение и учет обязательств и требований по ценным бумагам (по сделкам с ценными бумагами) по каждой позиции депо и по каждой учетной позиции Участника клиринга (Клирингового центра) в отношении каждой ценной бумаги в отдельности (в соответствии с условиями заключенных им сделок, обязательства по которым включены в соответствующий клиринговый пул).

- 38.2. Обязательства по обеспеченным сделкам с ценными бумагами с кодами расчетов T0 и K0, первым частям обеспеченных сделок РЕПО с кодами расчетов Rb, а также обязательства по обеспеченным сделкам с ценными бумагами с кодами расчетов B0-B30, первым частям обеспеченных сделок РЕПО с кодами расчетов S0-S2 и вторым частям обеспеченных сделок РЕПО с любыми кодами расчетов, исполнение которых осуществлялось Участниками клиринга путем ввода Отчетов на исполнение или Специальных отчетов на исполнение, а также обязательства по

внесению компенсационных взносов, прошедших в течение Расчетного дня Процедуру контроля обеспечения в соответствии с требованиями раздела V Правил клиринга, включаются в клиринговый пул для расчетов по итогам торгов.

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

38.2.1. Нетто-обязательство (нетто-требование) Участника клиринга (Клирингового центра) по денежным средствам по сделкам клирингового пула по каждой его позиции по денежным средствам рассчитывается по формуле:

**НОД = СТ - СО**, где:

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

**СТ** - сумма требований, а **СО** – сумма обязательств Участника клиринга (Клирингового центра) по денежным средствам по:

- обеспеченным сделкам с кодом расчетов Т0;
- обеспеченным сделкам с кодом расчетов К0;
- первым частям обеспеченных сделок РЕПО с кодом расчетов Rb;
- обеспеченным сделкам с кодом расчетов В0-В30, исполнение обязательств по которым осуществлялось Участниками клиринга путем ввода Отчетов на исполнение или Специальных отчетов на исполнение;
- первым частям обеспеченных сделок РЕПО с кодом расчетов S0-S2, исполнение обязательств по которым осуществлялось Участниками клиринга путем ввода Отчетов на исполнение или Специальных отчетов на исполнение;
- вторым частям обеспеченных сделок РЕПО с любым кодом расчетов, исполнение обязательств по которым осуществлялось Участниками клиринга путем ввода Отчетов на исполнение или Специальных отчетов на исполнение;
- внесению компенсационных взносов;
- передаче Дохода;

прошедшим в течение Расчетного дня Процедуру контроля обеспечения (по соответствующей позиции по денежным средствам);

- исполненным в Клиринговой системе распоряжениям на внесение денежных средств в Обеспечение, поданным / сформированным Участником клиринга / Клиринговым центром;
- исполненным в Клиринговой системе возвратам денежных средств из Обеспечения по Запросам Участника клиринга о возврате денежных средств из Обеспечения или по прекращенным обязательствам по Сделкам с частичным обеспечением;
- уплате процентов по Договорам займа Клирингового центра, заключенным в соответствии со статьей 46 Правил клиринга.

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

При включении в Сводную ведомость по обязательствам и требованиям по денежным средствам, формируемую в соответствии с пунктом 41.1 Правил клиринга, значение Нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам по сделкам клирингового пула увеличивается, а значение Нетто-требования - уменьшается на суммы денежных средств, указанных в Распоряжениях на списание денежных средств с Клирингового счета, направленных Расчетной организации в течение текущего Расчетного дня в соответствии с пунктом 20.6 Правил клиринга и содержащих распоряжения на перечисление денежных средств с Клирингового счета на Счет, соответствующий позиции по денежным средствам, по которой определены указанные Нетто-обязательства / Нетто-требования Участника клиринга.

38.2.2. Нетто-обязательство (Нетто-требование) Участника клиринга (Клирингового центра) по ценным бумагам по сделкам клирингового пула по каждой его позиции депо, определенной в отношении Раздела для исполнения обязательств по сделкам клирингового пула, и в отношении каждой ценной бумаги рассчитывается по формуле:

**НОЦ = СТЦ - СОЦ**, где:

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

**СТЦ** - сумма требований, а **СОЦ** – сумма обязательств Участника клиринга (Клирингового центра) по соответствующей ценной бумаге по:

- обеспеченным сделкам с кодом расчетов T0;
- обеспеченным сделкам с кодом расчетов K0;
- первым частям обеспеченных сделок РЕПО с кодом расчетов Rb;
- обеспеченным сделкам с кодом расчетов B0-B30, исполнение обязательств по которым осуществлялось Участниками клиринга путем ввода Отчетов на исполнение или Специальных отчетов на исполнение;
- первым частям обеспеченных сделок РЕПО с кодом расчетов S0-S2, исполнение обязательств по которым осуществлялось Участниками клиринга путем ввода Отчетов на исполнение или Специальных отчетов на исполнение;
- вторым частям обеспеченных сделок РЕПО с любым кодом расчетов, исполнение обязательств по которым осуществлялось Участниками клиринга путем ввода Отчетов на исполнение или Специальных отчетов на исполнение;
- внесению компенсационных взносов;
- передаче Дохода;

прошедшим в течение Расчетного дня Процедуру контроля обеспечения (по соответствующей позиции депо);

- исполненным в Клиринговой системе распоряжениям на внесение ценных бумаг в Обеспечение, поданным / сформированным Участником клиринга / Клиринговым центром;
- исполненным в Клиринговой системе возвратам ценных бумаг из Обеспечения по Запросам Участника клиринга о возврате ценных бумаг из Обеспечения или по прекращенным обязательствам по Сделкам с частичным обеспечением;

- передаче и возврату ценных бумаг во исполнение Договоров займа Клирингового центра, заключенных в соответствии со статьей 46 Правил клиринга.

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

- 38.2.3. Нетто-обязательство (нетто-требование) Участника клиринга по ценным бумагам по сделкам клирингового пула по каждому его Разделу для учета ценных бумаг в Обеспечении и по каждой ценной бумаге рассчитывается по формуле:

**НОЦ = СТЦ - СОЦ**, где:

**НОЦ** - Нетто-обязательство (Нетто-требование) Участника клиринга по ценной бумаге по сделкам клирингового пула;

**СТЦ** - сумма требований, а **СОЦ** – сумма обязательств Участника клиринга по соответствующей ценной бумаге по:

- исполненным в Клиринговой системе распоряжениям на внесение ценных бумаг в Обеспечение, поданным / сформированным Участником клиринга / Клиринговым центром;
- исполненным в Клиринговой системе возвратам ценных бумаг из Обеспечения по Запросам Участника клиринга о возврате ценных бумаг из Обеспечения или по прекращенным обязательствам по Сделкам с частичным обеспечением.

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

- 38.3. Обязательства по спот-сделкам с кодом расчетов Z0 и первым частям сделок РЕПО с кодом расчетов Z0, прошедшим в этот Расчетный день Процедуру контроля обеспечения в соответствии с требованиями раздела V Правил клиринга, включаются в клиринговый пул для расчетов в ходе торгов. Обязательства и требования Участников клиринга по таким сделкам определяются в отношении каждой сделки в отдельности.

- 38.4. Нетто-обязательства (нетто-требования) Участников клиринга по денежным средствам и по ценным бумагам по сделкам клирингового пула, рассчитанные в соответствии с пунктом 34.2 Правил клиринга по сделкам с ценными бумагами с кодом расчетов B0-B30, первым частям сделок РЕПО с кодом расчетов S0-S2, вторым частям сделок РЕПО с кодами расчетов Rb, Z0, S0-S2, а также по компенсационным взносам, исполнение которых осуществлялось Участниками клиринга путем ввода Срочных отчетов на исполнение, прошедшим в этот Расчетный день Процедуру контроля обеспечения в соответствии с требованиями раздела V Правил клиринга, включаются в клиринговый пул для расчетов в ходе торгов.

- 38.5. Обязательства и требования Участников клиринга по сделкам, не прошедшим в соответствии с требованиями раздела V Правил клиринга Процедуру контроля

обеспечения, за исключением Сделок с частичным обеспечением, учитываются в Клиринговой системе вплоть до Даты прекращения исполнения таких сделок.

При этом, Участники клиринга, являющиеся сторонами по Необеспеченным сделкам, имеют возможность исполнить свои обязательства по таким сделкам путем регистрации в Клиринговой системе Отчетов на исполнение и/или Специальных отчетов на исполнение и/или Срочных отчетов на исполнение вплоть до Даты прекращения исполнения. С Даты прекращения исполнения обязательства Участников клиринга по Необеспеченным сделкам не подлежат исполнению в Клиринговой системе, Необеспеченные сделки исключаются из Клиринговой системы.

- 38.6. Исключение сделок из Клиринговой системы не влечет прекращение обязательств сторон по указанным сделкам. Требования о надлежащем исполнении таких сделок могут быть предъявлены любой из сторон в соответствии с гражданским законодательством при условии соблюдения порядка разрешения споров, предусмотренного Правилами клиринга и Правилами торговли.
- 38.7. Обязательства и требования Участников клиринга по внесению компенсационных взносов в соответствии с требованиями раздела V Правил клиринга учитываются в Клиринговой системе в дату внесения компенсационных взносов. С даты, следующей за Датой внесения компенсационных взносов, обязательства Участников клиринга по необеспеченным компенсационным взносам не подлежат исполнению в Клиринговой системе.

### **Статья 39. Порядок определения подлежащих исполнению обязательств Участников клиринга по уплате Комиссионного вознаграждения**

- 39.1. Определение и учет обязательств Участников клиринга по уплате Комиссионного вознаграждения осуществляется в Клиринговой системе в российских рублях в отдельности по каждому виду и получателю Комиссионного вознаграждения.
- 39.2. Обязательства Участников клиринга по уплате клиринговой комиссии определяются в соответствии с действующими Тарифами Клирингового центра (приложение № 1 к Правилам клиринга).
- 39.3. В случае нарушения Участниками клиринга порядка и сроков уплаты клиринговой комиссии Участник клиринга обязан уплатить Клиринговому центру неустойку в размере 2% (двух процентов), включая НДС, от суммы неуплаченной клиринговой комиссии за каждый день просрочки.
- 39.4. Обязательства Участников клиринга по уплате иных видов Комиссионного вознаграждения в пользу Клирингового центра и иных организаций по сделкам с ценными бумагами, включая неустойку за нарушение порядка и сроков его уплаты, определяются Клиринговым центром на основании внутренних документов и заключенных с Участниками клиринга договоров, а также на основании иных соответствующих договоров.
- 39.5. Размер обязательства Участников клиринга по уплате Комиссионного вознаграждения по биржевым сделкам РЕПО рассчитывается с учетом выбранного Участником клиринга тарифного плана.

- 39.6. Выбор тарифного плана осуществляется Участником клиринга путем предоставления Клиринговому центру Заявления о выборе (смене) тарифного плана по сделкам РЕПО.
- 39.7. Заявление о выборе (смене) тарифного плана по сделкам РЕПО предоставляется Участником клиринга на бумажном носителе по форме, предусмотренной пунктом 1.8 приложения № 6 к Правилам клиринга.
- Заявление о выборе (смене) тарифного плана по сделкам РЕПО предоставляется в Клиринговый центр не позднее, чем за 5 (пять) рабочих дней до первого числа месяца, начиная с которого будет действовать выбранный тарифный план.
- В случае непредоставления Участником клиринга Заявления о выборе (смене) тарифного плана по сделкам РЕПО до даты вступления в силу тарифов, содержащих указанные тарифные планы, Участнику клиринга устанавливается Тарифный план 1 «Базовый».
- В случае предоставления Участником клиринга Заявления о выборе (смене) тарифного плана по сделкам РЕПО, выбранный на основании такого заявления тарифный план действует до момента предоставления Участником клиринга нового Заявления о выборе (смене) тарифного плана или до отмены Клиринговым центром и иными организациями установленных тарифных планов.
- В случае выбора Участником клиринга тарифного плана по сделкам РЕПО, содержащего постоянную часть Комиссионного вознаграждения, такая постоянная часть Комиссионного вознаграждения подлежит уплате Участником клиринга в первый Расчетный день календарного месяца, за который взимается постоянная часть Комиссионного вознаграждения, и, по окончании Торгов в данный Расчетный день, включается в состав обязательств по уплате Комиссионного вознаграждения по позиции по денежным средствам, определяемой в отношении Счета Участника клиринга, порядок выбора которого установлен пунктами 9.7-9.9 Правил клиринга.
- Оборотная часть Комиссионного вознаграждения по биржевым сделкам РЕПО рассчитывается при подаче заявки на заключение сделки РЕПО, и на ее сумму уменьшается позиция по денежным средствам, с указанием которой подана заявка на заключение сделки РЕПО (за исключением сделок, заключаемых в иностранной валюте, и Сделок с частичным обеспечением).
- 39.8. Комиссионное вознаграждение по Сделкам с частичным обеспечением рассчитывается по окончании Торгов в каждый Расчетный день и включается в состав обязательств по уплате Комиссионного вознаграждения по позиции по денежным средствам, определяемой в отношении Счета Участника клиринга, порядок выбора которого установлен пунктами 9.7-9.9 Правил клиринга.
- 39.9. Комиссионное вознаграждение по внебиржевым сделкам рассчитывается по окончании Торгов в дату регистрации Поручения на клиринг внебиржевой сделки, и на сумму рассчитанного Комиссионного вознаграждения уменьшается позиция по денежным средствам, указанная в Поручении на клиринг внебиржевой сделки (за исключением внебиржевых сделок, заключаемых в иностранной валюте).
- 39.10. Абонентская плата, определенная в соответствии с внутренними документами Биржи, подлежит уплате Участником клиринга, являющимся Участником торгов

Биржи, в первый Расчетный день календарного квартала, следующего за кварталом, за который взимается абонентская плата, и, по окончании Торгов в данный Расчетный день, включается в состав обязательств по уплате Комиссионного вознаграждения по позиции по денежным средствам, определяемой в отношении Счета Участника клиринга, порядок выбора которого установлен пунктами 9.7-9.9 Правил клиринга.

В случае прекращения допуска Участника клиринга к участию в Торгах Биржи в течение квартала, абонентская плата взимается на следующий Расчетный день после прекращения допуска к участию в Торгах.

39.11. Плата за повторную выдачу отчетных документов, предусмотренных Правилами клиринга, по запросам Участников клиринга, подлежат уплате Участником клиринга в день повторной выдачи отчетных документов и, по окончании Торгов в данный Расчетный день, включается в состав обязательств по уплате Комиссионного вознаграждения по позиции по денежным средствам, определяемой в отношении Счета Участника клиринга, порядок выбора которого установлен пунктами 9.7-9.9 Правил клиринга.

39.12. Клиринговый центр осуществляет определение и учет обязательств Участника клиринга по уплате Комиссионного вознаграждения по сделкам в отношении каждой его позиции по денежным средствам, с использованием которой были заключены соответствующие сделки (за исключением сделок, заключаемых в иностранной валюте). Обязательства Участника клиринга по уплате Комиссионного вознаграждения по сделкам с ценными бумагами, заключенным им в иностранной валюте, определяются в отношении его денежной (дополнительной собственной денежной) позиции (в российских рублях по курсу Банка России на дату заключения соответствующих сделок).

39.13. Обязательства Участников клиринга по уплате Комиссионного вознаграждения по сделкам определяются в дату заключения биржевых сделок с ценными бумагами (в дату регистрации Поручений на клиринг внебиржевых сделок) и в эту же дату подлежат исполнению Участниками клиринга (удерживаются со Счетов Участников клиринга).

39.14. Участник клиринга вправе выбрать тарифный план «Размещения-фиксированный». Выбор тарифного плана «Размещения-фиксированный» осуществляется на основании Заявления о выборе тарифного плана «Размещения-фиксированный» предоставленного Участником клиринга по форме предусмотренной пунктом 1.12 приложения № 6 к Правилам клиринга.

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

Период действия тарифного плана «Размещения-фиксированный» составляет 4 (четыре) последовательных квартальных периода, начиная с первого числа квартального периода, указанного в заявлении.

В случае выбора Участником клиринга тарифного плана «Размещения-фиксированный» Участник клиринга уплачивает плату за право заключения

биржевых сделок купли-продажи, право получения клирингового обслуживания и право получения услуг ИТС по биржевым сделкам купли-продажи облигаций и/или еврооблигаций 2 (двух) эмитентов, указанных в Заявлении Участника клиринга о выборе тарифного плана «Размещения-фиксированный», в которых Участник клиринга будет являться продавцом при осуществлении размещения или доразмещения (отчуждения первичным владельцем) в режимах торгов Режим основных торгов, Размещение: адресные заявки и Размещение: аукцион, а также в которых Участник клиринга будет являться покупателем в режимах торгов Выкуп: адресные заявки, Выкуп: Аукцион, в пользу Биржи, Клирингового центра и Технического центра соответственно.

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

Плата по тарифному плану «Размещения-фиксированный» подлежит уплате Участником клиринга в первый Расчетный день квартального периода, и, по окончании Торгов в данный Расчетный день, включается в состав обязательств по уплате Комиссионного вознаграждения по позиции по денежным средствам, определяемой в отношении Счета Участника клиринга, порядок выбора которого установлен пунктами 9.7-9.9 Правил клиринга.

- 39.15. Определенное в соответствии с внутренними документами Технического центра, отличное от нуля дополнительное вознаграждение, рассчитанное в отношении Участника клиринга / Клиента Участника клиринга, подлежит уплате Участником клиринга в Расчетный день, по итогам которого указанное дополнительное вознаграждение рассчитано, и по окончании Торгов в данный Расчетный день, включается в состав обязательств по уплате Комиссионного вознаграждения по позиции по денежным средствам, входящей в состав Торгово-клирингового счета, с указанием которого Участником клиринга в течение данного Расчетного дня были заключены сделки за свой счет или за счет указанного Клиента, если такой Торгово-клиринговый счет – единственный, либо по позиции по денежным средствам, определяемой в отношении Счета Участника клиринга, порядок выбора которого установлен пунктами 9.7-9.9 Правил клиринга, если Участником клиринга в течение данного Расчетного дня сделки за свой счет или за счет указанного Клиента были заключены с указанием нескольких Торгово-клиринговых счетов.
- 39.16. Сумма неустойки, предусмотренной за неисполнение обязательств Участников клиринга по уплате Комиссионного вознаграждения, включается в общий размер соответствующего обязательства Участника клиринга по уплате Комиссионного вознаграждения.
- 39.17. Обязательства Участника клиринга по уплате Комиссионного вознаграждения исполняются после исполнения Нетто-обязательств Участника клиринга по денежным средствам, определенных в соответствии со статьей 38 Правил клиринга.
- 39.18. В случае недостаточности денежных средств на соответствующем Счете для исполнения обязательств Участника клиринга по уплате Комиссионного вознаграждения, указанные обязательства исполняются в следующей очередности:



- в первую очередь исполняются обязательства по уплате неустойки, начисленной в связи с неисполнением обязательств по уплате Комиссионного вознаграждения;
- во вторую очередь – обязательства по уплате Комиссионного вознаграждения, начисленного в предыдущие Расчетные дни;
- в третью очередь – обязательства по уплате Комиссионного вознаграждения, начисленного в текущий Расчетный день;

В случае недостаточности денежных средств на соответствующем Счете для исполнения обязательств Участника клиринга по уплате Комиссионного вознаграждения соответствующей очереди, обязательства, входящие в соответствующую очередь, исполняются с учетом следующих приоритетов по видам Комиссионного вознаграждения:

- 7) оборотная часть Комиссионного вознаграждения;
- 8) постоянная часть Комиссионного вознаграждения;
- 9) плата по тарифному плану «Размещения-фиксированный»;
- 10) абонентская плата;
- 11) дополнительное вознаграждение;
- 12) плата за повторную выдачу отчетных документов.
- 13) В случае недостаточности денежных средств на соответствующем Счете для исполнения обязательств Участника клиринга по уплате Комиссионного вознаграждения соответствующей очереди и соответствующего вида, обязательства по уплате соответствующего вида Комиссионного вознаграждения, входящие в соответствующую очередь, исполняются с учетом следующих приоритетов по получателям Комиссионного вознаграждения:
  - 14) Клиринговый центр;
  - 15) Биржа;
  - 16) Технический центр.

39.19. В случае недостаточности денежных средств на соответствующем Счете для исполнения обязательств Участника клиринга по уплате Комиссионного вознаграждения, сумма неисполненных обязательств по уплате Комиссионного вознаграждения, в том числе обязательств по уплате неустойки, на следующий Расчетный день включается в Клиринговой системе в соответствующий Ограничительный лимит по уплате комиссионного вознаграждения, устанавливаемый для данного Участника клиринга.

Ограничительные лимиты по уплате комиссионного вознаграждения устанавливаются в Клиринговой системе в отношении денежных позиций, клиентских денежных позиций, денежных позиций ДУ, дополнительных рублевых денежных позиций Участников клиринга.

Значение Ограничительного лимита по уплате комиссионного вознаграждения ежедневно определяется в размере соответствующих неисполненных обязательств Участника клиринга по уплате Комиссионного вознаграждения.

#### **Статья 40. Порядок определения подлежащих исполнению обязательств Участников клиринга по уплате Возмещения**

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

40.2. Обязательства и требования Участников клиринга по уплате Возмещения определяются в Клиринговой системе только по биржевым сделкам (сделкам РЕПО), неисполненным до Даты прекращения исполнения, по которым только одним из Участников клиринга нарушены требования Правил клиринга, повлекшим неисполнение обязательств по биржевой сделке с ценными бумагами в Дату исполнения.

Обязательства и требования Участников клиринга по уплате Возмещения определяются в Клиринговой системе в дату неисполнения этих сделок на основании информации о сделках с ценными бумагами, получаемой от Бирж, Правилами торговли которых предусмотрено удержание Возмещения по сделкам с ценными бумагами.

40.3. Обязательство Участника клиринга по уплате Возмещения подлежит исполнению начиная с Даты прекращения исполнения соответствующей биржевой сделки. При этом в Дату прекращения исполнения биржевой сделки с ценными бумагами величина обязательства по уплате Возмещения по этой сделке включается в Клиринговой системе в Ограничительный лимит по уплате возмещения для данного Участника клиринга.

Ограничительные лимиты по уплате возмещения устанавливаются в Клиринговой системе каждый Расчетный день (до начала формирования начальных значений позиций по денежным средствам) только в отношении денежных (дополнительных собственных денежных) позиций Участников клиринга.

Значение Ограничительного лимита по уплате возмещения ежедневно определяется в размере совокупных неисполненных обязательств соответствующего Участника клиринга по уплате Возмещения.

40.4. Учет обязательства Участника клиринга по уплате Возмещения может быть прекращен в Клиринговой системе (до удержания с этого Участника клиринга денежных средств в размере его обязательства по уплате Возмещения) на основании полученной информации об отказе от получения Переменного возмещения или Фиксированного возмещения, подлежащего уплате в соответствии с условиями заключенной биржевой сделки, в порядке, предусмотренном Правилами торговли и Правилами клиринга (в соответствии с требованиями пункта 19.5 Правил клиринга).

40.5. Обязательства Участника клиринга по уплате Возмещения исполняются после исполнения всех обязательств Участника клиринга по уплате Комиссионного вознаграждения, определенных в соответствии со статьей 39 Правил клиринга.

40.6. В случае недостаточности денежных средств на Счете для исполнения обязательств Участника клиринга по уплате Возмещения, величина этих обязательств на следующий Расчетный день включается в Клиринговой системе в

Ограничительный лимит по уплате возмещения, устанавливаемый для данного Участника клиринга.

**Статья 41. Порядок взаимодействия Клирингового центра с Расчетной организацией и Депозитарием при проведении расчетов по итогам клиринга**

- 41.1. Клиринговый центр формирует Сводную ведомость по обязательствам и требованиям по денежным средствам (реквизиты которой предусмотрены пунктом 2.2 приложения № 3 к Правилам клиринга), в которую включает обязательства и требования Участника клиринга по оплате ценных бумаг и Нетто-обязательства и Нетто-требования Участника клиринга и Клирингового центра по денежным средствам по сделкам клирингового пула, включенные или определенные на основании обязательств, включенных в клиринговый пул для расчетов в ходе торгов или в клиринговый пул для расчетов по итогам торгов.
- 41.2. Клиринговый центр формирует Сводную ведомость по обязательствам и требованиям по ценным бумагам (реквизиты которой предусмотрены пунктом 3.2 приложения № 3 к Правилам клиринга), в которую включает обязательства и требования Участника клиринга по передаче ценных бумаг и Нетто-обязательства и Нетто-требования Участника клиринга и Клирингового центра по ценным бумагам по сделкам клирингового пула, включенные или определенные на основании обязательств, включенных в клиринговый пул для расчетов в ходе торгов или в клиринговый пул для расчетов по итогам торгов.
- 41.3. Для проведения расчетов Клиринговый центр в период времени, указанный в приложении № 2 к Правилам клиринга, направляет Сводную ведомость по обязательствам и требованиям по денежным средствам Расчетной организации и Сводную ведомость по обязательствам и требованиям по ценным бумагам Депозитарию.
- 41.4. Расчетная организация осуществляет исполнение полученной от Клирингового центра Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по денежным средствам (списание и зачисление денежных средств в размере и по Счетам, указанным Клиринговым центром).
- 41.4.1. Исполнение Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по денежным средствам может осуществляться Расчетной организацией с использованием Клирингового счета (если это предусмотрено режимом использования этого счета и договором между Клиринговым центром и Расчетной организацией).
- 41.4.2. После исполнения Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по денежным средствам в период времени, указанный в приложении № 2 к Правилам клиринга, Расчетная организация направляет Клиринговому центру Отчет об исполнении Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по денежным средствам (реквизиты которого предусмотрены пунктом 2.2 приложения № 4 к Правилам клиринга).
- 41.5. Депозитарий осуществляет списание с Разделов / зачисление на Разделы ценных бумаг в соответствии с информацией, содержащейся в полученной от Клирингового центра Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по

ценным бумагам (списание и зачисление ценных бумаг осуществляется в размере и по Разделам, указанным Клиринговым центром).

- 41.5.1. Списание с Разделов / зачисление на Разделы ценных бумаг в соответствии с информацией, содержащейся в Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по ценным бумагам, может осуществляться в Депозитарии с использованием Клирингового счета депо (если это предусмотрено режимом использования этого счета депо и договором между Клиринговым центром и Депозитарием). В случае указания Клирингового счета депо в Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по ценным бумагам:
- отрицательное значение поля «количество ценных бумаг» по транзакции определяет Клиринговый счет депо, как счет зачисления;
  - положительное значение поля «количество ценных бумаг» по транзакции определяет Клиринговый счет депо, как счет списания.
- 41.5.2. После списания с Разделов / зачисления на Разделы ценных бумаг в соответствии с информацией, содержащейся в Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по ценным бумагам, в период времени, указанный в приложении № 2 к Правилам клиринга, Депозитарий направляет Клиринговому центру Отчет об исполнении Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по ценным бумагам (реквизиты которого предусмотрены пунктом 3.1 приложения № 4 к Правилам клиринга).
- 41.6. При получении от Расчетной организации Отчета об исполнении Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по денежным средствам, Клиринговый центр осуществляет процедуру сверки реквизитов данного Отчета с реквизитами соответствующей Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по денежным средствам.
- При получении от Депозитария Отчета об исполнении Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по ценным бумагам, Клиринговый центр осуществляет процедуру сверки реквизитов данного Отчета с реквизитами соответствующей Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по ценным бумагам.
- 41.7. После окончания процедуры сверок, предусмотренных в пункте 41.6 Правил клиринга, и в случае отсутствия каких-либо расхождений:
- обязательства Участников клиринга и Клирингового центра по оплате и передаче ценных бумаг (по сделкам с ценными бумагами), включая обязательства по внесению компенсационных взносов (для проведения расчетов по которым были сформированы Сводная ведомость по обязательствам и требованиям по денежным средствам и Сводная ведомость по обязательствам и требованиям по ценным бумагам), считаются исполненными;
  - расчеты считаются завершенными.
- 41.8. В случае невозможности исполнения полученной от Клирингового центра Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по денежным средствам, Расчетная организация направляет Клиринговому центру Отчет о неисполнении Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по денежным средствам (реквизиты которого предусмотрены пунктом 2.2 приложения № 4 к Правилам клиринга). При

этом Клиринговый центр вправе повторно сформировать и направить Расчетной организации новую Сводную ведомость по обязательствам и требованиям по денежным средствам и/или признать ситуацию чрезвычайной в соответствии со статьей 49 Правил клиринга.

41.8.1. В случае невозможности исполнения списаний с Разделов / зачислений на Разделы ценных бумаг в соответствии с информацией, содержащейся в полученной от Клирингового центра Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по ценным бумагам, Депозитарий направляет Клиринговому центру Отчет о неисполнении Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по ценным бумагам (реквизиты которого предусмотрены пунктом 3.1 приложения № 4 к Правилам клиринга). При этом Клиринговый центр вправе повторно сформировать и направить Депозитарию новую Сводную ведомость по обязательствам и требованиям по ценным бумагам и/или признать ситуацию чрезвычайной в соответствии со статьей 49 Правил клиринга.

41.9. До момента завершения расчетов по сделкам, обязательства по которым включены в клиринговый пул для расчетов по итогам торгов (в случае обнаружения расхождения данных при осуществлении процедуры сверок, предусмотренных пунктом 41.6 Правил клиринга и/или в случае получения от Расчетной организации Отчета о неисполнении Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по денежным средствам и/или в случае получения от Депозитария Отчета о неисполнении Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по ценным бумагам), Клиринговый центр вправе:

- запросить у Депозитария новый Отчет об исполнении Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по ценным бумагам и/или у Расчетной организации - новый Отчет об исполнении Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по денежным средствам

или

- направить Расчетной организации Распоряжение на отмену Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по денежным средствам (реквизиты которого предусмотрены пунктом 2.2 приложения № 3 к Правилам клиринга) и/или в Депозитарий Распоряжение на отмену Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по ценным бумагам (реквизиты которого предусмотрены пунктом 3.2 приложения № 3 к Правилам клиринга).

В последнем случае Клиринговый центр вправе после получения от Расчетной организации Отчета об исполнении распоряжения на отмену Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по денежным средствам (реквизиты которого предусмотрены пунктом 2.2 приложения № 3 к Правилам клиринга) и/или от Депозитария Отчета об исполнении распоряжения на отмену Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по ценным бумагам (реквизиты которого предусмотрены пунктом 3.1 приложения № 3 к Правилам клиринга) повторно сформировать и направить, соответственно, в Расчетную организацию - новую Сводную ведомость по обязательствам и требованиям по денежным средствам и/или в Депозитарий - новую Сводную ведомость по обязательствам и требованиям по ценным бумагам.

41.9.1. В случае невозможности исключить расхождение данных после проведения вышеуказанных действий Клиринговый центр вправе признать ситуацию чрезвычайной в соответствии со статьей 49 Правил клиринга.

41.10. До момента завершения расчетов по сделкам, обязательства по которым включены в клиринговый пул для расчетов в ходе торгов (в случае обнаружения расхождения данных при осуществлении процедуры сверок, предусмотренных пунктом 41.6 Правил клиринга и/или в случае получения от Расчетной организации Отчета о неисполнении Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по денежным средствам и/или в случае получения от Депозитария Отчета о неисполнении Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по ценным бумагам), Клиринговый центр вправе:

- запросить у Депозитария новый Отчет об исполнении Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по ценным бумагам и/или у Расчетной организации - новый Отчет об исполнении Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по денежным средствам

или

- повторно сформировать и направить, соответственно, Расчетной организации - новую Сводную ведомость по обязательствам и требованиям по денежным средствам и/или Депозитарию - новую Сводную ведомость по обязательствам и требованиям по ценным бумагам

или

- направить Расчетной организации Распоряжения на отмену сводной ведомости по обязательствам и требованиям по денежным средствам, и/или Депозитарию - Распоряжение на отмену Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по ценным бумагам.

В последнем случае Клиринговый центр вправе признать ситуацию чрезвычайной в соответствии со статьей 49 Правил клиринга.

41.11. В период времени, указанный в приложении № 2 к Правилам клиринга, Клиринговый центр передает Расчетной организации Распоряжение на разблокировку денежных средств на Счетах (реквизиты которого предусмотрены пунктом 2.2 приложения № 3 к Правилам клиринга), а также передает в Депозитарий Распоряжение на разблокировку Разделов и ценных бумаг, находящихся на Разделах (реквизиты которого предусмотрены пунктом 3.2 приложения № 3 к Правилам клиринга).

После получения от Клирингового центра вышеуказанных распоряжений, Расчетная организация осуществляет разблокировку денежных средств на соответствующих Счетах, а Депозитарий осуществляет разблокировку ценных бумаг на соответствующих Разделах.

41.12. В случае выявленной при проведении расчетов недостаточности у Участника клиринга денежных средств для исполнения его обязательств по сделке(ам) с ценными бумагами, прошедшей(им) в Клиринговой системе процедуру контроля обеспечения, Правление Клирингового центра вправе признать ситуацию чрезвычайной в соответствии со статьей 49 Правил клиринга. При этом, Наблюдательный совет Клирингового центра вправе принять решение об использовании средств Гарантийного фонда в сумме, необходимой для проведения расчетов.

41.13. В случае выявления при проведении расчетов недостаточности у Участника клиринга ценных бумаг для исполнения его обязательств по сделке(ам) с ценными

бумагами, прошедшей(им) в Клиринговой системе процедуру контроля обеспечения, Правление Клирингового центра вправе признать ситуацию чрезвычайной в соответствии со статьей 49 Правил клиринга.

#### **Статья 42. Порядок удержания Комиссионного вознаграждения**

- 42.1. В Клиринговой системе формируется Ведомость по уплате комиссионного вознаграждения (реквизиты которой предусмотрены пунктом 2.2 приложения № 3 к Правилам клиринга).
- 42.2. Для удержания Комиссионного вознаграждения со Счетов Участников клиринга Клиринговый центр в период времени, указанный в приложении № 2 к Правилам клиринга, передает Расчетной организации Ведомость по уплате комиссионного вознаграждения.
- 42.3. Расчетная организация осуществляет исполнение полученной от Клирингового центра Ведомости по уплате комиссионного вознаграждения (списание денежных средств в размерах и со Счетов Участников клиринга, указанных Клиринговым центром).
- 42.4. Комиссионное вознаграждение, а также неустойка, начисляемая в связи с неисполнением обязательств по уплате этого Комиссионного вознаграждения, списываются с тех же Счетов Участников клиринга, денежные средства на которых учитывались при прохождении соответствующей сделкой Процедуры контроля обеспечения (за исключением постоянной части Комиссионного вознаграждения по биржевым сделкам РЕПО, абонентской платы, платы за повторную выдачу отчетных документов, платы по тарифному плану «Размещения-фиксированный» и дополнительного вознаграждения, предусмотренных Правилами клиринга, по запросам Участников клиринга).
- Постоянная часть Комиссионного вознаграждения по биржевым сделкам РЕПО, абонентская плата, плата за повторную выдачу отчетных документов, предусмотренных Правилами клиринга, по запросам Участников клиринга, плата по тарифному плану «Размещения-фиксированный» и дополнительное вознаграждение, а также неустойка, начисляемая в связи с неисполнением обязательств по уплате этих Комиссионных вознаграждений, списывается со Счета Участника клиринга, определяемого в соответствии с пунктами 9.7-9.9 Правил клиринга.
- 42.5. После исполнения Ведомости по уплате комиссионного вознаграждения в период времени, указанный в приложении № 2 к Правилам клиринга, Расчетная организация передает Клиринговому центру Отчет об исполнении Ведомости по уплате комиссионного вознаграждения (реквизиты которого предусмотрены пунктом 2.2 приложения № 4 к Правилам клиринга).
- 42.6. В случае невозможности исполнения полученной от Клирингового центра Ведомости по уплате комиссионного вознаграждения, Расчетная организация передает Клиринговому центру Отчет о неисполнении Ведомости по уплате комиссионного вознаграждения (реквизиты которого предусмотрены пунктом 2.2 приложения № 4 к Правилам клиринга). При этом Клиринговый центр вправе

повторно сформировать и направить Расчетной организации новую Ведомость по уплате комиссионного вознаграждения.

- 42.7. До момента передачи Расчетной организации Распоряжения на разблокировку денежных средств на Счетах Клиринговый центр вправе направить Расчетной организации Распоряжение на отмену Ведомости по уплате комиссионного вознаграждения (реквизиты которого предусмотрены пунктом 2.2 приложения № 3 к Правилам клиринга). В этом случае Клиринговый центр вправе после получения от Расчетной организации Отчета об исполнении распоряжения на отмену Ведомости по уплате комиссионного вознаграждения (реквизиты которого предусмотрены пунктом 2.2 приложения № 3 к Правилам клиринга) повторно сформировать и направить Расчетной организации новую Ведомость по уплате комиссионного вознаграждения.

### **Статья 43. Порядок удержания Возмещения**

- 43.1. В Клиринговой системе формируется Ведомость по уплате возмещения (реквизиты которой предусмотрены пунктом 2.2 приложения № 3 к Правилам клиринга).
- 43.2. Для удержания Возмещения со Счетов Участников клиринга Клиринговый центр в период времени, указанный в приложении № 2 к Правилам клиринга, передает Расчетной организации Ведомость по уплате возмещения.
- 43.3. Расчетная организация осуществляет исполнение полученной от Клирингового центра Ведомости по уплате возмещения (списание денежных средств в размерах и со Счетов Участников клиринга, указанных Клиринговым центром).
- 43.3.1. Возмещение по биржевой сделке с ценными бумагами удерживается путем списания денежных средств (в размере соответствующего обязательства по уплате Возмещения) с торгового счета Участника клиринга (торгового счета Клирингового банка, в отношении которого установлена дополнительная собственная денежная позиция Участника клиринга) и зачисления этих денежных средств на торговый счет Участника клиринга – контрагента по этой сделке.
- 43.3.2. Возмещение по биржевым сделкам с ценными бумагами удерживается с Участников клиринга в порядке возрастания номеров сделок.
- 43.3.3. Возмещение по биржевой сделке с ценными бумагами может быть удержано только в полном объеме, частичное удержание Возмещения по биржевой сделке не допускается.
- 43.4. После исполнения Ведомости по уплате возмещения в период времени, указанный в приложении № 2 к Правилам клиринга, Расчетная организация передает Клиринговому центру Отчет об исполнении Ведомости по уплате возмещения (реквизиты которого предусмотрены пунктом 2.2 приложения № 4 к Правилам клиринга).
- 43.5. В случае невозможности исполнения полученной от Клирингового центра Ведомости по уплате возмещения, Расчетная организация передает Клиринговому центру Отчет о неисполнении Ведомости по уплате возмещения (реквизиты которого предусмотрены пунктом 2.2 приложения № 4 к Правилам клиринга). При



этом Клиринговый центр вправе повторно сформировать и направить Расчетной организации новую Ведомость по уплате возмещения.

- 43.6. До момента передачи Расчетной организации Распоряжения на разблокировку денежных средств на Счетах Клиринговый центр вправе направить Расчетной организации Распоряжение на отмену Ведомости по уплате возмещения (реквизиты которого предусмотрены пунктом 2.2 приложения № 3 к Правилам клиринга). В этом случае Клиринговый центр вправе после получения от Расчетной организации Отчета об исполнении распоряжения на отмену Ведомости по уплате возмещения (реквизиты которого предусмотрены пунктом 2.2 приложения № 3 к Правилам клиринга) повторно сформировать и направить Расчетной организации новую Ведомость по уплате возмещения.

#### **Статья 44. Порядок представления Участникам клиринга отчетных документов и иных отчетов по итогам клиринга**

- 44.1. В Клиринговой системе формируются следующие отчетные документы для Участников клиринга:
- Выписка из реестра сделок, принятых в клиринг (реквизиты которой предусмотрены пунктом 1.1 приложения № 3 к Правилам клиринга);
  - Отчет по обязательствам и требованиям Участника клиринга по денежным средствам и ценным бумагам (реквизиты которого предусмотрены пунктом 1.2 приложения № 3 к Правилам клиринга);
  - Выписка из реестра неисполненных сделок (реквизиты которой предусмотрены пунктом 1.3 приложения № 3 к Правилам клиринга);
  - Выписка из протокола исполнения сделок и обязательств по внесению компенсационных взносов (реквизиты которой предусмотрены пунктом 1.4 приложения № 3 к Правилам клиринга);
  - Отчет по обязательствам Участника клиринга по комиссионному вознаграждению (реквизиты которого предусмотрены пунктом 1.5 приложения № 3 к Правилам клиринга);
  - Отчет о торгово-клиринговых счетах и иных реквизитах Участника клиринга (реквизиты которого предусмотрены пунктом 1.6 приложения № 3 к Правилам клиринга);
  - Выписка из протокола внесения компенсационных взносов (реквизиты которой предусмотрены пунктом 1.7 приложения № 3 к Правилам клиринга);
  - Уведомление о замене Торгово-клирингового счета (реквизиты которого предусмотрены пунктом 1.9 приложения № 3 к Правилам клиринга);
  - Отчет об обязательствах по Сделкам с частичным обеспечением (реквизиты которого предусмотрены пунктом 1.10 приложения № 3 к Правилам клиринга);
  - Отчет об Итоговых нетто-обязательствах / нетто-требованиях (реквизиты которого предусмотрены пунктом 1.11 приложения № 3 к Правилам клиринга);
  - Отчет об Обеспечении (реквизиты которого предусмотрены пунктом 1.12 приложения № 3 к Правилам клиринга);

- Требование о погашении Задолженности (реквизиты которого предусмотрены пунктом 1.13 приложения № 3 к Правилам клиринга);
- Отчет о Маржинальном требовании (реквизиты которого предусмотрены пунктом 1.14 приложения № 3 к Правилам клиринга);
- Отчет об обязательствах / требованиях по передаче Дохода (реквизиты которого предусмотрены пунктом 1.15 приложения № 3 к Правилам клиринга);
- Отчет об исполнении обязательств / требований по передаче Дохода (реквизиты которого предусмотрены пунктом 1.16 приложения № 3 к Правилам клиринга).

Указанные в настоящем пункте отчетные документы Клиринговый центр направляет Участникам клиринга и/или уполномоченным ими организациям.

- 44.2. В Клиринговой системе для клиентов Участников клиринга формируется Выписка из реестра сделок, принятых в клиринг (по сделкам клиентов) (реквизиты которой предусмотрены пунктом 1.1 приложения № 3 к Правилам клиринга).

Указанный в настоящем пункте отчетный документ Клиринговый центр направляет Участникам клиринга (для передачи их клиентам) и/или уполномоченным ими организациям.

В Клиринговой системе для Держателей формируется Отчет о дополнительных торговых разделах, открытых для проведения операций Участниками клиринга, и иных реквизитах (реквизиты которого предусмотрены пунктом 1.8 приложения № 3 к Правилам клиринга).

Указанный в настоящем пункте отчетный документ Клиринговый центр направляет Держателям и/или уполномоченным ими организациям.

- 44.3. В случае предоставления Участником клиринга Клиринговому центру заявления по форме, предусмотренной пунктом 1.10 приложения № 6 к Правилам клиринга, в Клиринговой системе для Держателя, указанного в заявлении, формируется Выписка из реестра сделок, принятых в клиринг (для Держателей), содержащая информацию о сделках, заключенных с указанием Торгово-клиринговых счетов, в состав которых входят позиции по ценным бумагам, определяемые в отношении Разделов Держателя (реквизиты выписки предусмотрены пунктом 1.1 приложения № 3 к Правилам клиринга).

Указанный в настоящем пункте отчетный документ Клиринговый центр направляет Держателю и/или уполномоченной им организации.

- 44.4. В случае предоставления Участником клиринга Клиринговому центру заявления по форме, предусмотренной пунктом 1.11 приложения № 6 к Правилам клиринга, в Клиринговой системе для Клирингового банка, указанного в заявлении, формируется Выписка из реестра сделок, принятых в клиринг (для Клиринговых банков), содержащая информацию о сделках, заключенных с указанием Торгово-клиринговых счетов, в состав которых входят позиции по денежным средствам, определяемые в отношении Счетов Клирингового банка (реквизиты выписки предусмотрены пунктом 1.1 приложения № 3 к Правилам клиринга).

Указанный в настоящем пункте отчетный документ Клиринговый центр направляет Клиринговому банку.

- 44.5. Отчетные документы, указанные в пунктах 44.1 и 44.2 Правил клиринга, направляются Участнику клиринга (Держателю, Клиринговому банку) в форме электронных документов в соответствии с Порядком ЭДО.
- 44.6. Отчетные документы, направляемые в форме электронных документов, имеют категорию «В»<sup>3</sup> и составляются в текстовом формате (ASCII) в соответствии с Порядком ЭДО.
- 44.7. Отчетные документы в форме электронных документов направляются Участнику клиринга / Держателю / Клиринговому банку ежедневно при условии совершения им (по его поручению / с использованием его Разделов (Счетов)) операций в Клиринговой системе.
- Отчет о торгово-клиринговых счетах и иных реквизитах Участника клиринга и Отчет о дополнительных торговых разделах, открытых для проведения операций Участниками клиринга направляются, соответственно, Участнику клиринга и Держателю дополнительно каждый первый Расчетный день месяца.
- 44.8. Участнику клиринга на основании его письменного запроса могут быть выданы повторно отчетные документы в бумажной форме или в форме электронных документов, а также отчетные документы, не предусмотренные пунктами 44.1 и 44.2 Правил клиринга (далее - нестандартные отчетные документы), в бумажной форме.
- 44.9. Для получения в бумажной форме отчетных документов, указанных в пункте 44.8 Правил клиринга, Участник клиринга обязан предоставить Клиринговому центру доверенность на предоставление и получение документов от его имени (по форме, предусмотренной пунктом 1.3 приложения № 6 к Правилам клиринга).
- 44.10. Отчетные документы в бумажной форме или в форме электронных документов, указанные в пункте 44.8 Правил клиринга, а также нестандартные отчетные документы в бумажной форме предоставляются/направляются Участникам клиринга в течение 5-ти рабочих дней, начиная с Расчетного дня, следующего за днем оплаты Участником клиринга выставленного Клиринговым центром счета в соответствии с Тарифами Клирингового центра, предусмотренными приложением № 1 к Правилам клиринга.
- 44.11. В случае обнаружения Клиринговым центром или Участником клиринга ошибок в ранее отправленных Участнику клиринга отчетных документах (в форме электронных документов) Участнику клиринга отправляются скорректированные отчетные документы (в форме электронных документов).
- Надлежаще представленным отчетным документом будет являться отчетный документ, направленный Клиринговым центром Участнику клиринга последним по времени.

---

<sup>3</sup> Понятие категории электронного документа определяется в Правилах ЭДО

- 44.12. В Клиринговой системе дополнительно к отчетным документам, указанным в пункте 44.1 Правил клиринга, формируются следующие отчеты по итогам клиринга для Участников клиринга:
- Отчет Участнику клиринга по итогам клиринга по собственным сделкам Участника клиринга и сделкам его клиентов;
  - Отчет клиенту Участника клиринга по итогам клиринга по сделкам клиента.
- 44.13. Отчеты, указанные в пункте 44.12 настоящего раздела, содержат следующие сведения:
- перечень сделок, по которым осуществлен клиринг, с указанием на исполнение либо неисполнение (с указанием причины неисполнения) каждой из сделок;
  - объем обязательств и требований по итогам клиринга по каждому Счету и/или Разделу Участника клиринга и (или) его клиента;
  - дату и время исполнения указанных обязательств.
- 44.14. Сведения, содержащиеся в отчетах, указанных в пункте 44.12 Правил клиринга, включаются в отчетные документы, формируемые для Участников клиринга в соответствии с пунктами 44.1 и 44.2 Правил клиринга.
- 44.15. В случае обнаружения ошибок в предоставленных Участнику клиринга отчетах, указанных в пункте 44.12 Правил клиринга, Клиринговый центр информирует об этом Участника клиринга средствами Клиринговой системы.

#### **Статья 45. Порядок формирования реестров Клирингового центра**

- 45.1. В Клиринговой системе ведется база данных, в которую каждый Расчетный день заносится информация, требуемая для формирования и ведения следующих реестров Клирингового центра:
- Реестр Участников клиринга;
  - Реестр клиентов Участников клиринга;
  - Реестр остатков ценных бумаг, размещенных на Разделах в Депозитарии;
  - Реестр остатков денежных средств, размещенных на Счетах в Расчетной организации;
  - Реестр сделок, по которым осуществлен клиринг;
  - Реестр принятых поручений;
  - Реестр поручений, направленных в Расчетную организацию и в Депозитарий;
  - Реестр отчетных документов, направленных Участникам клиринга и их клиентам.

Реестры Клирингового центра ведутся в электронной форме. Изменения и дополнения в эти реестры вносятся каждый Расчетный день на основании данных, получаемых от Участников клиринга, Бирж, Расчетной организации и Депозитария.

**Статья 46. Условия Договора займа Клирингового центра, порядок его заключения и исполнения**

- 46.1. Предметом Договора займа Клирингового центра могут являться ценные бумаги, включенные в Клиринговый лист для Сделок с частичным обеспечением (далее в настоящей статье – Ценные бумаги).
- 46.2. Займодавцем по Договору займа Клирингового центра является Участник клиринга, заемщиком - Клиринговый центр.
- 46.3. Клиринговый центр вправе заключить Договор займа Клирингового центра с любым Участником клиринга, внесшим взнос в Коллективный фонд, с использованием любого Торгово-клирингового счета такого Участника клиринга, в состав которого входит торговый раздел счета депо владельца Участника клиринга в Депозитарии.
- 46.4. Для предоставления Клиринговому центру возможности заключения Договоров займа Клирингового центра с иными Участниками клиринга с использованием их Торгово-клиринговых счетов, в состав которых входит торговый раздел счета депо владельца Участника клиринга в Депозитарии, и/или с использованием Торгово-клирингового счета Участника клиринга, в состав которого входит торговый раздел корреспондентского счета депо Участника клиринга в Депозитарии, Участник клиринга предоставляет Клиринговому центру заявление на бумажном носителе по форме, предусмотренной пунктом 1.17 приложения № 6 к Правилам клиринга
- Участник клиринга, предоставляя указанное заявление Клиринговому центру, гарантирует Клиринговому центру, что он обладает всеми необходимыми поручениями и полномочиями на заключение Договоров займа Клирингового центра в отношении ценных бумаг, учитываемых на торговом разделе, указанном в заявлении.
- 46.5. Выбор Участника клиринга, с которым, в случае необходимости, заключается Договор займа Клирингового центра, и выбор Торгово-клирингового счета Участника клиринга, с использованием которого будет заключен Договор займа Клирингового центра, осуществляется Клиринговым центром.
- 46.6. Условия Договора займа Клирингового центра:
- 5) в дату заключения Договора займа Участник клиринга (займодавец) обязан передать Клиринговому центру (заемщику) Ценные бумаги;
  - 6) в Расчетный день, следующий за датой заключения Договора займа Клирингового центра, Клиринговый центр обязан вернуть Участнику клиринга Ценные бумаги, полученные по Договору займа Клирингового центра, и уплатить проценты по Договору займа Клирингового центра, рассчитанные как произведение Ставки по Договорам займа Клирингового центра, установленной Клиринговым центром на дату заключения Договора займа Клирингового центра, количества Ценных бумаг, переданных по Договору займа Клирингового центра, количества календарных дней с даты заключения Договора займа Клирингового центра до следующего Расчетного дня, и последней Расчетной цены Ценных бумаг, определенной в соответствии с Методикой определения риск-параметров рынка ценных бумаг;

- 7) Ставка по Договорам займа Клирингового центра устанавливается в процентах годовых, с базой равной 365 дням. Информация о Ставке по Договорам займа Клирингового центра публикуется на Сайте Клирингового центра. Ставка по заключенным Договорам займа Клирингового центра не может быть изменена;
  - 8) в случае если на дату заключения Договора займа Клирингового центра приходится дата составления списка лиц, имеющих право на получение дивидендов, процентов и иного распределения по Ценным бумагам (далее – Доход), Клиринговый центр обязан передать Доход Участнику клиринга. Порядок и сроки передачи Дохода в форме денежных средств, а также сумма Дохода, подлежащая передаче, определяются со статьей 47 Правил клиринга. Иной Доход Клиринговый центр передает Участнику клиринга в течение десяти операционных дней, следующих за днем получения Клиринговым центром такого Дохода.
- 46.7. Клиринговый центр заключает Договоры займа Клирингового центра в случае недостаточности у него ценных бумаг для исполнения Итоговых нетто-требований Добросовестных участников клиринга с Участниками клиринга и с использованием Торгово-клиринговых счетов, указанных в пункте 46.3 Правил клиринга, или с Участниками клиринга, предоставившими заявление, указанное в пункте 46.4 Правил клиринга, с использованием Торгово-клиринговых счетов, указанных в данном заявлении, при условии, что на торговом разделе, входящем в состав такого Торгово-клирингового счета, учитываются недостающие у Клирингового центра ценные бумаги.
- 46.8. Договоры займа Клирингового центра заключаются без подачи заявок.
- 46.9. Обязательства по передаче и возврату Ценных бумаг во исполнение Договора займа Клирингового центра включаются в клиринговый пул для расчетов по итогам торгов в Дату их исполнения и учитываются при определении Нетто-обязательств / Нетто-требований Участников клиринга по ценным бумагам по сделкам клирингового пула в соответствии со статьей 38 Правил клиринга.
- 46.10. Обязательство Клирингового центра по уплате Участнику клиринга процентов по Договору займа Клирингового центра включается в клиринговый пул для расчетов по итогам торгов в Дату их исполнения и учитываются при определении Нетто-обязательств / Нетто-требований Участников клиринга по денежным средствам по сделкам клирингового пула в соответствии со статьей 38 Правил клиринга.
- 46.11. В дату заключения Договора займа Клирингового центра информация о заключенном Договоре займа Клирингового центра включается в Выписку из реестра сделок, принятых в клиринг (реквизиты которого предусмотрены пунктом 1.1 приложения № 3 к Правилам клиринга), предоставляемую Участнику клиринга в соответствии со статьей 44 Правил клиринга. Указанный отчет является документом, удостоверяющим передачу Участником клиринга Клиринговому центру Ценных бумаг.

## Статья 47. Порядок передачи Доходов по сделкам, заключенным с Клиринговым центром

47.1. Клиринговый центр определяет размер обязательств по ценным бумагам, определяемый с целью передачи Дохода, как разницу между определяемой в отношении позиции депо Участника клиринга суммой требований и суммой обязательств Участника клиринга по ценным бумагам, по которым принято решение о выплате Дохода, по неисполненным на дату составления списка лиц, имеющих право на получение Дохода, сделкам РЕПО, заключенным с Клиринговым центром, и Договорам займа Клирингового центра. Для сделок РЕПО под неисполненными сделками понимаются неисполненные вторые части сделок РЕПО.

47.2. Если размер обязательства по ценным бумагам, определяемый с целью передачи Дохода, определенный в соответствии с пунктом 47.1 Правил клиринга в отношении позиции депо Участника клиринга, отрицательный, такой Участник клиринга обязан передать Доход Клиринговому центру в течение 10 (десяти) рабочих дней после даты раскрытия эмитентом ценных бумаг информации о факте исполнения (полностью или частично) своих обязательств по выплате Дохода.

Если Размер обязательства по ценным бумагам, определяемый с целью передачи Дохода, определенный в соответствии с пунктом 47.1 Правил клиринга в отношении позиции депо Участника клиринга, положительный, Клиринговый центр обязан передать такому Участнику клиринга Доход в течение 15 (пятнадцати) рабочих дней после раскрытия эмитентом ценных бумаг информации о факте исполнения (полностью или частично) своих обязательств по выплате Дохода.

47.3. Для сделок с акциями размер обязательства по передаче Дохода в форме денежных средств рассчитывается по формуле:

$Inc = N \times d \times 0.91$ , где	
Inc	размер обязательства по передаче Дохода (в рублях Российской Федерации);
N	абсолютное значение размера обязательства по ценным бумагам, определяемого с целью передачи Дохода, определенное в отношении позиции депо Участника клиринга;
d	сумма начисления на одну акцию, установленная эмитентом ценных бумаг (в рублях Российской Федерации).

В случае выплаты Дохода ценными бумагами, размер обязательства по передаче Дохода в форме ценных бумаг рассчитывается по формуле:

$Inc = N \times d$ , где	
Inc	размер обязательства по передаче Дохода (в штуках);
N	абсолютное значение размера обязательства по ценным бумагам, определяемого с целью передачи Дохода, определенное в отношении позиции депо Участника клиринга;
d	количество ценных бумаг передаваемых эмитентом на одну акцию, установленное эмитентом ценных бумаг (в штуках).

47.4. Для сделок с облигациями размер обязательства по передаче Дохода в форме денежных средств рассчитывается по формуле:

Inc = N × (d + m), где	
Inc	размер обязательства по передаче Дохода (в рублях Российской Федерации);
N	абсолютное значение размера обязательства по ценным бумагам, определяемого с целью передачи Дохода, определенное в отношении позиции депо Участника клиринга;
d	размер начисленного купона на одну облигацию, установленный эмитентом ценных бумаг (в рублях Российской Федерации);
m	сумма погашения части основного долга.

47.5. В течение одного рабочего дня после раскрытия эмитентом ценных бумаг информации о факте исполнения (полностью или частично) своих обязательств по выплате Дохода, на основании информации о сделках РЕПО, заключенных с Клиринговым центром, и Договорах займа Клирингового центра, не исполненных на дату составления списка лиц, имеющих право на получение Дохода, в Клиринговой системе для каждого Участника клиринга, имеющего обязательства и/или требования по передаче Дохода, формируются Поручения на передачу Дохода.

Для Участников клиринга, имеющих обязательства и/или требования по передаче Дохода, формируется и направляется Отчет об обязательствах/требованиях по передаче Дохода в форме электронного документа (реквизиты которого предусмотрены пунктом 1.15 приложения № 3 к Правилам клиринга).

47.6. Участник клиринга, имеющий обязательство по передаче Дохода, обязан подтвердить свои Поручения на передачу Дохода до истечения срока исполнения обязательства по передаче Дохода, указанного в пункте 47.2 Правил клиринга.

Клиринговый центр, имеющий обязательство по передаче Дохода Участникам клиринга, обязан подтвердить соответствующие Поручения на передачу Дохода до истечения срока исполнения обязательства по передаче Дохода, указанного в пункте 47.2 Правил клиринга.

47.6.1. Клиринговый центр передает Доход Участнику клиринга, имеющему требование по получению Дохода в отношении одной или нескольких своих позиций депо, в случае, если данный Участник клиринга не имеет не исполненных в установленных срок (просроченных) обязательств по передаче Дохода перед Клиринговым центром в отношении другой (других) своих позиций депо.

47.7. Подтверждения Поручений на передачу Дохода направляются с использованием Клиринговой системы (реквизиты Подтверждения Поручения на передачу Дохода предусмотрены пунктом 1.10 приложения № 4 к Правилам клиринга).

47.7.1. При подтверждении Поручения на передачу Дохода осуществляется Процедура контроля обеспечения, в случае ее прохождения обязательства по передаче Дохода включаются в клиринговый пул для расчетов по итогам торгов и учитываются при определении Нетто-обязательств / Нетто-требований Участников клиринга по денежным средствам / ценным бумагам по сделкам клирингового пула в соответствии со статьей 38 Правил клиринга.

47.8. По итогам исполнения обязательств по передаче Дохода Участникам клиринга в форме электронных документов направляются отчеты, содержащие информацию



об исполнении обязательств/требований по передаче Дохода (реквизиты которых предусмотрены пунктом 1.16 приложения № 3 к Правилам клиринга).

47.9. В случае просрочки исполнения Участником клиринга обязательств по передаче Дохода, указанный Участник клиринга обязан уплатить Клиринговому центру пеню в размере удвоенной ставки рефинансирования Банка России, установленной на день начисления пени, от суммы неисполненного обязательства по передаче Дохода за каждый календарный день с даты истечения срока передачи Дохода до даты исполнения обязательства по передаче Дохода, но не менее 300 (трехсот) рублей.

Уплата пени осуществляется на основании счета, выставяемого Клиринговым центром.

47.10. В случае неисполнения Участником клиринга обязательства по передаче Дохода в срок, указанный в пункте 47.2 Правил клиринга, Клиринговый центр вправе удержать Доход в форме денежных средств из Обеспечения Участника клиринга в денежных средствах, а в случае их недостаточности - из вноса такого Участника клиринга в Коллективный фонд, и/или удержать Доход в форме ценных бумаг из Обеспечения Участника клиринга в ценных бумагах.

#### **Статья 48. Взаимодействие с Биржей при возникновении обстоятельств, которые могут повлиять на возможность проведения Торгов**

48.1. В случае возникновения обстоятельств, вызывающих и/или создающих предпосылки к возникновению сбоев (отказов) при эксплуатации Клиринговой системы и/или непосредственно препятствующие ее нормальному (штатному) функционированию, в том числе, обстоятельства непреодолимой силы, а также сбой, неисправности и отказы оборудования; сбой и ошибки программного обеспечения; сбой, 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 незамедлительно уведомляет об этом Биржу и/или Расчетную организацию и/или Депозитарий любым из доступных средств связи и предпринимает все возможные меры, направленные на устранение указанных обстоятельств.

#### **Статья 49. Чрезвычайные ситуации**

49.1. Чрезвычайной ситуацией может быть признана ситуация, связанная с наступлением обстоятельств, препятствующих клиринговому обслуживанию Участников клиринга, в том числе:

- обстоятельства, вызывающие и/или создающие предпосылки к возникновению сбоев (отказов) при эксплуатации Клиринговой системы и/или непосредственно препятствующие ее нормальному (штатному) функционированию, в том числе, обстоятельства непреодолимой силы, а также сбой, неисправности и отказы оборудования; сбой и ошибки программного обеспечения; сбой, 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, последствия которых не устранены до установленного в приложении № 2 к Правилам клиринга времени окончания периода передачи Клиринговым центром Депозитарию Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по ценным бумагам и Расчетной организации Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по денежным средствам;

- военные действия, акты террора, диверсии и саботажа, массовые беспорядки, забастовки, смена политического режима и другие политические осложнения;
- изменения законодательных или иных актов государственных органов Российской Федерации, решений законодательных и исполнительных органов власти;
- пожары или иные несчастные случаи, разрушения или значительные повреждения занимаемых Клиринговым центром помещений;
- любые иные обстоятельства, которые создают или могут создать угрозу жизни или здоровью работников Клирингового центра;
- получение сообщения Биржи о возникновении чрезвычайной ситуации, которая может привести к нарушению клирингового обслуживания Участников клиринга;
- иные обстоятельства, препятствующие клиринговому обслуживанию Участников клиринга, которые, находятся вне контроля Клирингового центра.

49.2. Признание ситуации чрезвычайной осуществляется по решению Клирингового центра.

49.3. В случае признания ситуации чрезвычайной Клиринговый центр извещает Участников клиринга, Биржу, Расчетную организацию/ Депозитарий имеющимися доступными средствами связи о возникновении чрезвычайной ситуации и предпринимаемых в связи с этим действиях.

49.4. В качестве мер по урегулированию чрезвычайной ситуации (при необходимости по согласованию с Биржей) Правлением Клирингового центра могут быть приняты следующие решения:

- об изменении времени проведения операций в Клиринговой системе и/или сроков осуществления документооборота в процессе взаимодействия Клирингового центра с Участниками клиринга, Расчетной организацией, Депозитарием и Биржей;
- об отмене результатов Процедуры контроля обеспечения по некоторым или всем сделкам, обязательства по которым были включены в клиринговый пул для расчетов в ходе торгов или клиринговый пул для расчетов по итогам торгов, прошедшим Процедуру контроля обеспечения в текущий Расчетный день, но расчеты по которым не проведены;
- об исключении из клирингового пула для расчетов в ходе торгов или из клирингового пула для расчетов по итогам торгов обязательств по некоторым или всем сделкам;
- о переносе на следующий Расчетный день Даты исполнения обязательств Участников клиринга по сделкам, обязательства по которым не были

исключены из клирингового пула для расчетов в ходе торгов или из клирингового пула для расчетов по итогам торгов, но по которым в текущий Расчетный день отменены результаты Процедуры контроля обеспечения, либо не проведена Процедура контроля обеспечения;

- о переносе на следующий Расчетный день Даты исполнения обязательств Участников клиринга по уплате Комиссионного вознаграждения и/или обязательств Участников клиринга по уплате Возмещения по некоторым или всем сделкам, обязательства по которым включены в клиринговый пул;
- об осуществлении иных действий, направленных на урегулирование чрезвычайной ситуации.

После принятия Клиринговым центром соответствующих решений по урегулированию чрезвычайной ситуации в Клиринговой системе производится корректировка соответствующих клиринговых регистров.

- 49.5. При принятии решений по урегулированию чрезвычайных ситуаций (при необходимости по согласованию с Биржей) Клиринговый центр вправе:
- устанавливать сроки и порядок исполнения своих решений Участниками клиринга;
  - обуславливать порядок вступления в силу своих решений определенными обстоятельствами.
- 49.6. О мерах, предпринятых по решению Клирингового центра в целях урегулирования чрезвычайной ситуации, Участники клиринга и Биржа оповещаются имеющимися доступными средствами связи не позднее дня принятия данных мер.
- 49.7. Клиринговый центр не несет ответственности за убытки, которые могут возникнуть в связи с нарушением клирингового обслуживания Участников клиринга в случае признания ситуации чрезвычайной в связи с обстоятельствами, предусмотренными пунктом 49.1 Правил клиринга.

**ПРИЛОЖЕНИЕ 1  
 К ПРАВИЛАМ ОСУЩЕСТВЛЕНИЯ  
 КЛИРИНГОВОЙ ДЕЯТЕЛЬНОСТИ  
 ЗАО АКБ «НАЦИОНАЛЬНЫЙ  
 КЛИРИНГОВЫЙ ЦЕНТР» НА РЫНКЕ  
 ЦЕННЫХ БУМАГ**

**Тарифы Клирингового центра**

<b>№ п/п</b>	<b>Наименование услуги/операции</b>	<b>Тариф, включая НДС</b>
1.	<b>Клиринговое обслуживание Участников клиринга по биржевым сделкам (кроме сделок РЕПО)</b>	
1.1.	<b>Комиссионное вознаграждение по биржевым сделкам с акциями, депозитарными расписками на акции, еврооблигациями и инвестиционными паями (за исключением Участников клиринга и сделок, предусмотренных разделом 7)</b>	в процентах от объема каждой сделки, взимается в дату заключения сделки с каждой стороны сделки, не менее 0,01 рубля
1.1.1.	с кодом расчетов, отличным от Z0 и K0	0,004%
1.1.2.	с кодом расчетов Z0	0,007%
1.1.3.	с кодом расчетов K0	0,004%, но не более 600 рублей
1.1.4.	в период до 11 июня 2012 г. включительно вместо тарифа, предусмотренного подпунктом 1.1.3 для биржевых сделок с кодом расчетов K0	0,002%, но не более 600 рублей
1.2.	<b>Комиссионное вознаграждение по биржевым сделкам с облигациями, депозитарными расписками на облигации (за исключением еврооблигаций, а также Участников клиринга и сделок, предусмотренных разделом 7)</b>	взимается в дату заключения сделки с каждой стороны сделки, не менее 0,01 рубля
1.2.1.	по сделкам, заключенным в Режиме основных торгов	произведение 0,000035% от объема сделки на срок до погашения <sup>1</sup> , но не более 0,0035% от объема сделки
1.2.2.	по сделкам, заключенным в Режиме переговорных сделок и Режиме торгов «Квал.Инвесторы – РПС»	произведение 0,000035% от объема сделки на срок до погашения <sup>1</sup> , но не более 0,0035% от объема сделки и не более 700 рублей
1.2.3.	по сделкам, заключенным в режимах торгов, отличных от Режиме основных торгов, Режиме переговорных сделок и Режиме торгов «Квал.Инвесторы – РПС»	произведение 0,000035% от объема сделки на срок до погашения <sup>1</sup> , но не более 0,00525% от объема сделки
2.	<b>Клиринговое обслуживание Участников клиринга по биржевым сделкам РЕПО</b>	
2.1.	<b>Постоянная часть комиссионного вознаграждения по биржевым сделкам РЕПО, за исключением Сделок с частичным обеспечением</b>	в российских рублях, по каждому Участнику клиринга за каждый календарный месяц, взимается в первый Расчетный день месяца оказания клиринговых услуг с Участника клиринга, имеющего допуск к клиринговому обслуживанию в течение одного и более дней в календарном месяце, вне зависимости от факта подачи заявок, заключения и/или исполнения Участником клиринга сделок на биржевых торгах

2.1.1.	Тарифный план 1 «Базовый»	0
2.1.2.	Тарифный план 2 «Экономный»	52 500
2.1.3.	Тарифный план 3 «Лидер»	175 000
2.2.	<b>Оборотная часть комиссионного вознаграждения по биржевым сделкам РЕПО, за исключением Сделок с частичным обеспечением</b>	взимается в дату заключения сделки РЕПО с каждой стороны сделки, не менее 5 рублей
2.2.1.	Тарифный план 1 «Базовый»	произведение 0,000084% от суммы РЕПО на срок сделки РЕПО <sup>2</sup>
2.2.2.	Тарифный план 2 «Экономный»	произведение 0,00007% от суммы РЕПО на срок сделки РЕПО <sup>2</sup>
2.2.3.	Тарифный план 3 «Лидер»	произведение 0,000056% от суммы РЕПО на срок сделки РЕПО <sup>2</sup>
2.3.	<b>Комиссионное вознаграждение по биржевым сделкам РЕПО, являющимся Сделками с частичным обеспечением и заключенным на основании безадресных заявок</b>	взимается в дату заключения сделки РЕПО с каждой стороны сделки, не менее 5 рублей
2.3.1.	для Участника клиринга, заявка РЕПО которого была сохранена в котировках и на ее основании заключена сделка РЕПО	произведение 0,000035% от суммы РЕПО на срок сделки РЕПО <sup>2</sup>
2.3.2.	для Участника клиринга, заявка РЕПО которого удовлетворила сохраненную в котировках заявку РЕПО	произведение 0,000105% от суммы РЕПО на срок сделки РЕПО <sup>2</sup>
2.4.	<b>Комиссионное вознаграждение по биржевым сделкам РЕПО, являющимся Сделками с частичным обеспечением и заключенным на основании адресных заявок</b>	взимается в дату заключения сделки РЕПО с каждой стороны сделки, не менее 5 рублей
2.4.1.	для всех Участников клиринга	произведение 0,000105% от суммы РЕПО на срок сделки РЕПО <sup>2</sup>
2.5.	В период до 28 февраля 2013 г. включительно вместо тарифов, предусмотренных пунктами 2.3-2.4 для биржевых сделок РЕПО, являющихся Сделками с частичными обеспечением	5 рублей за каждую биржевую сделку РЕПО, взимается в дату заключения сделки РЕПО с каждой стороны сделки
3.	<b>Клиринговое обслуживание Участников клиринга по внебиржевым сделкам (кроме сделок РЕПО)</b>	в процентах от объема каждой сделки, взимается в дату регистрации Поручения на клиринг внебиржевой сделки с каждой стороны сделки, не менее 0,01 рубля
3.1.	Комиссионное вознаграждение по внебиржевым сделкам с акциями, депозитарными расписками на акции, еврооблигациями и инвестиционными паями	0,004%
3.2.	Комиссионное вознаграждение по внебиржевым сделкам с облигациями, депозитарными расписками на облигации (за исключением еврооблигаций)	0,0065%
4.	<b>Клиринговое обслуживание Участников клиринга, отнесенных к категории «Б», по внебиржевым сделкам РЕПО</b>	произведение 0,00015% от суммы РЕПО на срок сделки РЕПО <sup>2</sup> , но не менее 5 рублей, взимается в дату регистрации Поручения на клиринг внебиржевой сделки
5.	<b>Клиринговое обслуживание Участников клиринга, отнесенных к категории «А», по внебиржевым сделкам РЕПО</b>	5 рублей за каждую внебиржевую сделку РЕПО, взимается в дату регистрации Поручения на клиринг

		внебиржевой сделки
6.	<b>Плата за повторную выдачу отчетных документов, предусмотренных Правилами клиринга, по запросам Участников клиринга</b>	в российских рублях, за каждый отчетный документ за один Расчетный день
	а) в форме электронного документа	20
	б) в бумажной форме	200
	в) за нестандартный отчетный документ в бумажной форме	250
7.	<b>Плата за право получения клирингового обслуживания для Участников клиринга, выбравших тарифный план «Размещения-фиксированный»</b>	в российских рублях, по каждому Участнику клиринга за 1 (один) кварталный период (3 (три) последовательных календарных месяца), взимается единовременно в первый Расчетный день кварталного периода, вне зависимости от факта подачи заявок, заключения и/или исполнения Участником клиринга сделок на биржевых торгах
7.1.	По биржевым сделкам с облигациями и/или еврооблигациями 2 (двух) эмитентов, указанных в заявлении Участника клиринга по форме приложения 1.1 к Правилам клиринга, в которых Участник клиринга будет являться продавцом при осуществлении размещения или доразмещения (отчуждения первичным владельцем) в режимах торгов Режим основных торгов, Размещение: адресные заявки и Размещение: аукцион, а также в которых Участник клиринга будет являться покупателем в режимах торгов Выкуп: адресные заявки, Выкуп: Аукцион	4 373 670

<sup>1</sup> - срок до погашения - количество календарных дней от даты заключения сделки, не включая эту дату, до даты погашения облигации, включая эту дату.

<sup>2</sup> - под суммой РЕПО и сроком сделки РЕПО принимаются параметры, определенные при заключении соответствующей сделки РЕПО. Для внутрисуточных сделок РЕПО для целей расчета комиссионного вознаграждения срок сделки РЕПО принимается равным 1 дню.

**ПРИЛОЖЕНИЕ 2  
К ПРАВИЛАМ ОСУЩЕСТВЛЕНИЯ  
КЛИРИНГОВОЙ ДЕЯТЕЛЬНОСТИ  
ЗАО АКБ «НАЦИОНАЛЬНЫЙ  
КЛИРИНГОВЫЙ ЦЕНТР» НА РЫНКЕ  
ЦЕННЫХ БУМАГ**

**Сроки представления Клиринговым центром и сроки получения  
Клиринговым центром документов в процессе взаимодействия с  
Участниками клиринга, Расчетной организацией, Депозитарием и  
Биржей. Сроки проведения клиринговых процедур.**

1. Время (сроки) осуществления документооборота (совершения операций) в процессе взаимодействия Клирингового центра с Участниками клиринга при проведении клиринга и расчетов по сделкам с ценными бумагами, указаны в таблице 1.
2. Время (сроки) осуществления документооборота (совершения операций) в процессе взаимодействия Клирингового центра с Расчетной организацией, Депозитарием и Биржей при проведении клиринга и расчетов по сделкам с ценными бумагами указано в таблице 2.
3. Время (сроки) осуществления документооборота (совершения операций) в процессе взаимодействия Клирингового центра с Участниками клиринга при внесении / возврате Обеспечения и проведения клиринга по Сделкам с частичным обеспечением, указаны в таблице 3.
4. Документы, определенные в строках 6.1, 6.2 и 6.8 таблицы 2, содержат информацию по торговым счетам, торговым счетам ДУ, клиентским торговым счетам и торговым счетам клиентов в Расчетной организации, а также по торговым разделам и дополнительным торговым разделам типа «А», «В» и «С» на счетах депо в Депозитарии.
5. Документы, определенные в строках 7.1 и 7.7 таблицы 2, содержат информацию по валютным торговым счетам, валютным торговым счетам ДУ, валютным клиентским торговым счетам и валютным торговым счетам клиентов в Расчетной организации, а также по валютным торговым разделам.
6. Все иные документы, которые не указаны в таблицах 1, 2 и 3, передаются Клиринговому центру и/или предоставляются Клиринговым центром в процессе взаимодействия Клирингового центра с Участниками клиринга, Расчетной организацией, Депозитарием и Биржей с 9:00 до 19:00 по московскому времени.

**Таблица 1**

<b>NN</b>	<b>НАИМЕНОВАНИЕ ОПЕРАЦИИ</b>	<b>ВРЕМЯ</b>
1.	Установление в Клиринговой системе начальных значений позиций по ценным бумагам и денежным средствам Участников клиринга.	до 9:30
2.	<b>Операции по сделкам с ценными бумагами, заключенным с расчетами в российских рублях</b>	
2.1.	Процедура контроля обеспечения.	9:30– 19:00
2.2.	Период регистрации поручений. Получение Клиринговым центром от Участников клиринга Специальных и Срочных отчетов на исполнение.	9:30 – 18:30
2.3.	Период регистрации поручений. Получение Клиринговым центром от Участников клиринга Отчетов на исполнение, Поручений на внесении компенсационных взносов и Поручений на отказ от компенсационных взносов по сделкам, за исключением сделок с облигациями, эмитентом или генеральным агентом по обслуживанию которых является	9:30 – 19:00

	Банк России.	
2.4.	Период регистрации поручений. Получение Клиринговым центром от Участников клиринга Поручений на клиринг внебиржевых сделок.	9:30 – 19:00
2.5.	Период регистрации поручений. Получение Клиринговым центром от Участников клиринга Отчетов на исполнение, Поручений на внесении компенсационных взносов и Поручений на отказ от компенсационных взносов по сделкам с облигациями, эмитентом или генеральным агентом по обслуживанию которых является Банк России.	9:30 – 18:45
3.	<b>Операции по сделкам с ценными бумагами, заключенным с расчетами в иностранной валюте (в долларах США)</b>	
3.1.	Процедура контроля обеспечения.	9:30 – 17:30
3.2.	Период регистрации поручений. Получение Клиринговым центром от Участников клиринга Специальных и Срочных отчетов на исполнение.	9:30 – 17:00
3.3.	Период регистрации поручений. Получение Клиринговым центром от Участников клиринга Отчетов на исполнение, Поручений на внесении компенсационных взносов и Поручений на отказ от компенсационных взносов по сделкам, за исключением сделок с облигациями, эмитентом или генеральным агентом по обслуживанию которых является Банк России.	9:30 – 17:30
3.4.	Период регистрации поручений. Получение Клиринговым центром от Участников клиринга Поручений на клиринг внебиржевых сделок.	9:30 – 17:30
3.5.	Период регистрации поручений. Получение Клиринговым центром от Участников клиринга Отчетов на исполнение, Поручений на внесении компенсационных взносов и Поручений на отказ от компенсационных взносов по сделкам с облигациями, эмитентом или генеральным агентом по обслуживанию которых является Банк России.	9:30 – 17:15
4.	Направление Участникам клиринга отчетных документов по итогам клиринга (в соответствии со статьей 44 Правил клиринга) в форме электронных документов.	Не позднее времени, указанного в нормативных правовых актах федерального органа исполнительной власти по рынку ценных бумаг

**Таблица 2**

<i>NN</i>	<b>НАИМЕНОВАНИЕ ОПЕРАЦИИ</b>	<b>ВРЕМЯ</b>
1.	Получение Клиринговым центром от Депозитария «Информации о состоянии Разделов», «Отчета об остатках на Разделах».	до 8:00
2.	Передача Клиринговым центром Расчетной организации «Запроса о денежных средствах».	до 9:00
3.	Получение Клиринговым центром от Расчетной организации «Сведений о денежных средствах, зарезервированных на Счетах».	9:00
4.	Передача Клиринговым центром Расчетной организации «Уведомления об обработке Сведений о денежных средствах, зарезервированных на Счетах».	по мере обработки, до 9:05
5.	Получение Клиринговым центром от Биржи «Биржевой информации».	до 9:00 <sup>4</sup>

<sup>4</sup> В получаемой в данное время «Биржевой информации» содержится информация только по полям «НКД», «КД» и «Дата выплаты купона»



		до 19:10 <sup>5</sup>
6.	<b>Операции по сделкам с ценными бумагами, заключенным с расчетами в российских рублях</b>	
6.1.	Получение Клиринговым центром от Депозитария «Перечней поручений депо, приводящих к уменьшению зарезервированных ценных бумаг» и «Уведомлений об увеличении остатков на Разделах». Получение Клиринговым центром от Расчетной организации «Запросов о возможности уменьшения денежных средств на Счетах» и «Уведомлений об увеличении денежных средств на Счетах».	9:15 - 19:00
6.2.	Передача Клиринговым центром Депозитарию «Распоряжений на разблокировку/неразблокировку ценных бумаг, зарезервированных на Разделе» и «Сообщений об обработке Уведомления об увеличении остатков на Разделах». Передача Клиринговым центром Расчетной организации «Уведомлений о возможности/невозможности уменьшения суммы денежных средств на Счетах» и «Сообщений об обработке / о невозможности обработки Уведомления об увеличении денежных средств на Счетах».	9:15 - 19:00
6.3.	Получение Клиринговым центром от Биржи «Информации о поданных заявках», «Уведомлений о заключении сделок», «Уведомлений о снятии заявок», «Выписок из реестра сделок». Передача Клиринговым центром Бирже «Отчетов о возможности / невозможности регистрации заявок», «Уведомлений о необеспеченности сделки» (при необходимости) и «Подтверждений Клирингового центра».	9:30 – 19:00
6.4.	<b>Операции по сделкам с ценными бумагами, заключенным с расчетами в российских рублях, обязательства по которым включены в клиринговый пул для расчетов в ходе торгов</b>	
6.4.1.	Передача Клиринговым центром Депозитарию «Сводных ведомостей по обязательствам и требованиям по ценным бумагам». Передача Клиринговым центром Расчетной организации «Сводных ведомостей по обязательствам и требованиям по денежным средствам». Получение Клиринговым центром от Депозитария «Отчетов об исполнении/неисполнении Сводных ведомостей по обязательствам и требованиям по ценным бумагам». Получение Клиринговым центром от Расчетной организации «Отчетов об исполнении/неисполнении Сводных ведомостей по обязательствам и требованиям по денежным средствам». Получение Клиринговым центром от Биржи «Выписок из реестра сделок с ценными бумагами». Передача Клиринговым центром на Биржу «Уведомления о необеспеченности сделки» (при необходимости).	9:30 – 18:30
6.5.	<b>Операции по сделкам с ценными бумагами, заключенным с расчетами в российских рублях, обязательства по которым включены в клиринговый пул для расчетов по итогам торгов</b>	
6.5.1.	Получение Клиринговым центром от Биржи «Сводного реестра сделок с ценными бумагами».	19:00 – 19:10
6.5.2.	Передача Клиринговым центром на Биржу «Уведомления об отказе в регистрации Сводного реестра сделок с ценными бумагами» (при необходимости).	до 19:30
6.5.3.	Передача Клиринговым центром Депозитарию «Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по ценным бумагам». Передача Клиринговым центром Расчетной организации «Сводной ведомости по	до 19:40

<sup>5</sup> В получаемой в данное время «Биржевой информации» содержится информация только по полям «Рыночная цена» и «Цена возмещения»

	обязательствам и требованиям по денежным средствам».	
6.5.4.	Получение Клиринговым центром от Депозитария «Отчета об исполнении/неисполнении Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по ценным бумагам». Получение Клиринговым центром от Расчетной организации «Отчета об исполнении/неисполнении Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по денежным средствам».	до 20:00
6.5.5.	Передача Клиринговым центром Депозитарию «Распоряжения на разблокировку Разделов и ценных бумаг, находящихся на Разделах». Передача Клиринговым центром Расчетной организации «Распоряжения на разблокировку денежных средств на Счетах».	до 20:05
7.	<b>Операции по сделкам с ценными бумагами, заключенным с расчетами в иностранной валюте (в долларах США)</b>	
7.1.	Получение Клиринговым центром от Депозитария «Перечней поручений депо, приводящих к уменьшению зарезервированных ценных бумаг» и «Уведомлений об увеличении остатков на Разделах». Получение Клиринговым центром от Расчетной организации «Запросов о возможности уменьшения денежных средств на Счетах» и «Уведомлений об увеличении денежных средств на Счетах».	9:15 – 17:30
7.2.	Передача Клиринговым центром Депозитарию «Распоряжений на разблокировку/неразблокировку ценных бумаг, зарезервированных на Разделе» и «Сообщений об обработке Уведомления об увеличении остатков на Разделах». Передача Клиринговым центром Расчетной организации «Уведомлений о возможности/невозможности уменьшения суммы денежных средств на Счетах» и «Сообщений об обработке /о невозможности обработки Уведомления об увеличении денежных средств на Счетах».	9:15 – 17:30
7.3.	Получение Клиринговым центром от Биржи «Информации о поданных заявках», «Уведомлений о заключении сделок», «Уведомлений о снятии заявок» и «Выписок из реестра сделок». Передача Клиринговым центром Бирже «Отчетов о возможности / невозможности регистрации заявок», «Уведомлений о необеспеченности сделки» (при необходимости) и «Подтверждений Клирингового центра».	9:30 – 17:30
7.4.	<b>Операции по сделкам с ценными бумагами, заключенным с расчетами в иностранной валюте (в долларах США), обязательства по которым включены в клиринговый пул для расчетов в ходе торгов</b>	
7.4.1.	Передача Клиринговым центром Депозитарию «Сводных ведомостей по обязательствам и требованиям по ценным бумагам». Передача Клиринговым центром Расчетной организации «Сводных ведомостей по обязательствам и требованиям по денежным средствам». Получение Клиринговым центром от Депозитария «Отчетов об исполнении/неисполнении Сводных ведомостей по обязательствам и требованиям по ценным бумагам». Получение Клиринговым центром от Расчетной организации «Отчетов об исполнении/неисполнении Сводных ведомостей по обязательствам и требованиям по денежным средствам». Получение Клиринговым центром от Биржи «Выписок из реестра сделок с ценными бумагами». Передача Клиринговым центром на Биржу «Уведомления о необеспеченности сделки» (при необходимости).	9:30 – 17:00
7.5.	<b>Операции по сделкам с ценными бумагами, заключенным с расчетами в иностранной валюте (в долларах</b>	

<b>США), обязательства по которым включены в клиринговый пул для расчетов по итогам торгов</b>		
7.5.1.	Получение Клиринговым центром от Биржи «Сводного реестра сделок с ценными бумагами» и «Биржевой информации» <sup>6</sup> .	17:30 – 17:40
7.5.2.	Передача Клиринговым центром Бирже «Уведомления об отказе в регистрации Сводного реестра сделок с ценными бумагами» (при необходимости).	до 17:50
7.5.3.	Передача Клиринговым центром Депозитарию «Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по ценным бумагам». Передача Клиринговым центром Расчетной организации «Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по денежным средствам».	до 17:55
7.5.4.	Получение Клиринговым центром от Депозитария «Отчета об исполнении/неисполнении Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по ценным бумагам». Получение Клиринговым центром от Расчетной организации «Отчета об исполнении/неисполнении Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по денежным средствам».	до 18:10
7.5.5.	Передача Клиринговым центром Депозитарию «Распоряжения на разблокировку Разделов и ценных бумаг, находящихся на Разделах». Передача Клиринговым центром Расчетной организации «Распоряжения на разблокировку денежных средств на Счетах».	до 18:25
8.	Передача Клиринговым центром Бирже «Сводной ведомости исполнения обязательств по внесению компенсационных взносов» и «Отчета о досрочном исполнении сделок РЕПО».	до 19:20
9.	Получение Клиринговым центром от Биржи «Сводного реестра компенсационных взносов».	до 19:40
10.	Получение Клиринговым центром от Биржи «Уведомлений с информацией о кодах клиентов Участника клиринга».	до 19:40
11.	Передача Клиринговым центром Расчетной организации «Ведомости по уплате комиссионного вознаграждения» и «Ведомости по уплате возмещения».	до 19:40
12.	Получение Клиринговым центром от Расчетной организации «Отчета об исполнении/неисполнении Ведомости по уплате комиссионного вознаграждения» и «Отчета об исполнении/неисполнении Ведомости по уплате возмещения».	до 20:00
13.	Передача Клиринговым центром Бирже «Уведомления о неисполнении обязательств по сделкам с ценными бумагами».	до 12:00 Расчетного дня, следующего за датой неисполнения
15.	Получение Клиринговым центром от Биржи «Уведомления об отказе Участника торгов от получения возмещения».	до 17:30 дня получения соответствующего Уведомления от Участника торгов
16.	Передача Клиринговым центром Бирже «Уведомления о ценных бумагах».	до 17:30 рабочего дня, предшествующего дате проведения операции <sup>7</sup>
17.	Получение Клиринговым центром от Биржи «Уведомления о ценных бумагах».	до 17:30 рабочего

<sup>6</sup> В получаемой в данное время «Биржевой информации» содержится информация только по полям «Рыночная цена».

<sup>7</sup> Если иное не установлено решением Правления Клирингового центра

		дня, предшествующего дате проведения операции
18.	Получение Клиринговым центром от Депозитария «Уведомлений об объединении выпусков эмиссионных ценных бумаг и/или аннулировании индивидуальных номеров (кодов) дополнительных выпусков эмиссионных ценных бумаг».	до 18:30 дня получения Депозитарием документа об объединении выпусков от регистрирующего органа, реестродержателя или другого депозитария
19.	Передача Клиринговым центром Бирже «Уведомлений об объединении выпусков эмиссионных ценных бумаг и/или аннулировании индивидуальных номеров (кодов) дополнительных выпусков эмиссионных ценных бумаг».	до 17:30 дня проведения операции

**Таблица 3**

<b>NN</b>	<b>НАИМЕНОВАНИЕ ОПЕРАЦИИ</b>	<b>ВРЕМЯ</b>
1.	Проведение клиринговой сессии.	с 9:45 до 10:00
2.	Передача Клиринговым центром Участникам клиринга Отчетов о Маржинальном требовании, Требований о погашении задолженности, Отчетов об Обеспечении, Отчетов об обязательствах по Сделкам с частичным обеспечением.	до 10:15
3.	Исполнение Маржинальных требований.	до 17:30 дня возникновения Маржинального требования
4.	Погашение Задолженности по гарантийным переводам.	до 17:30 дня возникновения Задолженности по гарантийным переводам
5.	Погашение Задолженности.	до 17:30 Рабочего дня, следующего за днем возникновения Задолженности
6.	Определение Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований.	16:00
7.	Передача Клиринговым центром Отчетов об Итоговых нетто-обязательствах / Итоговых нетто-требованиях.	с 16:00 до 16:15
8.	Исполнение Участниками клиринга Итоговых нетто-обязательств перед Клиринговым центром.	до 17:00
9.	Исполнение Клиринговым центром Итоговых нетто-требований перед Участниками клиринга.	до 17:30
10.	Урегулирование случаев неисполнения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением.	с 17:00 до 17:30
11.	Передача Участником клиринга в Клиринговый центр распоряжений на внесение денежных средств / ценных бумаг в Обеспечение.	с 10:00 до 18:50

12.	Передача Участником клиринга в Клиринговый центр Запросов о возврате денежных средств / ценных бумаг из Обеспечения.	с 10:00 до 18:50
13.	Исполнение Участниками клиринга обязательств по уплате комиссионных вознаграждений по Сделкам с частичным обеспечением.	до 19:00
14.	Передача Клиринговым центром Участникам клиринга Отчетов об обязательствах по Сделкам с частичным обеспечением.	до 20:00

**ПРИЛОЖЕНИЕ 3  
К ПРАВИЛАМ ОСУЩЕСТВЛЕНИЯ  
КЛИРИНГОВОЙ ДЕЯТЕЛЬНОСТИ  
ЗАО АКБ «НАЦИОНАЛЬНЫЙ  
КЛИРИНГОВЫЙ ЦЕНТР» НА РЫНКЕ  
ЦЕННЫХ БУМАГ**

**Реквизиты документов, направляемых Клиринговым центром  
Участникам клиринга, Расчетной организации, Депозитарию и Бирже**

**1. Реквизиты документов, направляемых Участникам клиринга:**

**1.1. Выписка из реестра сделок, принятых в клиринг.**

<b>Реквизиты</b>	<b>Порядок заполнения</b>
Дата	Дата в формате ДД.ММ.ГГ
Номер документа	Номер документа в СЭД: девятисимвольный с ведущим «0»/EQ
Отправитель	Клиринговый центр
Тип документа	EQM06 (для участников клиринга) EQM6C (для клиентов участника клиринга) EQM6D (для Держателей) EQM6B (для Клиринговых банков)
Реквизиты сделки	Номер сделки, цена, код расчетов, ценная бумага, торгово-клиринговые счета, дата заключения и Дата исполнения сделки, обязательство по денежным средствам и ценным бумагам и иные параметры сделки, принятой в клиринг
Реквизиты поручения Участника клиринга	Номер поручения и иные параметры поручения (заполняется при необходимости)
Тип раздела	1 – Исполненные сделки предыдущих дней; 2 – Исполненные сделки текущего дня; 3 – Сделки, подлежащие исполнению; 4 – Неисполненные сделки
Тип клиринга	Тип клиринга: S – простой клиринг, M – многосторонний клиринг по итогам торгов, R – многосторонний клиринг в ходе торгов

**1.2. Отчет по обязательствам и требованиям Участника клиринга по денежным средствам и ценным бумагам.**

<b>Реквизиты</b>	<b>Порядок заполнения</b>
Дата	Дата в формате ДД.ММ.ГГ
Номер документа	Номер документа в СЭД: девятисимвольный с ведущим «0»/EQ
Отправитель	Клиринговый центр
Тип документа	EQM04
Реквизиты Счета (Дополнительных денежных позиций, Торгово-клиринговых счетов)	Наименование и номер Счета в Расчетной организации (или код дополнительной позиции по денежным средствам) / наименование и номер Счета депо в Депозитарии, а также иные параметры. Номер торгово-клирингового счета (указывается только в отношении обязательств / требований по ценным бумагам) Участника клиринга
Тип клиринга	Тип клиринга: S – простой клиринг, M – многосторонний клиринг по итогам торгов, R – многосторонний клиринг в ходе торгов
Нетто-обязательство/нетто-требование	Размер нетто-обязательства (с ведущим минусом) или нетто-требования Участника клиринга. Указывается в денежном выражении (по коду денежных средств) или в ценных бумагах (по коду ценной бумаги). В поле учитываются данные только по сделкам/нетто-обязательствам и/или нетто-требованиям, исполнение которых предусмотрено в порядке многостороннего клиринга
Обязательство	Обязательство / сумма обязательств Участника клиринга в денежном выражении

	(по коду денежных средств) или в ценных бумагах (по коду ценной бумаги)
Требование	Требование / сумма требований Участника клиринга в денежном выражении (по коду денежных средств) или в ценных бумагах (по коду ценной бумаги)

### 1.3. Выписка из реестра неисполненных сделок.

Реквизиты	Порядок заполнения
Дата	Дата в формате ДД.ММ.ГГ
Номер документа	Номер документа в СЭД: девятисимвольный с ведущим «0»/EQ
Отправитель	Клиринговый центр
Тип документа	EQM08
Реквизиты сделки	Параметры сделки, принятой на клиринг
Реквизиты поручения Участника клиринга	Номер поручения, тип поручения, время и иные параметры поручения
Реквизиты Возмещения	Ставка фиксированного Возмещения, цена Возмещения и иные параметры Возмещения
Причина неисполнения	Причина неисполнения обязательств по сделке

### 1.4. Выписка из протокола исполнения сделок и обязательств по внесению компенсационных взносов.

Реквизиты	Порядок заполнения
Дата	Дата в формате ДД.ММ.ГГ
Номер документа	Номер документа в СЭД: девятисимвольный с ведущим «0»/EQ
Отправитель	Клиринговый центр
Тип документа	EQM05
Реквизиты сделки	Параметры сделки или компенсационного взноса
Реквизиты поручения Участника клиринга	Номер поручения и иные параметры поручения (при необходимости)
Параметры исполнения сделки	Время подачи и отзыва поручения, направление поручения, Клиринговый идентификатор, тип поручения и иные параметры поручения

### 1.5. Отчет по обязательствам Участника клиринга по комиссионному вознаграждению.

Реквизиты	Порядок заполнения
Дата	Дата в формате ДД.ММ.ГГ
Номер документа	Номер документа в СЭД: девятисимвольный с ведущим «0»/EQ
Отправитель	Клиринговый центр
Тип документа	EQM15
Реквизиты Счета (Дополнительных денежных позиций)	Наименование и номер Счета в Расчетной организации (или код дополнительной позиции по денежным средствам)
Признак вида комиссии	Всего по денежной позиции / оборотная часть / постоянная часть / абонентская плата / плата за повторную выдачу отчетов / плата по тарифному плану «Размещения-фиксированный» / дополнительное вознаграждение
Обязательство по уплате комиссии, в т.ч. НДС	Размер обязательств Участника клиринга по уплате Комиссионного вознаграждения в денежном выражении (в рублях) по сделкам, заключенным в текущую дату (информация о которых поступила в Клиринговую систему)
Комиссия удержанная, в т.ч. НДС	Размер удержанного с Участника клиринга Комиссионного вознаграждения в денежном выражении (в рублях). В поле указываются только данные по исполненным в текущую дату обязательствам Участника клиринга по уплате Комиссионного вознаграждения
Комиссия, подлежащая уплате, в т.ч. НДС	Размер обязательства Участника клиринга по уплате на следующий Расчетный день Комиссионного вознаграждения в денежном выражении (в рублях) по сделкам, заключенным в текущую дату (информация о которых поступила в Клиринговую систему)
Комиссия, не уплаченная в срок, в т.ч. НДС	Размер просроченных обязательств Участника клиринга по уплате Комиссионного вознаграждения в денежном выражении (в рублях)

### 1.6. Отчет о торгово-клиринговых счетах и иных реквизитах Участника клиринга.

Реквизиты	Порядок заполнения
-----------	--------------------

Дата	Дата в формате ДД.ММ.ГГ
Номер документа	Номер документа в СЭД: девятисимвольный с ведущим «0»/EQ
Отправитель	Клиринговый центр
Тип документа	EQM20
Реквизиты торгового-клирингового счета	Номер, описание, состояние и иные параметры торгового-клирингового счета
Реквизиты Разделов, Счетов депо и Счетов	Номер, дата окончания доверенности и иные параметры Разделов, Счетов депо и Счетов
Перечень Клиринговых идентификаторов	Клиринговый идентификатор
Изменения	Признак проведения изменений по параметрам торгового-клиринговых счетов и Клиринговых идентификаторов

#### 1.7. Выписка из протокола внесения компенсационных взносов.

Реквизиты	Порядок заполнения
Дата	Дата в формате ДД.ММ.ГГ
Номер документа	Номер документа в СЭД: девятисимвольный с ведущим «0»/EQ
Отправитель	Клиринговый центр
Тип документа	EQM24
Реквизиты сделки	Номер сделки, цена, код расчетов, ценная бумага, торгового-клиринговые счета, дата заключения и Дата исполнения сделки и иные параметры сделки, принятой на клиринг
Реквизиты поручения Участника клиринга	Номер поручения, направление поручения, обязательство по денежным средствам или ценным бумагам и иные параметры поручения
Статус поручения	«+» - компенсационный взнос внесен «-» - компенсационный взнос не внесен «ОТМ» - отказ от получения компенсационного взноса

#### 1.8. Отчет о дополнительных торговых разделах, открытых для проведения операций Участниками клиринга, и иных реквизитах.

Реквизиты	Порядок заполнения
Дата	Дата в формате ДД.ММ.ГГ
Номер документа	Номер документа в СЭД: девятисимвольный с ведущим «0»/EQ
Отправитель	Клиринговый центр
Тип документа	EQM28
Реквизиты торгового-клирингового счета	Номер, описание, состояние и иные параметры торгового-клирингового счета
Реквизиты Разделов и Счетов депо	Номер, дата окончания доверенности и иные параметры Разделов и Счетов депо
Изменения	Признак проведения изменений по параметрам торгового-клиринговых счетов

#### 1.9. Уведомление о замене Торгово-клирингового счета.

Реквизиты	Порядок заполнения
Дата	Дата в формате ДД.ММ.ГГ
Номер документа	Номер документа в СЭД: девятисимвольный с ведущим «0»/EQ
Отправитель	Клиринговый центр
Тип документа	EQM12
Реквизиты поручения Участника клиринга	Номер Поручения на замену Торгово-клирингового счета
Реквизиты сделки	Номер сделки, цена, код расчетов, ценная бумага, торгового-клиринговые счета, дата заключения и Дата исполнения сделки и иные параметры сделки
Номер Торгово-клирингового счета	Номер Торгово-клирингового счета до замены
Номер Торгово-клирингового счета	Номер Торгово-клирингового счета после замены

#### 1.10. Отчет об обязательствах по Сделкам с частичным обеспечением.

Реквизиты	Порядок заполнения
-----------	--------------------



Дата	Дата в формате ДД.ММ.ГГ
Номер документа	Номер документа в СЭД: девятисимвольный с ведущим «0»/EQ
Отправитель	Клиринговый центр
Тип документа	EQM23
Реквизиты Счета (Дополнительных денежных позиций, Торгово-клиринговых счетов)	Наименование и номер Счета в Расчетной организации (или код дополнительной позиции по денежным средствам) / наименование и номер Счета депо в Депозитарии, а также иные параметры. Номер торгово-клирингового счета (указывается только в отношении обязательств / требований по ценным бумагам) Участника клиринга
Дата исполнения	Дата исполнения
Нетто-обязательство/нетто-требование по Сделкам с частичным обеспечением	Размер нетто-обязательства или нетто-требования Участника клиринга. Указывается в денежном выражении (по коду денежных средств) или в ценных бумагах (по коду ценной бумаги)
Обязательство по уплате гарантийного перевода	Размер обязательства по уплате Гарантийного перевода
Обязательство по возврату Гарантийных переводов	Размер обязательства по возврату Гарантийных переводов

#### 1.11. Отчет об Итоговых нетто-обязательствах / нетто-требованиях.

Реквизиты	Порядок заполнения
Дата	Дата в формате ДД.ММ.ГГ
Номер документа	Номер документа в СЭД: девятисимвольный с ведущим «0»/EQ
Отправитель	Клиринговый центр
Тип документа	EQM13
Реквизиты Счета (Дополнительных денежных позиций, Торгово-клиринговых счетов)	Наименование и номер Счета в Расчетной организации (или код дополнительной позиции по денежным средствам) / наименование и номер Счета депо в Депозитарии, а также иные параметры. Номер торгово-клирингового счета (указывается только в отношении обязательств / требований по ценным бумагам) Участника клиринга
Дата исполнения	Дата исполнения
Итоговое нетто-обязательство / нетто-требование	Размер Итогового нетто-обязательства или Итогового нетто-требования Участника клиринга. Указывается в денежном выражении (по коду денежных средств) или в ценных бумагах (по коду ценной бумаги)
Обязательство по возврату Гарантийных переводов	Размер обязательства по возврату Гарантийных переводов

#### 1.12. Отчет об Обеспечении.

Реквизиты	Порядок заполнения
Дата	Дата в формате ДД.ММ.ГГ
Номер документа	Номер документа в СЭД: девятисимвольный с ведущим «0»/EQ
Отправитель	Клиринговый центр
Тип документа	EQM99
Расчетный код	Номер Расчетного кода
Код актива	Код валюты или ценной бумаги, являющихся Обеспечением
Тип операции	Тип операции, выполненной с Обеспечением
Сумма / объем операции	Сумма или объем операции, выполненной с Обеспечением

#### 1.13. Требование о погашении Задолженности.

Реквизиты	Порядок заполнения
Дата	Дата в формате ДД.ММ.ГГ
Номер документа	Номер документа в СЭД: девятисимвольный с ведущим «0»/EQ
Отправитель	Клиринговый центр
Тип документа	EQM22
Расчетный код	Номер Расчетного кода
Тип задолженности	Задолженность по сделкам / задолженность по гарантийным переводам

Сумма	Сумма задолженности
Дата и время	Дата и время, не позднее которых задолженность должна быть погашена

#### 1.14. Отчет о Маржинальном требовании.

Реквизиты	Порядок заполнения
Дата	Дата в формате ДД.ММ.ГГ
Номер документа	Номер документа в СЭД: девятисимвольный с ведущим «0»/EQ
Отправитель	Клиринговый центр
Тип документа	EQM14
Расчетный код	Номер Расчетного кода
Сумма	Сумма Маржинального требования
Дата и время	Дата и время, не позднее которых Маржинальное требование должно быть исполнено

#### 1.15. Отчет об обязательствах / требованиях по передаче Дохода.

Реквизиты	Порядок заполнения
Дата	Дата в формате ДД.ММ.ГГ
Номер документа	Номер документа в СЭД: девятисимвольный с ведущим «0»/EQ
Отправитель	Клиринговый центр
Тип документа	EQM98
Номер поручения	Номер поручения на передачу Дохода
Реквизиты Торгово-клирингового счета	Наименование и номер Счета депо в Депозитарии, а также иные параметры. Номер торгово-клирингового счета Участника клиринга
Код ценной бумаги	Код ценной бумаги, по которой эмитентом выплачен Доход
Размер обязательства по ценным бумагам	Размер обязательства по ценным бумагам, определяемый с целью передачи Дохода
Код валюты / ценной бумаги	Код валюты обязательства по передаче Дохода или код ценной бумаги
Обязательство / требование	Размер обязательства (с ведущим минусом) или требования Участника клиринга по передаче Дохода
Срок исполнения	Дата окончания срока исполнения обязательства / требования Участника клиринга по передаче Дохода
Реквизиты сделок	Номер сделки, цена, код расчетов, ценная бумага, торгово-клиринговые счета, дата заключения и Дата исполнения сделки, обязательство по денежным средствам и ценным бумагам и иные параметры сделки, принятой в клиринг

#### 1.16. Отчет об исполнении обязательств / требований по передаче Дохода.

Реквизиты	Порядок заполнения
Дата	Дата в формате ДД.ММ.ГГ
Номер документа	Номер документа в СЭД: девятисимвольный с ведущим «0»/EQ
Отправитель	Клиринговый центр
Тип документа	EQM98
Номер поручения	Номер поручения на передачу Дохода
Реквизиты Торгово-клирингового счета	Наименование и номер Счета депо в Депозитарии, а также иные параметры. Номер торгово-клирингового счета Участника клиринга
Код валюты / ценной бумаги	Код валюты обязательства по передаче Дохода или код ценной бумаги
Обязательство / требование	Размер обязательства (с ведущим минусом) или требования Участника клиринга по передаче Дохода
Срок исполнения	Дата окончания срока исполнения обязательства / требования Участника клиринга по передаче Дохода
Информация об исполнении	Исполнено / не исполнено
Дата исполнения	Фактическая дата исполнения обязательства по передаче Дохода
Количество дней просрочки	Количество дней просрочки
Пеня	Сумма пени, в рублях

Сроки предоставления документов, направляемых Клиринговым центром Участникам клиринга, определены в приложении № 2 к Правилам клиринга.

## **2. Документы, направляемые Расчетной организации**

### **2.1. Реквизиты документов в бумажной форме.**

#### **2.1.1. Уведомление об Участнике клиринга**

<b>Реквизиты</b>	<b>Порядок заполнения</b>
Дата	Дата составления документа
Номер документа	Исходящий номер документа
Наименование документа	Уведомление об Участнике клиринга
Реквизиты Участника клиринга	Наименование, код, ИНН и иные параметры

### **2.2. Реквизиты электронных документов.**

<b>Реквизиты</b>	<b>Порядок заполнения</b>
Дата	ГГГГММДД
Отправитель	Клиринговый центр
Получатель	Расчетная организация
Тип документа	0061- Сообщения об обработке/о невозможности обработки Уведомления об увеличении денежных средств на Счетах 0073– Уведомление о возможности/невозможности уменьшения суммы денежных средств на Счетах 0030 – Сводная ведомость по обязательствам и требованиям по денежным средствам (по итогам многостороннего клиринга) 0031 – Ведомость по уплате комиссионного вознаграждения 0032 – Ведомости по уплате возмещения 0036 – Сводная ведомость по обязательствам и требованиям по денежным средствам (по итогам простого клиринга) 0050 – Распоряжение на разблокировку денежных средств на Счетах 0090 – Распоряжение на отмену Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по денежным средствам (по итогам многостороннего клиринга) 0091 – Распоряжение на отмену Ведомости по уплате комиссионного вознаграждения 0092 – Распоряжение на отмену Ведомости по уплате возмещения 0096 – Распоряжение на отмену Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по денежным средствам (по итогам простого клиринга) 0136 – Сводная ведомость по обязательствам и требованиям по денежным средствам (по Срочным отчетам на исполнение) 0196 – Распоряжение на отмену Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по денежным средствам (по Срочным отчетам на исполнение) 0336 - Распоряжение на списание денежных средств с Клирингового счета
Исходящий номер	Исходящий номер электронного документа
Входящий номер	Входящий номер электронного документа
Количество повторяющихся последовательностей	Количество повторяющихся последовательностей по всему электронному документу
Результат обработки	Заполняется при необходимости

Сроки предоставления документов, направляемых Клиринговым центром Расчетной организации, определены в приложении № 2 к Правилам клиринга.

## **3. Документы, направляемые Депозитарию**

### 3.1. Реквизиты документов в бумажной форме.

#### 3.1.1. Уведомление об Участниках клиринга.

Реквизиты	Порядок заполнения
Номер	Исходящий номер документа
Дата	Дата составления документа
Наименование документа	Уведомление об Участниках клиринга
Реквизиты Участника клиринга	Наименование, код, ИНН и иные параметры

#### 3.2. Реквизиты электронных документов.

Реквизиты	Порядок заполнения
Дата	ГГГГММДД
Отправитель	Клиринговый центр
Получатель	Депозитарий
Тип документа	V – Распоряжение на разблокировку/неразблокировку ценных бумаг, зарезервированных на Разделе Z – Сообщение об обработке Уведомления об увеличении остатков на Разделах I – Сводная ведомость по обязательствам и требованиям по ценным бумагам (по итогам простого клиринга) H – Распоряжение на отмену Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по ценным бумагам (по итогам простого клиринга) D – Сводная ведомость по обязательствам и требованиям по ценным бумагам (по итогам многостороннего клиринга) G – Распоряжение на отмену Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по ценным бумагам (по итогам многостороннего клиринга) B – Распоряжение на разблокировку Разделов и ценных бумаг, находящихся на Разделах J – Сводная ведомость по обязательствам и требованиям по ценным бумагам (по Срочным отчетам на исполнение) S – Распоряжение на отмену Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по ценным бумагам (по Срочным отчетам на исполнение)
Исходящий номер	Исходящий номер электронного документа
Входящий номер	Входящий номер электронного документа
Количество повторяющихся последовательностей	Количество повторяющихся последовательностей по всему электронному документу
Результат обработки	Заполняется при необходимости

Сроки предоставления документов, направляемых Клиринговым центром Депозитарию, определены в приложении № 2 к Правилам клиринга.

## 4. Документы, направляемые Бирже

### 4.1. Реквизиты документов в бумажной форме.

#### 4.1.1. Уведомление об объединении выпусков эмиссионных ценных бумаг и/или аннулировании индивидуальных номеров (кодов) дополнительных выпусков эмиссионных ценных бумаг.

Реквизиты	Порядок заполнения
Номер	Исходящий номер документа
Дата	Дата составления документа
Наименование документа	Уведомление об объединении выпусков эмиссионных ценных бумаг и/или аннулировании индивидуальных номеров (кодов) дополнительных выпусков эмиссионных ценных бумаг
Реквизиты ценной бумаги	Наименование, код, вид, гос.рег. номер и иные параметры

#### 4.1.2. Уведомление о допуске Участников клиринга

Реквизиты	Порядок заполнения
Номер	Исходящий номер документа

Дата	Дата составления документа
Наименование документа	Уведомление о допуске Участников клиринга
Реквизиты Участника клиринга	Наименование, код, ИНН и иные параметры

#### 4.1.3. Уведомление о ценных бумагах

Реквизиты	Порядок заполнения
Номер	Исходящий номер документа
Дата	Дата составления документа
Наименование документа	Уведомление о ценных бумагах
Реквизиты ценной бумаги	Наименование, код, вид, гос.рег. номер и иные параметры

#### 4.1.4. Уведомление о неисполнении обязательств по сделкам с ценными бумагами

Реквизиты	Порядок заполнения
Номер	Исходящий номер документа
Дата	Дата составления документа
Наименование документа	Уведомление о неисполнении обязательств по сделкам с ценными бумагами
Реквизиты Участника клиринга	Краткое наименование и идентификатор Участника клиринга неисполнившего обязательства по сделке с ценными бумагами
Реквизиты сделки	Реквизиты сделки, обязательства по которой не исполнены

#### 4.2. Реквизиты электронных документов.

Реквизиты	Порядок заполнения
Дата	ГГГГММДД
Отправитель	Клиринговый центр
Получатель	Биржа
Тип документа	ВД14 - Уведомление о неисполнении обязательств по сделке с ценными бумагами ВД02 - Отчет о возможности / невозможности регистрации заявки ВД12 - Уведомление о необеспеченности сделки ВД13 - Уведомление об отказе в регистрации Сводного реестра сделок с ценными бумагами ВД09 - Сводная ведомость исполнения обязательств по внесению компенсационных взносов ВД10 - Отчет о досрочном исполнении сделок РЕПО ВД61 - Подтверждение Клирингового центра
Номер	Номер электронного документа

Сроки предоставления документов, направляемых Клиринговым центром Бирже, определены приложением № 2 к Правилам клиринга.

**ПРИЛОЖЕНИЕ 4  
К ПРАВИЛАМ ОСУЩЕСТВЛЕНИЯ  
КЛИРИНГОВОЙ ДЕЯТЕЛЬНОСТИ  
ЗАО АКБ «НАЦИОНАЛЬНЫЙ  
КЛИРИНГОВЫЙ ЦЕНТР» НА РЫНКЕ  
ЦЕННЫХ БУМАГ**

**Реквизиты документов, получаемых Клиринговым центром от  
Участников клиринга, Расчетной организации, Депозитария и Биржи**

**1. Реквизиты электронных документов, получаемых от Участников клиринга**

**1.1. Отчет на исполнение.**

<b>Реквизиты</b>	<b>Порядок заполнения</b>
Номер	Номер Отчета на исполнение
Дата	Дата регистрации Отчета на исполнение
Время	Время регистрации Отчета на исполнение
Реквизиты сделки	Номер сделки, по которой регистрируется Отчет на исполнение и иные параметры сделки
Наименование поручения	Отчет на исполнение

**1.2. Специальный отчет на исполнение.  
Срочный отчет на исполнение.**

<b>Реквизиты</b>	<b>Порядок заполнения</b>
Номер	Номер Специального отчета на исполнение / Срочного отчета на исполнение
Дата	Дата регистрации Специального отчета на исполнение / Срочного отчета на исполнение
Время	Время регистрации Специального отчета на исполнение / Срочного отчета на исполнение
Номер сделки/компенсационного взноса	Номера сделок и/или компенсационных взносов, по которым регистрируется Специальный отчет на исполнение / Срочный отчет на исполнение и иные параметры сделок и/или компенсационных взносов
Наименование поручения	Специальный отчет на исполнение / Срочный отчет на исполнение

**1.3. Поручение на внесение компенсационного взноса.  
Поручение на отказ от компенсационного взноса.**

<b>Реквизиты</b>	<b>Порядок заполнения</b>
Номер	Номер Поручения на внесение компенсационного взноса / Поручения на отказ от компенсационного взноса
Дата	Дата регистрации Поручения на внесение компенсационного взноса/Поручения на отказ от компенсационного взноса
Время	Время регистрации Поручения на внесение компенсационного взноса/Поручения на отказ от компенсационного взноса
Реквизиты сделки	Номер сделки, по которой регистрируется Поручение на внесение компенсационного взноса / Поручение на отказ от компенсационного взноса и иные параметры сделки
Обязательство	Сумма обязательства по компенсационному взносу
Наименование поручения	Поручение на внесение компенсационного взноса / Поручение на отказ от компенсационного взноса

#### 1.4. Поручение на клиринг внебиржевой сделки.

Реквизиты	Порядок заполнения
Номер	Номер поручения на клиринг внебиржевой сделки
Номер сделки	Номер внебиржевой сделки
Код расчетов	Код расчетов, определяющий условия исполнения сделки
Ценная бумага	Код ценной бумаги, являющейся предметом внебиржевой сделки
Участник клиринга – покупатель	Код Участника клиринга, имеющий обязательства по денежным средствам
Участник клиринга – продавец	Код Участника клиринга, имеющий обязательства по ценным бумагам
Сумма	Обязательство по денежным средствам
Количество	Обязательство по ценным бумагам
Торгово-клиринговый счет	Торгово-клиринговый счет Участника клиринга
Прочие реквизиты	Прочие реквизиты, которые участники клиринга имеют возможность указать в данном поручении (Дата заключения, срок РЕПО, НКД, комментариев и пр.)

#### 1.5. Заявление на регистрацию Торгово-клирингового счета.

Реквизиты	Порядок заполнения
Идентификатор Участника клиринга	Идентификатор Участника клиринга, присвоенный Клиринговым центром
Код Депозитария	Код Депозитария
Номер Раздела в Депозитарии	Номер Раздела в Депозитарии, соответствующего позиции по ценным бумагам
Номер счета депо в Депозитарии	Номер счета депо в Депозитарии, на котором открыт Раздел
Код Расчетной организации	Код Расчетной организации
Номер Счета в Расчетной организации	Заполняется при использовании основной позиции по денежным средствам
Тип дополнительной позиции	Заполняется при использовании дополнительной позиции по денежным средствам: «дополнительная собственная денежная позиция» / «дополнительная клиентская денежная позиция» / «дополнительная денежная позиция ДУ» / «дополнительная собственная валютная денежная позиция» / «дополнительная клиентская валютная денежная позиция» / «дополнительная валютная денежная позиция ДУ».
Код дополнительной позиции	Заполняется при использовании дополнительной позиции по денежным средствам: <b>12-ти-</b> значная последовательность из заглавных латинских букв и цифр, первые 7 символов которой должны представлять собой первые 7 символов кода Участника клиринга, присвоенного Клиринговым центром Банку/Уполномоченному Банку.

#### 1.6. Поручение на замену Торгово-клирингового счета.

Реквизиты	Порядок заполнения
Номер	Номер Поручения на замену Торгово-клирингового счета
Дата	Дата регистрации Поручения на замену Торгово-клирингового счета
Время	Время регистрации Поручения на замену Торгово-клирингового счета
Реквизиты сделки	Номер сделки, по которой регистрируется Поручение на замену Торгово-клирингового счета
Номер Торгово-клирингового счета	Новый номер Торгово-клирингового счета
Наименование поручения	Поручение на замену Торгово-клирингового счета

#### 1.7. Заявление о переводе денежных средств.

Реквизиты	Порядок заполнения
Номер	Номер Заявления о переводе денежных средств

Дата	Дата регистрации Заявления о переводе денежных средств
Время	Время регистрации Заявления о переводе денежных средств
Участник клиринга	Код Участника клиринга
Расчетный код списания	Расчетный код, по которому учитываются денежные средства, подлежащие списанию
Расчетный код зачисления	Расчетный код, по которому учитываются денежные средства, подлежащие зачислению
Код валюты	Код валюты
Сумма	Сумма денежных средств, подлежащая переводу

#### 1.8. Заявление на регистрацию Счета для возврата денежных средств.

Реквизиты	Порядок заполнения
Номер	Номер Заявления на регистрацию Счета для возврата денежных средств
Дата	Дата регистрации Заявления на регистрацию Счета для возврата денежных средств
Время	Время регистрации Заявления на регистрацию Счета для возврата денежных средств
Расчетный код	Расчетный код Участника клиринга
Реквизиты Счета для возврата денежных средств	Наименование банка-получателя, БИК, корреспондентский счет, расчетный/лицевой счет получателя, наименование получателя, ИНН/КПП получателя, swift-код

#### 1.9. Запрос о возврате денежных средств / ценных бумаг из Обеспечения.

Реквизиты	Порядок заполнения
Номер	Номер Запроса о возврате денежных средств / ценных бумаг из Обеспечения
Дата	Дата регистрации Запроса о возврате денежных средств / ценных бумаг из Обеспечения
Время	Время регистрации Запроса о возврате денежных средств / ценных бумаг из Обеспечения
Участник клиринга	Код Участника клиринга
Расчетный код / Раздел для учета ценных бумаг в Обеспечении	Расчетный код - в случае возврата денежных средств или номер Раздела для учета ценных бумаг в Обеспечении – в случае возврата ценных бумаг
Счет зачисления / Раздел для исполнения обязательств по сделкам клирингового пула	Номер счета для зачисления денежных средств или номер раздела для исполнения обязательств по сделкам клирингового пула
Сумма / количество	Сумма денежных средств или количество ценных бумаг, подлежащих возврату

#### 1.10. Подтверждение Поручения на передачу Дохода.

Реквизиты	Порядок заполнения
Номер	Номер Подтверждения Поручения на передачу Дохода
Дата	Дата регистрации Подтверждения Поручения на передачу Дохода
Время	Время регистрации Подтверждения Поручения на передачу Дохода
Номер	Номер Поручения на передачу Дохода

Электронные документы, получаемые от Участников клиринга, обрабатываются с использованием программного обеспечения Клирингового центра в порядке, определенном в разделах 4 – 8 Правил клиринга.



## **2. Документы, получаемые от Расчетной организации**

### **2.1. Реквизиты документов в бумажной форме.**

#### **2.1.1. Уведомление об открытии счета.**

<b>Реквизиты</b>	<b>Порядок заполнения</b>
Номер	Исходящий номер документа
Дата	Дата составления документа
Наименование документа	Уведомление об открытии счета
Реквизиты Счета	Наименование, номер и иные параметры

#### **2.1.2. Уведомление о закрытии счета.**

<b>Реквизиты</b>	<b>Порядок заполнения</b>
Номер	Исходящий номер документа
Дата	Дата составления документа
Наименование документа	Уведомление о закрытии счета
Реквизиты Счета	Наименование, номер и иные параметры

### **2.2. Реквизиты электронных документов.**

<b>Реквизиты</b>	<b>Порядок заполнения</b>
Дата	ГГГГММДД
Отправитель	Расчетная организация
Получатель	Клиринговый центр
Тип документа	0020 - Сведения о денежных средствах, зарезервированных на Счетах 0060- Уведомление об увеличении денежных средств на Счетах 0071– Запрос о возможности уменьшения суммы денежных средств на Счетах 0040 – Отчет об исполнении/неисполнении Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по денежным средствам (по итогам многостороннего клиринга) 0041 – Отчет об исполнении/неисполнении Ведомости по уплате комиссионного вознаграждения 0042 – Отчет об исполнении/неисполнении Ведомости по уплате возмещения 0046 – Отчет об исполнении/неисполнении Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по денежным средствам (по итогам простого клиринга) 0093 – Отчет об исполнении распоряжения на отмену Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по денежным средствам (по итогам многостороннего клиринга) 0094 – Отчет об исполнении распоряжения на отмену Ведомости по уплате комиссионного вознаграждения 0095 – Отчет об исполнении распоряжения на отмену Ведомости по уплате возмещения 0097 – Отчет об исполнении/неисполнении Распоряжения на отмену Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по денежным средствам (по итогам простого клиринга) 0146 – Отчет об исполнении/неисполнении Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по денежным средствам (по Срочным отчетам на исполнение) 0197 – Отчет об исполнении/неисполнении Распоряжения на отмену Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по денежным средствам (по Срочным отчетам на исполнение) 0346 – Отчет об исполнении/неисполнении Распоряжения на списание денежных средств с Клирингового счета
Исходящий номер	Исходящий номер электронного документа
Входящий номер	Входящий номер электронного документа
Количество повторяющихся	Количество повторяющихся последовательностей по всему

последовательностей	электронному документу
Результат обработки	Заполняется при необходимости

Электронные документы, получаемые от Расчетной организации, обрабатываются с использованием программного обеспечения Клирингового центра в порядке, определенном разделами 4 – 6 и 9 Правил клиринга и договором Клирингового центра с Расчетной организацией.

### **3. Документы, получаемые от Депозитария**

#### **3.1. Реквизиты электронных документов.**

<b>Реквизиты</b>	<b>Порядок заполнения</b>
Дата	ГГГГММДД
Отправитель	Депозитарий
Получатель	Клиринговый центр
Тип документа	Р – Информация о состоянии Разделов L – Отчет об остатках на Разделах С – Уведомление об увеличении остатков на Разделах W – Перечень поручений депо, приводящих к уменьшению зарезервированных ценных бумаг R – Отчет об исполнении/неисполнении Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по ценным бумагам (по итогам простого клиринга) O – Отчет об исполнении/неисполнении Распоряжения на отмену Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по ценным бумагам (по итогам простого клиринга) A – Отчет об исполнении Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по ценным бумагам (по итогам многостороннего клиринга) K – Отчет об исполнении Распоряжения на отмену Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по ценным бумагам (по итогам многостороннего клиринга) Q – Отчет об исполнении/неисполнении Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по ценным бумагам (по Срочным отчетам на исполнение) X – Отчет об исполнении/неисполнении Распоряжения на отмену Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по ценным бумагам (по Срочным отчетам на исполнение)
Исходящий номер	Исходящий номер электронного документа
Входящий номер	Входящий номер электронного документа
Количество повторяющихся последовательностей	Количество повторяющихся последовательностей по всему электронному документу
Результат обработки	Заполняется при необходимости

Электронные документы, получаемые от Депозитария, обрабатываются с использованием программного обеспечения Клиринговым центром в порядке, определенном разделами 4 – 6 и 9 Правил клиринга и договором Клирингового центра с Депозитарием.

#### **3.2. Реквизиты документов в бумажной форме.**

##### **3.2.1. Уведомление об объединении выпусков эмиссионных ценных бумаг и/или аннулировании индивидуальных номеров (кодов) дополнительных выпусков эмиссионных ценных бумаг.**

<b>Реквизиты</b>	<b>Порядок заполнения</b>
Номер	Исходящий номер документа
Дата	Дата составления документа
Наименование документа	Уведомление об объединении выпусков эмиссионных ценных бумаг и/или аннулировании индивидуальных номеров (кодов) дополнительных выпусков эмиссионных ценных бумаг
Реквизиты ценной бумаги	Наименование, код, вид, гос.рег. номер и иные параметры

**3.2.2. Отчет о неисполнении Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по ценным бумагам (по итогам многостороннего клиринга)**

Реквизиты	Порядок заполнения
Номер	Исходящий номер документа
Дата	Дата составления документа
Наименование документа	Отчет о неисполнении Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по ценным бумагам
Комментарий	Причина неисполнения Сводной ведомости по обязательствам и требованиям по ценным бумагам и иные параметры

**4. Документы, получаемые от Биржи**

**4.1. Реквизиты документов в бумажной форме.**

**4.1.1. Уведомление об отказе Участника торгов от получения возмещения.**

Реквизиты	Порядок заполнения
Номер	Исходящий номер документа
Дата	Дата составления документа
Наименование документа	Уведомление об отказе Участника торгов от получения возмещения
Реквизиты сделки	Номер, контрагенты и иные параметры

**4.1.2. Уведомление об Участниках торгов.**

Реквизиты	Порядок заполнения
Номер	Исходящий номер документа
Дата	Дата составления документа
Наименование документа	Уведомление об Участниках торгов
Реквизиты Участника торгов	Наименование, код, ИНН и иные параметры

**4.1.3. Уведомление о ценных бумагах.**

Реквизиты	Порядок заполнения
Номер	Исходящий номер документа
Дата	Дата составления документа
Наименование документа	Уведомление о ценных бумагах
Реквизиты ценной бумаги	Наименование, код, вид, гос.рег. номер и иные параметры

**4.1.4. Уведомление о прекращении допуска к торгам Участника торгов.**

Реквизиты	Порядок заполнения
Номер	Исходящий номер документа
Дата	Дата составления документа
Наименование документа	Уведомление о прекращении допуска к торгам Участника торгов
Реквизиты Участника торгов	Наименование, код, ИНН и иные параметры

**4.2. Реквизиты электронных документов.**

Реквизиты	Порядок заполнения
Дата	ГГГГММДД
Отправитель	Биржа
Получатель	Клиринговый центр
Тип документа	ВД01 - Информация о поданной заявке ВД03 - Уведомление о снятии заявки ВД04 - Уведомление о заключении сделки ВД11 - Выписка из реестра сделок ВД05 - Сводный реестр сделок с ценными бумагами ВД07 - Уведомление с информацией о кодах клиентов Участника клиринга ВД06 - Биржевая информация ВД08 - Сводный реестр компенсационных взносов ВД45 - Запрос о возможности заключения сделок

	ВД47 – Уведомление об окончании аукциона
Номер	Номер электронного документа

Электронные документы, получаемые от Биржи, обрабатываются с использованием программного обеспечения Клирингового центра в порядке, определенном разделами 4, 7 и 9 Правил клиринга и договором Клирингового центра с Биржей.

**ПРИЛОЖЕНИЕ 5  
К ПРАВИЛАМ ОСУЩЕСТВЛЕНИЯ  
КЛИРИНГОВОЙ ДЕЯТЕЛЬНОСТИ  
ЗАО АКБ "НАЦИОНАЛЬНЫЙ  
КЛИРИНГОВЫЙ ЦЕНТР" НА РЫНКЕ  
ЦЕННЫХ БУМАГ**

**Пункт 1.1.** Образец Договора об оказании клиринговых услуг, заключаемого с организациями, не являющимися Участниками клиринга.

**Договор об оказании клиринговых услуг № \_\_\_\_\_**

город Москва

«\_\_» \_\_\_\_\_ 20\_\_ года

<b>Участник клиринга (полное фирменное наименование)</b>	
<b>Клиринговая организация</b>	Акционерный Коммерческий Банк «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое акционерное общество)

1. Клиринговая организация обязуется в соответствии с правилами клиринга оказывать участнику клиринга клиринговые и иные связанные с клирингом услуги, а участник клиринга обязуется оплачивать указанные услуги.
2. Состав услуг, условия и порядок их оказания, размер и порядок оплаты, а также иные права и обязанности сторон, связанные с клиринговым обслуживанием, устанавливаются правилами клиринга клиринговой организации. Клиринговая организация вправе утверждать различные правила клиринга, регламентирующие различные направления клиринговой деятельности.

	<b>От имени участника клиринга</b>	<b>От имени клиринговой организации</b>
<b>ФИО</b>		
<b>Должность</b>		
<b>Основание полномочий</b>		
<b>Подпись, печать</b>		

**Пункт 1.2.** Образец Договора об оказании клиринговых услуг, заключаемого с организациями, являющимися Участниками клиринга.

**Договор об оказании клиринговых услуг № \_\_\_\_\_**

город Москва

«\_\_\_» \_\_\_\_\_ 20\_\_ года

<b>Участник клиринга (полное фирменное наименование)</b>	
<b>Клиринговая организация</b>	Акционерный Коммерческий Банк «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое акционерное общество)

1. Клиринговая организация обязуется в соответствии с правилами клиринга оказывать участнику клиринга клиринговые и иные связанные с клирингом услуги, а участник клиринга обязуется оплачивать указанные услуги.
2. Состав услуг, условия и порядок их оказания, размер и порядок оплаты, а также иные права и обязанности сторон, связанные с клиринговым обслуживанием, устанавливаются правилами клиринга клиринговой организации. Клиринговая организация вправе утверждать различные правила клиринга, регламентирующие различные направления клиринговой деятельности.
3. С даты начала оказания клиринговых услуг в соответствии с настоящим договором прекращается действие всех иных договоров, регламентирующих оказание клиринговых услуг, ранее заключенных между клиринговой организацией и участником клиринга.

	<b>От имени участника клиринга</b>	<b>От имени клиринговой организации</b>
<b>ФИО</b>		
<b>Должность</b>		
<b>Основание полномочий</b>		
<b>Подпись, печать</b>		

**ПРИЛОЖЕНИЕ 6  
К ПРАВИЛАМ ОСУЩЕСТВЛЕНИЯ  
КЛИРИНГОВОЙ ДЕЯТЕЛЬНОСТИ  
ЗАО АКБ «НАЦИОНАЛЬНЫЙ  
КЛИРИНГОВЫЙ ЦЕНТР» НА РЫНКЕ  
ЦЕННЫХ БУМАГ**

**Образцы документов в бумажной форме, получаемых Клиринговым центром от Участников клиринга, клиентов Участников клиринга и от Держателей**

**1. Формы документов в бумажном виде, получаемых Клиринговым центром от Участников клиринга**

**Пункт 1.1.**

**АНКЕТА УЧАСТНИКА КЛИРИНГА (КЛИЕНТА)  
(РЕГИСТРАЦИОННАЯ КАРТОЧКА)**

1.*	Полное наименование организации (из Устава)	
2.*	Сокращенное наименование организации (из Устава)	
3*.	Полное наименование организации на иностранном языке (из Устава, в случае отсутствия - применяемое на практике)	
4*.	Сокращенное наименование организации на иностранном языке (из Устава, в случае отсутствия - применяемое на практике)	
5.*	Организационно-правовая форма	
6.*	Коды форм Федерального государственного статистического наблюдения:	
6.1.*	ОКПО	
6.2.*	ОКВЭД	
6.3.*	ОКОГУ	
6.4.*	ОКФС	
6.5.*	ОКОПФ	
6.6*.	ОКАТО	
7*.	Сведения о государственной регистрации: дата, номер, наименование регистрирующего органа, место регистрации	
8.*	ИНН (или код иностранной организации – для нерезидента)	
	КПП	
	КПП 2 (указывается крупнейшими налогоплательщиками - при наличии)	
9*.	БИК	
10.	SWIFT-код	
11.*	Место нахождения по Уставу	
12*.	Фактический адрес	
13.*	Почтовый адрес (для направления корреспонденции)	
14.*	Телефон	
15.*	Факс	
16.*	Адрес электронной почты	
17.*	Адрес представительства организации в Интернете	
18*.	Сведения об органах управления юридического лица (структура и персональный состав органов управления юридического лица)	
19*.	Сведения о величине зарегистрированного и оплаченного	

	уставного (складочного) капитала или величине уставного фонда, имущества	
20*.	Сведения о присутствии или отсутствии по своему местонахождению юридического лица, его постоянно действующего органа управления, иного органа или лица, которые имеют право действовать от имени юридического лица без доверенности	
21*.	Количество филиалов	
22.	Для региональной организации - Московский филиал (представительство): почтовый адрес телефон Ф.И.О. руководителя (полностью) должность руководителя	
23.*	Лицензии на осуществление профессиональной деятельности (номер, кем и когда выданы с указанием видов деятельности, срок действия лицензии):	
23.1.*	На осуществление банковских операций	
23.2.*	Профессионального участника рынка ценных бумаг: Брокерская Дилерская Управление ценными бумагами Депозитарная	
23.3.*	На совершение товарных фьючерсных и опционных сделок в биржевой торговле (биржевого посредника)	
23.4.*	Лицензия на заключение биржевым посредником в биржевой торговле договоров, являющихся производными финансовыми инструментами, базисным активом которых является биржевой товар	
23.5*.	На осуществление деятельности, подлежащей лицензированию, не указанной в пп.23.1-23.3.	
24.*	Единоличный исполнительный орган организации (далее – руководитель организации): Ф.И.О. (полностью) должность документ о назначении на должность (наименование, дата, номер)	
24.1.*	Сведения о действующих квалификационных аттестатах руководителя организации: дата и номер протокола решения экзаменационной комиссии дата и номер протокола решения Аттестационной комиссии серия и номер квалификационного аттестата присвоенная квалификация	
25.*	Контролер организации: Ф.И.О. (полностью) должность документ о назначении на должность (название, дата, номер)	
25.1.*	Сведения о действующих квалификационных аттестатах контролера организации: дата и номер протокола решения экзаменационной комиссии дата и номер протокола решения Аттестационной комиссии серия и номер квалификационного аттестата присвоенная квалификация	
26*.	Сведения о наличии (отсутствии) корреспондентских счетов, открытых в банках государств (территорий), о которых известно, что они не соблюдают общепринятых стандартов в борьбе с легализацией (отмыванием) доходов, полученных	



	преступным путем, и финансированием терроризма, или являются иностранными государствами (иностранными территориями) с повышенным уровнем коррупции (если «имеются», то перечислить страны).	
27*.	Сведения о наличии (отсутствии) корреспондентских счетов, открытых в банках государств (на территориях), предоставляющих льготный налоговый режим и (или) не предусматривающих раскрытие и предоставление информации при проведении финансовых операций (оффшорных зонах) (если «имеются», то перечислить страны)	
28*.	Сведения о наличии (отсутствии) корреспондентских счетов, открытых в банках государств или территорий, о которых из международных источников известно, что в них незаконно производятся или переправляются наркотические вещества, а также государств или территорий, разрешающих свободный оборот наркотических веществ (кроме государств или территорий, использующих наркотические вещества исключительно в медицинских целях) (если «имеются», то перечислить страны).	
29*.	Сведения о наличии (отсутствии) счетов, открытых «банкам-оболочкам» («банк-оболочка» - банк, зарегистрированный под юрисдикцией государства, в котором у данного банка нет представительства). Если имеются открытые счета «банкам-оболочкам», то указать их полное наименование и реквизиты счетов.	
30*.	Контактные лица:	
30.1*.	Сотрудники, курирующие вопросы осуществления операций:	
	Ф.И.О.(полностью)	
	должность	
	контактные телефоны	
	адрес электронной почты	
31*.	Сведения об осуществлении мероприятий по противодействию легализации (отмыванию) доходов, полученных преступным путем, и финансированию терроризма	

Должность \_\_\_\_\_

(руководитель организации или иное уполномоченное лицо)<sup>1</sup> (Ф. И. О.)

м.п.

Исполнитель, тел. \_\_\_\_\_

(ФИО, номер телефона исполнителя регистрационной карточки)

<sup>1</sup> Если лицо, подписавшее Анкету Участника клиринга (клиента) (Регистрационную карточку), действует на основании доверенности, то к настоящей Анкете Участника клиринга (клиента) (Регистрационной карточке) должна быть приложена нотариально удостоверенная копия указанной доверенности, подтверждающей полномочия лица на подписание Анкеты Участника клиринга (клиента) (Регистрационной карточки).

**Пункт 1.2.**

На бланке организации  
В ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр»

**УВЕДОМЛЕНИЕ**

“ \_\_\_ ” \_\_\_\_\_ 20\_\_ г.

\_\_\_\_\_  
(полное наименование Банка/Уполномоченного Банка)

(далее – Банк/Уполномоченный Банк) в лице \_\_\_\_\_,  
действующего на основании \_\_\_\_\_, уведомляет ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр»  
в соответствии с Правилами осуществления клиринговой деятельности ЗАО АКБ «Национальный  
Клиринговый Центр» на рынке ценных бумаг (далее – Правила клиринга) о своем согласии на проведение  
клиринга и расчетов по обязательствам и требованиям Участника клиринга \_\_\_\_\_

\_\_\_\_\_  
(полное наименование Участника клиринга)

по денежным средствам по сделкам, заключенным с использованием его дополнительной позиции по  
денежным средствам:

Идентификатор Банка	Номер Счета Банка в РО	Идентификатор Участника клиринга, которому открывается дополнительная позиция по денежным средствам	Тип дополнительной позиции <sup>8</sup>	Код дополнительной позиции <sup>9</sup>

Должность руководителя  
Банка/Уполномоченного Банка

<подпись>

< И. О. Фамилия >

М.П.

<sup>8</sup> **Тип дополнительной позиции:** дополнительная собственная денежная позиция  
дополнительная клиентская денежная позиция  
дополнительная денежная позиция ДУ  
дополнительная собственная валютная денежная позиция  
дополнительная клиентская валютная денежная позиция  
дополнительная валютная денежная позиция ДУ

<sup>9</sup> **Код дополнительной позиции:** 12-ти значная последовательность из заглавных латинских букв и цифр, первые 7 символов которой должны представлять собой первые 7 символов кода Участника клиринга, присвоенного Клиринговым центром Банку/Уполномоченному Банку

### Пункт 1.3.

На бланке организации

#### Доверенность № \_\_\_\_\_

г. \_\_\_\_\_ “ \_\_\_\_ ” \_\_\_\_\_ 20\_\_ г.

\_\_\_\_\_  
(наименование организации - Участника клиринга)

в лице \_\_\_\_\_  
(должность, Фамилия, Имя, Отчество)

действующе \_\_\_ на основании\* \_\_\_\_\_  
(наименование документа и его реквизиты)

#### уполномочивает:

1. \_\_\_\_\_  
(Фамилия, Имя, Отчество представителя)

паспорт номер \_\_\_\_\_, выдан \_\_\_\_\_  
(кем и когда выдан)

Образец подписи \_\_\_\_\_

2. \_\_\_\_\_  
(Фамилия, Имя, Отчество представителя)

паспорт номер \_\_\_\_\_, выдан \_\_\_\_\_  
(кем и когда выдан)

Образец подписи \_\_\_\_\_

**предоставлять и получать документы (включая отчетные документы) в ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр», оформляемые в соответствии с внутренними документами ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр», регламентирующими проведение операций, связанных с заключением сделок на биржевых рынках ММВБ-РТС, а также осуществлением клиринга по заключенным сделкам.**

Подпись(и) вышеуказанного(ых) уполномоченного(ых) лиц(а) удостоверяю.

Настоящая доверенность выдана без права передоверия и действительна по « \_\_\_\_ » \_\_\_\_\_ 20\_\_ г. включительно.

Контактный телефон: \_\_\_\_\_

Подпись \_\_\_\_\_  
(занимаемая должность и Ф.И.О. лица, выдавшего Доверенность)

М.П.

\* в случае выдачи доверенности лицом, действующим не на основании Устава, доверенность должна быть нотариально удостоверена (статья 187 Гражданского кодекса Российской Федерации)

**Пункт 1.4.**

На бланке организации  
В ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр»

**Заявление о соответствии Счета идентификатору**

От: \_\_\_\_\_  
(полное наименование и идентификатор Участника клиринга)

Прошу установить соответствие между счетом, открытым в Небанковской кредитной организации закрытом акционерном обществе «Национальный расчетный депозитарий» № \_\_\_\_\_ и идентификатором № \_\_\_\_\_, присвоенным нашей организации в Клиринговой системе ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр».

Должность \_\_\_\_\_  
(руководитель организации или  
иное уполномоченное лицо\*)

(И. О. Фамилия)

М.П.

\* Если лицо, подписавшее Заявление, действует на основании доверенности, то к настоящему Заявлению должна быть приложена нотариально удостоверенная копия указанной доверенности, подтверждающей полномочия лица на подписание Заявления.

**Пункт 1.5.**

На бланке организации  
В ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр»

**З А Я В Л Е Н И Е  
на регистрацию ТКС**

“ \_\_\_ ” \_\_\_\_\_ 20\_\_ г.

От: \_\_\_\_\_  
(полное наименование и идентификатор Участника клиринга)

Прошу зарегистрировать в Клиринговой системе ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр» торгово-клиринговый счет, обеспечивающий взаимосвязь между:

- позицией по ценным бумагам, соответствующей следующим данным:

Наименование Депозитария	Номер Раздела в Депозитарии	Номер счета депо в Депозитарии
Небанковская кредитная организация закрытое акционерное общество «Национальный расчетный депозитарий»		

- и основной (дополнительной) позицией по денежным средствам, соответствующей следующим данным:

Номер Торгового счета в Расчетной организации	Тип дополнительной позиции <sup>10</sup>	Код дополнительной позиции <sup>11</sup>
(заполняется при необходимости указания основной позиции по денежным средствам)	(заполняется при необходимости указания дополнительной позиции по денежным средствам)	(заполняется при необходимости указания дополнительной позиции по денежным средствам)

Должность \_\_\_\_\_  
(руководитель организации или  
иное уполномоченное лицо\*)

(И. О. Фамилия)

М.П.

\* Если лицо, подписавшее Заявление, действует на основании доверенности, то к настоящему Заявлению должна быть приложена нотариально удостоверенная копия указанной доверенности, подтверждающей полномочия лица на подписание Заявления.

<sup>10</sup> **Тип дополнительной позиции:** дополнительная собственная денежная позиция  
дополнительная клиентская денежная позиция  
дополнительная денежная позиция ДУ  
дополнительная собственная валютная денежная позиция  
дополнительная клиентская валютная денежная позиция  
дополнительная валютная денежная позиция ДУ

<sup>11</sup> **Код дополнительной позиции:** 12-ти значная последовательность из заглавных латинских букв и цифр, первые 7 символов которой должны представлять собой первые 7 символов кода Участника клиринга, присвоенного Клиринговым центром Банку/Уполномоченному Банку

## Пункт 1.6.

На бланке организации  
В ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр»

### Заявление о торговом счете для возмещения и комиссии

От: \_\_\_\_\_  
(полное наименование и идентификатор Участника клиринга)

Прошу взимать/зачислять возмещение и взимать комиссионное вознаграждение по сделкам с ценными бумагами, заключенным нашей организацией за иностранную валюту, а также иные виды вознаграждения в случаях, предусмотренных Правилами клиринга, с торгового счета, открытого Небанковской кредитной организацией закрытом акционерном обществе «Национальный расчетный депозитарий» № \_\_\_\_\_.

\*Дополнительная собственная денежная позиция № \_\_\_\_\_

Должность \_\_\_\_\_  
(руководитель организации или  
иное уполномоченное лицо\*\*)

(И. О. Фамилия)

М.П.

\* Заполняется при необходимости.

\*\* Если лицо, подписавшее Заявление, действует на основании доверенности, то к настоящему Заявлению должна быть приложена нотариально удостоверенная копия указанной доверенности, подтверждающей полномочия лица на подписание Заявления.

## Пункт 1.7.

На бланке организации  
В ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр»

### Заявление о ТКС для внебиржевых сделок

От: \_\_\_\_\_  
(полное наименование и идентификатор Участника клиринга)

Прошу для исполнения обязательств по внебиржевым сделкам прямого РЕПО с Банком России зарегистрировать в Клиринговой системе ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр» следующий торгово-клиринговый счет:

Номер ТКС	Номер Раздела в Депозитарии	Номер счета депо в Депозитарии	Номер Торгового счета в РП/ Код дополнительной позиции

Должность \_\_\_\_\_  
(руководитель организации или  
иное уполномоченное лицо\*)

(И. О. Фамилия)

М.П.

\* Если лицо, подписавшее Заявление, действует на основании доверенности, то к настоящему Заявлению должна быть приложена нотариально удостоверенная копия указанной доверенности, подтверждающей полномочия лица на подписание Заявления.

**Пункт 1.8.**

На бланке организации  
В ЗАО «ФБ ММВБ»  
В ОАО Московская Биржа  
В ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр»

**Заявление о выборе (смене) тарифного плана по сделкам РЕПО**

От: \_\_\_\_\_  
(полное наименование и идентификатор Участника клиринга)

В соответствии с Правилами осуществления клиринговой деятельности ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр» на рынке ценных бумаг просим с \_\_\_\_\_ установить для нашей организации тарифный план \_\_\_\_\_  
(месяц, год)  
(1 «Базовый» / 2 «Экономный» / 3 «Лидер»)

Должность \_\_\_\_\_  
(руководитель организации или  
иное уполномоченное лицо\*)

(И. О. Фамилия)

М.п.

« \_\_\_\_ » \_\_\_\_\_ 20\_\_ год.

Исполнитель Ф.И.О., телефон \_\_\_\_\_

\* Если лицо, подписавшее Заявление, действует на основании доверенности, то к настоящему Заявлению должна быть приложена нотариально удостоверенная копия указанной доверенности, подтверждающей полномочия лица на подписание Заявления.

**Пункт 1.9.**

**В ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр»**

**Поручение на клиринг внебиржевой сделки**

Просим зарегистрировать в Клиринговой системе и принять в клиринг внебиржевую сделку со следующими параметрами:

Наименование реквизита	Порядок заполнения
Номер сделки	Номер внебиржевой сделки.
Тип сделки	«Сделка РЕПО» / «Сделка купли-продажи»
Код расчетов	Код расчетов в соответствии с Правилами торговли
Ценная бумага	ISIN-код ценной бумаги
Количество	Количество ценных бумаг, в штуках
Объем сделки	Объем сделки купли-продажи или Сумма репо, в российских рублях
Ставка РЕПО	Ставка РЕПО (в %)
Дата заключения сделки	Дата заключения сделки в формате DD.MM.YYYY
Срок сделки РЕПО	Срок РЕПО (в днях)
Начальный Дисконт	Начальное значение Дисконта для сделки РЕПО
<b>Информация об Участнике клиринга - продавце:</b>	
Код Участника клиринга 1	Код Участника клиринга – продавца / Участника клиринга – продавца по первой части РЕПО
Наименование Участника 1	Краткое наименование Участника клиринга – продавца / Участника клиринга – продавца по первой части РЕПО
Клиринговый идентификатор Участника клиринга 1	Клиринговый идентификатор в Клиринговой системе
Код клиента 1	Краткий код клиента, зарегистрированного в Клиринговом центре
Направление сделки (со стороны Участника клиринга 1)	«S» - продажа ценных бумаг / продажа ценных бумаг по <b>первой</b> части РЕПО
Торгово-клиринговый счет	Код Торгово-клирингового счета
Торговый счет	Номер торгового счета, соответствующий указанному Торгово-клиринговому счету
Номер счета депо и номер торгового раздела	Номер счета депо и торгового раздела в НКО ЗАО НРД, соответствующие указанному Торгово-клиринговому счету
<b>Информация об Участнике клиринга - покупателе:</b>	
Код Участника клиринга 2	Код Участника клиринга – покупателя / Участника клиринга – покупателя по первой части РЕПО
Наименование Участника клиринга 2	Краткое наименование Участника клиринга – покупателя / Участника клиринга – покупателя по первой части РЕПО



Клиринговый идентификатор Участника клиринга 2	Клиринговый идентификатор в Клиринговой системе
Код клиента 2	Краткий код клиента, зарегистрированного в Клиринговом центре
Направление сделки (со стороны участника клиринга 2)	«В» - покупка ценных бумаг / покупка ценных бумаг по <b>первой</b> части РЕПО
Торгово-клиринговый счет	Код Торгово-клирингового счета
Торговый счет	Номер торгового счета, соответствующий указанному Торгово-клиринговому счету
Номер счета депо и номер торгового раздела	Номер счета депо и торгового раздела в НКО ЗАО НРД, соответствующие указанному Торгово-клиринговому счету

**Реквизиты и подписи сторон:**

<p><b>Участник клиринга 1</b></p>       <p>_____</p> <p><i>Подпись уполномоченного лица организации,</i>        м.п.</p>	<p><b>Участник клиринга 2</b></p>       <p>_____</p> <p><i>Подпись уполномоченного лица организации,</i>        м.п.</p>
---	---

## Пункт 1.10.

На бланке организации  
В ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр»

### Заявление о предоставлении отчетов Держателю

От: \_\_\_\_\_  
(полное наименование и идентификатор Участника клиринга)

Прошу предоставлять \_\_\_\_\_  
(полное наименование и идентификатор Держателя)

отчет EQM6D «Выписка из реестра сделок, принятых в клиринг (для Держателей)», содержащий информацию о сделках, заключенных нашей организацией с указанием Торгово-клиринговых счетов, в состав которых входят позиции по ценным бумагам, определяемые в отношении Разделов указанного Держателя.

Должность \_\_\_\_\_  
(руководитель организации или  
иное уполномоченное лицо\*)

(И. О. Фамилия)

М.П.

\* Если лицо, подписавшее Заявление, действует на основании доверенности, то к настоящему Заявлению должна быть приложена нотариально удостоверенная копия указанной доверенности, подтверждающей полномочия лица на подписание Заявления.

## Пункт 1.11.

На бланке организации  
В ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр»

### Заявление о предоставлении отчетов Клиринговому банку

От: \_\_\_\_\_  
(полное наименование и идентификатор Участника клиринга)

Прошу предоставлять \_\_\_\_\_  
(полное наименование и идентификатор Клирингового банка)

отчет EQM6B «Выписка из реестра сделок, принятых в клиринг (для Клиринговых банков)», содержащий информацию о сделках, заключенных нашей организацией с указанием Торгово-клиринговых счетов, в состав которых входят позиции по денежным средствам, определяемые в отношении Счетов указанного Клирингового банка.

Должность \_\_\_\_\_  
(руководитель организации или  
иное уполномоченное лицо\*)

(И. О. Фамилия)

М.П.

\* Если лицо, подписавшее Заявление, действует на основании доверенности, то к настоящему Заявлению должна быть приложена нотариально удостоверенная копия указанной доверенности, подтверждающей полномочия лица на подписание Заявления.

## Пункт 1.12.

На бланке организации  
В ЗАО «ФБ ММВБ»  
В ОАО Московская Биржа  
В ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр»

### Заявление о выборе тарифного плана «Размещения-фиксированный»

От: \_\_\_\_\_  
(полное наименование и идентификатор Участника клиринга)

В соответствии с Правилами осуществления клиринговой деятельности ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр» на рынке ценных бумаг просим с \_\_\_\_\_ установить для  
(квартал, год)  
нашей организации на период 4 (четыре) квартала тарифный план «Размещения-фиксированный» по сделкам с облигациями и/или еврооблигациями следующих эмитентов ценных бумаг:

1. \_\_\_\_\_  
(полное наименование эмитента)
2. \_\_\_\_\_  
(полное наименование эмитента)

Должность \_\_\_\_\_  
(руководитель организации или  
иное уполномоченное лицо\*)

(И. О. Фамилия)

М.П.

« \_\_\_\_ » \_\_\_\_\_ 20 \_\_\_\_ год.

Исполнитель Ф.И.О., телефон \_\_\_\_\_

\* Если лицо, подписавшее Заявление, действует на основании доверенности, то к настоящему Заявлению должна быть приложена нотариально удостоверенная копия указанной доверенности, подтверждающей полномочия лица на подписание Заявления.

## Пункт 1.13.

На бланке организации  
В ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр»

### Заявление о возврате взноса в Коллективный фонд

От: \_\_\_\_\_  
(полное наименование и идентификатор Участника клиринга)

Прошу вернуть взнос в Коллективный фонд по следующим реквизитам:

Должность \_\_\_\_\_  
(руководитель организации или  
иное уполномоченное лицо\*)

(И. О. Фамилия)

М.П.

\* Если лицо, подписавшее Заявление, действует на основании доверенности, то к настоящему Заявлению должна быть приложена нотариально удостоверенная копия указанной доверенности, подтверждающей полномочия лица на подписание Заявления.

**Пункт 1.14.**

На бланке организации  
**В ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр»**

Настоящим \_\_\_\_\_  
(полное наименование Участника клиринга)

подтверждает, что им проведена полная процедура идентификации в соответствии с Федеральным законом №115-ФЗ от 07.08.2001 г. «О противодействии легализации (отмыванию) доходов, полученных преступным путем, и финансированию терроризма», своего Клиента

\_\_\_\_\_,  
(полное наименование Клиента Участника клиринга)

а также подтверждает, что по этому Клиенту имеет в наличии документы, подтверждающие сведения, полученные при идентификации.

Участник клиринга обязуется представить ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр» по его требованию сведения, полученные при проведении идентификации указанного Клиента.

Должность \_\_\_\_\_  
(руководитель организации или  
иное уполномоченное лицо\*)

(И. О. Фамилия)

М.П.

\* Если лицо, подписавшее Заявление, действует на основании доверенности, то к настоящему Заявлению должна быть приложена нотариально удостоверенная копия указанной доверенности, подтверждающей полномочия лица на подписание Заявления.

**Пункт 1.15.**

На бланке организации  
В ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр»

**Постоянное поручение на депонирование денежных средств и/или ценных бумаг**

От: \_\_\_\_\_  
(полное наименование и идентификатор Участника клиринга)

Расчетный код Участника клиринга: \_\_\_\_\_.

В соответствии с Правилами осуществления клиринговой деятельности ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр» на рынке ценных бумаг просим на постоянной основе денежные средства, ценные бумаги,  
(указать нужное)

причитающиеся нашей организации по итогам прекращения Итоговых нетто-требований не возвращать из Обеспечения.

Настоящее поручение действительно до его письменной отмены.

Должность \_\_\_\_\_  
(руководитель организации или  
иное уполномоченное лицо\*)

(И. О. Фамилия)

М.П.

\* Если лицо, подписавшее Заявление, действует на основании доверенности, то к настоящему Заявлению должна быть приложена нотариально удостоверенная копия указанной доверенности, подтверждающей полномочия лица на подписание Заявления.

**Пункт 1.16.**

На бланке организации  
В ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр»

**Заявление о заключении сделок купли-продажи**

От: \_\_\_\_\_  
(полное наименование и идентификатор Участника клиринга)

Расчетный код Участника клиринга: \_\_\_\_\_.

В соответствии с Правилами осуществления клиринговой деятельности ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр» на рынке ценных бумаг просим при урегулировании случаев неисполнения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением заключать с нашей организацией две сделки купли-продажи ценных бумаг.

Настоящее заявление действует до его письменной отмены.

Должность \_\_\_\_\_  
(руководитель организации или  
иное уполномоченное лицо\*)

(И. О. Фамилия)

М.П.

\* Если лицо, подписавшее Заявление, действует на основании доверенности, то к настоящему Заявлению должна быть приложена нотариально удостоверенная копия указанной доверенности, подтверждающей полномочия лица на подписание Заявления.

**Пункт 1.17.**

На бланке организации  
В ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр»

**Заявление о Торгово-клиринговых счетах  
для заключения Договоров займа Клирингового центра**

От: \_\_\_\_\_  
(полное наименование и идентификатор Участника клиринга)

В соответствии с Правилами осуществления клиринговой деятельности ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр» на рынке ценных бумаг просим заключать Договоры займа Клирингового центра с использованием следующих Торгово-клиринговых счетов:

\_\_\_\_\_  
(перечень Торгово-клиринговых счетов)

Должность \_\_\_\_\_  
(руководитель организации или  
иное уполномоченное лицо\*)

(И. О. Фамилия)

М.П.

\* Если лицо, подписавшее Заявление, действует на основании доверенности, то к настоящему Заявлению должна быть приложена нотариально удостоверенная копия указанной доверенности, подтверждающей полномочия лица на подписание Заявления.

**Пункт 1.18.**

На бланке организации  
В ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр»

**Заявление о неиспользовании денежных средств, учитываемых на торговых счетах,  
при подаче заявок на заключение Сделок с частичным обеспечением**

От: \_\_\_\_\_  
(полное наименование и идентификатор Участника клиринга)

Расчетный код Участника клиринга: \_\_\_\_\_.

В соответствии с Правилами осуществления клиринговой деятельности ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр» на рынке ценных бумаг просим не использовать денежные средства, учитываемые на торговых счетах, соответствующих указанному Расчетному коду, при подаче заявок на заключение Сделок с частичным обеспечением.

Настоящее заявление действует до его письменной отмены.

Должность \_\_\_\_\_  
(руководитель организации или  
иное уполномоченное лицо\*)

(И. О. Фамилия)

М.П.

\* Если лицо, подписавшее Заявление, действует на основании доверенности, то к настоящему Заявлению должна быть приложена нотариально удостоверенная копия указанной доверенности, подтверждающей полномочия лица на подписание Заявления.

**Пункт 1.19.**

**Опросная Анкета Банка – нерезидента**

Являются ли банки в Вашей стране субъектами исполнения законодательства о противодействии отмыванию преступных доходов и финансированию терроризма? Если да, то укажите, пожалуйста, действующие законодательные и иные нормативные акты в области противодействия отмыванию преступных доходов и финансированию терроризма, которые обязан соблюдать Ваш Банк.	
Приняты ли в Банке нормативные документы, регламентирующие процедуры осуществления внутреннего контроля, направленного на противодействие отмыванию преступных доходов и финансированию терроризма? Если да, то перечислите, пожалуйста, их.	
Имеются ли у Вашего Банка филиалы и дочерние общества? Если да, то перечислите, пожалуйста. Все ли филиалы и дочерние общества Вашего Банка придерживаются той же политики в области противодействия отмыванию преступных доходов и финансированию терроризма, что и головная организация?	
Назначен ли в Вашем Банке сотрудник, ответственный за организацию работы, направленной на противодействие отмыванию преступных доходов и финансированию терроризма? Укажите его ФИО, должность, телефон, факс, адрес электронной почты	
Применяется ли Вашим Банком процедура «Знай своего клиента»? Если да, то, каким образом?	
Является ли учет и хранение документов и информации составной частью процедуры внутреннего контроля в области противодействия отмыванию преступных доходов и финансированию терроризма?	
Проводится ли проверка потенциальных клиентов на предмет наличия информации о них в списках лиц и организаций, причастных к террористической деятельности?	
Осуществляется ли обучение сотрудников Банка по вопросам противодействия отмыванию преступных доходов и финансированию терроризма?	

(Должность руководителя) \_\_\_\_\_ /Ф.И.О./  
м.п.

« \_\_\_\_ » \_\_\_\_\_ 20 \_\_\_\_ год.

Исполнитель Ф.И.О., телефон \_\_\_\_\_

## 2. Формы документов в бумажном виде, получаемых Клиринговым центром от клиента Участника клиринга (эмитента).

### Пункт 2.1.

На бланке организации

В ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр»

#### УВЕДОМЛЕНИЕ

“\_\_” \_\_\_\_\_ 20\_\_ г.

\_\_\_\_\_  
(полное наименование клиента Участника клиринга)

(далее – клиент Участника клиринга) в лице \_\_\_\_\_, действующего на основании \_\_\_\_\_, уведомляет ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр» в соответствии с Правилами осуществления клиринговой деятельности ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр» на рынке ценных бумаг (далее – Правила клиринга) о своем согласии на проведение клиринга и расчетов:

- по обязательствам и требованиям \_\_\_\_\_

\_\_\_\_\_  
(полное наименование и идентификатор Участника клиринга)

(далее - Участник клиринга) по денежным средствам по сделкам, заключенным с использованием его клиентской денежной позиции / валютной клиентской денежной позиции, через торговый счет клиента Участника клиринга / валютный торговый счет клиента Участника клиринга в Небанковской кредитной организации \_\_\_\_\_ закрытом акционерном обществе «Национальный расчетный депозитарий» № \_\_\_\_\_.

Должность руководителя  
клиента Участника клиринга

<подпись>

< И. О. Фамилия >

М.П.



### 3. Формы документов в бумажном виде, получаемых Клиринговым центром от Держателей.

#### Пункт 3.1.

На бланке организации  
В ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр»

#### З А Я В Л Е Н И Е

“ \_\_\_ ” \_\_\_\_\_ 20\_\_ г.

Настоящим \_\_\_\_\_  
(наименование организации)

просит предоставить статус Держателя в соответствии с Правилами осуществления клиринговой деятельности ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр» на рынке ценных бумаг (далее – Правила клиринга) и обязуется:

- соблюдать требования, предъявляемые к Держателям в Правилах клиринга;
- разрешать все споры, вытекающие из добросовестного выполнения Держателем своих прав и обязанностей, а также связанные с применением и толкованием положений Правил клиринга, в порядке, установленном Правилами клиринга.

Приложение: копия лицензии профессионального участника рынка ценных бумаг на право осуществления депозитарной деятельности (для резидентов).

Должность \_\_\_\_\_  
(руководитель организации или  
иное уполномоченное лицо\*)

(И. О. Фамилия)

М.П.

\* Если лицо, подписавшее Заявление, действует на основании доверенности, то к настоящему Заявлению должна быть приложена нотариально удостоверенная копия указанной доверенности, подтверждающей полномочия лица на подписание Заявления.

**ПРИЛОЖЕНИЕ 7  
К ПРАВИЛАМ ОСУЩЕСТВЛЕНИЯ  
КЛИРИНГОВОЙ ДЕЯТЕЛЬНОСТИ  
ЗАО АКБ "НАЦИОНАЛЬНЫЙ  
КЛИРИНГОВЫЙ ЦЕНТР" НА РЫНКЕ  
ЦЕННЫХ БУМАГ**

**Порядок проведения технической экспертизы**

1. Проведение технической экспертизы в случае возникновения конфликтной ситуации в связи с использованием АСП осуществляется технической комиссией, формируемой в случае невозможности разрешения конфликтной ситуации в рабочем порядке.
2. Если стороны в конфликтной ситуации не договорятся об ином, в состав технической комиссии входит равное количество, но не менее чем по одному уполномоченному представителю каждой из конфликтующих сторон и Технического центра. Право представлять в технической комиссии соответствующую сторону должно подтверждаться доверенностью, выданной каждому представителю на срок работы технической комиссии.
3. Проведение технической экспертизы при разрешении конфликтных ситуаций в соответствии с особенностями функционирования Клиринговой системы требует применения специального программного и информационного обеспечения для выполнения необходимых проверок и документирования данных, используемых при выполнении необходимых проверок.
4. Для проведения технической экспертизы необходимы:
  - информация от заявителя претензии (Участника клиринга или Клирингового центра) о параметрах электронного сообщения, в отношении которого проводится техническая экспертиза;
  - дата и время формирования электронного сообщения;
  - номер электронного сообщения, зарегистрированный в Клиринговой системе;
  - параметры электронного сообщения, необходимые для рассмотрения претензии;
  - архив регистрации транзакций в Клиринговой системе на указанную дату (файл TransLog);
  - файлы с электронными сообщениями на указанную дату;
  - рабочее место, позволяющее просматривать и распечатывать информацию из файла TransLog и файлов с электронными сообщениями в удобном для восприятия членами технической комиссии виде;
  - отчетные документы, подтверждающие направление в установленном порядке уведомления о присвоении Клирингового идентификатора уполномоченному представителю заявителю претензии.
5. Проведение технической экспертизы включает в себя выполнение следующих действий:
  - изготовление (распечатку) на бумажном носителе копии электронного сообщения, в отношении которого проводится техническая экспертиза;

- проверку наличия в изготовленной (распечатанной) на бумажном носителе копии электронного сообщения информации о регистрации электронного сообщения, в отношении которого проводится техническая экспертиза;
- проверку соответствия АСП в копии электронного сообщения на бумажном носителе присвоенному Участнику клиринга / Клиринговому центру Клиринговому идентификатору;
- фиксирование результатов проверки в протоколе работы технической комиссии.

6. В случае, если:

- электронное сообщение, в отношении которого проводится техническая экспертиза, найдено в файле TransLog;
- электронное сообщение, в отношении которого проводится техническая экспертиза, соответствует копии электронного сообщения, изготовленной (распечатанной) на бумажном носителе;
- установлено соответствие АСП в копии электронного сообщения на бумажном носителе присвоенному Участнику клиринга / Клиринговому центру Клиринговому идентификатору;

считается установленным, что:

- электронное сообщение, в отношении которого возникла конфликтная ситуация, было сформировано Участником клиринга / Клиринговым центром;
- после подачи электронного сообщения Участником клиринга / Клиринговым центром с использованием Клиринговой системы не было изменено ни одного параметра данного электронного сообщения.

7. Все действия, предпринимаемые технической комиссией для выяснения фактических обстоятельств, а также выводы, сделанные комиссией, заносятся в Протокол работы технической комиссии. Протокол работы технической комиссии должен содержать следующие данные:

- состав технической комиссии с указанием сведений о должности и месте работы каждого из членов технической комиссии;
- краткое изложение обстоятельств возникшей конфликтной ситуации;
- мероприятия, проводимые технической комиссией для установления причин и последствий возникшей конфликтной ситуации, с указанием даты, времени и места их проведения;
- выводы, к которым пришла техническая комиссия в результате проведенных мероприятий;
- подписи всех членов технической комиссии.

Протокол составляется на бумажном носителе в количестве экземпляров, равном количеству организаций, уполномоченные представители которых принимали участие в работе технической комиссии.

**ПРИЛОЖЕНИЕ 8  
 К ПРАВИЛАМ ОСУЩЕСТВЛЕНИЯ  
 КЛИРИНГОВОЙ ДЕЯТЕЛЬНОСТИ  
 ЗАО АКБ "НАЦИОНАЛЬНЫЙ  
 КЛИРИНГОВЫЙ ЦЕНТР" НА РЫНКЕ  
 ЦЕННЫХ БУМАГ**

**Порядок изменения позиций**

**Обозначения, используемые в таблицах:**

S – сумма операции, указанная в заявке, запросе или реестре (в рублях, если не указано иное).

V – объем операции, указанный в заявке, запросе, сделке или реестре (в шт. ценных бумаг).

K – сумма комиссионного вознаграждения, рассчитанная по заявке (в рублях).

Сделки - сумма операции в соответствии с условиями сделки (в рублях, если не указано иное), где Сделки  $\leq S$  для заявок на покупку, Сделки  $\geq S$  для заявок на продажу.

Ксделки – сумма комиссионного вознаграждения (в рублях), рассчитанная по сделке, где Ксделки  $\leq K$  для заявок на покупку, Ксделки  $\geq K$  для заявок на продажу.

↑ - увеличение.

↓ - уменьшение.

**1. Порядок установления и изменения начальных, контрольных и плановых позиций по денежным средствам**

№	Операция	Значение позиции по денежным средствам (в соответствующей валюте)		
		Начальное	Плановое	Контрольное
1.	Получение от Расчетной организации информации об остатках денежных средств, зарезервированных на Счетах (S – остаток денежных средств, зарезервированных на соответствующем этим позициям Счете)	= S	= S	= S
2.	<b>Зачисление / списание денежных средств</b>			
2.1.	Зачисление денежных средств на Счет в сумме S, в том числе при возврате денежных средств из Обеспечения	↑ на S	↑ на S	↑ на S
2.2.	Уменьшение суммы денежных средств, зарезервированных на Счете, на основании Запроса о возможности уменьшения суммы денежных средств на Счетах, полученного от Расчетной организации, или при внесении денежных средств в Обеспечение:			
2.2.1.	в случаях, когда сумма денежных средств (S), указанная в запросе, не превышает контрольного и планового значений денежной позиции	↓ на S	↓ на S	↓ на S
2.2.2.	в случаях, когда сумма денежных средств (S), указанная в запросе, больше контрольного значения денежной позиции, но не больше планового значения денежной позиции 1 шаг. Направление Расчетной организации Распоряжения на списание денежных средств с Клирингового счета $X = (S - Y)$ , Y - контрольное значение позиции 2 шаг. Направление Расчетной организации Уведомления о возможности уменьшения суммы денежных средств	1) ↑ на X 2) ↓ на S	1) – 2) ↓ на S	1) ↑ на X 2) ↓ на S
3.	<b>Регистрация и снятие заявок</b>			
3.1.	Регистрация заявки на покупку на заключение сделки с		↓ на X	

	кодом расчетов T0, Rb; $X=S+K$ (здесь и далее – в российских рублях, если не указано иное)			
3.2.	Регистрация заявки на покупку на заключение сделки РЕПО с кодом расчетов T0 по первой части		↓ на S	
3.3.	Регистрация заявки на покупку на заключение сделки купли-продажи или сделки РЕПО с кодом расчетов Z0; $X=S+K$	↓ на S	↓ на X	↓ на S
3.4.	Регистрация заявки на продажу на заключение сделки купли-продажи или сделки РЕПО с кодом расчетов Z0		↓ на K	
3.5.	Регистрация заявки на покупку / продажу на заключение сделки с кодом расчетов B0 – B30, S0 – S2		↓ на K	
3.6.	Регистрация заявки на покупку на заключение сделки с кодом расчетов T0, Rb в иностранной валюте; S – в иностранной валюте, K – в российских рублях; позиции в иностранной валюте и в российских рублях проверяются и изменяются отдельно		↓ на S ↓ на K	
3.7.	Регистрация заявки на покупку на заключение сделки купли-продажи или сделки РЕПО с кодом расчетов Z0 в иностранной валюте; S – в иностранной валюте, K – в российских рублях; позиции в иностранной валюте и в российских рублях проверяются и изменяются отдельно	↓ на S	↓ на S ↓ на K	↓ на S
3.8.	Регистрация заявки на покупку на заключение сделки с кодом расчетов B0 – B30, S0 – S2 в иностранной валюте; S – в иностранной валюте, K – в российских рублях		↓ на K	
3.9.	Регистрация заявки на продажу на заключение сделки с любым кодом расчетов в иностранной валюте; S – в иностранной валюте, K – в российских рублях		↓ на K	
3.10.	Снятие заявки на покупку на заключение сделки с кодом расчетов T0, Rb в российских рублях; $X=S+K$		↑ на X	
3.11.	Снятие заявки на покупку на заключение сделки РЕПО с кодом T0 по первой части в российских рублях		↑ на S	
3.12.	Снятие заявки на покупку на заключение сделки купли-продажи или сделки РЕПО с кодом расчетов Z0; $X=S+K$	↑ на S	↑ на X	↑ на S
3.13.	Снятие заявки на продажу на заключение сделки купли-продажи или сделки РЕПО с кодом расчетов Z0		↑ на K	
3.14.	Снятие заявки на покупку на заключение сделки купли-продажи или сделки РЕПО с кодом расчетов Z0 в иностранной валюте; S – в иностранной валюте, K – в российских рублях	↑ на S	↑ на S ↑ на K	↑ на S
3.15.	Снятие заявки на покупку / продажу на заключение сделки с кодом расчетов B0 – B30, S0 – S2, в российских рублях и иностранной валюте		↑ на K	
3.16.	Снятие заявки на покупку на заключение сделки с кодом расчетов T0, Rb в иностранной валюте; S – в иностранной валюте, K – в российских рублях		↑ на S ↑ на K	
3.17.	Снятие заявки на продажу на заключение сделки с любым кодом расчетов в иностранной валюте; S – в иностранной валюте, K – в российских рублях		↑ на K	
4.	<b>Заключение сделок</b>			

4.1.	Заклучение сделки по заявке на продажу с кодом расчетов T0, Rb, K0; X=Сделки – Ксделки		↑ на X	
4.2.	Заклучение сделки по заявке на покупку с кодом расчетов T0, Rb; X = S – Сделки + (K - Ксделки)		↑ на X	
4.3.	Заклучение сделки по заявке на покупку с кодом расчетов K0; X=Сделки + Ксделки		↓ на X	
4.4.	Заклучение сделки по заявке на продажу с кодом расчетов T0, K0, Rb в иностранной валюте; S – в иностранной валюте		↑ на S	
4.5.	Заклучение сделки по заявке на покупку с кодом расчетов T0, Rb в иностранной валюте; X = S – Сделки (в иностранной валюте) Y = (K - Ксделки) (в российских рублях)		↑ на X ↑ на Y	
4.6.	Заклучение сделки по заявке на покупку с кодом расчетов K0 в иностранной валюте; Сделки – в иностранной валюте, Ксделки – в российских рублях		↓ на Сделки ↓ на Ксделки	
5.	<b>Регистрация и отзыв Отчетов на исполнение</b>			
5.1.	Регистрация в Клиринговой системе Отчета на исполнение, содержащего обязательство по оплате ценных бумаг		↓ на Сделки	
5.2.	Отзыв из Клиринговой системы Отчета на исполнение, содержащего обязательство по оплате ценных бумаг		↑ на Сделки	
5.3.	Прохождение Отчетом на исполнение, содержащим требование по оплате ценных бумаг, Процедуры контроля обеспечения		↑ на Сделки	
5.4.	Регистрация в Клиринговой системе Специального отчета на исполнение, содержащего условное двустороннее нетто-обязательство по денежным средствам (X, X<0)		↓ на (-X)	
5.5.	Отзыв из Клиринговой системы Специального отчета на исполнение, содержащего условное двустороннее нетто-обязательство по денежным средствам (X, X<0)		↑ на (-X)	
5.6.	Прохождение Специальным отчетом на исполнение, содержащим условное двустороннее нетто-требование по денежным средствам (X), Процедуры контроля обеспечения		↑ на X	
5.7.	Регистрация в Клиринговой системе Срочного отчета на исполнение, содержащего нетто-обязательство по денежным средствам (X, X<0)	↓ на (-X)	↓ на (-X)	↓ на (-X)
5.8.	Отзыв из Клиринговой системы Срочного отчета на исполнение, содержащего нетто-обязательство по денежным средствам (X, X<0)	↑ на (-X)	↑ на (-X)	↑ на (-X)
5.9.	Регистрация в Клиринговой системе Поручения на внесение компенсационного взноса в виде денежных средств		↓ на S	
5.10.	Регистрация в Клиринговой системе Поручения на внесение компенсационного взноса в виде денежных средств Участником клиринга – контрагентом по сделке		↑ на S	
5.11.	Регистрация в Клиринговой системе Поручения на проведение расчетов по поставке (по поставочным контрактам срочного рынка):			

5.11.1.	по обязательствам участника клиринга по оплате поставки базового актива		↓ на S	
5.11.2.	по требованиям участника клиринга по оплате поставки базового актива		↑ на S	
6.	<b>Расчеты по итогам клиринга</b>			
6.1.	Исполнение обязательства по оплате ценных бумаг или нетто-обязательства по денежным средствам (S) в ходе торгов в случае, когда S больше контрольного значения денежной позиции. Направление Расчетной организации Распоряжения на списание денежных средств с Клирингового счета $X = (S - Y)$ , Y - контрольное значение позиции	↑ на X		↑ на X
6.2.	Исполнение требования по оплате ценных бумаг или нетто-требования по денежным средствам в ходе торгов в размере X	↑ на X	↑ на X	↑ на X
6.3.	Исполнение Нетто-обязательства по денежным средствам по сделкам клирингового пула по итогам торгов в размере X	↓ на X		
6.4.	Исполнение Нетто-требования по денежным средствам по сделкам клирингового пула по итогам торгов в размере X	↑ на X		

**2. Порядок установления и изменения начальных, контрольных и плановых позиций по ценным бумагам**

№	Операция	Значение позиций депо (по каждому коду ценных бумаг)		
		Начальное	Плановое	Контрольное
1.	Получение от Депозитария Отчета об остатках на Разделах в размере остатков (V – остаток ценных бумаг, зарезервированных на соответствующем этим позициям Разделе)	= V	= V	= V
2.	<b>Зачисление / списание ценных бумаг</b>			
2.1.	Зачисление ценных бумаг на Раздел в количестве V, в том числе при возврате ценных бумаг из Обеспечения	↑ на V	↑ на V	↑ на V
2.2.	Уменьшение количества ценных бумаг, зарезервированных на Разделе, на V на основании Перечня поручений депо, приводящих к уменьшению зарезервированных ценных бумаг, и/или при внесении ценных бумаг в Обеспечение	↓ на V	↓ на V	↓ на V
3.	<b>Регистрация и снятие заявок</b>			
3.1.	Регистрация заявки на продажу на заключение сделки с кодом расчетов T0, Rb в российских рублях и иностранной валюте		↓ на V	
3.2.	Регистрация заявки на продажу на заключение сделки купли-продажи или сделки РЕПО с кодом расчетов Z0 в российских рублях и иностранной валюте		↓ на V	↓ на V
3.3.	Снятие заявки на продажу на заключение сделки с кодом расчетов T0, Rb в российских рублях и иностранной валюте		↑ на V	
3.4.	Снятие заявки на продажу на заключение сделки купли-продажи или сделки РЕПО с кодом расчетов Z0 в российских рублях и иностранной валюте		↑ на V	↑ на V
4.	<b>Заключение сделок</b>			
4.1.	Заключение сделки по заявке на покупку с кодом расчетов		↑ на V	

	T0, K0, Rb			
4.2.	Заключение сделки по заявке на продажу с кодом расчетов K0 в российских рублях и иностранной валюте		↓ на V	
5.	<b>Регистрация и отзыв Отчетов на исполнение</b>			
5.1.	Регистрация в Клиринговой системе Отчета на исполнение, содержащего обязательство по передаче ценных бумаг		↓ на V	
5.2.	Отзыв из Клиринговой системы Отчета на исполнение, содержащего обязательство по передаче ценных бумаг		↑ на V	
5.3.	Прохождение Отчетом на исполнение, содержащим требование по передаче ценных бумаг, Процедуры контроля обеспечения		↑ на V	
5.4.	Регистрация в Клиринговой системе Специального отчета на исполнение, содержащего условное двустороннее нетто-обязательство по ценным бумагам (X, X<0)		↓ на (-X)	
5.5.	Отзыв из Клиринговой системы Специального отчета на исполнение, содержащего условное двустороннее нетто-обязательство по ценным бумагам (X, X<0)		↑ на (-X)	
5.6.	Прохождение Специальным отчетом на исполнение, содержащим условное двустороннее нетто-требование по ценным бумагам (X), Процедуры контроля обеспечения		↑ на X	
5.7.	Регистрация в Клиринговой системе Срочного отчета на исполнение, содержащего нетто-обязательство по ценным бумагам (X, X<0)		↓ на (-X)	↓ на (-X)
5.8.	Отзыв из Клиринговой системы Срочного отчета на исполнение, содержащего нетто-обязательство по ценным бумагам (X, X<0)		↑ на (-X)	↑ на (-X)
5.9.	Регистрация в Клиринговой системе Поручения на внесение компенсационного взноса в виде ценных бумаг		↓ на V	
5.10.	Регистрация в Клиринговой системе Поручения на внесение компенсационного взноса в виде ценных бумаг Участником клиринга – контрагентом по сделке		↑ на V	
5.11.	Регистрация в Клиринговой системе Поручения на проведение расчетов по поставке (по поставочным контрактам срочного рынка)			
5.11.1.	по обязательствам участника клиринга по поставке базового актива		↓ на V	
5.11.2.	по требованиям участника клиринга по поставке базового актива		↑ на V	
6.	<b>Расчеты по итогам клиринга</b>			
6.1.	Исполнение обязательства по передаче ценных бумаг или нетто-обязательства по ценным бумагам в ходе торгов в размере X	↓ на X		
6.2.	Исполнение требования по передаче ценных бумаг или нетто-требования по ценным бумагам в ходе торгов в размере X	↑ на X	↑ на X	↑ на X
6.3.	Исполнение Нетто-обязательства по ценным бумагам по сделкам клирингового пула по итогам торгов в размере X	↓ на X		
6.4.	Исполнение Нетто-требования по ценным бумагам по сделкам клирингового пула по итогам торгов в размере X	↑ на X		



**ПРИЛОЖЕНИЕ 9  
К ПРАВИЛАМ ОСУЩЕСТВЛЕНИЯ  
КЛИРИНГОВОЙ ДЕЯТЕЛЬНОСТИ  
ЗАО АКБ "НАЦИОНАЛЬНЫЙ  
КЛИРИНГОВЫЙ ЦЕНТР" НА РЫНКЕ  
ЦЕННЫХ БУМАГ**

**I. Список документов, предоставляемых организацией – резидентом**

1. Анкета Участника клиринга (клиента) (Регистрационная карточка в электронном виде и на бумажном носителе по форме, предусмотренной пунктом 1.1 приложения № 6 к Правилам клиринга).
2. Нотариально удостоверенная копия Свидетельства о внесении записи в ЕГРЮЛ, выданная уполномоченным органом исполнительной власти, осуществляющим государственную регистрацию юридических лиц, и подтверждающую факт внесения в ЕГРЮЛ записи о государственной регистрации юридического лица (либо о юридическом лице, зарегистрированном до 1 июля 2002 года).
3. Копии учредительных документов юридического лица с изменениями и дополнениями с отметкой о регистрации федеральным органом исполнительной власти, уполномоченным на осуществление государственной регистрации юридических лиц. Указанные копии должны быть заверены федеральным органом исполнительной власти, уполномоченным на осуществление государственной регистрации юридических лиц, или нотариально (указанные документы не предоставляются государственными корпорациями).
4. Выписка из Единого государственного реестра юридических лиц (ЕГРЮЛ), действующая на дату предоставления документов и выданная регистрирующим органом не ранее 30-ти дней до дня предоставления выписки из Единого государственного реестра юридических лиц в Клиринговый центр, или нотариально удостоверенную копию такой выписки.
5. Нотариально удостоверенная копия свидетельства о постановке на учет в налоговом органе.
6. Нотариально удостоверенная копия информационного письма о присвоении кодов статистики или копия, заверенная подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица.
7. Нотариально удостоверенные копии лицензий на право осуществления деятельности, подлежащей лицензированию (если имеются).
8. В отношении единоличного исполнительного органа (далее по тексту - руководитель):
  - нотариально удостоверенная копия письма территориального учреждения Банка России с подтверждением согласования кандидатуры руководителя (только для кредитных организаций);
  - подлинник или нотариально удостоверенная копия решения уполномоченного органа юридического лица (также могут быть предоставлены нотариально удостоверенная выписка из решения или подлинник выписки, заверенный подписью лица, уполномоченного на подписание решения) об избрании единоличного исполнительного органа;

- копия документа, удостоверяющего личность, заверенная подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица, или письмо юридического лица, содержащее сведения о реквизитах документа, удостоверяющего личность, а также о дате и месте рождения, адресе места жительства (регистрации) или места пребывания;
  - копия свидетельства о постановке на учет в налоговом органе (ИНН), заверенная подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица, либо письмо в произвольной форме с указанием ИНН (при наличии).
9. В случае подписания Договора об оказании клиринговых услуг и (или) других документов в соответствии с настоящими Правилами клиринга от имени юридического лица не единоличным исполнительным органом, юридическое лицо предоставляет на такое уполномоченное лицо оригинал доверенности или нотариально удостоверенную копию, или копию доверенности, заверенную лицом, выдавшим указанную доверенность. В случае если доверенность представляет полномочия на совершение операций с денежными средствами или иным имуществом, дополнительно предоставляются:
- копия документа, удостоверяющего личность, заверенная подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица, или письмо юридического лица, содержащее сведения о реквизитах документа, удостоверяющего личность, а также о дате и месте рождения, адресе места жительства (регистрации) или места пребывания;
  - копия свидетельства о постановке на учет в налоговом органе (ИНН), заверенная подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица, либо письмо в произвольной форме с указанием ИНН (при наличии);
10. Нотариально удостоверенная копия карточки с образцами подписей и оттиска печати юридического лица.
11. Подлинник или нотариально удостоверенная копия решения уполномоченного органа юридического лица (также могут быть предоставлены нотариально удостоверенная выписка из решения или подлинник выписки, заверенный подписью лица, уполномоченного на подписание решения) об одобрении сделок, заключаемых в соответствии с Правилами клиринга с Клиринговым центром, а также Договора об оказании клиринговых услуг в случае, если сделки/договор между юридическим лицом и Клиринговым центром в соответствии с требованиями действующего законодательства признаются сделками с заинтересованностью, в противном случае юридическое лицо предоставляет письмо об отсутствии признаков заинтересованности в указанных сделках (договорах).
12. Согласие лиц, указанных в документах юридического лица, направляемых им в Клиринговый центр в соответствии с Правилами клиринга, на обработку персональных данных по форме, размещенной на Сайте Клирингового центра (в случае, если документы содержат персональные данные субъекта персональных данных в соответствии с Федеральным законом «О персональных данных» и если иное не вытекает из требований законодательства).
13. Иные документы, которые могут быть запрошены Клиринговым центром в необходимых случаях в целях, не противоречащих действующему законодательству Российской Федерации.

14. Если физическое лицо, на которое требуется предоставить копию документа, удостоверяющего личность, заверенную подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица, является иностранным гражданином (лицом без гражданства), то дополнительно необходимо представить:
- заверенную печатью юридического лица и подписью уполномоченного лица юридического лица копию документа, подтверждающего право иностранного гражданина (лица без гражданства) на пребывание (проживание) в Российской Федерации (вид на жительство, разрешение на временное проживание, виза, иной документ, подтверждающий в соответствии с законодательством Российской Федерации право иностранного гражданина или лица без гражданства на пребывание (проживание) в Российской Федерации);
  - заверенную печатью юридического лица и подписью уполномоченного лица юридического лица копию миграционной карты;
  - письмо со сведениями об адресе места жительства (регистрации) или места пребывания (в случае пребывания (проживания) иностранного гражданина в Российской Федерации, и если такая информация не содержится в иных документах, представленных в соответствии с настоящим списком).
15. Отчетность в соответствии со статьей 14 Правил клиринга: для кредитных организаций - за три последних отчетных месяца, для некредитных организаций - за два последних отчетных квартала.
16. Сопроводительное письмо с описью направляемых Клиринговому центру документов, подготовленное с использованием надстройки MS EXCEL "Опись документов", размещенной на Сайте Клирингового центра.

Все предъявляемые документы должны быть действительны на дату их предъявления.

## **II. Список документов, предоставляемых организацией – нерезидентом**

1. Анкета Участника клиринга (клиента) (Регистрационная карточка в электронном виде и на бумажном носителе по форме, предусмотренной пунктом 1.1 приложения № 6 к Правилам клиринга.
2. Опросная Анкета банка-нерезидента (для банков-нерезидентов) по форме, предусмотренной пунктом 1.19 приложения № 6 к Правилам клиринга.
3. Действующие редакции учредительных документов и все изменения к ним.
4. Документ, подтверждающий государственную регистрацию юридического лица.
5. Документ, подтверждающий полномочия руководителей юридического лица, или доверенности на уполномоченных лиц.
6. В отношении лиц, уполномоченных действовать от имени юридического лица:
  - копии паспортов или других документов, которые в соответствии с законодательством Российской Федерации являются документами, удостоверяющими личность и содержащие образцы подписей лиц, уполномоченных действовать от имени юридического лица, заверенные печатью юридического лица и подписью уполномоченного лица;

- копии свидетельств о постановке на учет в налоговом органе (ИНН), заверенные подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица, либо письмо в произвольной форме с указанием ИНН (при наличии).
7. Документ, подтверждающий постановку юридического лица на налоговый учет в Российской Федерации (копия, верность которой засвидетельствована нотариусом или самим юридическим лицом) (при наличии).
  8. Согласие лиц, указанных в документах юридического лица, направляемых им в Клиринговый центр в соответствии с Правилами клиринга, на обработку персональных данных по форме, размещенной на Сайте Клирингового центра (в случае, если документы содержат персональные данные субъекта персональных данных в соответствии с Федеральным законом «О персональных данных» и если иное не вытекает из требований законодательства).
  9. Надлежащим образом оформленное специальное разрешение (лицензия или иное основание), выданное уполномоченным органом государства юридического лица-нерезидента на право осуществления деятельности, осуществление которой в соответствии с национальным законодательством государства юридического лица-нерезидента возможно при наличии соответствующего специального разрешения уполномоченного органа.
  10. Если физическое лицо, на которое требуется предоставить копию документа, удостоверяющего личность, заверенную подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица, является иностранным гражданином (лицом без гражданства), то дополнительно необходимо представить:
    - заверенную печатью юридического лица и подписью уполномоченного лица копию документа, подтверждающего право иностранного гражданина (лица без гражданства) на пребывание (проживание) в Российской Федерации (вид на жительство, разрешение на временное проживание, виза, иной документ, подтверждающий в соответствии с законодательством Российской Федерации право иностранного гражданина или лица без гражданства на пребывание (проживание) в Российской Федерации);
    - заверенную печатью юридического лица и подписью уполномоченного лица копию миграционной карты;
    - письмо со сведениями об адресе места жительства (регистрации) или места пребывания (в случае пребывания (проживания) иностранного гражданина в Российской Федерации, и если такая информация не содержится в иных документах, представленных в соответствии с настоящим списком).

Документы (за исключением копий паспортов), составленные на территории иностранных государств, должны быть легализованы или апостилированы, если иное не предусмотрено международными договорами Российской Федерации.

Документы (за исключением копий паспортов и документов, содержащих образцы подписей), составленные на иностранном языке, должны быть переведены на русский язык. Верность перевода или подлинность подписи переводчика должна быть засвидетельствована нотариусом.

Все предъявляемые документы должны быть действительны на дату их предъявления.