

Центральный Банк  
Российской Федерации (Банк России)  
**ЗАРЕГИСТРИРОВАНО**  
Дата 23 июня 2015г.  
РБ-52-2/1308

УТВЕРЖДЕНЫ

Наблюдательным советом  
Банка «Национальный Клиринговый Центр»  
(Акционерное общество)

Протокол № 2 от 26 июня 2015 года

Председатель Наблюдательного совета  
Банка «Национальный Клиринговый Центр»  
(Акционерное общество)



Лыков С.П.

**ПРАВИЛА КЛИРИНГА  
БАНКА «НАЦИОНАЛЬНЫЙ КЛИРИНГОВЫЙ ЦЕНТР»  
(АКЦИОНЕРНОЕ ОБЩЕСТВО).  
ЧАСТЬ I. ОБЩАЯ ЧАСТЬ**

г. Москва  
2015 г.

## СОДЕРЖАНИЕ

РАЗДЕЛ I. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ .....	4
Статья 1. Структура, содержание и применение Правил клиринга.....	4
Статья 2. Термины и определения .....	5
Статья 3. Общие положения .....	13
Статья 4. Права и обязанности Участников клиринга и Клирингового центра .....	15
Статья 5. Конфиденциальность .....	17
Статья 6. Порядок использования Аналога собственноручной подписи.....	17
Статья 7. Торговые и клиринговые счета.....	19
Статья 8. Клиринговые регистры .....	20
РАЗДЕЛ II. ТРЕБОВАНИЯ К УЧАСТНИКАМ КЛИРИНГА .....	23
Статья 9. Требования к Участникам клиринга .....	23
Статья 10. Категории Участников клиринга.....	24
Статья 11. Условия клирингового обслуживания. Порядок предоставления допуска к клиринговому обслуживанию .....	25
Статья 12. Порядок регистрации Участников клиринга, порядок открытия Расчетных кодов Участникам клиринга .....	28
Статья 13. Порядок регистрации Обособленных клиентов.....	32
Статья 14. Порядок приостановления и прекращения допуска к клиринговому обслуживанию.....	33
РАЗДЕЛ III. МЕРЫ, НАПРАВЛЕННЫЕ НА УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ ПРИ ОСУЩЕСТВЛЕНИИ КЛИРИНГА .....	37
Статья 15. Перечень мер, направленных на управление рисками при осуществлении клиринга .....	37
Статья 16. Ограничение размера ответственности Клирингового центра.....	38
РАЗДЕЛ IV. ПОРЯДОК ПРОВЕДЕНИЯ КЛИРИНГА .....	41
ПОДРАЗДЕЛ IV-I. ПОРЯДОК ВНЕСЕНИЯ И ВОЗВРАТА ОБЕСПЕЧЕНИЯ ПОД СТРЕСС И ВЗНОСОВ В ГАРАНТИЙНЫЕ ФОНДЫ .....	41
Статья 17. Порядок внесения взносов в Гарантийные фонды и Обеспечения под стресс .....	41
Статья 18. Порядок возврата взносов в Гарантийные фонды и Обеспечения под стресс .....	44
Статья 19. Порядок возникновения и исполнения Маржинальных требований по фондам / обеспечению под стресс.....	47
ПОДРАЗДЕЛ IV-II. ПОРЯДОК ВКЛЮЧЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ В КЛИРИНГОВЫЙ ПУЛ .....	50
Статья 20. Общие требования к порядку включения обязательств в клиринговые пулы и к порядку исполнения обязательств .....	50
ПОДРАЗДЕЛ IV-III. ПОРЯДОК ДЕЙСТВИЙ В СЛУЧАЯХ НЕИСПОЛНЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ .....	51
Статья 21. Порядок использования и возмещения Гарантийных фондов и иных средств в целях погашения Задолженностей Участников клиринга (процедура кросс-дефолта) .....	51

ПОДРАЗДЕЛ IV-IV. ПОРЯДОК ВЗАИМОДЕЙСТВИЯ С РАСЧЕТНОЙ ОРГАНИЗАЦИЕЙ И РАСЧЕТНЫМ ДЕПОЗИТАРИЕМ.....	57
Статья 22. Порядок взаимодействия с Расчетной организацией .....	57
Статья 23. Порядок взаимодействия с Расчетным депозитарием и иными депозитариями.....	57
РАЗДЕЛ V. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ ОБ ОПЛАТЕ УСЛУГ .....	60
Статья 24. Общие положения об оплате услуг Клирингового центра, Биржи и Технического центра .....	60
РАЗДЕЛ VI. ПРОЧИЕ УСЛОВИЯ .....	62
Статья 25. Перевод обязательств и Обеспечения одного Участника клиринга другому Участнику клиринга .....	62
Статья 26. Порядок действий в случае включения Участника клиринга в перечень организаций, в отношении которых имеются сведения об их причастности к экстремистской деятельности или терроризму.....	67
Статья 27. Порядок урегулирования обязательств в случае прекращения допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию (ликвидационный неттинг в отношении Участника клиринга) .....	68
Статья 28. Порядок урегулирования обязательств в случае банкротства клиента Участника клиринга (ликвидационный неттинг в отношении клиента Участника клиринга) .....	82
Статья 29. Порядок урегулирования обязательств в случае отзыва (аннулирования) лицензии на осуществление банковских операций у Клирингового центра (ликвидационный неттинг в отношении Клирингового центра) .....	87
Статья 30. Взаимодействие с Биржей при возникновении обстоятельств, которые могут повлиять на возможность проведения Торгов .....	91
Статья 31. Чрезвычайные ситуации .....	91
Статья 32. Порядок разрешения споров .....	94
Приложение № 1. Договор об оказании клиринговых услуг № _____ .....	96
Приложение № 2. Порядок проведения технической экспертизы .....	97
Приложение № 3. Документы, предоставляемые юридическим лицом для заключения Договора об оказании клиринговых услуг .....	99
Приложение № 4. Отчетность, предоставляемая Участниками клиринга Клиринговому центру .....	109
Приложение № 5. Временной регламент .....	113

## РАЗДЕЛ I. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ

### Статья 1. Структура, содержание и применение Правил клиринга

1.1. Правила клиринга Банка «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество) включают:

1) настоящие «Правила клиринга Банка «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество). Часть I. Общая часть», регулирующие / содержащие:

- способы обеспечения исполнения обязательств, допущенных к клирингу;
- права и обязанности Участников клиринга и Клирингового центра;
- порядок использования аналога собственноручной подписи;
- общие требования к Участникам клиринга;
- перечень общих мер, направленных на управление рисками при осуществлении клиринга;
- порядок внесения и возврата Обеспечения под стресс и взносов в Гарантийные фонды;
- общие требования к порядку включения обязательств в клиринговые пулы и к порядку исполнения обязательств;
- порядок использования и возмещения Гарантийных фондов и иных средств в целях погашения Задолженностей Участников клиринга (процедура кросс-дефолта);
- основания и порядок перевода обязательств и Обеспечения одного Участника клиринга другому Участнику клиринга;
- порядок урегулирования обязательств в случае прекращения допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию (ликвидационный неттинг в отношении Участника клиринга);
- иные общие положения,

далее – «общая часть Правил клиринга»;

- 2) «Правила клиринга Банка «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество). Часть II. Тарифы», устанавливающие размер оплаты клиринговых услуг ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр» (далее – «Тарифы Клирингового центра»);
- 3) «Правила клиринга Банка «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество). Часть III. Правила клиринга на фондовом рынке», регулирующие отношения, связанные с 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 (далее – «Правила клиринга на фондовом рынке»);
- 4) «Правила клиринга Банка «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество). Часть IV. Правила клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов», регулирующие отношения, связанные с

исполнением сделок с иностранной валютой и драгоценными металлами, заключенных на торгах, организуемых ПАО Московская Биржа (далее – «Правила клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов»);

- 5) «Правила клиринга Банка «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество). Часть V. Правила клиринга на срочном рынке», регулирующие отношения, связанные с заключением и исполнением договоров, являющихся производными финансовыми инструментами, заключаемых на срочном рынке ПАО Московская Биржа, ОАО «Мосэнергобиржа», а также в Секции стандартных контрактов на зерновые, зернобобовые и технические культуры ЗАО НТБ (далее – «Правила клиринга на срочном рынке»).

Правила клиринга на фондовом рынке, Правила клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, Правила клиринга на срочном рынке далее совместно именуются «специальные части Правил клиринга», а в отдельности – «специальная часть Правил клиринга».

Общая часть Правил клиринга, Тарифы Клирингового центра и специальные части Правил клиринга далее совместно именуются «Правила клиринга», а по отдельности – «часть Правил клиринга».

- 1.2. В случае внесения изменений и дополнений в любую из частей Правил клиринга, в том числе путем принятия части Правил клиринга в новой редакции, соответствующие изменения и дополнения с даты введения их в действие распространяются на отношения по вышеуказанным сделкам (договорам), заключенным до введения в действие соответствующих изменений и дополнений (новой редакции), и не исполненным (не прекращенным) на дату введения в действие изменений и дополнений в часть Правил клиринга (новой редакции части Правил клиринга).

- 1.3. В случае если в общей части Правил клиринга установлены положения, отличные от положений, содержащихся в соответствующей специальной части Правил клиринга, применяются положения специальной части Правил клиринга.

## Статья 2. Термины и определения

<b>Аналог собственноручной подписи / АСП -</b>	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.
<b>Анкета FATCA -</b>	Анкета идентификации юридического лица в соответствии с нормами и положениями закона FATCA.
<b>Аутентификация -</b>	процедура подтверждения принадлежности АСП Участнику клиринга / Клиринговому центру.
<b>Банк ЕврАзЭС/ЕАЭС -</b>	Банк-нерезидент, зарегистрированный на территории государства, являющегося стороной Соглашения о сотрудничестве в области организации интегрированного валютного рынка государств - членов Евразийского экономического сообщества от 25.01.2006 (далее – Соглашение

	о сотрудничестве) и/или государства – стороны по Договору о Евразийском экономическом союзе от 29.05.2014 (далее – Договор ЕАЭС).
<b>Банк-нерезидент -</b>	юридическое лицо, являющееся Нерезидентом, которое на основании специального разрешения (лицензии или иного основания) компетентного органа государства учреждения имеет право осуществлять банковские операции, предусмотренные личным законом Банка-нерезидента.
<b>Биржа -</b>	биржа, заключившая договор о взаимодействии с Клиринговым центром.
<b>Биржевой рынок -</b>	одна из торговых (биржевых) секций ПАО Московская Биржа, на которой ПАО Московская Биржа является организатором торговли, Секция фондового рынка ЗАО «ФБ ММВБ», Секция срочного рынка ОАО «Мосэнергобиржа», Секция стандартных контрактов на зерновые, зернобобовые и технические культуры ЗАО НТБ, осуществление клиринга по которым регулируется Правилами клиринга, включая клиринг по соответствующим внебиржевым сделкам. В Правилах клиринга биржевыми рынками называются: валютный рынок и рынок драгоценных металлов, срочный рынок, фондовый рынок.
<b>Гарантийный фонд -</b>	коллективное клиринговое обеспечение, сформированное Клиринговым центром за счет взносов определенных Правилами клиринга Участников клиринга в целях обеспечения исполнения обязательств по сделкам с частичным обеспечением на соответствующем биржевом рынке.
<b>Дата исполнения -</b>	дата, в которую Участник клиринга и/или Клиринговый центр обязан исполнить свои обязательства в соответствии с условиями заключенной сделки или иные обязательства в порядке, определенном Правилами клиринга. В случае если определяемая в настоящем пункте дата выпадает не на Расчетный день, то Датой исполнения сделки считается ближайший следующий Расчетный день.
<b>Добросовестный участник клиринга -</b>	Участник клиринга, не имеющий неисполненных обязательств перед Клиринговым центром.
<b>Единый лимит -</b>	величина, рассчитываемая Клиринговым центром в российских рублях для каждого Участника клиринга по каждому Расчетному коду, ограничивающая риски по сделкам с частичным обеспечением (за исключением Срочных сделок), заключаемым между Клиринговым центром и Участником клиринга, для которого рассчитан Единый лимит, или величина, рассчитываемая Клиринговым центром в российских рублях для каждого Участника клиринга в целях проверки исполнения Участником клиринга обязательств по внесению взносов в Гарантийные фонды или Обеспечения под стресс.
<b>Задолженность -</b>	неисполненные обязательства Участника клиринга, в том числе обязательства по сделкам, обязательства по уплате комиссионного вознаграждения и/или иные обязательства,

	указанные в Правилах клиринга.
<b>Закон о клиринге -</b>	Федеральный закон от 07.02.2011 №7-ФЗ «О клиринге и клиринговой деятельности».
<b>Закон FATCA -</b>	Федеральный закон от 28.06.2014 N 173-ФЗ «Об особенностях осуществления финансовых операций с иностранными гражданами и юридическими лицами, о внесении изменений в Кодекс Российской Федерации об административных правонарушениях и признании утратившими силу отдельных положений законодательных актов Российской Федерации».
<b>Идентификатор (Идентификатор Участника клиринга) -</b>	уникальный буквенно-цифровой код, присваиваемый Клиринговым центром Участнику клиринга и однозначно определяющий Участника клиринга.
<b>Индивидуальный Участник клиринга -</b>	Участник клиринга, являющийся также участником торгов, заключающим сделки только от своего имени.
<b>Итоговое нетто-обязательство Участника клиринга -</b>	обязательства Участника клиринга перед Клиринговым центром по передаче российских рублей / соответствующей иностранной валюты / соответствующего драгоценного металла / соответствующих ценных бумаг по сделкам с частичным обеспечением (за исключением Срочных сделок) с наступившей Датой исполнения, не прекращенные в результате зачета в ходе клиринга, порядок проведения которого установлен соответствующей специальной частью Правил клиринга.
<b>Итоговое нетто-требование Участника клиринга -</b>	требования Участника клиринга к Клиринговому центру по получению российских рублей / соответствующей иностранной валюты / соответствующего драгоценного металла / соответствующих ценных бумаг по сделкам с частичным обеспечением (за исключением Срочных сделок) с наступившей Датой исполнения, не прекращенные в результате зачета в ходе клиринга, порядок проведения которого установлен соответствующей специальной частью Правил клиринга.
<b>Клиент -</b>	юридическое или физическое лицо, зарегистрированное Биржей в качестве клиента Участника торгов.
<b>Клиринг без предварительного обеспечения -</b>	клиринг по сделке, при заключении которой не проверяется наличие Обеспечения Участника клиринга в размере, необходимом для исполнения обязательств по такой сделке.
<b>Клиринг с полным обеспечением -</b>	клиринг по сделке, условием заключения которой является наличие Обеспечения Участника клиринга и/или требования Участника клиринга по получению ценных бумаг / денежных средств / драгоценного металла с Датой исполнения не позднее, чем Дата исполнения обязательств по заключаемой сделке, в размере, необходимом для исполнения обязательств по такой сделке в полном объеме.

<b>Клиринг с частичным обеспечением -</b>	клиринг по сделке, условием заключения, которой является достаточность Обеспечения Участника клиринга, контролируемая Клиринговым центром в порядке, установленном Правилами клиринга.
<b>Клиринговая система -</b>	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.
<b>Клиринговый брокер -</b>	Участник клиринга, исполняющий функции клирингового брокера в соответствии с Законом о клиринге и Правилами клиринга.
<b>Клиринговый центр -</b>	Банк «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество), действующий на основании лицензии на осуществление клиринговой деятельности и в соответствии с Законом о клиринге.
<b>Конечный контрагент -</b>	Участник клиринга, являющийся стороной по парной сделке с центральным контрагентом.
<b>Кредитная организация -</b>	кредитная организация, являющаяся Резидентом.
<b>Маржинальное требование -</b>	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.
<b>Маржинальное требование по обеспечению под стресс -</b>	требование о приведении размера средств, внесенных Участником клиринга в качестве Обеспечения под стресс, в соответствие установленному Клиринговым центром для Участника клиринга размеру Обеспечения под стресс.
<b>Маржинальное требование по фондам -</b>	требование о приведении взносов Участника клиринга в Гарантийные фонды в соответствие установленным Клиринговым центром размерам взносов в Гарантийные фонды.
<b>Международная организация -</b>	юридическое лицо, учрежденное в соответствии с международным договором Российской Федерации и имеющее право осуществлять банковские операции, в том числе валютные операции, на территории Российской Федерации в соответствии с международными договорами Российской Федерации и законодательством Российской Федерации.
<b>Методика определения размера Обеспечения под стресс -</b>	внутренний документ Клирингового центра, устанавливающий порядок определения размера Обеспечения под стресс Участников клиринга на соответствующих биржевых рынках. Методика определения размера Обеспечения под стресс раскрывается на Сайте Клирингового центра.
<b>Методика расчета выделенного капитала</b>	внутренний документ Клирингового центра, устанавливающий порядок определения суммарного размера выделенного капитала Клирингового центра для всех биржевых рынков.



<b>центрального контрагента -</b>	Методика расчета выделенного капитала центрального контрагента раскрывается на Сайте Клирингового центра.
<b>Недобросовестный участник клиринга -</b>	Участник клиринга, не исполнивший или ненадлежащим образом исполнивший свои обязательства перед Клиринговым центром, в том числе, Маржинальное требование, и/или имеющий Задолженность перед Клиринговым центром.
<b>Некредитная организация -</b>	юридическое лицо, являющееся Резидентом и не являющееся кредитной организацией.
<b>Некредитная организация - нерезидент -</b>	юридическое лицо, являющееся Нерезидентом и не имеющее права осуществлять банковские операции.
<b>Нерезидент -</b>	лицо, являющееся нерезидентом в соответствии с законодательством Российской Федерации о валютном регулировании и валютном контроле.
<b>Нетто-обязательство Участника клиринга -</b>	сумма денежных средств в российских рублях / соответствующей иностранной валюте / количество соответствующего драгоценного металла / соответствующих ценных бумаг, представляющие собой превышение обязательств Участника клиринга над его требованиями к Клиринговому центру в российских рублях / такой иностранной валюте / таком драгоценном металле / таких ценных бумагах по сделкам с частичным обеспечением (за исключением Срочных сделок), определяемые по каждой Дате исполнения в порядке, установленном соответствующей специальной частью Правил клиринга.
<b>Нетто-требование Участника клиринга -</b>	сумма денежных средств в российских рублях / соответствующей иностранной валюте / количество соответствующего драгоценного металла / соответствующих ценных бумаг, представляющие собой превышение требований Участника клиринга над его обязательствами перед Клиринговым центром в российских рублях / такой иностранной валюте / таком драгоценном металле / таких ценных бумагах по сделкам с частичным обеспечением (за исключением Срочных сделок), определяемые по каждой Дате исполнения в порядке, установленном соответствующей специальной частью Правил клиринга.
<b>Обеспечение -</b>	индивидуальное клиринговое обеспечение Участника клиринга в ценных бумагах и/или денежных средствах (российских рублях и/или иностранной валюте) и/или денежные средства Участника клиринга в иностранной валюте и/или драгоценные металлы Участника клиринга, которые используются для обеспечения исполнения обязательств Участника клиринга по сделкам с частичным обеспечением. Обеспечение используется для исполнения обязательств Участника клиринга по сделкам, а также иных обязательств Участника клиринга, указанных в Правилах клиринга.

<b>Обеспечение под стресс -</b>	индивидуальное клиринговое обеспечение определенных Правилами клиринга Участников клиринга в российских рублях и/или иностранной валюте и/или ценных бумагах, которое используется для обеспечения исполнения обязательств Участника клиринга по сделкам с частичным обеспечением на соответствующем биржевом рынке.
<b>Общий Участник клиринга -</b>	Участник клиринга, имеющий право действовать в качестве клирингового брокера.
<b>Парная сделка -</b>	каждая из двух сделок, заключенных с центральным контрагентом на основании двух допустимых встречных заявок, в порядке и на условиях, определенных правилами торгов на соответствующем биржевом рынке.
<b>Пароль -</b>	последовательность символов, используемая для аутентификации Участника клиринга или Клирингового центра.
<b>Подсистема ЭДО НКЦ -</b>	Подсистема Системы Электронного Документооборота ПАО Московская Биржа (далее – СЭД ПАО Московская Биржа), организатором которой является Клиринговый центр и которая используется Клиринговым центром для взаимодействия с участниками Подсистемы ЭДО НКЦ и Организатором СЭД. Подсистема ЭДО НКЦ представляет собой совокупность программного, информационного и аппаратного обеспечения Клирингового центра, Организатора СЭД и участников Подсистемы ЭДО НКЦ.
<b>Порядок предоставления информации и отчетности -</b>	внутренний документ Клирингового центра, устанавливающий состав, сроки и форматы предоставления информации и отчетности Участниками клиринга Клиринговому центру. Порядок предоставления информации и отчетности раскрывается на Сайте Клирингового центра.
<b>Порядок ЭДО -</b>	Порядок организации электронного документооборота Банка «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество).
<b>Правила торгов на валютном рынке -</b>	правила организованных торгов ПАО Московская Биржа, регламентирующие проведение организованных торгов на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.
<b>Правила торгов на срочном рынке -</b>	правила организованных торгов на Срочном рынке ПАО Московская Биржа, или правила биржевой торговли в Секции срочного рынка Открытого акционерного общества «Московская энергетическая биржа», или правила организованных торгов в Секции стандартных контрактов на зерновые, зернобобовые и технические культуры Закрытого акционерного общества «Национальная товарная биржа».
<b>Правила торгов на фондовом рынке -</b>	правила организованных торгов ЗАО «ФБ ММВБ», регламентирующие проведение организованных торгов ценными бумагами.
<b>Раздел -</b>	торговый раздел торгового счета депо, открытого в Расчетном

	депозитарии с указанием Клирингового центра в качестве клиринговой организации, которая вправе давать распоряжения по этому торговому счету, а также торговые разделы счетов депо, открытых в Расчетном депозитарии и указанных в Правилах клиринга на фондовом рынке.
<b>Расчетная организация -</b>	НКО ЗАО НРД и/или Банк России, в которой(-ом) Клиринговым центром открыт клиринговый банковский счет для учета индивидуального и/или коллективного клирингового обеспечения.
<b>Расчетный банк -</b>	банк или небанковская кредитная организация, в том числе иностранная кредитная организация, в которой Клиринговым центром открыт корреспондентский счет для учета Обеспечения в иностранной валюте.
<b>Расчетный день -</b>	<p>день, в том числе выходной или праздничный нерабочий день по законодательству Российской Федерации, в который Биржа проводит Торги, и в который Расчетная организация осуществляет расчеты в российских рублях по итогам клиринга.</p> <p>Не является Расчетным днем по соответствующей иностранной валюте день, не являющийся рабочим днем в банковской системе страны / группы стран - эмитентов иностранной валюты.</p> <p>Не является Расчетным днем по соответствующей ценной бумаге / иностранной валюте / драгоценному металлу день, в который на Бирже не допускается заключение сделок с такой ценной бумагой / иностранной валютой / драгоценным металлом с Датой исполнения обязательств в день проведения торгов.</p> <p>Расчетным днем для сделок с ценной бумагой с расчетами в российских рублях является Расчетный день, одновременно являющийся Расчетным днем по такой ценной бумаге.</p> <p>Расчетным днем для сделок с ценной бумагой с расчетами в иностранной валюте является Расчетный день, одновременно являющийся Расчетным днем по такой ценной бумаге и Расчетным днем по такой иностранной валюте.</p>
<b>Расчетный депозитарий -</b>	расчетный депозитарий, осуществляющий операции, связанные с исполнением обязательств по передаче ценных бумаг по итогам клиринга, осуществленного Клиринговым центром.
<b>Расчетный код -</b>	сектор аналитического учета во внутреннем учете Клирингового центра. Значение Расчетного кода соответствует пяти последним цифрам в номерах счетов, открытых Участнику клиринга в бухгалтерском учете Клирингового центра.
<b>Резидент -</b>	юридическое лицо, являющееся резидентом в соответствии с законодательством Российской Федерации о валютном регулировании и валютном контроле.
<b>Сайт Клирингового</b>	сайт в сети Интернет по адресу <a href="http://www.nkcbank.ru">www.nkcbank.ru</a> , на котором

<b>центра -</b>	осуществляется раскрытие информации Клиринговым центром.
<b>Сделка -</b>	сделка купли-продажи ценных бумаг / сделка РЕПО / сделка с иностранной валютой / драгоценным металлом, Срочный контракт, по которой / по которому Клиринговый центр осуществляет клиринг.
<b>Сделка с частичным обеспечением -</b>	сделка, по которой Клиринговый центр осуществляет клиринг с частичным обеспечением, в том числе Срочная сделка.
<b>Счет для возврата -</b>	<p>зарегистрированный в Клиринговом центре счет, предназначенный для перечисления на него денежных средств / ценных бумаг / драгоценных металлов с целью исполнения обязательств Клирингового центра по возврату денежных средств / ценных бумаг / драгоценных металлов, учитываемых в качестве Обеспечения / Обеспечения под стресс / взносов в Гарантийные фонды.</p> <p>В качестве Счета для возврата денежных средств может выступать счет Участника клиринга / клиента Участника клиринга, открытый в банке на территории Российской Федерации или в банке за пределами территории Российской Федерации.</p> <p>В качестве Счета для возврата драгоценных металлов может выступать открытый в Клиринговом центре обезличенный металлический счет Участника клиринга - банка, имеющего лицензию на привлечение во вклады и размещение драгоценных металлов, или обезличенный металлический счет Участника клиринга в банке, открывшем в Клиринговом центре обезличенный металлический счет и имеющем лицензию на привлечение во вклады и размещение драгоценных металлов.</p>
<b>Технический центр -</b>	ПАО Московская Биржа или ООО «МБ Технологии», обеспечивающее Участникам клиринга технический доступ к Клиринговой системе на основании соответствующего договора.
<b>Участник клиринга -</b>	юридическое лицо, которому Клиринговый центр оказывает клиринговые услуги на основании заключенного с ним Договора об оказании клиринговых услуг.
<b>Ценные бумаги / акции / облигации / инвестиционные паи / депозитарные расписки -</b>	ценные бумаги, в том смысле, в котором они определяются законодательством Российской Федерации.

Термины, специально не определенные в общей части Правил клиринга, используются в значениях, установленных специальными частями Правил клиринга, иными внутренними документами Клирингового центра, правилами организованных торгов, правилами допуска и иными внутренними документами Бирж, законами, нормативными актами Банка России и иными нормативными актами Российской Федерации.

### Статья 3. Общие положения

- 3.1. Клиринговый центр осуществляет клиринг, выполняя функции центрального контрагента и без выполнения функций центрального контрагента.
- 3.2. Клиринговый центр осуществляет клиринг с частичным обеспечением, клиринг с полным обеспечением и клиринг без предварительного обеспечения.
- 3.3. Клиринговый центр осуществляет клиринг с расчетами в российских рублях и с расчетами в иностранной валюте.
- 3.4. Особенности порядка осуществления клиринга на каждом из биржевых рынков определены в соответствующей специальной части Правил клиринга.
- 3.5. В качестве способов обеспечения исполнения обязательств, допущенных к клирингу, Клиринговый центр использует Обеспечение Участников клиринга, Обеспечение под стресс Участников клиринга, Гарантийные фонды.
  - 3.5.1. Особенности Обеспечения Участников клиринга, а также порядок его внесения и возврата определены в соответствующей специальной части Правил клиринга.
- 3.6. Перечень видов используемых торговых и клиринговых счетов приведен в статье 7 общей части Правил клиринга.
- 3.7. Информация о реквизитах клиринговых счетов Клирингового центра, предназначенных для внесения индивидуального и/или коллективного клирингового обеспечения, и/или реквизитах корреспондентских счетов Клирингового центра, открытых в Расчетных банках и предназначенных для учета Обеспечения в иностранной валюте, раскрывается Клиринговым центром путем размещения на Сайте Клирингового центра.

Об изменениях реквизитов указанных счетов Клиринговый центр извещает Участников клиринга путем направления им новых реквизитов в форме электронного документа и путем размещения соответствующей информации на Сайте Клирингового центра не позднее, чем за 3 (три) рабочих дня до введения этих изменений в действие, если решением Клирингового центра не установлен иной срок изменения реквизитов указанных счетов.
- 3.8. Учет Клиринговым центром индивидуального клирингового или иного обеспечения, внесенного Участниками клиринга, является услугой, оказываемой Клиринговым центром Участнику клиринга в рамках осуществления Клиринговым центром клиринговой деятельности.
- 3.9. Клиринговый центр вправе использовать в своих интересах денежные средства, составляющие индивидуальное и коллективное клиринговое обеспечение, зачисленное на клиринговые банковские счета Клирингового центра, а также Обеспечение Участников клиринга в иностранной валюте, зачисленное на корреспондентские счета Клирингового центра в Расчетных банках, с учетом ограничений, установленных внутренним документом Клирингового центра, определяющим критерии размещения временно свободных денежных средств Клирингового центра.

Доходы от такого использования указанных денежных средств не включаются в состав индивидуального и коллективного клирингового обеспечения.

- 3.10. Обмен электронными документами между Участником клиринга и Клиринговым центром осуществляется посредством Подсистемы ЭДО НКЦ и/или системы S.W.I.F.T. (в случаях, установленных Правилами клиринга).
- 3.10.1. Порядок формирования и передачи электронных документов посредством Подсистемы ЭДО НКЦ предусмотрен Порядком ЭДО и Договором об обмене электронными документами, заключенным Участником клиринга с Клиринговым центром.
- 3.10.2. Электронные документы, направляемые посредством Подсистемы ЭДО НКЦ, формируются в форматах, предусмотренных внутренними документами Клирингового центра. Указанные документы раскрываются Клиринговым центром путем размещения на Сайте Клирингового центра.
- 3.10.3. Электронные документы, направляемые посредством Системы S.W.I.F.T., формируются в форматах, установленных стандартами S.W.I.F.T., с учетом особенностей, установленных внутренним документом Клирингового центра. Указанный документ раскрывается Клиринговым центром путем размещения на Сайте Клирингового центра.
- 3.10.4. В случае несоответствия информации, содержащейся в электронном документе, направленном посредством Подсистемы ЭДО, и электронном документе, направленном посредством системы S.W.I.F.T., Участники клиринга и Клиринговый центр в первую очередь руководствуются информацией, содержащейся в электронном документе, направленном посредством Подсистемы ЭДО, во вторую - посредством системы S.W.I.F.T.
- 3.11. Документы, направляемые Участником клиринга Клиринговому центру с использованием Клиринговой системы, являются электронными сообщениями, подписанными АСП Участника клиринга.
- Документы и информация, получаемые Участником клиринга из Клиринговой системы, являются электронными сообщениями, подписанными АСП Клирингового центра.
- Порядок использования АСП определен в статье 6 общей части Правил клиринга.
- 3.12. Формы и форматы документов, предоставляемых Клиринговому центру в соответствии с Правилами клиринга Участниками клиринга, клиентами Участников клиринга и иными указанными в Правилах клиринга лицами, и способ их предоставления установлены внутренними документами Клирингового центра. Указанные документы раскрываются Клиринговым центром путем размещения на Сайте Клирингового центра.
- Правилами клиринга могут быть установлены случаи предоставления Клиринговому центру документов с использованием Клиринговой системы или по системе S.W.I.F.T.
- 3.13. Сроки исполнения обязательств, определенных общей частью Правил клиринга, а также сроки предоставления документов Клиринговому центру / Клиринговым центром в процессе взаимодействия с Участниками клиринга, определенного общей частью Правил клиринга, установлены временным регламентом,

являющимся приложением № 5 к общей части Правил клиринга (далее – Временной регламент).

Сроки исполнения обязательств, определенных специальными частями Правил клиринга, время проведения клиринговых сессий, а также сроки проведения клиринговых операций, сроки предоставления документов Клиринговому центру / Клиринговым центром в процессе взаимодействия с Участниками клиринга при проведении клиринга и расчетов по сделкам, определенных специальными частями Правил клиринга, установлены временными регламентами, являющимися приложениями к соответствующим специальным частям Правил клиринга.

Установленное временными регламентами время (сроки) в отношении отдельных операций может быть изменено по решению Клирингового центра. Об изменении времени (сроков) проведения отдельных операций Клиринговый центр извещает Участников клиринга путем размещения соответствующей информации на Сайте Клирингового центра, и/или посредством Подсистемы ЭДО НКЦ, и/или с использованием Клиринговой системы не менее, чем за 2 (два) Расчетных дня до даты такого изменения, если иной срок извещения Участников клиринга не определен решением Клирингового центра.

- 3.14. Клиринговый центр взаимодействует с Биржей в соответствии с заключенным договором, определяющим порядок и условия взаимодействия при организации Биржей Торгов, а также при осуществлении Клиринговым центром клиринга и иных функций, связанных с осуществлением клиринга по сделкам, заключенным на Торгах Биржи.
- 3.15. В целях исполнения обязательств по сделкам Клиринговый центр вправе совершать сделки на основании заявок, поданных в Систему торгов / Торговую систему Биржи Клиринговым центром.

#### **Статья 4. Права и обязанности Участников клиринга и Клирингового центра**

- 4.1. Права и обязанности Участников клиринга и Клирингового центра определяются Договором об оказании клиринговых услуг и Правилами клиринга.
- 4.2. Форма Договора об оказании клиринговых услуг установлена приложением № 1 к общей части Правил клиринга.
- 4.3. Заключение Договора об оказании клиринговых услуг осуществляется путем присоединения к договору, условия которого определены Правилами клиринга.
- 4.4. Размер оплаты клиринговых услуг, оказываемых Клиринговым центром Участникам клиринга в соответствии с Правилами клиринга, определен Тарифами Клирингового центра.
- 4.5. Общий порядок оплаты клиринговых услуг Клирингового центра определен в статье 24 общей части Правил клиринга.  
Особенности порядка оплаты клиринговых услуг Клирингового центра определены в соответствующих специальных частях Правил клиринга.
- 4.6. Клиринговые 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.
- 4.7. 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 5 (пять) дней до даты прекращения действия Договора об оказании клиринговых услуг.
- 4.8. Клиринговый центр вправе отказаться от исполнения Договора об оказании клиринговых услуг с Участником клиринга в случае нарушения Участником клиринга требований, предъявляемых к нему Правилами клиринга.
- 4.9. Клиринговый центр вправе отказаться от исполнения Договора об оказании клиринговых услуг с Участником клиринга в случае, если в течение 6 (шести) месяцев с момента заключения указанного Договора Участник клиринга не получил допуска к клиринговому обслуживанию ни на одном из биржевых рынков и на основании ни одних правил клиринга, либо в течение 6 (шести) месяцев подряд Участник клиринга не имел допуска к клиринговому обслуживанию ни на одном из биржевых рынков в связи с приостановлением / прекращением допуска к клиринговому обслуживанию.
- 4.10. Действие Договора об оказании клиринговых услуг прекращается в следующих случаях:
- 1) прекращения допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию на всех биржевых рынках, на которых Участник клиринга был допущен к клиринговому обслуживанию, и в соответствии со всеми правилами клиринга, на основании которых Участник клиринга был допущен к клиринговому обслуживанию;
  - 2) ликвидации Участника клиринга, а также в случае реорганизации Участника клиринга при условии, что деятельность Участника клиринга в результате реорганизации прекращается;
  - 3) отзыва (аннулирования) лицензии на осуществление банковских операций у Участника клиринга (для Кредитных организаций);
  - 4) аннулирование специального разрешения (лицензии или иного основания), выданного центральным (национальным) банком или иным компетентным органом страны Банка-нерезидента, который в соответствии с законодательством страны Банка-нерезидента осуществляет валютное регулирование и банковский надзор (далее – компетентный орган), на основании которого Банк-нерезидент имеет право осуществлять банковские операции, предусмотренные личным законом Банка-нерезидента (для Банков-нерезидентов, в т.ч. Банков ЕврАзЭС/ЕАЭС).
- 4.11. 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.



- 4.12. 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.
- 4.13. Для Участника клиринга, в том числе Участника клиринга - Банка-нерезидента, Международной организации или для отдельной категории юридических лиц, применимым правом, регулирующим Договор об оказании клиринговых услуг и связанные с ним отношения Участника клиринга и Клирингового центра, является законодательство Российской Федерации.

## **Статья 5. Конфиденциальность**

- 5.1. Участник клиринга и Клиринговый центр обязуются рассматривать содержание Договора об оказании клиринговых услуг и условия заключенных сделок с ценными бумагами, сделок РЕПО, сделок с иностранной валютой / драгоценным металлом и Срочных контрактов как конфиденциальную информацию и не будут раскрывать ее третьим лицам (за исключением аудиторов Участника клиринга или Клирингового центра, уполномоченных государственных органов, Участников торгов, которыми заключены указанные сделки, и их Клиентов, 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.
- 5.2. 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, сделок с иностранной валютой / драгоценным металлом и Срочных контрактов, заключенных в рамках Договора об оказании клиринговых услуг, будут рассматриваться как конфиденциальные.
- 5.3. Участники клиринга соглашаются с тем, что Клиринговый центр на основании договора, заключенного с Банком России, передает Банку России по его запросу информацию о ходе и итогах клиринга.

## **Статья 6. Порядок использования Аналога собственноручной подписи**

- 6.1. 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 Участником клиринга / Клиринговым центром.
- 6.2. Клиринговый центр обеспечивает защищенность и целостность электронных сообщений Участника клиринга и Клирингового центра в результате применения комплекса организационных и технических мер.
- 6.3. 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 статьёй.

- 6.4. Процедура аутентификации осуществляется Техническим центром с использованием Клиринговой системы при осуществлении технического доступа Участника клиринга или Клирингового центра в Клиринговую систему путем сопоставления введенного реквизита, являющегося АСП, пароля, а также IP-адреса удаленного рабочего места Участника клиринга или Клирингового центра, с которого получено электронное сообщение, соответствующим реквизиту, являющемуся АСП, паролю и IP-адресу удаленного рабочего места 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.

- 6.5. При подаче (направлении) электронных сообщений, подписанных АСП, Технический центр с использованием Клиринговой системы осуществляет идентификацию лица, подписавшего электронное сообщение, путем сопоставления АСП, содержащегося в электронном сообщении, реквизиту, являющемуся АСП, присвоенному Участнику клиринга / Клиринговому центру, информация о котором содержится в базе данных Клиринговой системы.

Участник клиринга соглашается 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 доказательством факта направления электронного сообщения с использованием Клиринговой системы, а также подтверждают соответствие электронного сообщения содержанию копии электронного сообщения, изготовленного (распечатанного) на бумажном носителе.

- 6.6. 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.

- 6.7. Участник клиринга и Клиринговый центр соглашаются с тем, что все возникшие конфликтные ситуации, связанные с использованием АСП, будут стремиться решить в досудебном порядке.

- 6.8. В случае возникновения конфликтных ситуаций в связи с использованием АСП проводится техническая экспертиза в соответствии с приложением № 2 к общей части Правил клиринга.

- 6.9. В случае, если по результатам технической экспертизы, проведенной в соответствии с приложением № 2 к общей части Правил клиринга, конфликтная ситуация остается неурегулированной, то такая конфликтная ситуация подлежит рассмотрению в порядке, предусмотренном статьёй 32 общей части Правил клиринга.

## Статья 7. Торговые и клиринговые счета

7.1. При осуществлении клиринга в соответствии с Правилами клиринга Клиринговый центр использует следующие виды клиринговых банковских счетов в российских рублях / иностранных валютах, открытых в Расчетной организации:

- клиринговый банковский счет, предназначенный для внесения индивидуального клирингового обеспечения;
- клиринговый банковский счет, предназначенный для внесения коллективного клирингового обеспечения (Гарантийных фондов).

7.2. При осуществлении клиринга в соответствии с Правилами клиринга Клиринговый центр использует следующие виды клиринговых счетов депо, открытых в Расчетном депозитарии:

- клиринговый счет депо, предназначенный для внесения Обеспечения под стресс;
- клиринговый счет депо, предназначенный для внесения коллективного клирингового обеспечения (Гарантийных фондов).

На указанных в настоящем пункте общей части Правил клиринга клиринговых счетах депо для каждого Участника клиринга, обязанного вносить средства в Гарантийные фонды / Обеспечение под стресс и желающего вносить ценные бумаги в качестве взносов в Гарантийные фонды / Обеспечение под стресс, открываются субсчета депо.

7.3. При осуществлении клиринга в соответствии с Правилами клиринга Клиринговый центр может использовать торговые банковские счета в российских рублях / иностранных валютах, открытые в Расчетной организации с указанием Клирингового центра в качестве клиринговой организации, которая вправе давать распоряжения по этим счетам.

Торговый банковский счет может быть открыт Участнику клиринга, клиенту Участника клиринга, Клиринговому центру.

7.4. При осуществлении клиринга в соответствии с Правилами клиринга Клиринговый центр может использовать следующие виды торговых счетов депо, открытых в Расчетном депозитарии с указанием Клирингового центра в качестве клиринговой организации, которая вправе давать распоряжения по этим счетам, а также следующие типы счетов депо, открытых в Расчетном депозитарии:

- торговый счет депо владельца;
- торговый счет депо номинального держателя;
- торговый счет депо иностранного номинального держателя;
- торговый счет депо доверительного управляющего;
- торговый счет депо брокера;
- эмиссионный счет;
- торговый казначейский счет депо.

При осуществлении клиринга в соответствии с Правилами клиринга Клиринговый центр использует торговые разделы, блокированные для клиринга НКЦ, торговых счетов депо.

7.5. Торговые банковские счета и торговые счета депо, используемые при осуществлении клиринга, предназначены для внесения индивидуального клирингового обеспечения.

Виды торговых банковских счетов и торговых счетов депо, используемых при осуществлении клиринга на соответствующих биржевых рынках, указаны в соответствующих специальных частях Правил клиринга.

7.6. Порядок совершения операций по клиринговым счетам в связи с внесением и возвратом взносов в Гарантийные фонды и Обеспечения под стресс указан в статьях 17, 18 общей части Правил клиринга.

Порядок совершения операций по клиринговым и/или торговым счетам в связи с внесением и возвратом Обеспечения и/или исполнением обязательств по сделкам указан в соответствующих специальных частях Правил клиринга.

## Статья 8. Клиринговые регистры

8.1. Клиринговый центр осуществляет внутренний учет, предусмотренный Законом о клиринге, на клиринговых регистрах. Клиринговые регистры ведутся Клиринговым центром в Клиринговой системе.

8.2. На клиринговых регистрах Клиринговый центр учитывает:

- позиции по денежным средствам по Счетам обеспечения / Счетам гарантийных фондов / Счетам обеспечения под стресс, предназначенные для учета данных о суммах денежных средств, внесенных Участником клиринга в качестве Обеспечения / взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс;
- позиции по ценным бумагам в разрезе Разделов / субсчетов депо, кодов ценных бумаг, предназначенные для учета данных о количестве ценных бумаг, внесенных Участником клиринга или его клиентом в качестве Обеспечения / взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс;
- Маржинальное требование (в случае наличия);
- обязательства Участника клиринга по внесению взносов в Гарантийные фонды;
- обязательства Участника клиринга по внесению Обеспечения под стресс;
- Маржинальное требование по фондам (в случае наличия);
- Маржинальное требование по обеспечению под стресс (в случае наличия).

8.3. **Счет обеспечения** – клиринговый регистр, соответствующий лицевому счету, открытому Участнику клиринга в Клиринговом центре на балансовом счете № 30420 (30421) «Средства для исполнения обязательств, допущенных к клирингу, и индивидуального клирингового обеспечения» для учета Обеспечения в денежных средствах.

8.3.1. Счета обеспечения открываются при открытии Участнику клиринга Расчетного кода в соответствии со статьей 12 общей части Правил клиринга.

8.3.2. Для одного Расчетного кода открывается один Счет обеспечения в российских рублях и по одному Счету обеспечения в каждой иностранной валюте, в которой

- проводятся расчеты по сделкам с частичным обеспечением и/или денежные средства в которой принимаются Клиринговым центром в качестве Обеспечения.
- 8.4. **Счет гарантийных фондов** – клиринговый регистр, соответствующий лицевому счету, открытому Участнику клиринга в Клиринговом центре на балансовом счете № 30422 (30423) «Средства для коллективного клирингового обеспечения (гарантийный фонд)» («Средства нерезидентов для коллективного клирингового обеспечения (гарантийный фонд)») для учета взносов Участника клиринга Гарантийные фонды в денежных средствах.
- 8.4.1. Счета гарантийных фондов открываются Клиринговым центром Участнику клиринга категории «Б» или «О» при открытии Расчетного кода для учета взносов в Гарантийные фонды в соответствии с пунктом 12.5 общей части Правил клиринга.
- 8.4.2. Для одного Расчетного кода для учета взносов в Гарантийные фонды открывается один Счет гарантийных фондов в российских рублях и по одному Счету гарантийных фондов в каждой иностранной валюте, денежные средства в которой принимаются Клиринговым центром в качестве взносов в Гарантийные фонды.
- 8.5. **Счет обеспечения под стресс** – клиринговый регистр, соответствующий лицевому счету, открытому Участнику клиринга в Клиринговом центре на балансовом счете № 30420 (30421) «Средства для исполнения обязательств, допущенных к клирингу, и индивидуального клирингового обеспечения» («Средства нерезидентов для исполнения обязательств, допущенных к клирингу, и индивидуального клирингового обеспечения») для учета Обеспечения под стресс Участника клиринга в денежных средствах.
- 8.5.1. Счета обеспечения под стресс открываются Клиринговым центром Участнику клиринга категории «Б» или «О» при открытии Расчетного кода для учета Обеспечения под стресс в соответствии с пунктом 12.6 общей части Правил клиринга.
- 8.5.2. Для одного Расчетного кода для учета Обеспечения под стресс открывается один Счет обеспечения под стресс в российских рублях и по одному Счету обеспечения под стресс в каждой иностранной валюте, денежные средства в которой принимаются Клиринговым центром в качестве Обеспечения под стресс.
- 8.6. В Клиринговой системе устанавливаются начальные и плановые значения позиций по денежным средствам по Счетам гарантийных фондов / Счетам обеспечения под стресс и позиций по ценным бумагам по субсчетам депо Участников клиринга.
- 8.6.1. При открытии Счета гарантийных фондов / Счета обеспечения под стресс начальное и плановое значение позиции по денежным средствам по Счету гарантийных фондов / Счету обеспечения под стресс устанавливается равным нулю.
- 8.6.2. Порядок и случаи изменения значений позиций по денежным средствам и позиций депо в связи с внесением и возвратом взносов в Гарантийные фонды и Обеспечения под стресс указаны в статьях 17, 18 общей части Правил клиринга.
- 8.7. Перечень иных клиринговых регистров, используемых при осуществлении клиринга на соответствующих биржевых рынках, определен в соответствующих специальных частях Правил клиринга.

- 8.8. Порядок ведения клиринговых регистров, предусмотренных Правилами клиринга и используемых при осуществлении клиринга на соответствующих биржевых рынках, может быть определен в соответствующих специальных частях Правил клиринга.
- 8.9. Клиринговый центр осуществляет ежегодную сверку остатков на Счетах обеспечения, Счетах гарантийных фондов, Счетах обеспечения под стресс Участника клиринга в российских рублях и иностранной валюте 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 на Счетах обеспечения, Счетах гарантийных фондов, Счетах обеспечения под стресс Участника клиринга в российских рублях и/или иностранной валюте считаются подтвержденными.

## РАЗДЕЛ II. ТРЕБОВАНИЯ К УЧАСТНИКАМ КЛИРИНГА

### Статья 9. Требования к Участникам клиринга

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

- Договор об оказании клиринговых услуг по форме, предусмотренной приложением № 1 к общей части Правил клиринга, в 2 (двух) экземплярах, подписанный уполномоченным лицом юридического лица и скрепленный печатью юридического лица (при наличии);
- комплект документов в соответствии с перечнем, приведенным в приложении № 3 к общей части Правил клиринга.

В случае если какой-либо из документов, указанных в приложении № 3 к общей части 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.

9.2. Клиринговый центр вправе потребовать от юридического лица предоставления дополнительных документов. При этом юридическое лицо обязано предоставить данные документы в срок, указанный в запросе, а если такой срок не указан, то в течение 5 (пяти) рабочих дней со дня получения им запроса Клирингового центра.

9.3. В целях получения информации о юридическом лице Клиринговый центр имеет право использовать сведения (информацию) о юридическом лице из официальных источников, в том числе электронного сервиса Федеральной налоговой службы.

9.4. 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 предоставленных 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.

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

9.5. Одновременно с ежегодным предоставлением Клиринговому центру Анкеты Участника клиринга (клиента) (Регистрационной карточки) Участник клиринга, за исключением Участника клиринга категории «А», обязан предоставлять Клиринговому центру Отзывы о деловой репутации, заверенные подписью уполномоченных представителей лиц их выдавших.

Участник клиринга предоставляет Отзывы о деловой репутации от других Участников клиринга Клирингового центра, имеющих с ним деловые отношения, или Отзывы о деловой репутации от кредитных организаций, у которых Участник клиринга находится или ранее находился на обслуживании. Списки Участников клиринга раскрываются на Сайте Клирингового центра. В случае невозможности получения Отзывов о деловой репутации Участник клиринга направляет Клиринговому центру письмо об отсутствии возможности их получения.

9.6. Для подтверждения своего финансового состояния Участники клиринга, за исключением Участников клиринга категории «А», обязаны в течение всего срока действия Договора об оказании клиринговых услуг предоставлять Клиринговому центру отчетность в соответствии с приложением № 4 к общей части Правил клиринга.

В целях оценки финансового состояния Участника клиринга Клиринговый центр вправе затребовать от Участника клиринга дополнительную информацию и отчетность, не указанную в приложении № 4 к общей части Правил клиринга.

9.7. Участник клиринга, за исключением Участника клиринга категории «А», предоставляет Клиринговому центру Анкету FATCA в форме электронного документа, а также иные прилагаемые к Анкете FATCA документы и сведения, предоставляемые для целей Закона FATCA, необходимость предоставления которых следует из Анкеты FATCA и (или) действующего законодательства, в том числе согласие на передачу информации в иностранный налоговый орган.

9.7.1. В случае изменения сведений, содержащихся в Анкете FATCA, Участник клиринга обязан в течение 30 (тридцати) дней после таких изменений предоставить Клиринговому центру Анкету FATCA с обновленной информацией и прилагаемыми к Анкете FATCA соответствующими документами и сведениями, подтверждающими такие изменения, в форме электронного документа.

9.7.2. Форма для заполнения Анкеты FATCA Участниками клиринга размещается на Сайте Клирингового центра. При этом документы и сведения, прилагаемые к Анкете FATCA, заполняются Участником клиринга и предоставляются в Клиринговый центр в виде PDF файлов, содержащих скан-копии этих документов.

9.8. Обязанность по предоставлению Участником клиринга отчетности, указанной в приложении № 4 к общей части Правил клиринга, Анкеты Участника клиринга (клиента) (Регистрационной карточки) и Анкеты FATCA считается выполненной при условии, что предоставленные Участником клиринга документы соответствуют требованиям к их составу, форме и форматам, установленным Правилами клиринга и (или) Порядком предоставления информации и отчетности.

## **Статья 10. Категории Участников клиринга**

10.1. Существуют следующие категории Участников клиринга:

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



- 10.2. Участниками клиринга категории «А» являются Банк России, а также иные лица, на которые в соответствии с Законом о клиринге не распространяется требование о передаче имущества в индивидуальное и коллективное клиринговое обеспечение. Положения Правил клиринга распространяются на Участников клиринга категории «А», если иное не предусмотрено договором, заключенным между соответствующим Участником клиринга категории «А» и Клиринговым центром. Участник клиринга категории «А» может принять на себя обязательство по внесению индивидуального клирингового обеспечения в ценных бумагах и/или денежных средствах.
- 10.3. Участниками клиринга категории «О» являются Общие Участники клиринга.
- 10.4. Участник клиринга категории «О» имеет допуск к клирингу с частичным обеспечением, за исключением случаев, установленных Правилами клиринга.
- 10.5. Участниками клиринга категории «Б» являются Индивидуальные Участники клиринга, имеющие допуск к клирингу с частичным обеспечением.
- 10.6. Участниками клиринга категории «В» являются Индивидуальные Участники клиринга, не имеющие допуска к клирингу с частичным обеспечением.
- 10.7. Специальной частью Правил клиринга устанавливается перечень категорий Участников клиринга для каждого биржевого рынка.

#### **Статья 11. Условия клирингового обслуживания. Порядок предоставления допуска к клиринговому обслуживанию**

- 11.1. Допуск к клиринговому обслуживанию на каждом из биржевых рынков предоставляется Участнику клиринга, соответствующему требованиям, установленным пунктами 11.2 и/или 11.3 общей части Правил клиринга, на основании соответствующего Заявления о предоставлении допуска к клиринговому обслуживанию. Специальной частью Правил клиринга могут быть установлены дополнительные требования для допуска к клиринговому обслуживанию на соответствующем биржевом рынке для Участников клиринга любой категории.
- 11.2. Для допуска к клиринговому обслуживанию на любом из биржевых рынков Участник клиринга категории «В» должен соответствовать следующим требованиям:
- 11.2.1. иметь действующий Договор об оказании клиринговых услуг, заключенный с Клиринговым центром;
- 11.2.2. иметь действующий договор / договоры, заключенный(-ые) с Техническим центром и обеспечивающий(-ие) технический доступ к Клиринговой системе, и установить необходимое для клирингового обслуживания программно-техническое обеспечение, соответствующее требованиям, установленным Техническим центром;
- 11.2.3. иметь действующую лицензию на осуществление банковских операций, выданную Банком России (для Кредитных организаций);

- 11.2.4. иметь действующее специальное разрешение (лицензию или иное основание), выданное компетентным органом государства учреждения Банка-нерезидента, на основании которого Банк-нерезидент имеет право осуществлять банковские операции, предусмотренные личным законом Банка-нерезидента (для Банков-нерезидентов);
- 11.2.5. являться участником Подсистемы ЭДО НКЦ;
- 11.2.6. выполнять требования Клирингового центра по предоставлению информации и отчетности, предусмотренные пунктами 9.4-9.7 общей части Правил клиринга;
- 11.2.7. выполнять требования Клирингового центра к финансовой устойчивости Участника клиринга, предусмотренные пунктом 11.5 общей части Правил клиринга.
- 11.3. Для допуска к клиринговому обслуживанию на любом из биржевых рынков Участник клиринга категории «Б» помимо требований, установленных пунктом 11.2 общей части Правил клиринга, должен соответствовать следующим требованиям:
  - 11.3.1. внести взнос в Гарантийный фонд соответствующего биржевого рынка в размере, установленном в соответствующей специальной части Правил клиринга;
  - 11.3.2. в деятельности Участника клиринга должны отсутствовать факты ухудшения его финансового состояния и/или должна отсутствовать 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.
- 11.4. Для допуска к клиринговому обслуживанию на любом из биржевых рынков Участник клиринга категории «О» помимо требований, установленных пунктами 11.2-11.3 общей части Правил клиринга, должен соответствовать требованиям, установленным в соответствующей специальной части Правил клиринга.
- 11.5. Участники клиринга должны соответствовать следующим требованиям к финансовой устойчивости:
  - 11.5.1. Участники клиринга - кредитные организации - соблюдать обязательные нормативы Банка России, установленные для кредитных организаций;
  - 11.5.2. в деятельности Участников клиринга – кредитных организаций должны отсутствовать основания для осуществления мер по предупреждению банкротства в соответствии с законодательством Российской Федерации о несостоятельности (банкротстве), а также основания для отзыва Банком России лицензии на осуществление банковских операций в соответствии с законодательством Российской Федерации о банковской деятельности;
  - 11.5.3. в деятельности Участников клиринга должны отсутствовать основания для осуществления мер по предупреждению банкротства в соответствии с законодательством Российской Федерации о несостоятельности (банкротстве) или в соответствии с личным законом Участника клиринга;

- 11.5.4. в деятельности Участников клиринга – Банков-нерезидентов должны отсутствовать основания для отзыва в соответствии с национальным законодательством государства учреждения Банка-нерезидента специального разрешения (лицензии или иного основания), выданного компетентным органом государства учреждения Банка-нерезидента, на основании которого Банк-нерезидент имеет право осуществлять банковские операции.
- 11.6. Участники клиринга должны соответствовать требованиям к финансовой устойчивости, приведенным в пункте 11.5 общей части Правил клиринга, в течение всего времени допуска к клиринговому обслуживанию.  
Участники клиринга обязаны незамедлительно уведомлять Клиринговый центр о своем несоответствии указанным требованиям.
- 11.7. Клиринговый центр вправе не предоставлять допуск к клиринговому обслуживанию на одном или нескольких биржевых рынках Участникам клиринга категорий «О», «Б» и «В», не соответствующим следующим требованиям:
- 11.7.1. Кредитные организации – наличие по балансу на последнюю отчетную дату положительного финансового результата текущего года, определяемого 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;
- 11.7.2. Государственные корпорации, Международные организации, Некредитные организации – наличие по балансу на последнюю отчетную дату положительного финансового результата деятельности, определяемого как прибыль после налогообложения;
- 11.7.3. Нерезиденты - наличие по финансовой отчетности на последнюю отчетную дату положительного финансового результата деятельности, определяемого как прибыль после налогообложения.
- 11.8. Клиринговый центр вправе определить особенности применения требований по допуску к клиринговому обслуживанию для отдельных категорий юридических лиц, в том числе для Банков-нерезидентов, с учетом положений соответствующего международного соглашения (договора), для Международных организаций - с учетом положений соответствующего международного договора.
- 11.9. Допуск к клиринговому обслуживанию на соответствующем биржевом рынке предоставляется Участнику клиринга Клиринговым центром в срок, не превышающий 5 (пяти) рабочих дней после выполнения Участником клиринга требований и условий, предусмотренных Правилами клиринга.  
О факте предоставления Участнику клиринга допуска к клиринговому обслуживанию и о категории Участника клиринга Клиринговый центр извещает Участника клиринга и Биржу не позднее рабочего дня, следующего за днем предоставления допуска к клиринговому обслуживанию.
- 11.10. Участник клиринга вправе предоставить Клиринговому центру Заявление об изменении категории Участника клиринга.

- 11.10.1. Заявление об изменении категории Участника клиринга с категории «Б» на категорию «В» на соответствующем биржевом рынке исполняется при соблюдении следующих условий:
- 1) у Участника клиринга отсутствуют Маржинальные требования по всем Расчетным кодам, открытым для такого рынка, и
  - 2) у Участника клиринга отсутствуют непогашенные Задолженности по всем Расчетным кодам, учитываемые в соответствии с Правилами клиринга.
- 11.10.2. Заявление на изменение категории Участника клиринга с категории «О» на категорию «Б» или «В» на соответствующем биржевом рынке осуществляется при соблюдении условий, указанных в подпункте 11.10.1 общей части Правил клиринга, а также при отсутствии неисполненных обязательств по сделкам, заключенным на соответствующем биржевом рынке Участниками торгов с указанием соответствующего Участника клиринга категории «О» в качестве клирингового брокера.
- 11.10.3. Клиринговый центр вправе изменить категорию Участника клиринга с категории «В» на категорию «Б» на соответствующем биржевом рынке без подачи заявления при выполнении Участником клиринга требований, установленных для Участников клиринга категории «Б» на соответствующем биржевом рынке.
- 11.10.4. Клиринговый центр извещает Участника клиринга и Биржу об изменении категории Участника клиринга не позднее рабочего дня, следующего за днем установления Участнику клиринга новой категории.
- 11.11. При изменении категории Участника клиринга с категории «Б» на категорию «В» на соответствующем биржевом рынке или при прекращении допуска к клиринговому обслуживанию Участника клиринга с категорией «Б» на соответствующем биржевом рынке Клиринговый центр прекращает учет обязательств Участника клиринга по внесению взноса в Гарантийный фонд такого биржевого рынка и Обеспечения под стресс на таком биржевом рынке.

## **Статья 12. Порядок регистрации Участников клиринга, порядок открытия Расчетных кодов Участникам клиринга**

- 12.1. Клиринговый центр осуществляет регистрацию Участников клиринга.
- 12.1.1. Процедура регистрации Участника клиринга предусматривает присвоение (открытие) Участнику клиринга следующих кодов и идентификаторов:
- кода Участника клиринга в соответствии с требованиями нормативных актов Банка России;
  - Расчетных кодов.
- 12.2. Код Участника клиринга присваивается при заключении Участником клиринга с Клиринговым центром Договора об оказании клиринговых услуг.
- 12.2.1. Информация о коде Участника клиринга учитывается в реестре Участников клиринга и предоставляется по запросу Банка России, иных уполномоченных лиц и органов, а также Участника клиринга и содержит данные, соответствующие требованиям Банка России, предъявляемым к регистрации Участников клиринга (кодов Участников клиринга).

- 12.3. Открытие Расчетных кодов осуществляется для каждого биржевого рынка в порядке и случаях, установленных настоящей статьей общей части Правил клиринга.
- Специальными частями Правил клиринга могут быть установлены особенности открытия Расчетных кодов Участникам клиринга для соответствующего биржевого рынка.
- 12.4. Участнику клиринга могут быть открыты Расчетные коды следующих типов:
- собственный – для учета денежных средств Участника клиринга;
  - клиентский – для учета денежных средств клиента Участника клиринга / клиентов Участника клиринга;
  - ДУ – для учета денежных средств, находящихся в доверительном управлении Участника клиринга.
- 12.4.1. Участнику клиринга может быть открыто неограниченное количество Расчетных кодов каждого из типов.
- 12.5. Участнику клиринга категории «Б» или «О» Клиринговый центр открывает Расчетный код для учета взносов в Гарантийные фонды.
- 12.5.1. Одному Участнику клиринга категории «Б» или «О» открывается один Расчетный код для учета взносов в Гарантийные фонды.
- 12.6. Участнику клиринга категории «Б» или «О» при первом случае возникновения обязанности по внесению Обеспечения под стресс Клиринговый центр открывает Расчетный код для учета Обеспечения под стресс.
- 12.6.1. Одному Участнику клиринга категории «Б» или «О» открывается один Расчетный код для учета Обеспечения под стресс.
- 12.7. Для заключения Участником клиринга сделок за счет клиентов Участника клиринга и/или за счет денежных средств, находящихся в доверительном управлении Участника клиринга, Участник клиринга обязан совершить действия, необходимые для открытия Клиринговым центром Участнику клиринга отдельного клиентского Расчетного кода (отдельных клиентских Расчетных кодов) и/или отдельного Расчетного кода ДУ (отдельных Расчетных кодов ДУ).
- 12.8. Для заключения Участником клиринга сделок за счет клиента Участника клиринга, в отношении которого в соответствии с действующими нормативными актами Российской Федерации Участник клиринга обязан требовать от Клирингового центра ведения отдельного учета денежных средств и иного имущества этого клиента, переданных Клиринговому центру в качестве индивидуального клирингового обеспечения, Участник клиринга обязан совершить действия, необходимые для присвоения Клиринговым центром Участнику клиринга отдельного клиентского Расчетного кода для такого клиента, а также действия, необходимые для регистрации Клиринговым центром Участнику клиринга для такого клиента Участника клиринга отдельного Торгово-клирингового счета, в состав которого входит клиентский Расчетный код, присвоенный Участнику клиринга для такого клиента Участника клиринга (на тех биржевых рынках, условием допуска к клирингу на которых является открытие Торгово-клиринговых счетов).

- 12.9. При присвоении Клиринговым центром Участнику клиринга Идентификатора / кода Расчетной фирмы, Участнику клиринга Клиринговым центром без подачи заявления открывается основной Расчетный код в рамках Идентификатора / кода Расчетной фирмы.
- 12.9.1. По умолчанию основной Расчетный код является собственным и используется для заключения сделок на основании заявок Участника торгов, являющегося Участником клиринга.
- 12.9.2. По умолчанию основной Расчетный код является Расчетным кодом для списания комиссионных вознаграждений.
- 12.9.3. Участник клиринга обязан предоставить Клиринговому центру реквизиты Счетов для возврата для основного Расчетного кода Участника клиринга в соответствии с порядком, определенным пунктом 2) подпункта 12.10.1 общей части Правил клиринга.
- 12.10. Открытие Расчетного кода Участнику клиринга, за исключением основного Расчетного кода, осуществляется на основании заявления Участника клиринга, предоставленного Клиринговому центру, а также без заявления Участника клиринга в случаях, установленных специальными частями Правил клиринга.
- 12.10.1. Заявление о присвоении Расчетного кода должно содержать:
- 1) указание на тип Расчетного кода:
    - собственный;
    - клиентский;
    - ДУ.
  - 2) реквизиты Счетов для возврата для данного Расчетного кода.  
В случае если владельцем Счета для возврата является клиент Участника клиринга Участник клиринга предоставляет Клиринговому центру:
    - Письмо об идентификации клиента;
    - копию договора об обслуживании / оказании услуг, заключенного между клиентом Участника клиринга и Участником клиринга, заверенную нотариально или Участником клиринга (в случае если владельцем Счета для возврата является Нерезидент);
    - иные документы (по требованию Клирингового центра).
- 12.10.2. Клиринговый центр вправе отказать в регистрации Счета для возврата и (или) не удовлетворить требование Участника клиринга о возврате денежных средств, составляющих Обеспечение Участника клиринга, в случае, если по заключению Клирингового центра регистрация Счета для возврата на основании Заявления или удовлетворение требования Участника клиринга может повлечь увеличение принимаемых Клиринговым центром рисков и/или нарушение правил и порядка внутреннего контроля, осуществляемого Клиринговым центром в соответствии с нормативными актами Банка России.
- 12.10.3. В случае изменения реквизитов Счета для возврата Участник клиринга обязан предоставить Клиринговому центру Заявление на регистрацию Счета для возврата, содержащего информацию о новых реквизитах счета.

Новые реквизиты Счета для возврата (при условии его регистрации Клиринговым центром) действуют с Рабочего дня, следующего за днем получения Клиринговым центром Заявления на регистрацию Счета для возврата.

Участник клиринга несет риск последствий, вызванных непредоставлением (несвоевременным представлением) Клиринговому центру Заявления на регистрацию Счета для возврата, содержащего информацию о новых реквизитах счета, в соответствии с настоящим подпунктом Правил клиринга.

Клиринговый центр вправе отказать в регистрации новых реквизитов Счета для возврата по основанию, указанному в подпункте 12.10.2 общей части Правил клиринга.

- 12.11. Клиринговый центр информирует Участника клиринга об открытом ему Расчетном коде не позднее рабочего дня, следующего за днем открытия Расчетного кода, посредством Подсистемы ЭДО НКЦ.
- 12.12. Участник клиринга вправе изменить реквизиты Расчетного кода, указанные в подпункте 12.10.1 общей части Правил клиринга, предоставив Клиринговому центру Заявление об изменении реквизитов Расчетного кода.
  - 12.12.1. Новые реквизиты Расчетного кода действуют с Рабочего дня, следующего за днем получения Клиринговым центром Заявления об изменении реквизитов Расчетного кода.
- 12.13. В случае получения от Биржи уведомления о прекращении допуска к торгам Участника торгов, являющегося Участником клиринга, по идентификатору / коду Расчетной фирмы Клиринговый центр аннулирует Расчетные коды, присвоенные Участнику клиринга в рамках идентификатора / кода Расчетной фирмы.
- 12.14. Аннулирование присвоенного Участнику клиринга Расчетного кода также осуществляется на основании письма Участника клиринга.
- 12.15. Аннулирование присвоенного Участнику клиринга Расчетного кода осуществляется при условии отсутствия у Участника клиринга неисполненных обязательств, учитываемых по такому Расчетному коду.
- 12.16. При аннулировании присвоенного Участнику клиринга Расчетного кода Клиринговый центр в течение 3 (трех) банковских дней после получения соответствующего уведомления от Биржи или письма от Участника клиринга, осуществляет возврат Обеспечения Участнику клиринга в соответствующей валюте / соответствующем драгоценном металле, учитываемого по данному Расчетному коду, на Счета для возврата, зарегистрированные в Клиринговом центре для данного Расчетного кода.
- 12.17. Клиринговый центр информирует Участника клиринга об аннулировании Расчетного кода не позднее рабочего дня, следующего за днем его аннулирования, посредством Подсистемы ЭДО НКЦ.
- 12.18. Клиринговый центр осуществляет учет Обеспечения и обязательств по сделкам по каждому Расчетному коду, открытому Участнику клиринга.

Клиринговый центр не осуществляет зачет (неттинг) обязательств, учитываемых по разным Расчетным кодам, за исключением случаев, установленных в статье 27 общей части Правил клиринга.

- 12.19. Участник клиринга обязан информировать своих клиентов о предусмотренном Правилами клиринга порядке ведения Клиринговым центром учета обязательств по сделкам, заключенным в интересах и (или) за счет клиентов Участников клиринга, и Обеспечения указанных обязательств, в том числе о типах Расчетных кодов, а также о возможности и порядке регистрации Обособленных клиентов, для которых существует возможность Перевода обязательств и Обеспечения, по основаниям и в порядке, установленном в статье 25 общей части Правил клиринга.

### **Статья 13. Порядок регистрации Обособленных клиентов**

- 13.1. Для предоставления Участнику торгов или Клиенту возможности воспользоваться Переводом обязательств и Обеспечения, определенными в статье 25 общей части Правил клиринга, по основаниям и в порядке, установленных в статье 25 общей части Правил клиринга, Участник клиринга должен открыть для такого Участника торгов или Клиента (далее – Обособленный клиент) отдельный клиентский Расчетный код, а также выполнить иные действия, если это предусмотрено соответствующей специальной частью Правил клиринга, и предоставить Клиринговому центру Заявление на регистрацию Обособленного клиента, в котором указать:

- 1) Расчетные коды, открытые Участником клиринга для Обособленного клиента, а также иную информацию, если это предусмотрено соответствующей специальной частью Правил клиринга;
- 2) наименование / фамилию, имя и отчество Обособленного клиента;
- 3) идентификационные данные Обособленного клиента в соответствии с Заявлением на регистрацию Обособленного клиента, включая, но не ограничиваясь ИНН Обособленного клиента – юридического лица, имеющего ИНН, или номер паспорта Обособленного клиента – физического лица, или код страны регистрации Обособленного клиента – юридического лица, являющегося Нерезидентом и не имеющего ИНН.

Совместно с Заявлением на регистрацию Обособленного клиента Участник клиринга обязан предоставить Клиринговому центру Согласие Обособленного клиента – физического лица на обработку персональных данных по форме, размещенной на Сайте Клирингового центра (в соответствии с Федеральным законом от 27.07.2006 № 152-ФЗ «О персональных данных»).

Участник клиринга несет ответственность за достоверность информации об Обособленном клиенте, предоставленной Клиринговому центру в соответствии с настоящим пунктом общей части Правил клиринга.

- 13.2. Участник клиринга не вправе использовать Расчетный код, открытый для Обособленного клиента, для заключения и исполнения сделок за счет иных клиентов Участников клиринга и/или за свой счет.



## **Статья 14. Порядок приостановления и прекращения допуска к клиринговому обслуживанию**

- 14.1. Клиринговый центр вправе приостановить допуск к клиринговому обслуживанию Участника клиринга категории «О», категории «Б» или категории «В» на одном или нескольких биржевых рынках по всем сделкам или по отдельным видам сделок, а также по отдельным Режимам торгов, по любому из следующих оснований:
- 14.1.1. на основании уведомления Биржи о приостановлении допуска Участника клиринга к участию в торгах на Бирже на соответствующем биржевом рынке (для Участника клиринга, являющегося Участником торгов);
  - 14.1.2. при возникновении обстоятельств, препятствующих, в соответствии с законодательством Российской Федерации, заключению и/или исполнению Участником клиринга сделок (за исключением чрезвычайных ситуаций), ставших известными Клиринговому центру;
  - 14.1.3. при нарушении Участником клиринга установленных Правилами клиринга требований;
  - 14.1.4. при применении Банком России к Участнику клиринга – кредитной организации санкций за нарушение банковского законодательства, в том числе: введение запрета на осуществление Участником клиринга отдельных банковских операций, если это приведет к невозможности заключения и/или исполнения Участником клиринга сделок, и назначение временной администрации по управлению кредитной организацией – Участником клиринга в рамках мер по предупреждению банкротства кредитной организации;
  - 14.1.5. при применении к Участнику клиринга санкций уполномоченных органов за нарушение законодательства Российской Федерации, в том числе при применении административных наказаний;
  - 14.1.6. при получении Клиринговым центром письменного сообщения от компетентного органа государства учреждения Банка-нерезидента в отношении Банка-нерезидента, из которого следует невозможность дальнейшего осуществления клирингового обслуживания Банка-нерезидента, и/или размещении соответствующей информации на сайте вышеуказанного компетентного органа в сети Интернет;
  - 14.1.7. в случае приостановления международного соглашения (договора) для Российской Федерации либо в случае приостановления международного соглашения (договора) для государства - стороны международного соглашения (договора), являющегося государством учреждения соответствующего Участника-клиринга;
  - 14.1.8. в случае приостановления международного договора для Российской Федерации, в соответствии с которым Международная организация учреждена либо в случае принятия решения уполномоченными лицами сторон указанного международного договора о приостановлении деятельности Международной организации;
  - 14.1.9. наличие в деятельности Участника клиринга оснований для осуществления мер по предупреждению банкротства в соответствии с законодательством Российской Федерации о несостоятельности (банкротстве), а также оснований для отзыва (аннулирования) уполномоченным органом / Банком России лицензии на

- осуществление соответствующего вида деятельности в соответствии с законодательством Российской Федерации;
- 14.1.10. по результатам рассмотрения Клиринговым центром предоставленных Участником клиринга в соответствии с пунктами 9.4-9.6 общей части Правил клиринга информации и документов, а также в случае их непредставления в надлежащий срок;
- 14.1.11. 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;
- 14.1.12. при наличии фактов неисполнения или ненадлежащего исполнения Участником клиринга обязательств перед Клиринговым центром, возникших из Договора об оказании клиринговых услуг;
- 14.1.13. в случае отсутствия в отчетности Участника клиринга положительного финансового результата, предусмотренного пунктом 11.7 общей части Правил клиринга, по состоянию на две и более последовательные отчетные даты;
- 14.1.14. в случае непредоставления Участником клиринга Анкеты FATCA в соответствии с пунктом 9.7 общей части Правил клиринга;
- 14.1.15. в случае получения от иностранного налогового органа уведомления о невыполнении Участником клиринга требований законодательства иностранного государства;
- 14.1.16. в случае наличия риска потери деловой репутации Клирингового центра в связи с продолжением клирингового обслуживания Участника клиринга.
- 14.2. Клиринговый центр вправе установить Участнику клиринга категории «Б» категорию «В» на одном или нескольких биржевых рынках по основаниям, предусмотренным пунктом 14.1 общей части Правил клиринга, а также:
- 14.2.1. при несоответствии размера вноса Участника клиринга категории «Б» в Гарантийный фонд соответствующего биржевого рынка размеру, установленному в соответствующей специальной части Правил клиринга;
- 14.2.2. при несоответствии размера Обеспечения под стресс Участника клиринга на соответствующем биржевом рынке размеру, установленному в соответствии с Правилами клиринга.
- 14.3. При отсутствии на биржевом рынке категории «В» Клиринговый центр вправе приостановить допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию на таком биржевом рынке по основаниям, указанным в подпунктах 14.2.1, 14.2.2 общей части Правил клиринга.
- 14.4. В случае приостановления допуска к клиринговому обслуживанию на одном или нескольких биржевых рынках, в том числе по отдельным видам сделок или по отдельным Режимам торгов, Клиринговый центр продолжает осуществлять клиринг и иные функции, связанные с осуществлением на соответствующем биржевом рынке клиринга по сделкам, стороной по которым является данный

Участник клиринга, заключенным до момента приостановления допуска к клиринговому обслуживанию Участника клиринга или, соответственно, до момента приостановления допуска к клиринговому обслуживанию по отдельным видам сделок или по отдельным Режимам торгов, а также Клиринговый центр вправе в порядке и случаях, установленных Правилами клиринга, заключать с таким Участником клиринга сделки, направленные на урегулирование неисполненных обязательств такого Участника клиринга.

- 14.5. После получения информации о прекращении действия оснований для приостановления допуска к клиринговому обслуживанию на одном или нескольких биржевых рынках и на основании соответствующего письма Участника клиринга Клиринговый центр вправе принять решение о возобновлении допуска к клиринговому обслуживанию Участника клиринга.
  - 14.5.1. Для возобновления допуска к клиринговому обслуживанию, приостановленного на основании подпункта 14.1.1 общей части Правил клиринга, предоставление соответствующего письма Участника клиринга не требуется.
  - 14.5.2. Клиринговый центр вправе принять решение о возобновлении допуска к клиринговому обслуживанию, приостановленного на основании подпунктов 14.2.1, 14.2.2 общей части Правил клиринга, без предоставления соответствующего письма Участника клиринга.
- 14.6. Клиринговый центр прекращает допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию (независимо от его категории) на всех биржевых рынках по любому из следующих оснований:
  - 14.6.1. прекращение действия Договора об оказании клиринговых услуг;
  - 14.6.2. отзыв (аннулирование) Банком России лицензии на осуществление банковских операций у Участника клиринга – кредитной организации;
  - 14.6.3. отзыв (аннулирование) специального разрешения (лицензии или иного основания) компетентного органа государства учреждения Банка-нерезидента, в соответствии с которым Банк-нерезидент имеет право осуществлять банковские операции;
  - 14.6.4. прекращение международного соглашения (договора) для Российской Федерации либо прекращение международного соглашения (договора) для государства - стороны международного соглашения (договора), являющегося государством учреждения соответствующего Участника-клиринга;
  - 14.6.5. прекращение международного договора, в соответствии с которым учреждена Международная организация, для Российской Федерации либо принятие решения уполномоченными лицами сторон указанного международного договора о прекращении деятельности Международной организации;
  - 14.6.6. принятие федерального закона о ликвидации государственной корпорации;
  - 14.6.7. назначение временной администрации или принятие арбитражным судом решения о введении в отношении Участника клиринга одной из процедур банкротства;
  - 14.6.8. ликвидация Участника клиринга, а также реорганизация Участника клиринга при условии, что деятельность Участника клиринга в результате реорганизации прекращается;

- 14.6.9. размещение в сети Интернет на официальном сайте уполномоченного органа информации о включении Участника клиринга в перечень организаций, в отношении которых имеются сведения об их причастности к экстремистской деятельности или терроризму, либо размещение в сети Интернет на официальном сайте уполномоченного органа решения о применении мер по замораживанию (блокированию) денежных средств или иного имущества, принадлежащих Участнику клиринга, в отношении которого имеются достаточные основания подозревать его причастность к террористической деятельности (в том числе к финансированию терроризма) при отсутствии оснований для включения в указанный перечень (далее – включение в перечень).
- 14.7. Клиринговый центр вправе прекратить допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию на одном или нескольких биржевых рынках:
- 14.7.1. при поступлении в Клиринговый центр уведомления от Биржи о прекращении допуска Участника клиринга к участию в торгах на Бирже на соответствующем рынке (для Участника клиринга, являющегося Участником торгов);
- 14.7.2. неоднократно (два и более раза) в течение одного года неисполнения Участником клиринга своих обязательств, допущенных к клирингу, и/или иных денежных обязательств Участника клиринга, возникающих на основании Правил клиринга;
- 14.7.3. неоднократно (два и более раза) в течение одного года нарушения Участником клиринга установленных Правилами клиринга требований.
- 14.8. Клиринговый центр извещает Участника клиринга и Биржу о приостановлении / прекращении или возобновлении приостановленного допуска к клиринговому обслуживанию на одном или нескольких рынках (в том числе, по отдельным видам сделок или по отдельным Режимам торгов) или об изменении категории Участника клиринга не позднее Рабочего дня, следующего за днем приостановления / прекращения или возобновления приостановленного допуска к клиринговому обслуживанию / днем установления Участнику клиринга иной категории.

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

#### **Статья 15. Перечень мер, направленных на управление рисками при осуществлении клиринга**

15.1. В целях снижения рисков, связанных с осуществлением клиринга, Клиринговый центр:

- предъявляет требования к финансовой устойчивости Участников клиринга;
- предъявляет к Участникам клиринга требование о внесении Обеспечения;
- осуществляет предварительный контроль достаточности Обеспечения Участника клиринга при подаче заявок на заключение сделок;
- не реже, чем каждый Расчетный день, осуществляет переоценку стоимости Обеспечения, а также обязательств и требований Участника клиринга по сделкам с частичным обеспечением на нетто-основе и иных обязательств и требований Участников клиринга, возникающих в соответствии с Правилами клиринга, и контроль достаточности Обеспечения, в случае недостаточности – предъявляет Участнику клиринга Маржинальное требование;
- осуществляет контроль достаточности Обеспечения при возврате Обеспечения;
- формирует Гарантийные фонды для обеспечения исполнения обязательств по сделкам с частичным обеспечением;
- не реже, чем каждый Расчетный день, осуществляет переоценку стоимости иностранной валюты и ценных бумаг, учитываемых в качестве взносов в Гарантийные фонды, и в случае недостаточности – предъявляет Участнику клиринга Маржинальное требование по фондам;
- предъявляет к Участникам клиринга категории «Б» и «О» требование о внесении Обеспечения под стресс;
- не реже, чем каждый Расчетный день, осуществляет переоценку стоимости иностранной валюты и ценных бумаг, учитываемых в качестве Обеспечения под стресс Участника клиринга, и в случае недостаточности – предъявляет Участнику клиринга Маржинальное требование по обеспечению под стресс;
- ограничивает размер своей ответственности в соответствии со статьей 16 общей части Правил клиринга.

15.2. Перечень ценных бумаг и перечень иностранных валют, принимаемых в качестве обеспечения исполнения обязательств по сделкам с частичным обеспечением, устанавливается решением Клирингового центра.

Для отдельных биржевых рынков Клиринговым центром может быть установлен отдельный перечень указанных ценных бумаг и иностранных валют.

При погашении ценной бумаги ценная бумага исключается из Перечня ценных бумаг и перечня иностранных валют, принимаемых в качестве обеспечения исполнения обязательств по сделкам с частичным обеспечением, с даты погашения без решения Клирингового центра.

- 15.2.1. Ценные бумаги, эмитентом которых является Участник клиринга или связанное с ним лицо, учитываемые по Разделу, предназначенному для учета собственных ценных бумаг такого Участника клиринга, не учитываются в качестве обеспечения исполнения обязательств по сделкам с частичным обеспечением, заключенным таким Участником клиринга за его счет.
- 15.3. Гарантийный фонд каждого биржевого рынка формируется Клиринговым центром за счет взносов всех Участников клиринга категорий «Б» и «О».
- Размер взноса в Гарантийный фонд соответствующего биржевого рынка каждого Участника клиринга категорий «Б» и/или «О» устанавливается соответствующей специальной частью Правил клиринга.
- 15.4. Обеспечение под стресс на каждом биржевом рынке обязаны вносить Участники клиринга категорий «Б» и «О».
- Порядок определения размера Обеспечения под стресс Участника клиринга на соответствующем биржевом рынке установлен Методикой определения размера Обеспечения под стресс.
- 15.5. В качестве взноса в Гарантийные фонды и/или Обеспечения под стресс Участники клиринга могут вносить денежные средства в российских рублях и иностранной валюте, а также ценные бумаги.
- 15.5.1. Перечень иностранных валют и ценных бумаг, принимаемых Клиринговым центром в качестве взносов в Гарантийные фонды и/или Обеспечения под стресс, устанавливается решением Клирингового центра.
- При погашении ценной бумаги ценная бумага исключается из Перечня иностранных валют и ценных бумаг, принимаемых Клиринговым центром в качестве взносов в Гарантийные фонды и/или Обеспечения под стресс, с даты погашения без решения Клирингового центра.
- 15.5.2. Ценные бумаги, эмитентом которых является Участник клиринга или связанное с ним лицо, не учитываются в качестве взносов в Гарантийные фонды и Обеспечения под стресс такого Участника клиринга.

## **Статья 16. Ограничение размера ответственности Клирингового центра**

- 16.1. Размер ответственности Клирингового центра за неисполнение или ненадлежащее исполнение обязательств перед Добросовестными участниками клиринга, включенных в клиринговый пул на соответствующем биржевом рынке, в случае наличия Недобросовестных участников клиринга, не исполнивших обязательства перед Клиринговым центром, ограничен суммарно следующими средствами:
- 1) размером Обеспечения, внесенного Недобросовестными участниками клиринга на соответствующем биржевом рынке, за исключением Обеспечения, учитываемого по клиентским Расчетным кодам и Расчетным кодам ДУ, по которым отсутствует Задолженность;
  - 2) размером Обеспечения под стресс Недобросовестных участников клиринга на всех биржевых рынках;
  - 3) размером взносов Недобросовестных участников клиринга в Гарантийные фонды всех биржевых рынков;
  - 4) размером собственных средств Клирингового центра, установленных

- Клиринговым центром для соответствующего биржевого рынка (далее – выделенный капитал Клирингового центра);
- 5) размером взносов Добросовестных участников клиринга в Гарантийный фонд соответствующего биржевого рынка;
  - 6) размером собственных средств Клирингового центра, определенным для соответствующего биржевого рынка на основании отдельного решения Клирингового центра, и не превышающих разности величины собственных средств (капитала) Клирингового центра и величины капитала, необходимого для поддержания норматива достаточности капитала Клирингового центра на минимально необходимом уровне, установленном решением Клирингового центра (далее – дополнительный выделенный капитал Клирингового центра).
- 16.2. Суммарный размер выделенного капитала Клирингового центра для всех биржевых рынков рассчитывается Клиринговым центром в соответствии с Методикой расчета выделенного капитала центрального контрагента.
- 16.2.1. Клиринговый центр рассматривает вопрос о необходимости изменения суммарного размера выделенного капитала Клирингового центра для всех биржевых рынков с периодичностью не реже, чем это установлено нормативными актами Банка России.
- 16.2.2. Размер выделенного капитала на каждом из биржевых рынков установлен в соответствующей специальной части Правил клиринга.
- 16.3. Ограничение размера ответственности Клирингового центра величиной, указанной в пункте 16.1 общей части Правил клиринга, осуществляется за счет выполнения следующих процедур.
- 16.4. В случае необходимости заключения Клиринговым центром сделок с иностранной валютой / драгоценными металлами / ценными бумагами / Срочных контрактов с Недобросовестным участником клиринга, имеющим неисполненное Маржинальное требование, а также в иных предусмотренных Правилами клиринга случаях необходимости заключения Клиринговым центром сделок с иностранной валютой / драгоценными металлами / ценными бумагами / Срочных контрактов с Недобросовестным участником клиринга (далее – закрывающие сделки), Клиринговый центр заключает сделки с иностранной валютой / драгоценными металлами / ценными бумагами / Срочные контракты с целью минимизации рисков Клирингового центра по обязательствам и требованиям по сделкам с центральным контрагентом (далее – балансирующие сделки).
- 16.5. Балансирующие сделки заключаются на соответствующих биржевых рынках на основании пункта 3.15 общей части Правил клиринга или на внебиржевых рынках в случае, если в результате заключения закрывающих сделок по ценам соответствующих балансирующих сделок сумма Задолженностей Недобросовестных участников клиринга не превысит величины, определенной в соответствии с пунктом 16.1 общей части Правил клиринга.
- 16.6. Если заключение балансирующих сделок на соответствующих биржевых или внебиржевых рынках приводит к нарушению условия, указанного в пункте 16.5 общей части Правил клиринга, балансирующие сделки заключаются по предельным ценам, заключение закрывающих сделок по которым приведет к

возникновению Задолженностей Недобросовестных участников клиринга, сумма которых не превысит величины, определенной в соответствии с пунктом 16.1 общей части Правил клиринга.

- 16.7. Балансирующие сделки, указанные в пункте 16.6 общей части Правил клиринга, заключаются без подачи заявок между Клиринговым центром и Добросовестными участниками клиринга, имеющими Нетто-обязательства / Нетто-требования / позиции, противоположные Нетто-обязательствам / Нетто-требованиям / позициям Недобросовестных участников клиринга в объеме, пропорциональном объему Нетто-обязательств / Нетто-требований / открытых позиций Добросовестных участников клиринга.
- 16.8. Клиринговый центр, действуя от имени Участника клиринга в отношении себя лично, осуществляет все юридические и фактические действия, необходимые для заключения сделок в соответствии с настоящей статьей общей части Правил клиринга без специального полномочия (доверенности), а также без согласия Участника клиринга.
- 16.9. В случае использования выделенного капитала Клирингового центра, Клиринговый центр должен принять решение по вопросу о необходимости восполнения выделенного капитала Клирингового центра.



## **РАЗДЕЛ IV. ПОРЯДОК ПРОВЕДЕНИЯ КЛИРИНГА**

### **ПОДРАЗДЕЛ IV-I. ПОРЯДОК ВНЕСЕНИЯ И ВОЗВРАТА ОБЕСПЕЧЕНИЯ ПОД СТРЕСС И ВЗНОСОВ В ГАРАНТИЙНЫЕ ФОНДЫ**

#### **Статья 17. Порядок внесения взносов в Гарантийные фонды и Обеспечения под стресс**

17.1. Внесение денежных средств в российских рублях и иностранной валюте в качестве взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс Участником клиринга возможно двумя способами:

- 1) путем зачисления денежных средств на клиринговый банковский счет Клирингового центра, открытый в Расчетной организации, реквизиты которого размещены на Сайте Клирингового центра;
- 2) путем подачи Распоряжения на внесение денежных средств в Гарантийные фонды / Обеспечение под стресс с использованием Клиринговой системы.

17.1.1. Зачисление на клиринговый банковский счет Клирингового центра денежных средств для учета их в качестве взноса Участника клиринга в Гарантийный фонд / Обеспечения под стресс Участника клиринга должно осуществляться Участником клиринга с обязательным указанием в назначении платежа Расчетного кода Участника клиринга для учета взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс.

17.1.2. Распоряжение на внесение денежных средств в Гарантийные фонды / Обеспечение под стресс, направляемое с использованием Клиринговой системы, должно содержать указание на Торгово-клиринговый счет Участника клиринга, с которого денежные средства должны быть списаны, Торгово-клиринговый счет Участника клиринга для учета взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс, валюту и сумму денежных средств.

В состав Торгово-клирингового счета Участника клиринга, с которого денежные средства должны быть списаны, может входить Расчетный код, предназначенный для учета Обеспечения, или Расчетный код для учета взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс.

17.1.3. Распоряжение на внесение денежных средств в Гарантийные фонды / Обеспечение под стресс, поданное Участником клиринга, исполняется в случае если плановое значение позиции по денежным средствам по Счету обеспечения / Счету обеспечения Т0 / Счету гарантийных фондов / Счету обеспечения под стресс, с которого денежные средства должны быть списаны, больше либо равно сумме денежных средств, указанной в распоряжении, за вычетом соответствующего Ограничительного лимита.

Для списания денежных средств со Счета обеспечения / Счета гарантийных фондов / Счета обеспечения под стресс дополнительными условиями, необходимыми для исполнения указанного распоряжения, являются:

- 1) неотрицательное значение Единого лимита по Расчетному коду, соответствующему Счету обеспечения / Счету гарантийных фондов / Счету обеспечения под стресс, с которого денежные средства должны быть списаны, на момент подачи распоряжения;

- 2) списание денежных средств не приведет к возникновению у Участника клиринга отрицательного Единого лимита по Расчетному коду, соответствующему Счету обеспечения / Счету гарантийных фондов / Счету обеспечения под стресс, с которого денежные средства должны быть списаны.
- 17.1.4. Денежные средства, зачисленные на клиринговый банковский счет Клирингового центра с указанием в назначении платежа Расчетного кода Участника клиринга для учета взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс, а также денежные средства, внесенные в качестве взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс Участником клиринга путем подачи соответствующего распоряжения с использованием Клиринговой системы, Клиринговый центр учитывает в Клиринговой системе путем увеличения значения денежной позиции по Счету гарантийных фондов / Счету обеспечения под стресс на сумму зачисленных / внесенных денежных средств.
- 17.1.5. Обязательства по списанию денежных средств со Счета обеспечения Т0 / Счета обеспечения / Счета гарантийных фондов / Счета обеспечения под стресс и/или требования по зачислению денежных средств на Счет гарантийных фондов / Счет обеспечения под стресс по Распоряжениям на внесение денежных средств в Гарантийные фонды / Обеспечение под стресс, прошедшим проверку возможности их исполнения в соответствии с подпунктом 17.1.3 общей части Правил клиринга, включаются в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов и учитываются при определении Нетто-обязательств / Нетто-требований Участников клиринга по денежным средствам по сделкам клирингового пула по Счету обеспечения Т0 / Счету обеспечения / Счету гарантийных фондов / Счету обеспечения под стресс в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке.
- 17.2. Для внесения ценных бумаг в качестве взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс Участник клиринга обязан:
- 1) получить допуск к клиринговому обслуживанию на фондовом рынке в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке;
  - 2) выполнить действия, необходимые для открытия субсчета депо на клиринговом счете депо Клирингового центра в Расчетном депозитарии, предназначенном для внесения коллективного клирингового обеспечения (Гарантийных фондов) / Обеспечения под стресс (далее – субсчет депо), предусмотренные Условиями осуществления депозитарной деятельности Расчетного депозитария и Правилами клиринга;
  - 3) выполнить действия, необходимые для зачисления ценных бумаг на соответствующий субсчет депо.
- 17.2.1. Клиринговый центр регистрирует Торгово-клиринговый счет для учета взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс Участника клиринга после получения от Расчетного депозитария списка Разделов / субсчетов депо, в который включена информация об открытом соответствующем субсчете депо.
- 17.2.2. Для зачисления ценных бумаг на соответствующий субсчет депо Участнику клиринга необходимо с использованием Клиринговой системы подать Распоряжение на перечисление ценных бумаг в Гарантийные фонды / Обеспечение под стресс, в котором указывается Торгово-клиринговый счет Участника клиринга, в состав которого входит Раздел, с которого ценные бумаги должны быть списаны,

Торгово-клиринговый счет для учета взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс, код и количество ценных бумаг.

В качестве Торгово-клирингового счета Участника клиринга, в состав которого входит Раздел, с которого ценные бумаги должны быть списаны, может быть указан только Торгово-клиринговый счет, в состав которого входит Раздел, открытый на торговом счете депо владельца Участника клиринга.

- 17.2.3. Распоряжение на перечисление ценных бумаг в Гарантийные фонды / Обеспечение под стресс исполняется в случае, если плановое значение позиции по ценным бумагам по Разделу, с которого ценные бумаги должны быть списаны, больше либо равно количеству перечисляемых ценных бумаг, указанному в распоряжении.

В случае перечисления ценных бумаг с Раздела Т+ дополнительными условиями, необходимыми для исполнения указанного распоряжения, являются:

- 1) неотрицательное значение Единого лимита по Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета совместно с Разделом, с которого ценные бумаги должны быть списаны, на момент подачи распоряжения;
- 2) перечисление ценных бумаг не приведет к возникновению у Участника клиринга отрицательного Единого лимита по Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета совместно с Разделом, с которого ценные бумаги должны быть списаны.

Единый лимит по Расчетному коду и порядок его определения установлены Правилами клиринга на фондовом рынке.

- 17.2.4. Ценные бумаги, внесенные в качестве взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс Участником клиринга путем подачи соответствующего распоряжения с использованием Клиринговой системы, Клиринговый центр учитывает в Клиринговой системе путем увеличения значения позиции по ценным бумагам по соответствующему субсчету депо Участника клиринга на количество внесенных ценных бумаг.

- 17.2.5. Обязательства по списанию ценных бумаг с Раздела Т0 / Раздела Т+ и/или требования по зачислению ценных бумаг на субсчета депо по распоряжениям на перечисление ценных бумаг в Гарантийные фонды / Обеспечение под стресс, прошедшим проверку возможности их исполнения в соответствии с подпунктом 17.2.3 общей части Правил клиринга, включаются в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов и учитываются при определении Нетто-обязательств / Нетто-требований Участников клиринга по ценным бумагам по сделкам клирингового пула по субсчету депо / Разделу Т0 / Разделу Т+ в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке.

- 17.3. Для контроля за исполнением обязательств Участника клиринга по внесению взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс, Клиринговый центр рассчитывает Единый лимит Участника клиринга по Расчетному коду для учета взносов в Гарантийные фонды / Расчетному коду для учета Обеспечения под стресс как сумму с учетом знака:

- позиции по денежным средствам в российских рублях по Счету гарантийных фондов / Счету обеспечения под стресс (учитывается со знаком «плюс»);
- позиции по денежным средствам в иностранной валюте по Счету гарантийных фондов / Счету обеспечения под стресс, пересчитанной в российские рубли по соответствующей Нижней границе диапазона оценки

рыночных рисков, установленной для иностранной валюты в соответствии с Методикой определения размера Обеспечения под стресс (учитывается со знаком «плюс»);

- позиции по ценным бумагам, учитываемой по соответствующему субсчету депо Участника клиринга, пересчитанной в российские рубли по соответствующей Нижней границе диапазона оценки рыночных рисков, установленной для ценной бумаги в соответствии с Методикой определения размера Обеспечения под стресс (учитывается со знаком «плюс»);
- обязательств Участника клиринга по внесению взносов в Гарантийные фонды соответствующих биржевых рынков в размере, установленном в соответствующей специальной части Правил клиринга (учитываются со знаком «минус»);
- обязательств Участника клиринга по внесению Обеспечения под стресс на соответствующих биржевых рынках в размере, установленном в соответствии с Методикой определения размера Обеспечения под стресс (учитываются со знаком «минус»).

17.4. Обязательства Участника клиринга по внесению взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс считаются исполненными, если Единый лимит Участника клиринга по Расчетному коду для учета взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс, рассчитанный в соответствии с пунктом 17.3 общей части Правил клиринга, является неотрицательным.

17.5. В случае изменения размера Обеспечения под стресс на соответствующем биржевом рынке в соответствии с Методикой определения размера Обеспечения под стресс, новое значение размера Обеспечения под стресс Участника клиринга используется при расчете Единого лимита Участника клиринга по Расчетному коду для учета Обеспечения под стресс, начиная с 6-го Расчетного дня со дня направления Участнику клиринга Клиринговым центром уведомления о новом значении размера Обеспечения под стресс.

17.6. После увеличения значения денежной позиции по Счету гарантийных фондов / Счету обеспечения под стресс на сумму денежных средств, внесенных Участником клиринга в Гарантийные фонды / в качестве Обеспечения под стресс, Клиринговый центр начинает учитывать обязательство по возврату Участнику клиринга денежных средств / ценных бумаг, учитываемых в качестве взносов Участника клиринга в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс Участника клиринга.

17.7. Клиринговый центр вправе осуществить в любое время зачет требований Участника клиринга по возврату ему денежных средств, учитываемых в качестве взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс, с требованиями Клирингового центра к этому Участнику клиринга в денежных средствах в соответствующей валюте.

## **Статья 18. Порядок возврата взносов в Гарантийные фонды и Обеспечения под стресс**

18.1. В случае прекращения Договора об оказании клиринговых услуг с Участником клиринга, Клиринговый центр возвращает Участнику клиринга денежные средства

и/или ценные бумаги, учитываемые в качестве взносов Участника клиринга в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс Участника клиринга на дату прекращения Договора об оказании клиринговых услуг, не позднее 3 (трех) рабочих дней с даты прекращения Договора об оказании клиринговых услуг, денежные средства в российских рублях и иностранной валюте - по реквизитам Счета для возврата в соответствующей валюте, зарегистрированного Участником клиринга в соответствии с подпунктом 18.3.3 общей части Правил клиринга, а в случае отсутствия такого зарегистрированного счета, по реквизитам Счета для возврата в соответствующей валюте, зарегистрированного Участником клиринга в соответствии подпунктом 12.9.3 общей части Правил клиринга, ценные бумаги – на торговый счет депо владельца Участника клиринга, с учетом положений статьи 27 общей части Правил клиринга.

- 18.2. Возврат Участнику клиринга денежных средств и/или ценных бумаг, учитываемых в качестве взноса Участника клиринга в Гарантийный фонд / Обеспечения под стресс Участника клиринга на соответствующем биржевом рынке, при изменении категории Участника клиринга с категории «Б» или «О» на категорию «В» / при прекращении допуска к клиринговому обслуживанию Участника клиринга с категорией «Б» или «О» на таком биржевом рынке осуществляется после изменения категории Участника клиринга с категории «Б» или «О» на категорию «В» / прекращения допуска к клиринговому обслуживанию Участника клиринга с категорией «Б» или «О» в порядке и по основаниям, установленным статьей 11 общей части Правил клиринга, в порядке, предусмотренном пунктом 18.3 общей части Правил клиринга
- 18.3. Возврат Участнику клиринга денежных средств / ценных бумаг, учитываемых в качестве взносов Участника клиринга в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс, за исключением случая, указанного в пункте 18.1 общей части Правил клиринга, осуществляется на основании Запроса о возврате денежных средств / ценных бумаг из Гарантийных фондов / Обеспечения под стресс.
- 18.3.1. Запрос о возврате денежных средств из Гарантийных фондов / Обеспечения под стресс направляется Участником клиринга Клиринговому центру посредством Подсистемы ЭДО НКЦ, системы S.W.I.F.T. или Клиринговой системы.
- 18.3.2. Запрос о возврате ценных бумаг из Гарантийных фондов / Обеспечения под стресс направляется Участником клиринга Клиринговому центру посредством Клиринговой системы.
- 18.3.3. Возврат денежных средств на основании Запроса о возврате денежных средств из Гарантийных фондов / Обеспечения под стресс, направляемого посредством Подсистемы ЭДО НКЦ и/или системы S.W.I.F.T., осуществляется на Счет для возврата, зарегистрированный в Клиринговом центре.
- Регистрация Счета для возврата осуществляется на основании Заявления на регистрацию Счета для возврата.
- 18.3.4. Запрос о возврате денежных средств из Гарантийных фондов / Обеспечения под стресс, направляемый посредством Подсистемы ЭДО НКЦ и/или системы S.W.I.F.T., должен содержать указание на Расчетный код Участника клиринга для учета взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс, валюту и сумму денежных средств.

- 18.3.5. Запрос о возврате денежных средств из Гарантийных фондов / Обеспечения под стресс, направляемый посредством Клиринговой системы, должен содержать указание на Торгово-клиринговый счет Участника клиринга для учета взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс, Торгово-клиринговый счет Участника клиринга, на который денежные средства должны быть зачислены, валюту и сумму денежных средств.
- В состав Торгово-клирингового счета Участника клиринга, на который денежные средства должны быть зачислены, может входить Расчетный код, предназначенный для учета Обеспечения, или Расчетный код для учета взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс.
- 18.3.6. Запрос о возврате ценных бумаг из Гарантийных фондов / Обеспечения под стресс должен содержать указание на Торгово-клиринговый счет Участника клиринга для учета взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс, Торгово-клиринговый счет Участника клиринга, на который ценные бумаги должны быть зачислены, код и количество ценных бумаг.
- В качестве Торгово-клирингового счета Участника клиринга, на который ценные бумаги должны быть зачислены, может быть указан только Торгово-клиринговый счет, в состав которого входит Раздел, открытый на торговом счете депо владельца Участника клиринга.
- 18.3.7. Сроки предоставления Запросов о возврате денежных средств / ценных бумаг из Гарантийных фондов / Обеспечения под стресс установлены Временным регламентом.
- 18.3.8. При предоставлении Запроса о возврате денежных средств / ценных бумаг из Гарантийных фондов / Обеспечения под стресс, позднее времени, указанного во Временном регламенте, указанный запрос не исполняется.
- 18.3.9. Запрос о возврате денежных средств / ценных бумаг из Гарантийных фондов / Обеспечения под стресс подлежит исполнению в день его получения Клиринговым центром при условии соблюдения требования, установленного подпунктом 18.3.10 / 18.3.11 общей части Правил клиринга.
- 18.3.10. Запрос о возврате денежных средств из Гарантийных фондов / Обеспечения под стресс исполняется в случае, если сумма денежных средств, подлежащая возврату, не превышает значения позиции по денежным средствам в соответствующей валюте по Счету гарантийных фондов / Счету обеспечения под стресс, у Участника клиринга отсутствуют Задолженности и Единый лимит Участника клиринга по Расчетному коду Участника клиринга для учета взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс, рассчитанный без учета возвращаемой суммы денежных средств, не станет отрицательным.
- 18.3.11. Запрос о возврате ценных бумаг из Гарантийных фондов / Обеспечения под стресс исполняется в случае, если значение позиции по ценным бумагам по соответствующему субсчету депо Участника клиринга больше либо равно количеству ценных бумаг, указанному в запросе, у Участника клиринга отсутствуют Задолженности и Единый лимит Участника клиринга по Расчетному коду для учета взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс, рассчитанный без учета возвращаемого количества ценных бумаг, не станет отрицательным.

- 18.3.12. Для исполнения Запроса о возврате денежных средств из Гарантийных фондов / Обеспечения под стресс, направленного посредством Подсистемы ЭДО НКЦ и/или системы S.W.I.F.T., Клиринговый центр перечисляет денежные средства, учитываемые в качестве взносов Участника клиринга в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс Участника клиринга, по реквизитам Счета для возврата.
- 18.3.13. Обязательства по списанию денежных средств со Счета гарантийных фондов / Счета обеспечения под стресс и/или требования по зачислению денежных средств на Счет обеспечения T0 / Счет обеспечения / Счет гарантийных фондов / Счет обеспечения под стресс по Запросам о возврате денежных средств из Гарантийных фондов / Обеспечения под стресс, прошедшим проверку возможности их исполнения в соответствии с подпунктом 18.3.10 общей части Правил клиринга, включаются в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов и учитываются при определении Нетто-обязательств / Нетто-требований Участников клиринга по денежным средствам по сделкам клирингового пула по Счету обеспечения T0 / Счету обеспечения / Счету гарантийных фондов / Счету обеспечения под стресс в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке.
- 18.3.14. Обязательства по списанию ценных бумаг с субсчетов депо и/или требования по зачислению ценных бумаг на Разделы T0 / Разделы T+ по Запросам о возврате ценных бумаг из Гарантийных фондов / Обеспечения под стресс, прошедшим проверку возможности их исполнения в соответствии с подпунктом 18.3.11 общей части Правил клиринга, включаются в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов и учитываются при определении Нетто-обязательств / Нетто-требований Участников клиринга по ценным бумагам по сделкам клирингового пула по субсчету депо / Разделу T0 / Разделу T+ в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке.

## **Статья 19. Порядок возникновения и исполнения Маржинальных требований по фондам / обеспечению под стресс**

- 19.1. В ходе клиринговой сессии, проводимой в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке, Клиринговый центр также осуществляет следующие действия:
- для каждого Участника клиринга категории «Б» или «О» рассчитывает значение Единого лимита по Расчетному коду для учета взносов в Гарантийные фонды; определяет Участников клиринга, у которых возникли Маржинальные требования по фондам; формирует и направляет Участникам клиринга Отчеты о Гарантийных фондах;
  - для каждого Участника клиринга категории «Б» или «О», к которому Клиринговым центром предъявлено требование о внесении Обеспечения под стресс, размер которого отличен от нуля, рассчитывает значение Единого лимита по Расчетному коду для учета Обеспечения под стресс; определяет Участников клиринга, у которых возникли Маржинальные требования по обеспечению под стресс; формирует и направляет Участникам клиринга Отчеты об Обеспечении под стресс.
- 19.2. В случае если по итогам клиринговой сессии Единый лимит Участника клиринга по Расчетному коду для учета взносов в Гарантийные фонды становится меньше величины, установленной решением Клирингового центра (далее – порог выставления Маржинального требования по фондам), Клиринговый центр предъявляет Участнику клиринга Маржинальное требование по фондам.

Информация о Маржинальном требовании по фондам направляется Участнику клиринга в составе Отчета о Гарантийных фондах, направляемого в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке.

Маржинальное требование по фондам должно быть исполнено Участником клиринга не позднее установленного Временным регламентом времени текущего Рабочего дня, путем перечисления денежных средств в российских рублях и/или иностранной валюте и/или ценных бумаг для учета в качестве взносов в Гарантийные фонды в порядке, установленном статьей 17 общей части Правил клиринга.

Маржинальное требование по фондам считается исполненным в момент времени, когда Единый лимит Участника клиринга по Расчетному коду для учета взносов в Гарантийные фонды станет больше либо равен нулю.

- 19.3. В случае если Единый лимит Участника клиринга по Расчетному коду для учета Обеспечения под стресс становится меньше величины, установленной решением Клирингового центра (далее – порог выставления Маржинального требования по обеспечению под стресс), Клиринговый центр предъявляет Участнику клиринга Маржинальное требование по обеспечению под стресс.

Информация о Маржинальном требовании по обеспечению под стресс направляется Участнику клиринга в составе Отчета об Обеспечении под стресс, направляемого в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке.

Маржинальное требование по обеспечению под стресс должно быть исполнено Участником клиринга не позднее установленного Временным регламентом времени текущего Рабочего дня, путем перечисления денежных средств в российских рублях и/или иностранной валюте и/или ценных бумаг для учета в качестве Обеспечения под стресс в порядке, установленном статьей 17 общей части Правил клиринга.

Маржинальное требование по обеспечению под стресс считается исполненным в момент времени, когда Единый лимит Участника клиринга по Расчетному коду для учета обеспечения под стресс станет больше либо равен нулю.

- 19.4. В случае неисполнения Участником клиринга Маржинального требования по фондам в срок, установленный пунктом 19.2 общей части Правил клиринга, считается, что Участник клиринга не исполнил обязательства по внесению взносов в Гарантийные фонды всех биржевых рынков, к клирингу на которых Участник клиринга допущен с категорией «Б» или «О», и к Участнику клиринга применяются меры, предусмотренные соответствующей специальной частью Правил клиринга.

- 19.5. В случае неисполнения Участником клиринга Маржинального требования по обеспечению под стресс, возникшего в связи с переоценкой стоимости ценных бумаг и иностранной валюты, учитываемых в качестве Обеспечения под стресс, в срок, установленный пунктом 19.3 общей части Правил клиринга, считается, что Участник клиринга не исполнил обязательства по внесению Обеспечения под стресс на всех биржевых рынках, на которых согласно соответствующей специальной части Правил клиринга Клиринговым центром к Участнику клиринга предъявлено требование о внесении Обеспечения под стресс, и к Участнику



клиринга применяются меры, предусмотренные соответствующей специальной частью Правил клиринга.

- 19.6. В случае неисполнения Участником клиринга Маржинального требования по обеспечению под стресс, возникшего в связи с изменением размера Обеспечения под стресс на определенном биржевом рынке, считается, что Участник клиринга не исполнил обязательства по внесению Обеспечения под стресс на том биржевом рынке, на котором размер Обеспечения под стресс был увеличен.

## **ПОДРАЗДЕЛ IV-II. ПОРЯДОК ВКЛЮЧЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ В КЛИРИНГОВЫЙ ПУЛ**

### **Статья 20. Общие требования к порядку включения обязательств в клиринговые пулы и к порядку исполнения обязательств**

20.1. Подлежащие исполнению обязательства по сделкам и иные обязательства, определенные Правилами клиринга, включаются в соответствующие клиринговые пулы в Дату исполнения указанных обязательств.

Перечень клиринговых пулов и порядок включения обязательств в соответствующие клиринговые пулы определены соответствующими специальными частями Правил клиринга.

20.2. Для исполнения обязательств по сделкам и иных обязательств, определенных Правилами клиринга, включенных в соответствующий клиринговый пул, Участники клиринга обязаны обеспечить наличие денежных средств / ценных бумаг / драгоценных металлов на соответствующих счетах, указанных в соответствующей специальной части Правил клиринга, до момента времени исполнения соответствующих обязательств, указанного в соответствующем временном регламенте.

20.3. Правилами клиринга может быть определено, что:

- исполнение обязательств по сделкам и иных обязательств, определенных Правилами клиринга, включенных в соответствующий клиринговый пул, осуществляется в моменты времени, установленные соответствующим временным регламентом, либо
- для исполнения обязательств по сделкам и иных обязательств, определенных Правилами клиринга, Участники клиринга обязаны или вправе подать отчеты на исполнение или иные распоряжения Клиринговому центру.

20.4. Правилами клиринга, в том числе, могут быть предусмотрены:

- случаи и порядок досрочного исполнения обязательств по сделкам и иных обязательств, определенных Правилами клиринга;
- порядок и условия замены счетов, по которым должны быть исполнены обязательства по сделкам и/или иные обязательства, определенные Правилами клиринга;
- случаи, порядок и условия отказа от исполнения обязательств по сделкам и иных обязательств, определенных Правилами клиринга;
- случаи и порядок принятия Клиринговым центром решения об изменении в одностороннем порядке предмета (объекта) сделок, обязательства по которым не исполнены, и/или порядка исполнения обязательств по сделкам.

20.5. Порядок исполнения обязательств, включенных в соответствующий клиринговый пул, определен в соответствующей специальной части Правил клиринга.

## ПОДРАЗДЕЛ IV-III. ПОРЯДОК ДЕЙСТВИЙ В СЛУЧАЯХ НЕИСПОЛНЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ

### Статья 21. Порядок использования и возмещения Гарантийных фондов и иных средств в целях погашения Задолженностей Участников клиринга (процедура кросс-дефолта)

21.1. Настоящая статья общей части Правил клиринга применяется, если Задолженность Участника клиринга, учитываемая по Расчетному коду, не погашена в результате действий Клирингового центра, указанных в соответствующей специальной части Правил клиринга, с учетом ограничения размера ответственности Клирингового центра, предусмотренного статьей 16 общей части Правил клиринга.

21.2. Индивидуальное клиринговое и иное обеспечение Недобросовестного участника клиринга, в том числе Обеспечение под стресс Недобросовестного участника клиринга, средства Гарантийных фондов используются для погашения Задолженности Участника клиринга, учитываемой по Расчетному коду, в следующей очередности:

- 1) свободное Обеспечение Недобросовестного участника клиринга на биржевом рынке, на котором возникла Задолженность, учитываемое по собственным Расчетным кодам Недобросовестного участника клиринга (по выбору Клирингового центра);
- 2) свободное Обеспечение Недобросовестного участника клиринга на других биржевых рынках, учитываемое по собственным Расчетным кодам Недобросовестного участника клиринга (по выбору Клирингового центра);
- 3) Обеспечение Недобросовестного участника клиринга на биржевом рынке, на котором возникла Задолженность, учитываемое по собственным Расчетным кодам Недобросовестного участника клиринга (по выбору Клирингового центра), освободившееся в результате заключения сделок, направленных на увеличение объема свободного Обеспечения Недобросовестного участника клиринга;
- 4) Обеспечение Недобросовестного участника клиринга на других биржевых рынках, учитываемое по собственным Расчетным кодам Недобросовестного участника клиринга (по выбору Клирингового центра), освободившееся в результате заключения сделок, направленных на увеличение объема свободного Обеспечения Недобросовестного участника клиринга;
- 5) Обеспечение под стресс Недобросовестного участника клиринга на биржевом рынке, на котором возникла Задолженность;
- 6) взнос Недобросовестного участника клиринга в Гарантийный фонд биржевого рынка, на котором возникла Задолженность;
- 7) Обеспечение под стресс Недобросовестного участника клиринга на другом биржевом рынке по выбору Клирингового центра;
- 8) взнос Недобросовестного участника клиринга в Гарантийный фонд другого биржевого рынка, на котором было использовано Обеспечение под стресс Недобросовестного участника клиринга;

Действия, предусмотренные подпунктами 7)-8), последовательно повторяются Клиринговым центром для всех биржевых рынков в

очередности по выбору Клирингового центра.

- 9) взносы Добросовестных участников клиринга в Гарантийный фонд биржевого рынка, на котором возникла Задолженность (с учетом условия пункта 21.14 общей части Правил клиринга).
- 21.3. Взносы в Гарантийные фонды и иные средства Участников клиринга каждой очереди, указанной в пункте 21.2 общей части Правил клиринга, используются в следующей очередности:
- 1) российские рубли;
  - 2) иностранная валюта;
  - 3) ценные бумаги;
  - 4) драгоценные металлы.
- 21.4. Использование средств Гарантийных фондов и иных средств следующей очереди в соответствии с настоящей статьей общей части Правил клиринга осуществляется в случае, если Задолженность Участника клиринга не погашена при использовании средств предыдущей очереди.
- 21.5. Обеспечение Недобросовестного участника в российских рублях используется для погашения его Задолженности при условии отсутствия Маржинального требования по Расчетному коду / Расчетной фирме, открытому (открытой) для соответствующего биржевого рынка, и в объеме, не приводящем к возникновению Маржинального требования по такому Расчетному коду / такой Расчетной фирме и/или Задолженности по такому Расчетному коду.
- 21.6. Обеспечение Недобросовестного участника в иностранной валюте / ценных бумагах используется для погашения его Задолженности при условии отсутствия Маржинального требования по Расчетному коду / Расчетной фирме, открытому (открытой) для соответствующего биржевого рынка, и в объеме, не приводящем к возникновению Маржинального требования по такому Расчетному коду / такой Расчетной фирме.
- 21.7. Если после использования свободного Обеспечения Недобросовестного участника клиринга, учитываемого по всем собственным Расчетным кодам на всех биржевых рынках, Задолженность Участника клиринга не погашена, между Клиринговым центром и Недобросовестным участником клиринга по собственным Расчетным кодам без подачи заявок заключаются сделки, направленные на увеличение объема свободного Обеспечения Недобросовестного участника клиринга, учитываемого по собственным Расчетным кодам, сначала - на биржевом рынке, на котором возникла Задолженность, затем – на других биржевых рынках (по выбору Клирингового центра).
- Обеспечение, освободившееся в результате заключения сделок в соответствии с настоящим пунктом общей части Правил клиринга, переводится Клиринговым центром на Расчетный код, по которому учитывается Задолженность, и используется для ее погашения.
- Указанные в настоящем пункте общей части Правил клиринга сделки заключаются до момента погашения Задолженности Участника клиринга, учитываемой по Расчетному коду, или до момента невозможности заключения указанных сделок (в зависимости от того, какое из этих событий наступит раньше).

21.8. Если после совершения действий, указанных в пункте 21.7 общей части Правил клиринга, Задолженность Участника клиринга не погашена, между Клиринговым центром и Недобросовестным участником клиринга по всем Расчетным кодам на биржевом рынке, на котором возникла Задолженность, без подачи заявок заключаются закрывающие сделки, направленные на прекращение обязательств Недобросовестного участника клиринга.

После заключения сделок в соответствии с настоящим пунктом общей части Правил клиринга Обеспечение под стресс Недобросовестного участника клиринга на биржевом рынке, на котором возникла Задолженность, а затем взнос Недобросовестного участника клиринга в Гарантийный фонд биржевого рынка, на котором возникла Задолженность, используются для погашения его Задолженности.

21.9. Если после использования Обеспечения под стресс Недобросовестного участника клиринга на биржевом рынке, на котором возникла Задолженность, и вноса Недобросовестного участника клиринга в Гарантийный фонд биржевого рынка, на котором возникла Задолженность, Задолженность Участника клиринга не погашена, между Клиринговым центром и Недобросовестным участником клиринга по всем Расчетным кодам на другом биржевом рынке (по выбору Клирингового центра) без подачи заявок заключаются закрывающие сделки, направленные на прекращение обязательств Недобросовестного участника клиринга.

После заключения сделок в соответствии с настоящим пунктом общей части Правил клиринга Обеспечение под стресс Недобросовестного участника клиринга на таком биржевом рынке, а затем взнос Недобросовестного участника клиринга в Гарантийный фонд на таком биржевом рынке используются для погашения его Задолженности.

При этом Обеспечение под стресс на биржевом рынке и взнос Недобросовестного участника клиринга в Гарантийный фонд биржевого рынка используются в случае отсутствия у Участника клиринга Задолженностей по Расчетным кодам на таком биржевом рынке.

21.10. Если после совершения действий, указанных в пункте 21.9 общей части Правил клиринга, Задолженность Участника клиринга не погашена, действия, указанные в пункте 21.9 общей части Правил клиринга, совершаются в отношении Недобросовестного участника клиринга на другом биржевом рынке.

21.11. Клиринговый центр, действуя от имени Участника клиринга в отношении себя лично, осуществляет все юридические и фактические действия, необходимые для заключения сделок в соответствии с пунктами 21.7-21.9 общей части Правил клиринга без специального полномочия (доверенности), а также без согласия Участника клиринга.

21.12. При использовании вноса Участника клиринга в Гарантийный фонд биржевого рынка и/или Обеспечения под стресс на биржевом рынке, к Участнику клиринга применяются меры, предусмотренные соответствующей специальной частью Правил клиринга.

21.13. В случае использования вноса в Гарантийный фонд и/или Обеспечения под стресс Недобросовестного участника клиринга, такой Участник клиринга обязан в течение

- 1 (одного) Расчетного дня после направления Клиринговым центром Маржинального требования по фонду и/или Маржинального требования по Обеспечению под стресс в соответствии с пунктами 19.2 / 19.3 общей части Правил клиринга восполнить свой взнос в Гарантийный фонд / свое Обеспечение под стресс до размеров, установленных Клиринговым центром.
- 21.14. Взносы в Гарантийный фонд Добросовестных участников клиринга на соответствующем биржевом рынке используются в случае, если сумма Задолженностей Недобросовестных участников клиринга перед Клиринговым центром на таком биржевом рынке превышает размер выделенного капитала Клирингового центра, установленного для такого биржевого рынка в соответствующей специальной части Правил клиринга.
- 21.15. Взносы Добросовестных участников клиринга в Гарантийный фонд соответствующего биржевого рынка используются в равных долях.
- 21.16. В случае возникновения нескольких задолженностей одного или нескольких Недобросовестных участников клиринга на нескольких биржевых рынках, взнос Недобросовестного участника клиринга в Гарантийный фонд биржевого рынка / Обеспечение под стресс Недобросовестного Участника клиринга на биржевом рынке используется, в первую очередь, для погашения Задолженности Участника клиринга, возникшей на таком биржевом рынке, во вторую – Задолженностей, возникших на других биржевых рынках.
- 21.17. Обеспечение Недобросовестного участника / Взнос Недобросовестного участника клиринга в Гарантийный фонд / Обеспечение под стресс Недобросовестного участника клиринга в российских рублях используются для удовлетворения требований Клирингового центра по Задолженности Недобросовестного участника клиринга путем передачи денежных средств в российских рублях, учитываемых в качестве Обеспечения Недобросовестного участника на соответствующем биржевом рынке / взноса Недобросовестного участника клиринга в Гарантийный фонд соответствующего биржевого рынка / Обеспечения под стресс Недобросовестного участника клиринга на соответствующем биржевом рынке, Клиринговому центру в счет погашения Задолженности Недобросовестного участника клиринга.
- 21.18. Обеспечение Недобросовестного Участника клиринга / взнос Недобросовестного участника клиринга в Гарантийный фонд / Обеспечение под стресс Недобросовестного участника клиринга в иностранной валюте / ценных бумагах / драгоценных металлах используются для удовлетворения требований Клирингового центра по Задолженности Недобросовестного участника клиринга путем:
- 1) продажи указанной иностранной валюты / ценных бумаг / драгоценных металлов в объеме, необходимом для погашения указанной Задолженности, с передачей вырученных от продажи денежных средств в российских рублях Клиринговому центру в счет погашения Задолженности Недобросовестного участника клиринга;
  - 2) передачи указанной иностранной валюты / ценных бумаг / драгоценных металлов Клиринговому центру в счет погашения Задолженности Недобросовестного участника клиринга (в случае невозможности их

продажи).

При этом сумма денежных средств в иностранной валюте / количество драгоценных металлов, подлежащие передаче Клиринговому центру из Обеспечения Участник клиринга на соответствующем биржевом рынке / взноса Участника клиринга в Гарантийный фонд соответствующего биржевого рынка / Обеспечения под стресс Участника клиринга на соответствующем биржевом рынке, рассчитывается исходя из суммы Задолженности и курса иностранной валюты / драгоценных металлов, равного соответствующей Нижней границе диапазона оценки рыночных рисков, установленной Клиринговым центром для такой иностранной валюты / такого драгоценного металла в соответствии с Методикой определения риск-параметров валютного рынка и рынка драгоценных металлов на дату удовлетворения требований, а количество ценных бумаг – исходя из суммы Задолженности и соответствующей Нижней границы диапазона оценки рыночных рисков, установленной Клиринговым центром для таких ценных бумаг в соответствии с Методикой определения риск-параметров рынка ценных бумаг на дату удовлетворения требований.

- 21.18.1. Удовлетворение требований за счет Обеспечения Недобросовестного участника клиринга / взноса Недобросовестного участника клиринга в Гарантийный фонд / Обеспечения под стресс Недобросовестного участника клиринга осуществляется Клиринговым центром без предварительного уведомления Участника клиринга.
- 21.18.2. Значение позиции по денежным средствам в соответствующей валюте / соответствующим драгоценным металлам по Счету обеспечения / Счету гарантийных фондов / Счету обеспечения под стресс / значение позиции по ценным бумагам по соответствующему Разделу / субсчету депо Недобросовестного участника клиринга, и размер обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга Обеспечения / взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс уменьшаются на сумму / количество использованных денежных средств / ценных бумаг / драгоценных металлов из Обеспечения Недобросовестного участника / взноса Недобросовестного участника клиринга в Гарантийный фонд / Обеспечения под стресс Недобросовестного участника клиринга.
- 21.19. В случае необходимости использования ценных бумаг, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга / взносов Участников клиринга в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс, Клиринговый центр включает распоряжение на перевод ценных бумаг с субсчета депо Участника клиринга на субсчет депо Клирингового центра в распоряжение на проведение операций по Разделам / субсчетам депо, направляемое Расчетному депозитарию в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке.
- 21.20. В случае необходимости использования драгоценных металлов, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга, Клиринговый центр списывает соответствующий драгоценный металл со Счета обеспечения Участника клиринга.
- 21.21. В случае использования взносов в Гарантийный фонд Добросовестных участников клиринга, Недобросовестный участник клиринга обязан в течение 1 (одного) Расчетного дня возместить Клиринговому центру в российских рублях использованные средства Гарантийного фонда.

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

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

- 21.22. После возмещения Недобросовестным участником клиринга использованных средств Гарантийного фонда из взносов Добросовестных участников клиринга, Клиринговый центр возмещает в российских рублях использованные взносы в Гарантийные фонды Добросовестных участников клиринга.

Если полученных от Недобросовестного участника клиринга денежных средств недостаточно для полного возмещения взносов Добросовестных участников клиринга в Гарантийный фонд соответствующего биржевого рынка, осуществляется частичное возмещение таких взносов в размере, пропорциональном сумме использованных средств Гарантийного фонда соответствующего биржевого рынка из взноса каждого Добросовестного участника клиринга.

При этом значение позиции по денежным средствам в российских рублях по Счету гарантийных фондов Добросовестного участника клиринга и размер обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга взносов в Гарантийные фонды увеличиваются на сумму возмещенных денежных средств.

- 21.23. После возмещения Недобросовестным участником клиринга использованных средств Гарантийных фондов из взносов Добросовестных участников клиринга такой Недобросовестный участник клиринга обязан возместить (внести) свои взносы в Гарантийные фонды соответствующих биржевых рынков и/или Обеспечение под стресс на соответствующих биржевых рынках в установленном Клиринговым центром размере.

- 21.24. В случае использования взносов Добросовестных участников клиринга в Гарантийный фонд соответствующего биржевого рынка, Добросовестные участники клиринга обязаны в течение 1 (одного) Расчетного дня после направления Клиринговым центром Маржинальных требований по фонду в соответствии с пунктом 19.2 общей части Правил клиринга восполнить в российских рублях свои взносы в Гарантийный фонд соответствующего биржевого рынка до размера, установленного Клиринговым центром.

Указанная обязанность по восполнению взноса в Гарантийный фонд соответствующего биржевого рынка не может возникать у Добросовестного участника клиринга чаще, чем 1 (один) раз в Расчетный день и 6 (шесть) раз в течение календарного года.



## **ПОДРАЗДЕЛ IV-IV. ПОРЯДОК ВЗАИМОДЕЙСТВИЯ С РАСЧЕТНОЙ ОРГАНИЗАЦИЕЙ И РАСЧЕТНЫМ ДЕПОЗИТАРИЕМ**

### **Статья 22. Порядок взаимодействия с Расчетной организацией**

- 22.1. Клиринговый центр взаимодействует с Расчетной организацией по клиринговым банковским счетам в соответствии с условиями договора банковского счета.
- 22.2. Перечень документов, которыми обмениваются Клиринговый центр и Расчетная организация в процессе взаимодействия при осуществлении клиринга и расчетов по денежным средствам по итогам клиринга по торговым банковским счетам, а также форматы указанных документов и сроки их предоставления определяются договором, заключенным между Клиринговым центром и Расчетной организацией.
- 22.3. В случае использования при осуществлении клиринга и расчетов торговых банковских счетов, списание денежных средств с торговых банковских счетов осуществляется на основании распоряжений Клирингового центра или на основании распоряжений лица, которому открыт такой торговый банковский счет с согласия Клирингового центра.
- 22.4. Клиринговый центр соглашается с проведением любых операций зачисления на торговый банковский счет на основании распоряжений лица, которому открыт такой торговый банковский счет.
- 22.5. В случае обращения взыскания на имущество Участника клиринга, находящееся на торговом банковском или клиринговом банковском счете, Клиринговый центр вправе принять решение о том, что Дата исполнения обязательств по сделкам считается наступившей в Расчетный день, когда Клиринговый центр получил от Расчетной организации копию документа, являющегося основанием для указанного обращения взыскания, или в Расчетный день, следующий за днем получения Клиринговым центром копии указанного документа, и/или решение о заключении с Участником клиринга закрывающих сделок, направленных на прекращение обязательств Участника клиринга, в Расчетный день, когда Клиринговый центр получил от Расчетной организации копию документа, являющегося основанием для указанного обращения взыскания, или в Расчетный день, следующий за днем получения Клиринговым центром копии указанного документа.
  - 22.5.1. Информация о решении, принятом Клиринговым центром в соответствии с настоящим пунктом общей части Правил клиринга направляется Участнику клиринга с использованием Подсистемы ЭДО НКЦ.

### **Статья 23. Порядок взаимодействия с Расчетным депозитарием и иными депозитариями**

- 23.1. Перечень документов, которыми обмениваются Клиринговый центр и Расчетный депозитарий в процессе взаимодействия при осуществлении клиринга и расчетов по ценным бумагам по итогам клиринга, а также форматы указанных документов и сроки их предоставления определяются договором, заключенным между Клиринговым центром и Расчетным депозитарием.

- 23.2. Списание ценных бумаг с Разделов торговых счетов депо осуществляется на основании распоряжений Клирингового центра или на основании распоряжений лица, которому открыт такой торговый счет депо с согласия Клирингового центра.
- 23.2.1. Учет ценных бумаг, принадлежащих Участнику клиринга на праве собственности и переданных Участником клиринга в качестве взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс, осуществляется на соответствующих субсчетах депо. Для открытия субсчета депо Участник клиринга должен предоставить в Расчетный депозитарий комплект документов, предусмотренный Условиями осуществления депозитарной деятельности Расчетного депозитария, а также предоставить заявление на перечисление причитающихся ему доходов и иных выплат по ценным бумагам в качестве взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс.
- 23.2.2. Списание / зачисление ценных бумаг с субсчетов / на субсчета депо осуществляется на основании распоряжений Клирингового центра.
- 23.2.3. Доходы и иные выплаты, причитающиеся Участникам клиринга по ценным бумагам, учитываемые на субсчетах депо, перечисляются в качестве взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс, на соответствующий клиринговый счет Клирингового центра, в порядке, предусмотренном договором Клирингового центра с Расчетным депозитарием.
- Доходы и иные выплаты по ценным бумагам, перечисленные в качестве взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс в соответствии с заявлением Участника клиринга, указанным в подпункте 23.2.1 общей части Правил клиринга, учитываются как средства Участника клиринга, зачисленные на соответствующий клиринговый счет Клирингового центра.
- 23.3. Клиринговый центр соглашается с проведением любых операций зачисления на Разделы торгового счета депо на основании распоряжений лица, которому открыт такой торговый счет депо.
- 23.4. В случае если торговые счета депо Участников клиринга, клиентов Участника клиринга и иных лиц открыты в депозитарии, открывшем в Расчетном депозитарии торговый счет депо номинального держателя, Клиринговый центр соглашается с проведением любых операций по таким торговым счетам депо, включая закрытие таких торговых счетов депо. Указанное согласие Клирингового центра действует до момента его отзыва Клиринговым центром в указанном депозитарии или до момента направления Клиринговым центром указанному депозитарию распоряжения, устанавливающего иные условия проведения операций по таким торговым счетам депо.
- 23.5. Каждый Расчетный день до начала Торгов, Клиринговый центр направляет Расчетному депозитарию запрос выписки по Разделам / субсчетам депо, в ответ на который Расчетный депозитарий передает Клиринговому центру список Разделов / субсчетов депо и выписку по Разделам / субсчетам депо.
- 23.6. После получения от Расчетного депозитария выписки по Разделам / субсчетам депо Клиринговый центр устанавливает в Клиринговой системе начальные и плановые значения позиций депо по Разделам / субсчетам депо Участников клиринга в соответствии с информацией о количестве ценных бумаг, учитываемых на Разделах / субсчетах депо, полученной от Расчетного депозитария в Выписке по Разделам / субсчетам депо.

- 23.7. В случае обращения взыскания на имущество Участника клиринга, находящееся на торговом счете депо и/или на клиринговом счете депо, Клиринговый центр вправе принять решение о том, что Дата исполнения обязательств по сделкам считается наступившей в Расчетный день, когда Клиринговый центр получил от Расчетного депозитария копию документа, являющегося основанием для указанного обращения взыскания, или в Расчетный день, следующий за днем получения Клиринговым центром копии указанного документа, и/или решение о заключении с Участником клиринга закрывающих сделок, направленных на прекращение обязательств Участника клиринга, в Расчетный день, когда Клиринговый центр получил от Расчетного депозитария копию документа, являющегося основанием для указанного обращения взыскания, или в Расчетный день, следующий за днем получения Клиринговым центром копии указанного документа.
- 23.7.1. Информация о решении, принятом Клиринговым центром в соответствии с настоящим пунктом общей части Правил клиринга направляется Участнику клиринга с использованием Подсистемы ЭДО НКЦ.

## РАЗДЕЛ V. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ ОБ ОПЛАТЕ УСЛУГ

### Статья 24. Общие положения об оплате услуг Клирингового центра, Биржи и Технического центра

- 24.1. Клиринговый центр в соответствии с тарифами, применяемыми на соответствующем биржевом рынке, взимает с Участников клиринга следующие виды комиссионных вознаграждений:
- комиссионное вознаграждение за оказание клиринговых услуг в пользу Клирингового центра;
  - комиссионное вознаграждение за организацию торгов / биржевой сбор в пользу Биржи;
  - плату за абонентское обслуживание в пользу Биржи;
  - неустойки в пользу Биржи, установленные Правилами торгов на фондовом рынке;
  - вознаграждение в пользу Технического центра за предоставление интегрированного технологического сервиса (ИТС), включая дополнительное вознаграждение / дополнительный комиссионный сбор за предоставление ИТС, установленный документами Технического центра;
  - сбор за неэффективные транзакции и сбор за ошибочные транзакции в пользу Технического центра.
- 24.2. Размер комиссионного вознаграждения за оказание клиринговых услуг, подлежащего уплате Участником клиринга (далее - комиссионное вознаграждение Клирингового центра), рассчитывается Клиринговым центром в соответствии с Тарифами Клирингового центра.
- 24.3. Комиссионное вознаграждение за организацию торгов / биржевой сбор и плата за абонентское обслуживание в пользу Биржи (далее - комиссионные вознаграждения Биржи) рассчитываются и взимаются Клиринговым центром в соответствии с действующими размерами комиссионного вознаграждения за организацию торгов, утвержденными Биржей, на основании договора, заключенного с Биржей.
- 24.4. Неустойки в пользу Биржи, установленные правилами торгов, взимаются Клиринговым центром в размере, указанном в полученном от Биржи уведомлении.
- 24.5. Вознаграждение в пользу Технического центра за предоставление интегрированного технологического сервиса (ИТС), включая дополнительное вознаграждение / дополнительный комиссионный сбор за предоставление ИТС, установленный документами Технического центра, сбор за неэффективные транзакции и сбор за ошибочные транзакции (далее - вознаграждение Технического центра) рассчитываются и взимаются Клиринговым центром в соответствии с действующими размерами вознаграждения за предоставление ИТС, утвержденными Техническим центром, действующими тарифами Технического центра, на основании договора, заключенного с Техническим центром.

- 24.6. Комиссионное вознаграждение Биржи и неустойки в пользу Биржи взимаются с Участника клиринга, являющегося Участником торгов, или с Участника клиринга, исполняющего указанные обязательства за Участника торгов в соответствии со специальной частью Правил клиринга.
- 24.7. Вознаграждение Технического центра взимается с Участника клиринга, или с Участника клиринга, являющегося Участником торгов, или с Участника клиринга, исполняющего указанные обязательства за Участника торгов в соответствии со специальной частью Правил клиринга.
- 24.8. Обязательства по уплате комиссионных вознаграждений Клирингового центра, Биржи и вознаграждений Технического центра исполняются в российских рублях.
- 24.8.1. В случае если сумма комиссионного вознаграждения Клирингового центра, Биржи или вознаграждения Технического центра выражена в иностранной валюте, указанная сумма пересчитывается в российские рубли по курсу такой иностранной валюты к российскому рублю, установленному Банком России на дату взимания соответствующего вознаграждения.
- 24.9. Размер обязательства Участника клиринга / Участника торгов по уплате комиссионного вознаграждения может рассчитываться с учетом выбранного Участником клиринга / Участником торгов тарифного плана, если это предусмотрено соответствующими тарифами.
- 24.9.1. Порядок выбора или изменения тарифных планов установлен в соответствующей специальной части Правил клиринга.
- 24.10. Тарифами Клирингового центра и/или Биржи может быть предусмотрено предоставление Участнику клиринга / Участнику торгов премии при выполнении условий, необходимых для получения премии.  
Порядок перечисления премии установлен в соответствующей специальной части Правил клиринга.

## РАЗДЕЛ VI. ПРОЧИЕ УСЛОВИЯ

### Статья 25. Перевод обязательств и Обеспечения одного Участника клиринга другому Участнику клиринга

25.1. Клиринговый центр осуществляет перевод долга и уступку требований одного Участника клиринга (далее – Базовый Участник клиринга) по обязательствам по сделкам, заключенным с центральным контрагентом за счет Обособленного клиента, а также передачу Обеспечения, учитываемого по Расчетному коду Базового Участника клиринга, за которым закреплен такой Обособленный клиент, другому Участнику клиринга (далее – Участник клиринга – реципиент) при наличии Заявления на перевод обязательств и Обеспечения (далее также – Заявление), предоставляемого Обособленным клиентом (далее – Перевод обязательств и Обеспечения).

В Заявлении должны быть указаны:

- наименование Участника клиринга – реципиента;
- перечень биржевых рынков, на которых зарегистрирован Обособленный клиент и на которых необходимо провести Перевод обязательств и Обеспечения;
- не менее чем одно из следующих оснований в отношении Базового Участника клиринга для осуществления Перевода обязательств и Обеспечения:

25.1.1. основания, предусмотренные подпунктами 14.1.3-14.1.12, пунктом 14.6 общей части Правил клиринга;

25.1.2. наличие дела о банкротстве в отношении Базового Участника клиринга в производстве арбитражного суда более 2 (двух) месяцев с момента подачи соответствующего заявления;

25.1.3. нарушение Базовым Участником клиринга правил российских или иностранных организатора торгов или клиринговой организации;

25.1.4. включение в повестку дня органов управления Базового Участника клиринга вопроса о ликвидации Базового Участника клиринга либо принятие решения органами управления Базового Участника клиринга о ликвидации Базового Участника клиринга;

25.1.5. принятие органами управления Базового Участника клиринга решения о реорганизации Базового Участника клиринга (за исключением случаев реорганизации, которые не влекут прекращения деятельности Базового Участника клиринга);

25.1.6. принятие судебного акта о взыскании, наложении ареста либо ином обременении в отношении имущества Базового Участника клиринга;

25.1.7. наличие Задолженности Базового Участника клиринга, не погашенной в установленные временными регламентами сроки;

25.1.8. предоставление Базовым Участником клиринга Клиринговому центру поручения на перевод обязательств и Обеспечения.

- 25.2. Клиринговый центр вправе отказать в исполнении Заявления на Перевод обязательств и Обеспечения, если основания для осуществления Перевода обязательств и Обеспечения, указанные в Заявлении, наступили ранее, чем за 30 (тридцать) дней до дня подачи Заявления.
- 25.3. Днем начала процедуры Перевода обязательств и Обеспечения считается день отзыва (аннулирования) Банком России лицензии на осуществление банковских операций у Участника клиринга – кредитной организации или день назначения временной администрации или день принятия арбитражным судом решения о введении в отношении Участника клиринга одной из процедур банкротства, в случае проведения процедуры Перевода обязательств и Обеспечения по указанным основаниям (далее – основания, установленные законодательством), или день получения Клиринговым центром от Обособленного клиента Заявления на перевод обязательств и Обеспечения, в случае проведения процедуры Перевода обязательств и Обеспечения по иным основаниям, предусмотренным пунктом 25.1 общей части Правил клиринга.
- 25.4. Процедура Перевода обязательств и Обеспечения не может занимать более 2 (двух) дней со дня ее начала, в случае проведения процедуры Перевода обязательств и Обеспечения по основаниям отзыва (аннулирования) Банком России лицензии на осуществление банковских операций у Участника клиринга – кредитной организации, назначения временной администрации или принятия арбитражным судом решения о введении в отношении Участника клиринга одной из процедур банкротства, или более 2 (двух) Расчетных дней со дня ее начала, в случае проведения процедуры Перевода обязательств и Обеспечения по иным основаниям, предусмотренным пунктом 25.1 общей части Правил клиринга.
- 25.5. Подача Базовым Участником клиринга Заявления на регистрацию Обособленного клиента является безусловным согласием Базового участника клиринга на раскрытие (передачу) Клиринговым центром Участнику клиринга – реципиенту информации о Базовом участнике, предусмотренной пунктом 25.10 общей части Правил клиринга. Такое согласие не может быть отозвано Базовым Участником клиринга.
- 25.6. Перевод обязательств и Обеспечения не осуществляется при отсутствии согласия Участника клиринга – реципиента, предусмотренного пунктом 25.11 общей части Правил клиринга.
- 25.7. Заявление на перевод обязательств и Обеспечения предоставляется Обособленным клиентом вместе с копией документа, подтверждающего полномочия лица, подписавшего Заявление (в случае если такой документ не был предоставлен Клиринговому центру ранее). Подача Заявления на перевод обязательств и Обеспечения является безусловным согласием Обособленного клиента на раскрытие (передачу) Клиринговым центром Участнику клиринга – реципиенту информации, предусмотренной пунктом 25.10 общей части Правил клиринга.
- 25.7.1. Обособленный клиент вправе предоставить Клиринговому центру Заявление на перевод обязательств и Обеспечения с указанием оснований, установленных законодательством, заранее, до наступления указанных оснований.
- 25.7.2. В случае если между Обособленным клиентом и Клиринговым центром предусмотрен обмен сообщениями с использованием Подсистемы ЭДО НКЦ,

Обособленный клиент вправе направить Заявление на перевод обязательств и Обеспечения в форме сообщения с использованием Подсистемы ЭДО НКЦ.

- 25.7.3. Клиринговый центр не осуществляет проверку достоверности оснований для Перевода обязательств и Обеспечения, указанных Обособленным клиентом в Заявлении. При этом Клиринговый центр вправе отказать Обособленному клиенту в исполнении Заявления на перевод обязательств и Обеспечения при наличии информации об отсутствии указанных в Заявлении оснований.
- 25.7.4. Клиринговый центр не несет ответственности за убытки, понесенные Базовым участником клиринга / Обособленным клиентом / Участником клиринга – реципиентом в случае исполнения / неисполнения Клиринговым центром Заявления, поданного Обособленным клиентом в соответствии с пунктом 25.1 общей части Правил клиринга.
- 25.8. В случае если между Обособленным клиентом и Клиринговым центром предусмотрен обмен сообщениями с использованием Подсистемы ЭДО НКЦ, и Клиринговому центру стало известно о наступлении в отношении Базового Участника клиринга одного или нескольких оснований для Перевода обязательств и Обеспечения, предусмотренных пунктом 25.1 общей части Правил клиринга, а Заявление на перевод обязательств и Обеспечения от Обособленного клиента не получено, Клиринговый центр вправе сообщить Обособленному клиенту о наличии таких оснований путем направления сообщения с использованием Подсистемы ЭДО НКЦ.
- 25.9. Клиринговый центр незамедлительно после получения Заявления на перевод обязательств и Обеспечения, но не ранее наступления оснований, установленных законодательством (для Заявлений с указанием таких оснований), уведомляет Биржу:
- о необходимости установления запрета на подачу Участниками торгов заявок на заключение сделок, стороной по которым будет являться Базовый Участник клиринга, за счет Обособленного клиента, предоставившего Заявление на перевод обязательств и Обеспечения;
  - о необходимости снятия таких зарегистрированных заявок.

В случае проведения процедуры Перевода обязательств и Обеспечения по основанию, предусмотренному подпунктом 25.1.8 общей части Правил клиринга, Клиринговый центр вправе осуществить действия, указанные в настоящем пункте общей части Правил клиринга в иное время, до момента направления Участнику клиринга – реципиенту информации в соответствии с пунктом 25.10 общей части Правил клиринга.

- 25.10. При отсутствии у Клирингового центра оснований для отказа в исполнении Заявления на перевод обязательств и Обеспечения, полученного от Обособленного клиента, Клиринговый центр передает Участнику клиринга – реципиенту сообщение о размере обязательств / требований Базового Участника клиринга в денежных средствах / ценных бумагах / драгоценных металлах по обязательствам по сделкам, заключенным с центральным контрагентом, а также о размере Обеспечения Базового Участника клиринга в денежных средствах / ценных бумагах / драгоценных металлах, учитываемых по Расчетному коду Базового Участника клиринга, за которым закреплен Обособленный клиент, предоставивший Заявление на перевод обязательств и Обеспечения.



25.11. Участник клиринга – реципиент предоставляет Клиринговому центру согласие на прием обязательств / требований и Обеспечения Базового Участника клиринга в денежных средствах / ценных бумагах / драгоценных металлах, информация о которых передана Участнику клиринга - реципиенту в соответствии с пунктом 25.10 общей части Правил клиринга (далее – Согласие на прием), не позднее времени, указанного во Временном регламенте.

25.11.1. Согласие на прием должно содержать информацию, предусмотренную соответствующей специальной частью Правил клиринга.

Согласие на прием может содержать указание на необходимость обособления клиента, предоставившего Заявление.

Указание в Согласии на прием на необходимость обособления клиента, предоставившего Заявление, является Заявлением Участника клиринга – реципиента на регистрацию Обособленного клиента.

Указание в Согласии на прием на необходимость обособления клиента, предоставившего Заявление, не допускается одновременно с указанием в Заявлении Расчетного кода Участника клиринга – реципиента, за которым не закреплен Обособленный клиент.

25.12. Для исполнения Заявления на перевод обязательств и Обеспечения Участник клиринга – реципиент обязан заблаговременно предпринять действия, необходимые для открытия Разделов для обособленного учета Обеспечения в ценных бумагах Обособленного клиента и/или Счетов обеспечения в драгоценных металлах для обособленного учета Обеспечения в драгоценных металлах Обособленного клиента.

25.13. После получения от Участника клиринга - реципиента Согласия на прием в соответствии с пунктом 25.11 общей части Правил клиринга и до конца соответствующего дня, следующего за днем начала процедуры Перевода обязательств и Обеспечения, Клиринговый центр исполняет Заявление на перевод обязательств, для чего:

- открывает клиентский Расчетный код Участнику клиринга – реципиенту для Обособленного клиента, предоставившего Заявление на перевод обязательств, если в Согласии на прием Расчетный код не был указан;
- осуществляет действия, предусмотренные соответствующей специальной частью Правил клиринга;
- прекращает учитывать обязательства / требования и Обеспечение Базового Участника клиринга в денежных средствах / ценных бумагах / драгоценных металлах, определенные в пункте 25.10 общей части Правил клиринга, как обязательства и требования Базового Участника клиринга в отношении Клирингового центра;
- начинает учитывать обязательства / требования и Обеспечение Базового Участника клиринга в денежных средствах / ценных бумагах / драгоценных металлах, определенные в пункте 25.10 общей части Правил клиринга, как обязательства и требования Участника клиринга – реципиента в отношении Клирингового центра;
- аннулирует регистрацию Расчетных кодов, открытых Базовым Участником клиринга для Обособленного клиента.

- 25.14. Обособленный клиент вправе до получения Клиринговым центром от Участника клиринга – реципиента Согласия на прием отозвать свое Заявление о переводе обязательств и Обеспечения путем направления Клиринговому центру соответствующего заявления (далее – Заявление об отзыве). Заявление об отзыве предоставляется Обособленным клиентом вместе с копией документа, подтверждающего полномочия лица, подписавшего Заявление (в случае если такой документ не был предоставлен Клиринговому центру ранее).
- 25.14.1. В случае если между Обособленным клиентом и Клиринговым центром предусмотрен обмен сообщениями с использованием Подсистемы ЭДО НКЦ или по системе S.W.I.F.T., Обособленный клиент вправе направить Заявление об отзыве в форме сообщения с использованием Подсистемы ЭДО НКЦ или по системе S.W.I.F.T.
- 25.15. Обособленный клиент вправе до получения Клиринговым центром от Участника клиринга – реципиента Согласия на прием заменить первоначально указанного Участника клиринга – реципиента на другого Участника клиринга – реципиента путем направления Клиринговому центру Заявления на перевод обязательств и Обеспечения с указанием наименования нового Участника клиринга – реципиента. Такое Заявление на перевод обязательств и Обеспечения должно содержать сведения, предусмотренные пунктом 25.1 общей части Правил клиринга и предоставляться в порядке, предусмотренном настоящей статьей общей части Правил клиринга.
- 25.16. В случае неполучения Клиринговым центром Согласия на прием от Участника клиринга – реципиента, указанного Обособленным клиентом, в срок, установленный Временным регламентом, Обособленный клиент вправе предоставить Клиринговому центру заявление о возобновлении возможности заключения сделок, стороной по которым будет являться Базовый Участник клиринга, за исключением случаев проведения процедуры Перевода обязательств и Обеспечения по основаниям, установленным законодательством. Получив такое заявление от Обособленного клиента, Клиринговый центр незамедлительно уведомляет Биржу о необходимости возобновления подачи Участниками торгов заявок на заключение сделок, стороной по которым будет являться Базовый Участник клиринга, за счет Обособленного клиента, предоставившего указанное заявление.
- 25.17. За осуществление процедур Перевода обязательств и Обеспечения с Участника клиринга – реципиента взимается плата в размере, установленном Тарифами Клирингового центра.
- 25.18. В целях осуществления Перевода обязательств и Обеспечения Клиринговый центр раскрывает (передает) предусмотренную настоящей статьей общей части Правил клиринга информацию, в том числе инсайдерскую информацию Клирингового центра.

**Статья 26. Порядок действий в случае включения Участника клиринга в перечень организаций, в отношении которых имеются сведения об их причастности к экстремистской деятельности или терроризму**

26.1. В дату включения Участника клиринга в перечень организаций, определенный в подпункте 14.6.9 общей части Правил клиринга (далее – перечень), Клиринговый центр незамедлительно:

- блокирует (замораживает) операции с денежными средствами / ценными бумагами / драгоценными металлами, учитываемыми в качестве Обеспечения, Обеспечения под стресс и взноса в Гарантийный фонд Участника клиринга, за исключением денежных средств и ценных бумаг, учитываемых на разделах клиринговых регистров, открытых в рамках Обособленных Брокерских фирм, за которыми закреплены Доверенные владельцы счетов, не являющиеся Участником клиринга, включенным в перечень, и иные операции такого Участника клиринга, предусмотренные Правилами клиринга;
- прекращает допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию на всех биржевых рынках;
- уведомляет Биржу о необходимости установления запрета на подачу Участниками торгов заявок на заключение сделок, стороной по которым будет являться Участник клиринга, и о необходимости снятия таких зарегистрированных заявок.

26.2. В дату включения Участника клиринга в перечень обязательства такого Участника клиринга по сделкам, заключенным с Клиринговым центром, за исключением обязательств Участника клиринга, учитываемых на разделах клиринговых регистров, открытых в рамках Обособленных Брокерских фирм, за которыми закреплены Доверенные владельцы счетов, не являющиеся Участником клиринга, включенным в перечень, прекращаются полностью возникновением нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга, рассчитываемого в российских рублях как сумма с учетом знака:

- по каждой ценной бумаге суммы (с учетом знака) Нетто-обязательств / Нетто-требований по ценной бумаге по всем Разделам Участника клиринга, учитываемых на дату включения Участника клиринга в перечень, пересчитанной в российские рубли по Расчетной цене соответствующей ценной бумаги, установленной Клиринговым центром на дату включения Участника клиринга в перечень;
- по каждой иностранной валюте / драгоценному металлу суммы (с учетом знака) Нетто-обязательств / Нетто-требований в соответствующей валюте / соответствующем драгоценном металле Участника клиринга по всем Расчетным кодам и всем Датам исполнения, учитываемых на дату включения Участника клиринга в перечень, пересчитанной в российские рубли по Центральному курсу соответствующей иностранной валюты / драгоценного металла, установленному Клиринговым центром на дату включения Участника клиринга в перечень;
- суммы (с учетом знака) Нетто-обязательств / Нетто-требований в российских рублях Участника клиринга по всем Расчетным кодам и всем Датам исполнения, учитываемых на дату включения Участника клиринга в перечень;

- по каждому Срочному контракту суммы (с учетом знака) позиций по Срочным контрактам по всем разделам регистра учета позиций Участника клиринга, учитываемых на дату включения Участника клиринга в перечень, пересчитанной в российские рубли по Расчетной цене соответствующего Срочного контракта, установленной Клиринговым центром на дату включения Участника клиринга в перечень.

Если величина, рассчитанная в соответствии с настоящим пунктом общей части Правил клиринга, положительная, это означает наличие нетто-требования Участника клиринга по отношению к Клиринговому центру, если отрицательная – нетто-обязательства Участника клиринга по отношению к Клиринговому центру.

- 26.3. Клиринговый центр вправе предъявить к Участнику клиринга требование о взыскании нетто-обязательства Участника клиринга, рассчитанного в порядке, предусмотренном пунктом 26.2 общей части Правил клиринга.

Клиринговый центр вправе использовать средства Гарантийного фонда, за исключением средств Участника клиринга, включенного в перечень, для исполнения указанного нетто-обязательства в порядке, предусмотренном статьей 21 общей части Правил клиринга.

- 26.4. После исключения Участника клиринга из перечня:

- 26.4.1. в случае если для исполнения нетто-обязательства Участника клиринга, рассчитанного в порядке, предусмотренном пунктом 26.2 общей части Правил клиринга, не были использованы средства Гарантийного фонда, и по Участнику клиринга учитываются Обеспечение, Обеспечение под стресс и/или взнос в Гарантийный фонд, Клиринговый центр осуществляет действия, необходимые для исполнения указанного нетто-обязательства за счет указанных средств, полностью или частично, а в случае, если указанных средств недостаточно, - направляет Участнику клиринга уведомление с требованием о погашении указанного нетто-обязательства в неисполненной части;

- 26.4.2. в случае если для исполнения нетто-обязательства Участника клиринга, рассчитанного в порядке, предусмотренном пунктом 26.2 общей части Правил клиринга, были использованы средства Гарантийного фонда, и по Участнику клиринга учитываются Обеспечение, Обеспечение под стресс и/или взнос в Гарантийный фонд, Клиринговый центр осуществляет действия, необходимые для возмещения средств Гарантийного фонда за счет указанных средств, полностью или частично, а в случае, если указанных средств недостаточно, - направляет Участнику клиринга уведомление с требованием о возмещении средств Гарантийного фонда.

## **Статья 27. Порядок урегулирования обязательств в случае прекращения допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию (ликвидационный неттинг в отношении Участника клиринга)**

- 27.1. В случае отзыва (аннулирования) Банком России у Участника клиринга – Кредитной организации лицензии на осуществление банковских операций, допуск к клиринговому обслуживанию и клиринговое обслуживание Участника клиринга - Кредитной организации прекращается с даты, следующей за датой отзыва (аннулирования) Банком России у такого Участника клиринга лицензии на

осуществление банковских операций, за исключением расчета Клиринговым центром нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга в соответствии с пунктами 27.9-27.10 общей части Правил клиринга и исполнения обязательств по возврату Участнику клиринга денежных средств / драгоценных металлов в соответствии с пунктом 27.13 общей части Правил клиринга.

Обязательства по сделкам, стороной по которым является Участник клиринга, заключенным до даты отзыва такой лицензии, прекращаются полностью на дату, следующую за датой отзыва (аннулирования) Банком России у такого Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций, в порядке, установленном пунктом 27.7 общей части Правил клиринга.

- 27.1.1. Сделки, стороной по которым является Участник клиринга, заключенные в дату отзыва (аннулирования) у Участника клиринга – Кредитной организации лицензии на осуществление банковских операций и (или) после нее, являются недействительными.

Клиринговый центр или Участник клиринга – контрагент по указанным сделкам вправе предъявить к Участнику клиринга – Кредитной организации требование о взыскании убытков, связанных с недействительностью указанных сделок, в общем порядке, предусмотренном законодательством о несостоятельности (банкротстве).

- 27.1.2. 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 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 Банком России по электронному адресу Клирингового центра электронное сообщение, содержащее информацию об отзыве (аннулировании) у Участника клиринга - Кредитной организации лицензии на осуществление банковских операций.

- 27.2. В случае назначения временной администрации или принятия арбитражным судом решения о введении в отношении Участника клиринга – Некредитной организации одной из процедур банкротства, допуск к клиринговому обслуживанию и клиринговое обслуживание Участника клиринга – Некредитной организации прекращается с даты, следующей за датой назначения временной администрации, или даты, следующей за датой принятия арбитражным судом решения о введении в отношении Участника клиринга одной из процедур банкротства, или даты, следующей за датой принятия арбитражным судом решения о признании участника клиринга банкротом и об открытии конкурсного производства, в зависимости от того, какая дата наступила ранее, за исключением расчета Клиринговым центром нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга в соответствии с пунктами 27.9-27.10 общей части Правил клиринга и исполнения обязательств по возврату Участнику клиринга денежных средств / драгоценных металлов в соответствии с пунктом 27.13 общей части Правил клиринга.

Обязательства по сделкам, стороной по которым является Участник клиринга, прекращаются полностью на дату, следующую за датой назначения временной администрации, или дату, следующую за датой принятия арбитражным судом решения о введении в отношении Участника клиринга одной из процедур банкротства, или дату, следующую за датой принятия арбитражным судом решения

о признании участника клиринга банкротом и об открытии конкурсного производства, в зависимости от того, какая дата наступила ранее, в порядке, установленном пунктом 27.7 общей части Правил клиринга.

- 27.3. В случае назначения временной администрации или принятия уполномоченным органом решения о введении в отношении Участника клиринга – Нерезидента - некредитной организации одной из процедур банкротства, допуск к клиринговому обслуживанию и клиринговое обслуживание Участника клиринга – Нерезидента - некредитной организации прекращается с даты, следующей за датой, в которую Клиринговый центр узнал о назначении временной администрации или принятии арбитражным судом решения о введении в отношении Участника клиринга – Нерезидента - некредитной организации одной из процедур банкротства, за исключением расчета Клиринговым центром нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга в соответствии с пунктами 27.9-27.10 общей части Правил клиринга и исполнения обязательств по возврату Участнику клиринга денежных средств / драгоценных металлов в соответствии с пунктом 27.13 общей части Правил клиринга.

Обязательства по сделкам, стороной по которым является Участник клиринга, прекращаются полностью на дату, следующую за датой, в которую Клиринговый центр узнал о назначении временной администрации или принятии уполномоченным органом решения о введении в отношении Участника клиринга – Нерезидента - некредитной организации одной из процедур банкротства, в порядке, установленном пунктом 27.7 общей части Правил клиринга.

- 27.3.1. Подтверждением факта назначения временной администрации или принятия уполномоченным органом решения о введении в отношении Участника клиринга – Нерезидента - некредитной организации одной из процедур банкротства является письменное уведомление компетентного органа государства учреждения Участника клиринга – Нерезидента - некредитной организации, направленное Клиринговому центру (в том числе, посредством факсимильной связи), и/или размещенная на сайте компетентного органа государства учреждения Участника клиринга – Нерезидента - некредитной организации или на сайте Участника клиринга – Нерезидента - некредитной организации в сети Интернет информация о назначении временной администрации или принятии уполномоченным органом решения о введении в отношении Участника клиринга – Нерезидента - некредитной организации одной из процедур банкротства.

- 27.4. В случае отзыва (аннулирования) специального разрешения (лицензии или иного основания), выданного компетентным органом государства учреждения Участника клиринга – Банка-нерезидента, на основании которого Участник клиринга – Банк-нерезидент имеет право осуществлять банковские операции, предусмотренные личным законом Участника клиринга – Банка-нерезидента, допуск к клиринговому обслуживанию и клиринговое обслуживание Участника клиринга – Банка-нерезидента, в том числе Участника клиринга - Банка ЕврАзЭс/ЕАЭС, прекращается с даты, следующей за датой, в которую Клиринговый центр узнал об отзыве (аннулировании) такого специального разрешения (лицензии или иного основания), за исключением расчета Клиринговым центром нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга – Банка-нерезидента в соответствии с пунктами 27.9-27.10 общей части Правил клиринга и исполнения обязательств по

возврату Участнику клиринга денежных средств / драгоценных металлов в соответствии с пунктом 27.13 общей части Правил клиринга.

Обязательства по сделкам, стороной по которым является Участник клиринга, прекращаются полностью на дату, следующую за датой, в которую Клиринговый центр узнал об отзыве (аннулировании) такого специального разрешения (лицензии или иного основания), в порядке, установленном пунктом 27.7 общей части Правил клиринга.

27.4.1. Подтверждением факта отзыва (аннулирования) указанного специального разрешения (лицензии или иного основания), выданного компетентным органом государства учреждения Участника клиринга – Банка-нерезидента, является письменное уведомление компетентного органа государства учреждения Участника клиринга – Банка-нерезидента, направленное Клиринговому центру (в том числе, посредством факсимильной связи) и/или размещенная компетентным органом государства учреждения Участника клиринга – Банка-нерезидента на сайте вышеуказанного компетентного органа в сети Интернет информации о принятом решении об отзыве (аннулировании) выданного Участнику клиринга – Банку-нерезиденту специального разрешения (лицензии или иного основания), в соответствии с которым Участник клиринга – Банк-нерезидент имеет право осуществлять банковские операции, предусмотренные национальным законодательством государства учреждения Участника клиринга – Банка-нерезидента, и/или направленное компетентным органом по электронному адресу Клирингового центра соответствующее электронное сообщение.

27.5. В случае прекращения Соглашения о сотрудничестве/Договора ЕАЭС для Российской Федерации либо для государства - стороны Соглашения о сотрудничестве/Договора ЕАЭС, являющегося государством учреждения Участника-клиринга – Банка ЕврАзЭс/ЕАЭС, допуск к клиринговому обслуживанию и клиринговое обслуживание такого Участника клиринга – Банка ЕврАзЭс/ЕАЭС прекращается с даты, следующей за датой прекращения Соглашения о сотрудничестве/Договора ЕАЭС для Российской Федерации либо для государства - стороны Соглашения о сотрудничестве/Договора ЕАЭС, являющегося государством учреждения такого Участника-клиринга – Банка ЕврАзЭс/ЕАЭС, за исключением расчета Клиринговым центром нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга – Банка ЕврАзЭс/ЕАЭС в соответствии с пунктами 27.9-27.10 общей части Правил клиринга и исполнения обязательств по возврату Участнику клиринга денежных средств / драгоценных металлов в соответствии с пунктом 27.13 общей части Правил клиринга.

Обязательства по сделкам, стороной по которым является Участник клиринга, прекращаются полностью на дату, следующую за датой прекращения Соглашения о сотрудничестве/Договора ЕАЭС для Российской Федерации либо для государства - стороны Соглашения о сотрудничестве/Договора ЕАЭС, являющегося государством учреждения такого Участника-клиринга – Банка ЕврАзЭс/ЕАЭС, в порядке, установленном пунктом 27.7 общей части Правил клиринга.

27.6. В случае прекращения международного договора, в соответствии с которым учрежден Участник-клиринга – Международная организация, для Российской Федерации либо в случае принятия уполномоченными лицами сторон указанного международного договора решения о прекращении деятельности Участника-клиринга – Международной организации, допуск к клиринговому обслуживанию и

клиринговое обслуживание Участника-клиринга – Международной организации прекращается с даты, следующей за датой прекращения международного договора, в соответствии с которым такой Участник-клиринга – Международная организация учрежден, для Российской Федерации, либо с даты, следующей за датой принятия уполномоченными лицами сторон указанного международного договора решения о прекращении деятельности Участника-клиринга – Международной организации, за исключением расчета Клиринговым центром нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга – Международной организации в соответствии с пунктами 27.9-27.10 общей части Правил клиринга и исполнения обязательства по возврату Участнику клиринга денежных средств / драгоценных металлов в соответствии с пунктом 27.13 общей части Правил клиринга.

Обязательства по сделкам, стороной по которым является Участник клиринга, прекращаются полностью на дату, следующую за датой прекращения международного договора, в соответствии с которым такой Участник-клиринга – Международная организация учрежден, для Российской Федерации, либо на дату, следующую за датой принятия уполномоченными лицами сторон указанного международного договора решения о прекращении деятельности Участника-клиринга – Международной организации, в порядке, установленном пунктом 27.7 общей части Правил клиринга.

- 27.7. В случаях прекращения клирингового обслуживания Участника клиринга по основаниям, указанным в пунктах 27.1-27.6 общей части Правил клиринга, обязательства по сделкам с центральным контрагентом, стороной по которым является Участник клиринга, прекращаются возникновением нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга, рассчитанных в соответствии с пунктом 27.9 общей части Правил клиринга, обязательства по сделкам без центрального контрагента - прекращаются возникновением нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга в отношении других Участников клиринга – его контрагентов по указанным сделкам, рассчитанных в соответствии с пунктом 27.10 общей части Правил клиринга.

С даты вступления в силу правил клиринга НКО ЗАО НРД, регламентирующих порядок расчета нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга – кредитной организации по сделкам, заключенным с Банком России, клиринг по которым осуществляет Клиринговый центр, Клиринговый центр в соответствии с пунктом 27.10 общей части Правил клиринга рассчитывает предварительное нетто-обязательство / нетто-требование Участника клиринга – кредитной организации в отношении контрагента - Банка России, и не позднее 3 (трех) рабочих дней с даты отзыва (аннулирования) лицензии на осуществление банковских операций у Участника клиринга – кредитной организации передает информацию о рассчитанном предварительном нетто-обязательстве / нетто-требовании НКО ЗАО НРД для определения нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга – кредитной организации и Банка России. Указанный порядок применяется для обязательств, возникших из договоров, заключенных на условиях одного генерального соглашения.

- 27.8. Клиринговый центр заключает балансирующие сделки с ценными бумагами / иностранной валютой / драгоценными металлами / Срочные контракты в порядке, определенном статьей 16 общей части Правил клиринга.



27.9. Клиринговый центр рассчитывает сумму нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга в российских рублях по сделкам с центральным контрагентом в порядке, предусмотренном подпунктами 27.9.1-27.9.3 общей части Правил клиринга, отдельно:

- 1) по сделкам, заключенным за счет Участника клиринга, - по всем собственным Расчетным кодам;
- 2) по сделкам, заключенным за счет клиентов Участника клиринга, за исключением Обособленных клиентов и сделок, заключенных за счет средств Доверенных владельцев счетов, - по всем клиентским Расчетным кодам, за исключением Расчетных кодов, открытых для Обособленных клиентов, и Расчетных кодов, с которыми связаны Обособленные Брокерские фирмы;
- 3) по сделкам, заключенным за счет каждого Обособленного клиента Участника клиринга, - по Расчетному коду, открытому для Обособленного клиента;
- 4) по сделкам, заключенным за счет средств каждого Доверенного владельца счетов, - по Расчетному коду, с которым связана Обособленная Брокерская фирма;
- 5) по сделкам, заключенным за счет средств, находящихся в доверительном управлении Участника клиринга, - по каждому Расчетному коду ДУ.

27.9.1. Клиринговый центр рассчитывает величину, равную сумме с учетом знака:

- а) величины SUM, рассчитанной по формуле:

$$SUM = POS\_RUB + \sum_i (POS\_C_i \times CC_i) + \sum_j (POS\_VAL_j \times C\_VAL_j) + \sum_k (POS\_D_k \times (CD_k - SP_k)), \text{ где}$$

POS\_RUB - сумма значений (с учетом знака) Нетто-обязательств / Нетто-требований Участника клиринга в российских рублях по сделкам с центральным контрагентом по соответствующим Расчетным кодам и Датам исполнения, учитываемых на конец дня прекращения обязательств по сделкам;

POS\_C<sub>i</sub> – сумма значений (с учетом знака) Нетто-обязательств / Нетто-требований Участника клиринга по i-ой ценной бумаге по сделкам с центральным контрагентом по соответствующим Расчетным кодам и Датам исполнения, учитываемых на конец дня прекращения обязательств по сделкам;

CC<sub>i</sub> – цена сделки / средневзвешенная цена сделок с ценными бумагами, заключенной / заключенных Клиринговым центром в соответствии с пунктом 27.8 общей части Правил клиринга с i-ой ценной бумагой (в российских рублях);

$\sum_i$  – сумма по ценным бумагам;

POS\_VAL<sub>j</sub> – сумма значений (с учетом знака) Нетто-обязательств / Нетто-требований Участника клиринга по денежным средствам / драгоценным металлам в j-ой иностранной валюте / j-ом драгоценном металле по соответствующим Расчетным кодам и Датам исполнения, учитываемых на конец дня прекращения обязательств по сделкам;

C\_VAL<sub>j</sub> – курс сделки / средневзвешенный курс сделок с иностранной валютой / драгоценным металлом, заключенной / заключенных Клиринговым центром в соответствии с пунктом 27.8 общей части Правил клиринга с j-ой иностранной валютой / j-ым драгоценным металлом;

$\sum_j$  – сумма по иностранным валютам / драгоценным металлам;

$POS\_D_k$  – нетто-позиция (с учетом знака) Участника клиринга по k-му Срочному контракту, рассчитанная как сумма (с учетом знака) позиций по k-му Срочному контракту, учитываемых на всех разделах регистра учета позиций Участника клиринга, относящихся к соответствующим Расчетным кодам, на конец дня прекращения обязательств по сделкам;

$CD_k$  – цена сделки / средневзвешенная цена сделок, заключенной / заключенных Клиринговым центром в соответствии с пунктом 27.8 общей части Правил клиринга по k-му Срочному контракту;

$SP_k$  - Расчетная цена k-го Срочного контракта, определенная Клиринговым центром в ходе вечерней клиринговой сессии дня прекращения обязательств по сделкам;

$\sum_k$  – сумма по Срочным контрактам,

и

- б) Задолженности (со знаком «минус») Участника клиринга в российских рублях, учитываемой по соответствующим Расчетным кодам на конец дня прекращения обязательств по сделкам, не включающей неисполненные обязательства Участника клиринга по уплате комиссионных вознаграждений, неустоек (штрафов, пеней), подлежащих уплате Участником клиринга в соответствии с Правилами клиринга, и
- в) обязательств Участника клиринга по передаче Дохода, учитываемых по соответствующим Расчетным кодам и не исполненных по состоянию на конец дня прекращения обязательств по сделкам, при отзыве (аннулировании) у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций – обязательства по передаче Дохода, возникшие до дня отзыва (аннулирования) у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций (учитываются со знаком «минус»), и
- г) обязательств Клирингового центра по передаче Дохода Участнику клиринга, учитываемых по соответствующим Расчетным кодам и не исполненных по состоянию на конец дня прекращения обязательств по сделкам, при отзыве (аннулировании) у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций – обязательства по передаче Дохода, возникшие до дня отзыва (аннулирования) у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций (учитываются со знаком «плюс»), и
- д) значений (с учетом знака) обязательств / требований Участника клиринга в российских рублях по возврату Гарантийных переводов, учитываемых по соответствующим Расчетным кодам на конец дня прекращения обязательств по сделкам, и
- е) значений (с учетом знака) обязательств / требований Участника клиринга в российских рублях по уплате / получению вариационной маржи, учитываемых по соответствующим Расчетным кодам на конец дня прекращения обязательств по сделкам, и
- ж) обязательств Участника клиринга по уплате комиссионных вознаграждений, а также неустоек (штрафов, пеней), подлежащих уплате Участником клиринга в соответствии с Правилами клиринга, учитываемых по соответствующим Расчетным кодам (учитываются со знаком «минус»), за исключением случаев

отзыва (аннулирования) у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций и принятия арбитражным судом решения о признании Участника клиринга банкротом и об открытии конкурсного производства.

Если величина, рассчитанная в соответствии с настоящим подпунктом общей части Правил клиринга, отрицательная, расчет соответствующего нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга продолжается в соответствии с подпунктом 27.9.2 общей части Правил клиринга, если неотрицательная - в соответствии с подпунктом 27.9.3 общей части Правил клиринга.

27.9.2. Клиринговый центр рассчитывает сумму с учетом знака отрицательной величины, рассчитанной в соответствии с подпунктом 27.9.1 общей части Правил клиринга, и следующих величин, учитываемых по соответствующим Расчетным кодам на конец дня прекращения обязательств по сделкам, в следующей очередности и размере:

- 1) величины обязательств Клирингового центра по возврату Участнику клиринга его Обеспечения в российских рублях (учитываются со знаком «плюс»);
- 2) величины, равной минимальной из двух величин: (1) величине обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга его Обеспечения под стресс в российских рублях (учитывается со знаком «плюс», только для собственных Расчетных кодов), или (2) величине текущего размера абсолютного значения отрицательной величины, рассчитанной в соответствии с настоящим подпунктом общей части Правил клиринга;
- 3) величины, равной минимальной из двух величин: (1) величине обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга его взноса в Гарантийный фонд в российских рублях (учитывается со знаком «плюс», только для собственных Расчетных кодов), или (2) величине текущего размера абсолютного значения отрицательной величины, рассчитанной в соответствии с настоящим подпунктом общей части Правил клиринга;
- 4) величины, равной минимальной из двух величин: (1) величине обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга его Обеспечения в иностранной валюте, пересчитанной в российские рубли по курсу, установленному Банком России на дату прекращения обязательств по сделкам (учитывается со знаком «плюс»), или (2) величине текущего размера абсолютного значения отрицательной величины, рассчитанной в соответствии с настоящим подпунктом общей части Правил клиринга;
- 5) величины, равной минимальной из двух величин: (1) величине обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга его Обеспечения под стресс в иностранной валюте, пересчитанной в российские рубли по курсу соответствующей иностранной валюты, установленному Банком России на дату прекращения обязательств по сделкам (учитывается со знаком «плюс», только для собственных Расчетных кодов), или (2) величине текущего размера абсолютного значения отрицательной величины, рассчитанной в соответствии с настоящим подпунктом общей части Правил клиринга;
- 6) величины, равной минимальной из двух величин: (1) величине обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга его взноса в Гарантийный фонд в иностранной валюте, пересчитанной в российские рубли по курсу, установленному Банком России на дату прекращения обязательств по сделкам (учитывается со знаком «плюс», только для собственных

- Расчетных кодов), или (2) величине текущего размера абсолютного значения отрицательной величины, рассчитанной в соответствии с настоящим подпунктом общей части Правил клиринга;
- 7) величины, равной минимальной из двух величин: (1) величине обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга его Обеспечения в ценных бумагах, пересчитанной в российские рубли по Расчетной цене соответствующей ценной бумаги, установленной Клиринговым центром на дату прекращения обязательств по сделкам (учитывается со знаком «плюс»), или (2) величине текущего размера абсолютного значения отрицательной величины, рассчитанной в соответствии с настоящим подпунктом общей части Правил клиринга;
  - 8) величины, равной минимальной из двух величин: (1) величине обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга его Обеспечения под стресс в ценных бумагах, пересчитанной в российские рубли по Расчетной цене соответствующей ценной бумаги, установленной Клиринговым центром на дату прекращения обязательств по сделкам (учитывается со знаком «плюс», только для собственных Расчетных кодов), или (2) величине текущего размера абсолютного значения отрицательной величины, рассчитанной в соответствии с настоящим подпунктом общей части Правил клиринга;
  - 9) величины, равной минимальной из двух величин: (1) величине обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга его взносов в Гарантийный фонд в ценных бумагах, пересчитанной в российские рубли по Расчетной цене соответствующей ценной бумаги, установленной Клиринговым центром на дату прекращения обязательств по сделкам (учитывается со знаком «плюс», только для собственных Расчетных кодов), или (2) величине текущего размера абсолютного значения отрицательной величины, рассчитанной в соответствии с настоящим подпунктом общей части Правил клиринга;
  - 10) величины, равной минимальной из двух величин: (1) величине обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга его Обеспечения в драгоценных металлах, пересчитанной в российские рубли по Центральному курсу соответствующего драгоценного металла, установленному Клиринговым центром на дату прекращения обязательств по сделкам (учитывается со знаком «плюс»), или (2) величине текущего размера абсолютного значения отрицательной величины, рассчитанной в соответствии с настоящим подпунктом общей части Правил клиринга.

Если в результате последовательного выполнения любого из действий, предусмотренных пунктами 1 - 10 настоящего подпункта общей части Правил клиринга, полученное значение является неотрицательной величиной, расчет соответствующего нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга продолжается в соответствии с подпунктом 27.9.3 общей части Правил клиринга.

- 27.9.3. Если величина, рассчитанная в соответствии с подпунктом 27.9.1 или 27.9.2 общей части Правил клиринга по соответствующим Расчетным кодам, равна нулю, это означает отсутствие у Участника клиринга нетто-обязательства / нетто-требования по соответствующим сделкам, при этом расчет нетто-обязательства / нетто-требования по таким сделкам прекращается.

Если величина, рассчитанная в соответствии с подпунктом 27.9.1 или 27.9.2 общей части Правил клиринга по собственным Расчетным кодам, отрицательная, это означает наличие нетто-обязательства Участника клиринга по отношению к Клиринговому центру по сделкам, заключенным за счет Участника клиринга, при этом расчет такого нетто-обязательства Участника клиринга прекращается.

Если величина, рассчитанная в соответствии с подпунктом 27.9.1 или 27.9.2 общей части Правил клиринга по соответствующим Расчетным кодам, за исключением собственных Расчетных кодов, положительная, это означает наличие нетто-требования Участника клиринга по отношению к Клиринговому центру по соответствующим сделкам, при этом расчет такого нетто-требования Участника клиринга прекращается.

Если величина, рассчитанная в соответствии с подпунктом 27.9.1 или 27.9.2 общей части Правил клиринга по соответствующим Расчетным кодам, за исключением собственных Расчетных кодов, отрицательная, расчет нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга продолжается следующим образом:

Клиринговый центр рассчитывает сумму с учетом знака указанной отрицательной величины, и положительной величины, рассчитанной в соответствии с подпунктом 27.9.1 или 27.9.2 общей части Правил клиринга по собственным Расчетным кодам.

Если рассчитанная сумма отрицательная, это означает наличие нетто-обязательства Участника клиринга по соответствующим сделкам, при этом расчет такого нетто-обязательства прекращается.

Если рассчитанная сумма положительная для всех соответствующих Расчетных кодов, это означает наличие нетто-требования Участника клиринга по сделкам, заключенным за счет Участника клиринга, при этом расчет нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга прекращается.

- 27.9.4. Каждое из обязательств, перечисленных в подпункте 27.9.2 общей части Правил клиринга, включенное в расчет нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга, в соответствующей части прекращается.

При этом обязательство в иностранной валюте прекращается в части, равной соответствующей величине в российских рублях, включенной в расчет нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга, пересчитанной в иностранную валюту по курсу, установленному Банком России на дату прекращения обязательств по сделкам, обязательство в ценных бумагах прекращается в части, равной соответствующей величине в российских рублях, включенной в расчет нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга, пересчитанной в ценные бумаги по Расчетной цене соответствующей ценной бумаги, установленной Клиринговым центром на дату прекращения обязательств по сделкам, а обязательство в драгоценных металлах прекращается в части, равной соответствующей величине в российских рублях, включенной в расчет нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга, пересчитанной в драгоценные металлы по Центральному курсу соответствующего драгоценного металла, установленному Клиринговым центром на дату прекращения обязательств по сделкам.

- 27.10. Клиринговый центр рассчитывает сумму нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в российских рублях в отношении других Участников клиринга – его контрагентов по сделкам без центрального контрагента в порядке,

предусмотренном подпунктами 27.10.1-27.10.3 общей части Правил клиринга, отдельно:

- 1) по сделкам, заключенным за счет Участника клиринга, - по всем собственным Расчетным кодам;
- 2) по сделкам, заключенным за счет клиентов Участника клиринга, за исключением Обособленных клиентов, - по всем клиентским Расчетным кодам, за исключением Расчетных кодов, открытых для Обособленных клиентов;
- 3) по сделкам, заключенным за счет каждого Обособленного клиента Участника клиринга, - по Расчетному коду, открытому для Обособленного клиента;
- 4) по сделкам, заключенным за счет средств, находящихся в доверительном управлении Участника клиринга, - по всем Расчетным кодам ДУ.

27.10.1. Клиринговый центр рассчитывает величину, равную сумме с учетом знака:

$SUM = POS\_RUB + \sum_i (POS\_C_i \times CC_i) + \sum_i (POS\_R_i \times CR_i) + \sum_j (POS\_VAL_j \times C\_VAL_j)$ , где

$POS\_RUB = ST - SO$ ,

$POS\_VAL_j = ST_j - SO_j$ ,

$POS\_C_j = STC_j - SOC_j$ ,

$POS\_R_i = STR_i - SOR_i$ ,

$POS\_RUB$  - обязательство (требование) Участника клиринга по денежным средствам в российских рублях;

$POS\_VAL_j$  - обязательство (требование) Участника клиринга по денежным средствам в j-ой иностранной валюте;

$POS\_C_i$  - обязательство (требование) Участника клиринга по i-ой ценной бумаге по сделкам купли-продажи ценных бумаг;

$POS\_R_i$  - обязательство (требование) Участника клиринга по i-ой ценной бумаге по сделкам РЕПО;

$ST$  - сумма требований, а  $SO$  – сумма обязательств Участника клиринга по денежным средствам в соответствующей валюте, учитываемых на дату прекращения обязательств по сделкам, по:

- сделкам с кодом расчетов B0-B30;
- первым частям сделок РЕПО с кодом расчетов Sn;
- вторым частям сделок РЕПО с кодом расчетов Rb, Sn, Z0.

При этом сумма обязательств и требований по вторым частям сделок РЕПО рассчитывается исходя из фактического срока сделки РЕПО, прошедшего от фактической даты исполнения обязательств по первой части РЕПО, включая эту дату, до даты прекращения обязательств по сделкам, не включая эту дату. В случае если обязательства по первой части сделки РЕПО не исполнены на дату прекращения обязательств по сделкам в соответствии с настоящей статьей общей части Правил клиринга, в целях расчета нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в отношении Участников клиринга – его контрагентов срок сделки РЕПО принимается равным нулю.

$STC_i$  - сумма требований, а  $SOC_i$  – сумма обязательств Участника клиринга по  $i$ -ой ценной бумаге, учитываемых на дату прекращения обязательств по сделкам, по:

- сделкам с кодом расчетов B0-B30.

$STR_i$  - сумма требований, а  $SOR_i$  – сумма обязательств Участника клиринга по  $i$ -ой ценной бумаге, учитываемых на дату прекращения обязательств по сделкам, по:

- первым частям сделок РЕПО с кодом расчетов  $Sn$ ;

- вторым частям сделок РЕПО с кодом расчетов  $Rb, Sn, Z0$ .

$CC_i$  – цена (в российских рублях), равная сумме расчетной цены  $i$ -ой ценной бумаги, определенной Биржей в соответствии с Правилами торгов на фондовом рынке по итогам Торгового дня прекращения обязательств по сделкам, или последней использовавшейся расчетной цены такой ценной бумаги, и НКД на дату прекращения обязательств по сделкам (при условии его расчета для данной ценной бумаги). Если Биржей не установлена расчетная цена  $i$ -ой ценной бумаги в российских рублях для ценных бумаг, сделки на торгах Биржи с которыми заключаются только с расчетами в иностранной валюте, расчёт цены осуществляется по курсу соответствующей иностранной валюты, установленному Банком России на дату прекращения обязательств по сделкам;

$CR_i$  – цена (в российских рублях), равная сумме расчетной цены  $i$ -ой ценной бумаги, определенной Биржей в соответствии с Правилами торгов на фондовом рынке по итогам Торгового дня прекращения обязательств по сделкам, или последней использовавшейся расчетной цены такой ценной бумаги, и НКД на дату прекращения обязательств по сделкам (при условии его расчета для данной ценной бумаги), уменьшенной с учётом начального значения дисконта, установленного Банком России для  $i$ -ой ценной бумаги в целях расчёта стоимости обеспечения по РЕПО на дату прекращения обязательств по сделкам, или последнего использовавшегося дисконта для такой ценной бумаги. Если Биржей не установлена расчетная цена  $i$ -ой ценной бумаги в российских рублях для ценных бумаг, сделки на торгах Биржи с которыми заключаются только с расчетами в иностранной валюте, расчёт цены осуществляется по курсу соответствующей иностранной валюты, установленному Банком России на дату прекращения обязательств по сделкам;

$\sum_i$  – сумма по ценным бумагам;

$C\_VAL_j$  – курс  $j$ -ой иностранной валюты, установленный Банком России на дату прекращения обязательств по сделкам;

$\sum_j$  – сумма по иностранным валютам.

27.10.2. Если величина, рассчитанная в соответствии с подпунктом 27.10.1 общей части Правил клиринга, положительная, это означает наличие нетто-требования Участника клиринга по отношению к Участнику клиринга - контрагенту, отрицательная – наличие нетто-обязательства Участника клиринга по отношению к Участнику клиринга - контрагенту.

27.10.3. Если Участником клиринга – контрагентом является Банк России, то с даты вступления в силу правил клиринга НКО ЗАО НРД, регламентирующих порядок расчета нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга – кредитной организации по сделкам, заключенным с Банком России, клиринг по которым осуществляет Клиринговый центр, положительная величина, рассчитанная в соответствии с подпунктом 27.10.1 общей части Правил клиринга, является предварительным нетто-требованием Участника клиринга по отношению к Банку

России, отрицательная – предварительным нетто-обязательством Участника клиринга по отношению к Банку России. Указанный порядок применяется для обязательств, возникших из договоров, заключенных на условиях одного генерального соглашения.

- 27.11. Клиринговый центр направляет Участнику клиринга, клиринговое обслуживание которого прекращено, уведомление о прекращении обязательств по сделкам в течение 3 (трех) рабочих дней, следующих за датой прекращения клирингового обслуживания. Указанное уведомление также содержит информацию о рассчитанных в соответствии с пунктом 27.9 общей части Правил клиринга нетто-обязательствах / нетто-требованиях Участника клиринга в отношении Клирингового центра, а также о рассчитанных в соответствии с пунктом 27.10 общей части Правил клиринга нетто-обязательствах / нетто-требованиях Участника клиринга в отношении его контрагентов по сделкам без центрального контрагента.

С даты вступления в силу правил клиринга НКО ЗАО НРД, регламентирующих порядок расчета нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга – кредитной организации по сделкам, заключенным с Банком России, клиринг по которым осуществляет Клиринговый центр, уведомления о нетто-обязательствах / нетто-требованиях Участника клиринга – кредитной организации и Банка России, рассчитанные по сделкам, заключенным между Участником клиринга – кредитной организацией и Банком России, направляются таким Участникам клиринга НКО ЗАО НРД в соответствии с правилами клиринга НКО ЗАО НРД.

Уведомления о прекращении обязательств по сделкам без центрального контрагента, содержащие информацию о рассчитанных в соответствии с настоящей статьей общей части Правил клиринга нетто-обязательствах / нетто-требованиях Участников клиринга – контрагентов Участника клиринга, клиринговое обслуживание которого прекращено, направляются указанным Участникам клиринга – контрагентам в те же сроки.

Клиринговый центр также направляет Участнику клиринга, клиринговое обслуживание которого прекращено, уведомление о прекращении действия Договора об оказании клиринговых услуг.

- 27.12. Клиринговый центр направляет Доверенному владельцу счетов в форме электронного документа уведомление о рассчитанной в соответствии с пунктом 27.9 общей части Правил клиринга сумме нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга по сделкам, заключенным за счет средств Доверенного владельца счетов.

Доверенный владелец счетов вправе подать в Клиринговый центр Заявление на возврат денежных средств, составляющих Обеспечение, обязательства по возврату которого учитываются по Расчетному коду, с которым связана Обособленная Брокерская фирма, за которой закреплен указанный Доверенный владелец счетов, в сумме, оставшейся после определения указанного нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга. Возврат указанных денежных средств осуществляется в порядке, установленном Правилами клиринга на срочном рынке.

- 27.13. Возврат денежных средств / ценных бумаг Участнику клиринга, клиринговое обслуживание которого прекращено, осуществляется Клиринговым центром не позднее 3 (трех) рабочих дней с даты прекращения Договора об оказании клиринговых услуг, российских рублей Участнику клиринга – Кредитной



- организации - на корреспондентский счет Участника клиринга – Кредитной организации, открытый в Банке России, российских рублей иным Участникам клиринга - по реквизитам Счета для возврата в российских рублях, зарегистрированного для основного Расчетного кода Участника клиринга, ценных бумаг - на торговый счет депо владельца Участника клиринга.
- 27.13.1. Для исполнения обязательств по возврату Участнику клиринга денежных средств в иностранной валюте / драгоценных металлов, оставшихся после определения нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга в порядке, предусмотренном пунктом 27.9 общей части Правил клиринга, Клиринговый центр на основании пункта 3.15 общей части Правил клиринга в дату прекращения Договора об оказании клиринговых услуг осуществляет на соответствующих биржевых рынках продажу соответствующей иностранной валюты / соответствующих драгоценных металлов в сумме / количестве, равном размеру обязательств Клирингового центра по возврату Обеспечения / Обеспечения под стресс / взноса в Гарантийный фонд Участника клиринга в соответствующей иностранной валюте / соответствующих драгоценных металлах, оставшихся после определения нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга в порядке, предусмотренном пунктом 27.9 общей части Правил клиринга.
- 27.13.2. Возврат денежных средств Участнику клиринга осуществляется Клиринговым центром в суммах нетто-требований Участника клиринга в российских рублях, рассчитанных в порядке, предусмотренном пунктом 27.9 общей части Правил клиринга, а также в суммах денежных средств в российских рублях, полученных от продажи иностранной валюты / драгоценных металлов в соответствии с подпунктом 27.13.1 общей части Правил клиринга, а в случае, если такая продажа невозможна, в размере соответствующих обязательств по возврату Участнику клиринга денежных средств в иностранной валюте / драгоценных металлов, пересчитанных в российские рубли по курсу иностранной валюты, установленному Банком России на дату прекращения Договора об оказании клиринговых услуг / по Центральному курсу соответствующего драгоценного металла, установленному Клиринговым центром на дату прекращения Договора об оказании клиринговых услуг.
- 27.13.3. Ценные бумаги, оставшиеся на Разделах Участника клиринга / Держателя / Доверенного владельца счетов / клиента Участника клиринга после определения нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга в порядке, предусмотренном пунктом 27.9 общей части Правил клиринга, списываются с Разделов Участника клиринга без согласия Клирингового центра.
- 27.14. Клиринговый центр вправе предъявить к Участнику клиринга требование о взыскании нетто-обязательств Участника клиринга, рассчитанных в порядке, предусмотренном пунктом 27.9 общей части Правил клиринга, а также неустоек (штрафов, пеней), и комиссионных вознаграждений, подлежащих уплате в соответствии с Правилами клиринга и не участвовавших в определении нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга, в общем порядке, предусмотренном законодательством о несостоятельности (банкротстве).

**Статья 28. Порядок урегулирования обязательств в случае банкротства клиента Участника клиринга (ликвидационный неттинг в отношении клиента Участника клиринга)**

- 28.1. В случае отзыва (аннулирования) Банком России у клиента Участника клиринга, являющегося кредитной организацией, лицензии на осуществление банковских операций, а также в случае принятия арбитражным судом решения о введении одной из процедур банкротства в отношении клиента Участника клиринга, Участник клиринга вправе обратиться к Клиринговому центру за расчетом нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга по сделкам, заключенным за счет такого клиента Участника клиринга, обязательства по которым не исполнены и/или не прекращены по иным основаниям, предусмотренным Правилами клиринга, предоставив Заявление о проведении ликвидационного неттинга в отношении клиента Участника клиринга.
- 28.1.1. Предоставление Заявления о проведении ликвидационного неттинга в отношении клиента Участника клиринга возможно не ранее даты отзыва (аннулирования) Банком России у клиента Участника клиринга, являющегося кредитной организацией, лицензии на осуществление банковских операций, или даты принятия арбитражным судом решения о введении одной из процедур банкротства в отношении клиента Участника клиринга.
- 28.2. В Заявлении о проведении ликвидационного неттинга в отношении клиента Участника клиринга (далее по тексту настоящей статьи общей части Правил клиринга также – Заявление) или совместно с Заявлением Участник клиринга обязан предоставить Клиринговому центру:
- 1) Расчетный код (Расчетные коды), открытые Участником клиринга для Обособленного клиента;
  - 2) идентификационные данные клиента Участника клиринга, не являющегося Обособленным клиентом, включая, но не ограничиваясь ИНН клиента – юридического лица, имеющего ИНН, или номер паспорта клиента – физического лица, или код страны регистрации клиента – юридического лица, являющегося Нерезидентом и не имеющего ИНН;
  - 3) документы и/или информацию, подтверждающую наличие оснований, указанных в пункте 28.1 общей части Правил клиринга;
  - 4) номера сделок, стороной по которым является Участник клиринга, заключенным на соответствующих биржевых рынках за счет клиента Участника клиринга, указанного в Заявлении (указанная информация не предоставляется для Обособленных клиентов);
  - 5) информацию о суммах денежных средств или о сумме Задолженности, а также о количествах ценных бумаг и драгоценных металлов клиента Участника клиринга, учитываемых на Расчетных кодах, Торгово-клиринговых счетах и/или разделах денежного и депо регистров обеспечения Участника клиринга и о номерах (кодах) таких Расчетных кодов, Торгово-клиринговых счетов и/или разделов денежного и депо регистров обеспечения (указанная информация не предоставляется для Обособленных клиентов);
  - 6) иную информацию по требованию Клирингового центра, необходимую для расчета нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга по сделкам, заключенным за счет клиента Участника клиринга.

- 28.3. Клиринговый центр вправе отказать Участнику клиринга в исполнении Заявления:
- 28.3.1. в случае непредоставления Участником клиринга документов и/или информации, указанных в пункте 28.2 общей части Правил клиринга;
- 28.3.2. в случае, если, по мнению Клирингового центра, исполнение Заявления может создать угрозу финансовой стабильности Клирингового центра;
- 28.3.3. в случае, если, по мнению Клирингового центра, исполнение Заявления не возможно в срок, установленный законодательством;
- 28.3.4. если Клиринговым центром начато прекращение обязательств Участника клиринга по основаниям, установленным Правилами клиринга.
- 28.4. Исполнение Заявления о проведении ликвидационного неттинга в отношении клиента Участника клиринга осуществляется в следующем порядке.
- 28.4.1. В случае отзыва (аннулирования) Банком России у клиента Участника клиринга, являющегося кредитной организацией, лицензии на осуществление банковских операций обязательства по сделкам, стороной по которым является Участник клиринга, заключенным за счет такого клиента Участника клиринга до даты отзыва такой лицензии, прекращаются полностью на дату, следующую за датой отзыва (аннулирования) Банком России у такого клиента Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций, возникновением нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга, рассчитанного в соответствии с пунктом 28.6 общей части Правил клиринга.
- 28.4.2. В случае принятия арбитражным судом решения о введении в отношении клиента Участника клиринга одной из процедур банкротства, обязательства по сделкам, стороной по которым является Участник клиринга, заключенным за счет такого клиента Участника клиринга, прекращаются полностью на дату, следующую за датой принятия арбитражным судом решения о введении в отношении Участника клиринга одной из процедур банкротства, возникновением нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга, рассчитанного в соответствии с пунктом 28.6 общей части Правил клиринга.
- 28.5. Клиринговый центр заключает балансирующие сделки с ценными бумагами / иностранной валютой / драгоценными металлами / Срочные контракты в порядке, определенном статьей 16 общей части Правил клиринга.
- 28.6. Клиринговый центр рассчитывает сумму нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в российских рублях по сделкам с центральным контрагентом, заключенным за счет клиента Участника клиринга, в следующем порядке.
- 28.6.1. Клиринговый центр рассчитывает величину, равную сумме с учетом знака:
- а) величины SUM, рассчитанной по формуле:
- $$SUM = POS\_RUB + \sum_i (POS\_C_i \times CC_i) + \sum_j (POS\_VAL_j \times C\_VAL_j) + \sum_k (POS\_D_k \times (CD_k - SP_k)), \text{ где}$$
- POS\_RUB - сумма значений (с учетом знака) Нетто-обязательств / Нетто-требований Участника клиринга в российских рублях по сделкам с центральным контрагентом, заключенным за счет клиента Участника клиринга, по всем соответствующим Расчетным кодам и Датам исполнения, учитываемых на конец дня прекращения обязательств по сделкам;

$POS\_C_i$  – сумма значений (с учетом знака) Нетто-обязательств / Нетто-требований Участника клиринга по  $i$ -ой ценной бумаге по сделкам с центральным контрагентом, заключенным за счет клиента Участника клиринга, по всем соответствующим Расчетным кодам и Датам исполнения, учитываемых на конец дня прекращения обязательств по сделкам;

$CC_i$  – цена сделки / средневзвешенная цена сделок с ценными бумагами, заключенной / заключенных Клиринговым центром в соответствии с пунктом 28.5 общей части Правил клиринга с  $i$ -ой ценной бумагой (в российских рублях);

$\sum_i$  – сумма по ценным бумагам;

$POS\_VAL_j$  – сумма значений (с учетом знака) Нетто-обязательств / Нетто-требований Участника клиринга по денежным средствам / драгоценным металлам в  $j$ -ой иностранной валюте /  $j$ -ом драгоценном металле по всем соответствующим Расчетным кодам и Датам исполнения, учитываемых на конец дня прекращения обязательств по сделкам;

$C\_VAL_j$  – курс сделки / средневзвешенный курс сделок с иностранной валютой / драгоценным металлом, заключенной / заключенных Клиринговым центром в соответствии с пунктом 28.5 общей части Правил клиринга с  $j$ -ой иностранной валютой /  $j$ -ым драгоценным металлом;

$\sum_j$  – сумма по иностранным валютам / драгоценным металлам;

$POS\_D_k$  – нетто-позиция (с учетом знака) Участника клиринга по  $k$ -му Срочному контракту, рассчитанная как сумма (с учетом знака) позиций по  $k$ -му Срочному контракту, заключенному за счет клиента Участника клиринга, учитываемых на всех соответствующих разделах регистра учета позиций Участника клиринга на конец дня прекращения обязательств по сделкам;

$CD_k$  – цена сделки / средневзвешенная цена сделок, заключенной / заключенных Клиринговым центром в соответствии с пунктом 28.5 общей части Правил клиринга по  $k$ -му Срочному контракту;

$SP_k$  – Расчетная цена  $k$ -го Срочного контракта, определенная Клиринговым центром в ходе вечерней клиринговой сессии дня прекращения обязательств по сделкам;

$\sum_k$  – сумма по Срочным контрактам,

и

- б) Задолженности (со знаком «минус») Участника клиринга в российских рублях по сделкам, заключенным за счет такого клиента Участника клиринга, учитываемой на конец дня прекращения обязательств по сделкам, не включающей неисполненные обязательства Участника клиринга по уплате комиссионных вознаграждений, неустоек (штрафов, пеней), подлежащих уплате Участником клиринга в соответствии с Правилами клиринга, и
- в) обязательств Участника клиринга по передаче Дохода по сделкам, заключенным за счет такого клиента Участника клиринга, не исполненных по состоянию на конец дня прекращения обязательств по сделкам, при отзыве (аннулировании) у клиента Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций – обязательства по передаче Дохода, возникшие до дня отзыва (аннулирования) у клиента Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций (учитываются со знаком «минус»), и

- г) обязательств Клирингового центра по передаче Дохода Участнику клиринга по сделкам, заключенным за счет такого клиента Участника клиринга, не исполненных по состоянию на конец дня прекращения обязательств по сделкам, при отзыве (аннулировании) у клиента Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций – обязательства по передаче Дохода, возникшие до дня отзыва (аннулирования) у клиента Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций (учитываются со знаком «плюс»), и
- д) значений (с учетом знака) обязательств / требований Участника клиринга в российских рублях по возврату Гарантийных переводов по сделкам, заключенным за счет такого клиента Участника клиринга, учитываемых на конец дня прекращения обязательств по сделкам, и
- е) значений (с учетом знака) обязательств / требований Участника клиринга в российских рублях по уплате / получению вариационной маржи по сделкам, заключенным за счет такого клиента Участника клиринга, учитываемых на конец дня прекращения обязательств по сделкам.

Если величина, рассчитанная в соответствии с настоящим подпунктом общей части Правил клиринга, неотрицательная, расчет нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга по сделкам, заключенным за счет клиента Участника клиринга, прекращается, если отрицательная - продолжается в соответствии с подпунктом 28.6.2 общей части Правил клиринга.

28.6.2. Клиринговый центр рассчитывает сумму с учетом знака отрицательной величины, рассчитанной в соответствии с подпунктом 28.6.1 общей части Правил клиринга, и следующих величин, учитываемых на конец дня прекращения обязательств по сделкам, в следующей очередности и размере:

- 1) величины обязательств Клирингового центра по возврату Участнику клиринга его Обеспечения в российских рублях, внесенного клиентом Участника клиринга (учитываются со знаком «плюс»);
- 2) величины, равной минимальной из двух величин: (1) величине обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга его Обеспечения в иностранной валюте, внесенного клиентом Участника клиринга, пересчитанной в российские рубли по курсу, установленному Банком России на дату прекращения обязательств по сделкам (учитывается со знаком «плюс»), или (2) величине текущего размера абсолютного значения отрицательной величины, рассчитанной в соответствии с настоящим подпунктом общей части Правил клиринга;
- 3) величины, равной минимальной из двух величин: (1) величине обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга его Обеспечения в ценных бумагах, внесенного клиентом Участника клиринга, пересчитанной в российские рубли по Расчетной цене соответствующей ценной бумаги, установленной Клиринговым центром на дату прекращения обязательств по сделкам (учитывается со знаком «плюс»), или (2) величине текущего размера абсолютного значения отрицательной величины, рассчитанной в соответствии с настоящим подпунктом общей части Правил клиринга;
- 4) величины, равной минимальной из двух величин: (1) величине обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга его Обеспечения в драгоценных металлах, внесенного клиентом Участника клиринга,

пересчитанной в российские рубли по Центральному курсу соответствующего драгоценного металла, установленному Клиринговым центром на дату прекращения обязательств по сделкам (учитывается со знаком «плюс»), или (2) величине текущего размера абсолютного значения отрицательной величины, рассчитанной в соответствии с настоящим подпунктом общей части Правил клиринга.

Если в результате последовательного выполнения любого из действий, предусмотренных пунктами 1 - 4 настоящего подпункта общей части Правил клиринга, полученное значение является неотрицательной величиной, расчет нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга по сделкам, заключенным за счет клиента Участника клиринга, прекращается.

- 28.6.3. Если величина, рассчитанная в соответствии с подпунктом 28.6.1 или 28.6.2 общей части Правил клиринга, равна нулю, это означает отсутствие у Участника клиринга нетто-обязательства / нетто-требования по сделкам, заключенным за счет клиента Участника клиринга.

Если величина, рассчитанная в соответствии с подпунктом 28.6.1 или 28.6.2 общей части Правил клиринга, положительная, это означает наличие нетто-требования Участника клиринга по отношению к Клиринговому центру по сделкам, заключенным за счет клиента Участника клиринга.

Если величина, рассчитанная в соответствии с подпунктом 28.6.2 общей части Правил клиринга, отрицательная, это означает наличие нетто-обязательства Участника клиринга по отношению к Клиринговому центру по сделкам, заключенным за счет клиента Участника клиринга.

- 28.6.4. Каждое из обязательств, перечисленных в подпункте 28.6.2 общей части Правил клиринга, включенное в расчет нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга по сделкам, заключенным за счет клиента Участника клиринга, в соответствующей части прекращается.

При этом обязательство в иностранной валюте прекращается в части, равной соответствующей величине в российских рублях, включенной в расчет нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга по сделкам, заключенным за счет клиента Участника клиринга, пересчитанной в иностранную валюту по курсу, установленному Банком России на дату прекращения обязательств по сделкам, обязательство в ценных бумагах прекращается в части, равной соответствующей величине в российских рублях, включенной в расчет нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга по сделкам, заключенным за счет клиента Участника клиринга, пересчитанной в ценные бумаги по Расчетной цене соответствующей ценной бумаги, установленной Клиринговым центром на дату прекращения обязательств по сделкам, а обязательство в драгоценных металлах прекращается в части, равной соответствующей величине в российских рублях, включенной в расчет нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга по сделкам, заключенным за счет клиента Участника клиринга, пересчитанной в драгоценные металлы по Центральному курсу соответствующего драгоценного металла, установленному Клиринговым центром на дату прекращения обязательств по сделкам.

- 28.7. Клиринговый центр не позднее 3 (трех) рабочих дней, следующих за датой получения от Участника клиринга Заявления о проведении ликвидационного неттинга в отношении клиента Участника клиринга, направляет Участнику

клиринга уведомление о прекращении обязательств по сделкам, заключенным за счет такого клиента Участника клиринга. Указанное уведомление также содержит информацию о рассчитанном в соответствии с пунктом 28.6 общей части Правил клиринга нетто-обязательстве / нетто-требовании Участника клиринга в отношении Клирингового центра по сделкам, заключенным за счет такого клиента Участника клиринга.

28.8. Клиринговый центр не позднее 3 (трех) рабочих дней, следующих за датой получения от Участника клиринга Заявления, возвращает Участнику клиринга для включения в конкурсную массу клиента Участника клиринга:

- денежные средства в российских рублях в сумме нетто-требования Участника клиринга, рассчитанного в соответствии с пунктом 28.6 общей части Правил клиринга;
- денежные средства в иностранной валюте - в размере обязательства Клирингового центра по возврату Обеспечения Участника клиринга в соответствующей иностранной валюте, равного сумме денежных средств клиента Участника клиринга в соответствующей иностранной валюте, оставшихся после определения нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в соответствии с пунктом 28.6 общей части Правил клиринга;
- драгоценные металлы – в размере обязательства Клирингового центра по возврату Обеспечения Участника клиринга в соответствующем драгоценном металле, равного количеству соответствующего драгоценного металла клиента Участника клиринга, оставшегося после определения нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в соответствии с пунктом 28.6 общей части Правил клиринга.

28.9. Нетто-обязательство Участника клиринга, рассчитанное в соответствии с пунктом 28.6 общей части Правил клиринга, учитывается как Задолженность такого Участника клиринга и исполняется за счет Обеспечения Участника клиринга, учитываемого по собственным Расчетным кодам, а также Обеспечения под стресс и взносов в Гарантийные фонды в порядке, установленном статьей 21 общей части Правил клиринга.

28.10. Если в результате определения нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга по сделкам, заключенным за счет клиента Участника клиринга, в соответствии с настоящей статьей общей части Правил клиринга у Участника клиринга возникло Маржинальное требование, такое Маржинальное требование должно быть исполнено Участником клиринга в порядке и сроки, установленные Правилами клиринга.

## **Статья 29. Порядок урегулирования обязательств в случае отзыва (аннулирования) лицензии на осуществление банковских операций у Клирингового центра (ликвидационный неттинг в отношении Клирингового центра)**

29.1. В случае отзыва (аннулирования) лицензии на осуществление банковских операций у Клирингового центра, обязательства по сделкам с центральным контрагентом, 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-обязательств / нетто-требований Клирингового центра, рассчитанных в соответствии с пунктом 29.2 общей части Правил клиринга.

- 29.1.1. В случае отзыва (аннулирования) лицензии на осуществление банковских операций у Клирингового центра, обязательства по сделкам с центральным контрагентом, 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).

- 29.2. Клиринговый центр рассчитывает сумму нетто-обязательств / нетто-требований Клирингового центра в российских рублях в отношении каждого Участника клиринга отдельно:

- 1) по сделкам, заключенным за счет Участника клиринга, - по всем собственным Расчетным кодам;
- 2) по сделкам, заключенным за счет клиентов Участника клиринга, за исключением Обособленных клиентов и сделок, заключенных за счет средств Доверенных владельцев счетов, - по всем клиентским Расчетным кодам, за исключением Расчетных кодов, открытых для Обособленных клиентов, и Расчетных кодов, с которыми связаны Обособленные Брокерские фирмы;
- 3) по сделкам, заключенным за счет каждого Обособленного клиента Участника клиринга, - по Расчетному коду, открытому для Обособленного клиента;
- 4) по сделкам, заключенным за счет средств каждого Доверенного владельца счетов, - по Расчетному коду, с которым связана Обособленная Брокерская фирма;
- 5) по сделкам, заключенным за счет средств, находящихся в доверительном управлении Участника клиринга, - по каждому Расчетному коду ДУ.

как сумму с учетом знака:

- а) по каждой ценной бумаге суммы (с учетом знака) Нетто-обязательств / Нетто-требований по сделкам с центральным контрагентом по соответствующим Расчетным кодам и Датам исполнения по ценной бумаге, учитываемых на конец дня, предшествующего дате отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций, пересчитанной в российские рубли по Расчетной цене соответствующей ценной бумаги, установленной Клиринговым центром на день отзыва у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций;
- б) суммы (с учетом знака) Нетто-обязательств / Нетто-требований по сделкам с центральным контрагентом по соответствующим Расчетным кодам и Датам исполнения по денежным средствам в российских рублях Участника клиринга, учитываемых на конец дня, предшествующего дате отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций;



- в) по каждой иностранной валюте суммы (с учетом знака) Нетто-обязательств / Нетто-требований по сделкам с центральным контрагентом по соответствующим Расчетным кодам и Датам исполнения по денежным средствам в иностранной валюте Участника клиринга, учитываемых на конец дня, предшествующего дате отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций, пересчитанной в российские рубли по курсу, установленному Банком России на день отзыва у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций;
- г) по каждому драгоценному металлу суммы (с учетом знака) Нетто-обязательств / Нетто-требований по сделкам с центральным контрагентом по соответствующим Расчетным кодам и Датам исполнения по драгоценным металлам, учитываемых на конец дня, предшествующего дате отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций, пересчитанной в российские рубли по Центральному курсу соответствующего драгоценного металла, установленному Клиринговым центром на день отзыва у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций;
- д) Обеспечения Участника клиринга в российских рублях, учитываемого по соответствующим Расчетным кодам на конец дня, предшествующего дате отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций (учитывается со знаком «плюс»);
- е) Обеспечения Участника клиринга в иностранной валюте, учитываемого по соответствующим Расчетным кодам на конец дня, предшествующего дате отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций, пересчитанного в российские рубли по курсу, установленному Банком России на день отзыва у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций (учитывается со знаком «плюс»);
- ж) Обеспечения Участника клиринга в ценных бумагах, учитываемого по соответствующим Расчетным кодам на конец дня, предшествующего дате отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций, пересчитанного в российские рубли по Расчетной цене соответствующей ценной бумаги, установленной Клиринговым центром на день отзыва у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций;
- з) Обеспечения Участника клиринга в драгоценных металлах, учитываемого по соответствующим Расчетным кодам на конец дня, предшествующего дате отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций, пересчитанного в российские рубли по Центральному курсу соответствующего драгоценного металла, установленного Клиринговым центром на день отзыва у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций;
- и) Обеспечения под стресс Участника клиринга в российских рублях, учитываемого на конец дня, предшествующего дате отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций (учитывается со знаком «плюс», только для собственных Расчетных кодов);

- к) Обеспечения под стресс Участника клиринга в иностранной валюте, учитываемого на конец дня, предшествующего дате отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций, пересчитанного в российские рубли по курсу, установленному Банком России на день отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций (учитывается со знаком «плюс», только для собственных Расчетных кодов);
- л) Обеспечения под стресс Участника клиринга в ценных бумагах, учитываемого на конец дня, предшествующего дате отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций, пересчитанного в российские рубли по Расчетной цене соответствующей ценной бумаги, установленной Клиринговым центром на день отзыва у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций (учитывается со знаком «плюс», только для собственных Расчетных кодов);
- м) взноса Участника клиринга в Гарантийный фонд в российских рублях, учитываемого на конец дня, предшествующего дате отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций (учитывается со знаком «плюс», только для собственных Расчетных кодов);
- н) взноса Участника клиринга в Гарантийный фонд в иностранной валюте, учитываемого на конец дня, предшествующего дате отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций, пересчитанного в российские рубли по курсу, установленному Банком России на день отзыва у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций (учитывается со знаком «плюс», только для собственных Расчетных кодов);
- о) взноса Участника клиринга в Гарантийный фонд в ценных бумагах, учитываемого на конец дня, предшествующего дате отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций, пересчитанного в российские рубли по Расчетной цене соответствующей ценной бумаги, установленной Клиринговым центром на день отзыва у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций (учитывается со знаком «плюс», только для собственных Расчетных кодов);
- п) Задолженности Участника клиринга в российских рублях, возникшей до даты отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций, учитываемой по соответствующим Расчетным кодам, не включающей неисполненные обязательства Участника клиринга по уплате комиссионных вознаграждений, неустоек (штрафов, пеней), подлежащих уплате Участником клиринга в соответствии с Правилами клиринга (учитывается со знаком «минус»);
- р) значения (с учетом знака) обязательств / требований Участника клиринга в российских рублях по возврату Гарантийных переводов, учитываемых по соответствующим Расчетным кодам на дату, предшествующую дате отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций;
- с) обязательств Участника клиринга по передаче Дохода, учитываемых по соответствующим Расчетным кодам и не исполненных по состоянию на день

отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций (учитываются со знаком «минус»);

- т) требований Участника клиринга по получению Дохода, учитываемых по соответствующим Расчетным кодам и не исполненных по состоянию на день отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций (учитываются со знаком «плюс»).

Если величина, рассчитанная в соответствии с настоящим пунктом общей части 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.

- 29.3. Информация о сумме нетто-обязательств / нетто-требований Клирингового центра в российских рублях в отношении Участника клиринга, определенных в соответствии с пунктом 29.2 общей части Правил клиринга, направляется Клиринговым центром Участнику клиринга.

- 29.4. Информация о сумме нетто-обязательства / нетто-требования Клирингового центра в российских рублях в отношении Участника клиринга, определенных в соответствии с пунктом 29.2 общей части Правил клиринга по сделкам, заключенным за счет средств Доверенного владельца счетов, направляется Клиринговым центром Доверенному владельцу счетов.

### **Статья 30. Взаимодействие с Биржей при возникновении обстоятельств, которые могут повлиять на возможность проведения Торгов**

- 30.1. 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 сбои, неисправности и отказы оборудования; сбои и ошибки программного обеспечения; сбои, неисправности и отказы систем связи, энергоснабжения, кондиционирования и других систем жизнеобеспечения, а также иные обстоятельства, такие как случаи нарушения правил разграничения доступа и/или попыток несанкционированного доступа к Клиринговой системе, Клиринговый центр незамедлительно уведомляет об этом Биржу и/или Расчетную организацию и/или Расчетный депозитарий любым из доступных средств связи и предпринимает все возможные меры, направленные на устранение указанных обстоятельств.

### **Статья 31. Чрезвычайные ситуации**

- 31.1. Чрезвычайной ситуацией может быть признана ситуация, связанная с наступлением обстоятельств, препятствующих клиринговому обслуживанию Участников клиринга и/или исполнению Клиринговым центром своих обязательств перед Участниками клиринга по возврату им денежных средств, 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 сбои, неисправности и отказы оборудования; сбои и ошибки программного обеспечения; сбои, неисправности и отказы систем связи, энергоснабжения, кондиционирования и других систем жизнеобеспечения, а также иные обстоятельства, такие как случаи нарушения правил разграничения доступа и/или попыток несанкционированного доступа к Клиринговой системе, последствия которых не устранены в течение 3 (трех) часов со времени окончания торгов;

- военные действия, акты террора, диверсии и саботажа, массовые беспорядки, забастовки, смена политического режима, другие политические осложнения, как в Российской Федерации, так и в иных государствах;
- решения органов государственной власти, иных органов, учреждений и организаций Российской Федерации и/или иных государств;
- пожары или иные несчастные случаи, разрушения или значительные повреждения в занимаемых Клиринговым центром помещениях;
- 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.

31.2. Признание ситуации чрезвычайной осуществляется по решению Клирингового центра.

31.3. В случае признания Клиринговым центром возникшей ситуации чрезвычайной, Клиринговый центр предпринимает следующие действия:

- извещает Биржу имеющимися доступными средствами связи о возникновении чрезвычайной ситуации и о мерах, необходимых, по мнению Клирингового центра, для ее устранения;
- извещает Участников клиринга, Расчетную организацию / Расчетный депозитарий имеющимися доступными ему в данной ситуации средствами связи о возникновении чрезвычайной ситуации и предпринимаемых в связи с этим действиях;
- на основании решения Клирингового центра, согласованного (если таковое согласование с учетом сложившихся обстоятельств было возможным) с Банком России и, при необходимости, с Биржей, не осуществляет клиринговое обслуживание Участников клиринга.

31.4. В качестве мер по урегулированию чрезвычайной ситуации (при необходимости по согласованию с Банком России и Биржей) Клиринговым центром могут быть приняты следующие решения:

- об изменении Временного регламента и/или сроков осуществления документооборота в процессе взаимодействия Клирингового центра с Расчетной организацией, Расчетным депозитарием и Биржей;

- об исключении из клирингового пула обязательств по некоторым или всем сделкам;
- об изменении способа, порядка и Даты исполнения обязательств Участниками клиринга и/или Клиринговым центром, в том числе в соответствии с пунктом 31.5 общей части Правил клиринга;
- 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.

31.5. В случае признания ситуации чрезвычайной в связи с обстоятельствами, предусмотренными пунктом 31.1 общей части Правил клиринга, Клиринговый центр вправе принять решения:

- 1) об изменении условий сделок с ценными бумагами с расчетами в иностранной валюте: установить, что обязательства по оплате ценных бумаг по таким сделкам исполняются в российских рублях по курсу, установленному решением Клирингового центра по согласованию с Банком России;
- 2) о том, что Дата исполнения обязательств по сделкам с иностранной валютой считается наступившей в Расчетный день, установленный решением Клирингового центра по согласованию с Банком России, и об исполнении обязательств по указанным сделкам в порядке, установленном подпунктами 31.5.1-31.5.3 общей части Правил клиринга.

31.5.1. Обязательства по сделкам с иностранной валютой включаются в клиринговый пул, формируемый в Расчетный день, установленный решением Клирингового центра, в соответствии с Правилами клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.

31.5.2. В случае наличия Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований Участника клиринга в иностранной валюте, между Клиринговым центром и Участниками клиринга, в том числе без подачи заявок, заключаются сделки купли-продажи иностранной валюты с Датой исполнения в Расчетный день, установленный решением Клирингового центра в соответствии с настоящим пунктом общей части Правил клиринга, таким образом, чтобы по указанной сделке купли-продажи иностранной валюты:

- в случае наличия у Участника клиринга Итогового нетто-обязательства в иностранной валюте, у Участника клиринга возникли требования в соответствующей иностранной валюте, противоположные указанному Итоговому нетто-обязательству Участника клиринга в объеме, равном указанному Итоговому нетто-обязательству Участника клиринга;
- в случае наличия у Участника клиринга Итогового нетто-требования в иностранной валюте, у Участника клиринга возникли обязательства в соответствующей иностранной валюте, противоположные указанному Итоговому нетто-требованию Участника клиринга в иностранной валюте в объеме, равном указанному Итоговому нетто-требованию Участника клиринга.

Курс сделок купли-продажи иностранной валюты, заключаемых в соответствии с настоящим подпунктом общей части Правил клиринга, устанавливается решением Клирингового центра по согласованию с Банком России.

- 31.5.3. Обязательства по сделкам, заключенным в соответствии с подпунктом 31.5.2 общей части Правил клиринга, включаются в клиринговый пул, формируемый в Расчетный день, установленный решением Клирингового центра, и прекращаются в указанном клиринговом пуле в соответствии с Правилами клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.
- 31.6. 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.
- 31.7. О мерах, предпринятых по решению Клирингового центра в целях урегулирования чрезвычайной ситуации, Банк России, Участники клиринга и Биржа оповещаются имеющимися доступными средствами связи не позднее дня принятия данных мер.
- 31.8. Клиринговый центр не несет ответственности за убытки, которые могут возникнуть в связи с неосуществлением клирингового обслуживания Участников клиринга в соответствии с Правилами клиринга в случае признания ситуации чрезвычайной в связи с обстоятельствами, предусмотренными пунктом 31.1 общей части Правил клиринга.

## **Статья 32. Порядок разрешения споров**

- 32.1. Все споры и разногласия, возникшие в связи с применением, нарушением, толкованием Правил клиринга, исполнением обязательств, вытекающих из Правил клиринга, признанием недействительными Правил клиринга или их части, подлежат рассмотрению и разрешению в Арбитражной комиссии при ПАО Московская Биржа в соответствии с документами, определяющими ее правовой статус и порядок разрешения споров, действующими на момент подачи искового заявления (за исключением споров и разногласий, стороной по которым является любая из компаний, входящих в Группу «Московская Биржа»).
- 32.2. Все споры и разногласия, возникающие между Участниками клиринга и любой компанией, входящей в Группу «Московская Биржа», в связи с применением, нарушением, толкованием Правил клиринга, исполнением обязательств, вытекающих из Правил клиринга, признанием недействительными Правил клиринга или их части подлежат рассмотрению в Третейском суде НАУФОР в соответствии с его регламентом, действующим на момент подачи искового заявления.
- 32.3. Решения Арбитражной комиссии при ПАО Московская Биржа / Третейского суда НАУФОР являются окончательными и обязательными для исполнения. Неисполненное добровольно решение Арбитражной комиссии при ПАО Московская Биржа / Третейского суда НАУФОР подлежит принудительному исполнению в соответствии с законодательством Российской Федерации или

законодательством страны места принудительного исполнения и/или  
международными соглашениями.

**Приложение № 1**  
к общей части Правил 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>		



**Приложение № 2**  
к общей части Правил клиринга

**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;
    - иные параметры электронного сообщения, необходимые для рассмотрения претензии;
  - архив регистрации транзакций в Клиринговой системе на указанную дату;
  - рабочее место, позволяющее просматривать и распечатывать информацию из архива регистрации транзакций в Клиринговой системе в удобном для восприятия членами технической комиссии виде;
  - документы, подтверждающие направление в установленном порядке уведомления о присвоении идентификатора, являющегося АСП на соответствующем биржевом рынке, 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 идентификатору, являющемуся АСП на соответствующем биржевом рынке;
- фиксирование результатов проверки в протоколе работы технической комиссии.

б) В случае, если:

- электронное сообщение, в отношении которого проводится техническая экспертиза, найдено в архиве регистрации транзакций в Клиринговой системе;
- 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 идентификатору, являющемуся АСП на соответствующем биржевом рынке;

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.

## **Документы, предоставляемые юридическим лицом для заключения Договора об оказании клиринговых услуг**

### **I. Список документов, предоставляемых Резидентом**

- 1) Анкета Участника клиринга (клиента) (Регистрационная карточка), являющаяся приложением к Порядку предоставления информации и отчетности и размещенная на Сайте Клирингового центра в форме электронного документа.
- 2) Копии учредительных документов юридического лица с изменениями и дополнениями с отметкой о регистрации федеральным органом исполнительной власти, уполномоченным на осуществление государственной регистрации юридических лиц. Указанные копии должны быть заверены федеральным органом исполнительной власти, уполномоченным на осуществление государственной регистрации юридических лиц, или нотариально.
- 3) Нотариально удостоверенные копии свидетельств о внесении записей в Единый государственный реестр юридических лиц (ЕГРЮЛ), выданных уполномоченным органом, осуществляющим государственную регистрацию юридических лиц, и подтверждающую факт внесения в ЕГРЮЛ записей о государственной регистрации юридического лица (либо о юридическом лице, зарегистрированном до 1 июля 2002 года).
- 4) Заверенная подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии) копия свидетельства о постановке на учет в налоговом органе юридического лица.
- 5) Копия информационного письма или уведомления о присвоении кодов статистики, заверенная подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии).
- 6) Нотариально удостоверенная копия лицензии Банка России на осуществление банковских операций со средствами в рублях и иностранной валюте (для Кредитных организаций).
- 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 Банка России с подтверждением согласования кандидатуры Руководителя (для Кредитных организаций и для Некредитных организаций – профессиональных участников рынка ценных бумаг);
  - 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 (назначении) Руководителя;
  - копия документа, удостоверяющего личность Руководителя, заверенная

- подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии);
- копия свидетельства о постановке на учет в налоговом органе (ИНН) Руководителя, заверенная подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии), либо письмо в произвольной форме с указанием ИНН (при наличии).
- 9) Оригинал доверенности, или нотариально удостоверенная копия, или копия, заверенная лицом, выдавшим указанную доверенность на представителя юридического лица, уполномоченного подписывать необходимые документы во взаимоотношениях с Клиринговым центром. В случае если доверенность предоставляет полномочия на совершение операций с денежными средствами или иным имуществом, дополнительно предоставляются:
- копия документа, удостоверяющего личность представителя юридического лица, заверенная подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии);
  - копия свидетельства о постановке на учет в налоговом органе (ИНН) представителя юридического лица, заверенная подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии), либо письмо в произвольной форме с указанием ИНН (при наличии).
- 10) Карточка с образцами подписей и оттиска печати юридического лица (при наличии), оформленная в соответствии с требованиями нормативных актов Банка России (либо нотариально удостоверенная копия карточки).
- 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) Отзывы о деловой репутации юридического лица в соответствии с пунктом 9.5 общей части Правил клиринга.
- 13) 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).
- 14) В случае если физическое лицо, на которое требуется предоставить копию документа, удостоверяющего личность, является иностранным гражданином (лицом без гражданства), то дополнительно необходимо предоставить:
- заверенную подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии) копию документа, подтверждающего право иностранного

гражданина (лица без гражданства) на пребывание (проживание) в Российской Федерации (вид на жительство, разрешение на временное проживание, виза, иной документ, подтверждающий в соответствии с законодательством Российской Федерации право иностранного гражданина или лица без гражданства на пребывание (проживание) в Российской Федерации);

- заверенную подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии) копию миграционной карты;
  - письмо со сведениями об адресе места жительства (регистрации) или места пребывания (в случае если такая информация не содержится в иных документах, предоставленных в соответствии с настоящим списком).
- 15) Отчетность, указанную в пунктах 1), 3) или 4) приложения № 4 к общей части Правил клиринга в форме электронного документа:
- Кредитные организации предоставляют месячные формы отчетности - за три последние отчетные даты, квартальные формы отчетности - на последнюю отчетную дату;
  - Некредитные организации, являющиеся профессиональными участниками рынка ценных бумаг, предоставляют квартальные формы отчетности - за две последние отчетные даты, месячные формы отчетности – за три последние отчетные даты;
  - Некредитные организации, не являющиеся профессиональными участниками рынка ценных бумаг, предоставляют годовую отчетность на последнюю отчетную дату;
  - список аффилированных лиц (форма 0409051, форма 0420402 и форма 0420403), актуальный по состоянию на дату предоставления документов.
- 16) Анкета FATCA в форме электронного документа, а также иные прилагаемые к Анкете FATCA документы и сведения, предоставляемые для целей FATCA, в том числе согласие на передачу информации в иностранный налоговый орган.
- 17) Иные документы, которые могут быть запрошены Клиринговым центром в необходимых случаях, также Клиринговый центр вправе потребовать уточнения информации, содержащейся в ранее предоставленных документах.

Документы, предоставляемые юридическим лицом, должны быть действительными на дату их предъявления Клиринговому центру.

К предоставляемым документам прилагается сопроводительное письмо с описью направляемых Клиринговому центру документов.

## **II. Список документов, предоставляемых государственной корпорацией**

- 1) Анкета Участника клиринга (клиента) (Регистрационная карточка), являющаяся приложением к Порядку предоставления информации и отчетности и размещенная на Сайте Клирингового центра в форме электронного документа.
- 2) Копия официальной публикации федерального закона, на основании которого учреждена данная государственная корпорация.
- 3) Заверенная подписью уполномоченного лица и печатью государственной

- корпорации копия свидетельства о постановке на учет в налоговом органе государственной корпорации.
- 4) Копия информационного письма или уведомления о присвоении кодов статистики, заверенная подписью уполномоченного лица и печатью государственной корпорации.
- 5) В отношении Руководителя:
- подлинник или нотариально удостоверенная копия решения уполномоченного органа государственной корпорации (также могут быть предоставлены нотариально удостоверенная выписка из решения или подлинник выписки, заверенный подписью лица, уполномоченного на подписание решения), предусмотренного федеральным законом, определяющим статус, цели деятельности, функции и полномочия данной государственной корпорации, о назначении Руководителя;
  - копия документа, удостоверяющего личность Руководителя государственной корпорации, заверенная подписью уполномоченного лица и печатью государственной корпорации;
  - копия свидетельства о постановке на учет в налоговом органе (ИНН) Руководителя, заверенная подписью уполномоченного лица и печатью государственной корпорации, либо письмо в произвольной форме с указанием ИНН (при наличии).
- 6) Оригинал доверенности, или нотариально удостоверенная копия, или копия, заверенная лицом, выдавшим указанную доверенность на представителя государственной корпорации, уполномоченного подписывать необходимые документы во взаимоотношениях с Клиринговым центром. В случае если доверенность предоставляет полномочия на совершение операций с денежными средствами или иным имуществом, дополнительно предоставляются:
- копия документа, удостоверяющего личность представителя государственной корпорации, заверенная подписью уполномоченного лица и печатью государственной корпорации;
  - копия свидетельства о постановке на учет в налоговом органе (ИНН) представителя государственной корпорации, заверенная подписью уполномоченного лица и печатью государственной корпорации, либо письмо в произвольной форме с указанием ИНН (при наличии).
- 7) Карточка с образцами подписей и оттиска печати государственной корпорации, оформленная в соответствии с требованиями нормативных актов Банка России (либо нотариально удостоверенная копия карточки).
- 8) Отзывы о деловой репутации государственной корпорации в соответствии с пунктом 9.5 общей части Правил клиринга.
- 9) Согласие лиц, указанных в документах государственной корпорации, направляемых в Клиринговый центр в соответствии с Правилами клиринга, на обработку персональных данных по форме, размещенной на Сайте Клирингового центра (в случае, если документы содержат персональные данные субъекта персональных данных в соответствии с Федеральным законом «О персональных данных» и если иное не вытекает из требований законодательства).
- 10) В случае если физическое лицо, на которое требуется предоставить копию документа, удостоверяющего личность, является иностранным гражданином

(лицом без гражданства), то дополнительно необходимо предоставить:

- заверенную подписью уполномоченного лица и печатью государственной корпорации 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 подписью уполномоченного лица и печатью государственной корпорации копию миграционной карты;
  - письмо со сведениями об адресе места жительства (регистрации) или места пребывания (если такая информация не содержится в иных документах, предоставленных в соответствии с настоящим списком).
- 11) Отчетность, указанная в пункте 2) приложения № 4 к общей части Правил клиринга в форме электронного документа: месячные формы отчетности - за три последние отчетные даты, квартальные формы отчетности - на последнюю отчетную дату.
- 12) Анкета FATCA в форме электронного документа, а также иные прилагаемые к Анкете FATCA документы и сведения, предоставляемые для целей FATCA, в том числе согласие на передачу информации в иностранный налоговый орган.
- 13) Иные документы, которые могут быть запрошены Клиринговым центром в необходимых случаях, также Клиринговый центр вправе потребовать уточнения информации, содержащейся в ранее предоставленных документах.

Документы, предоставляемые государственной корпорацией, должны быть действительными на дату их предъявления Клиринговому центру.

К предоставляемым документам прилагается сопроводительное письмо с описью направляемых Клиринговому центру документов.

### **III. Список документов, предоставляемых Международной организацией**

- 1) Анкета Участника клиринга (клиента) (Регистрационная карточка), являющаяся приложением к Порядку предоставления информации и отчетности и размещенная на Сайте Клирингового центра в форме электронного документа.
- 2) Нотариально удостоверенная копия международного договора, включая учредительные документы (со всеми изменениями и дополнениями), или копия, удостоверенная уполномоченным лицом организации, осуществляющей хранение международных договоров в соответствии с законодательством Российской Федерации.
- 3) Заверенная подписью уполномоченного лица и печатью Международной организации (при наличии) копия свидетельства о постановке на учет в налоговом органе (при наличии).
- 4) Копия информационного письма или уведомления о присвоении кодов статистики, заверенная подписью уполномоченного лица и печатью Международной организации (при наличии).

- 5) В отношении лица, уполномоченного действовать от имени Международной организации в соответствии с международным договором и/или учредительными документами (далее - Руководитель):
- нотариально удостоверенная копия протокола или выписка из протокола заседания уполномоченного органа Международной организации, содержащая решение уполномоченного органа Международной организации об избрании (назначении) Руководителя;
  - копия документа, удостоверяющего личность Руководителя, заверенная подписью уполномоченного лица и печатью Международной организации (при наличии);
  - копия свидетельства о постановке на учет в налоговом органе (ИНН) Руководителя, заверенная подписью уполномоченного лица и печатью Международной организации (при наличии), либо письмо в произвольной форме с указанием ИНН (при наличии).
- 6) Оригинал доверенности, или нотариально удостоверенная копия или копия, заверенная лицом, выдавшим указанную доверенность на представителя Международной организации, уполномоченного подписывать необходимые документы во взаимоотношениях с Клиринговым центром. В случае если доверенность предоставляет полномочия на совершение операций с денежными средствами или иным имуществом, дополнительно предоставляются:
- копия документа, удостоверяющего личность представителя Международной организации, заверенная подписью уполномоченного лица и печатью международной организации (при наличии);
  - копия свидетельства о постановке на учет в налоговом органе (ИНН) представителя Международной организации, заверенная подписью уполномоченного лица и печатью Международной организации (при наличии), либо письмо в произвольной форме с указанием ИНН (при наличии).
- 7) Нотариально удостоверенная карточка (либо нотариально удостоверенная копия карточки) или иной документ с образцами подписей и оттиска печати Международной организации (при наличии).
- 8) Отзывы о деловой репутации Международной организации в соответствии с пунктом 9.5 общей части Правил клиринга.
- 9) Согласие лиц, указанных в документах Международной организации, направляемых в Клиринговый центр в соответствии с Правилами клиринга, на обработку персональных данных по форме, размещенной на Сайте Клирингового центра (в случае, если документы содержат персональные данные субъекта персональных данных в соответствии с Федеральным законом «О персональных данных» и если иное не вытекает из требований законодательства).
- 10) В случае если физическое лицо, на которое требуется предоставить копию документа, удостоверяющего личность, является иностранным гражданином (лицом без гражданства), то дополнительно необходимо предоставить:
- заверенную подписью уполномоченного лица и печатью Международной организации (при наличии) копию документа, подтверждающего право иностранного гражданина (лица без гражданства) на пребывание (проживание) в Российской Федерации (вид на жительство, разрешение на



временное проживание, виза, иной документ, подтверждающий в соответствии с законодательством Российской Федерации право иностранного гражданина или лица без гражданства на пребывание (проживание) в Российской Федерации);

- заверенную подписью уполномоченного лица и печатью Международной организации (при наличии) копию миграционной карты;
  - письмо со сведениями об адресе места жительства (регистрации) или места пребывания (если такая информация не содержится в иных документах, предоставленных в соответствии с настоящим списком).
- 11) Отчетность, указанная в пункте 2) приложения № 4 к общей части Правил клиринга в форме электронного документа: месячные формы отчетности - за три последние отчетные даты, квартальные формы отчетности - на последнюю отчетную дату.
  - 12) Анкета физического лица – бенефициарного владельца в форме электронного документа<sup>1</sup>.
  - 13) Анкета FATCA в форме электронного документа, а также иные прилагаемые к Анкете FATCA документы и сведения, предоставляемые для целей FATCA, в том числе согласие на передачу информации в иностранный налоговый орган.
  - 14) Иные документы, которые могут быть запрошены Клиринговым центром в необходимых случаях, также Клиринговый центр вправе потребовать уточнения информации, содержащейся в ранее предоставленных документах.

Документы, предоставляемые Международной организацией, должны быть действительными на дату их предъявления Клиринговому центру.

К предоставляемым документам прилагается сопроводительное письмо с описью направляемых Клиринговому центру документов.

#### **IV. Список документов, предоставляемых Нерезидентом**

- 1) Анкета Участника клиринга (клиента) (Регистрационная карточка), являющаяся приложением к Порядку предоставления информации и отчетности и размещенная на Сайте Клирингового центра в форме электронного документа.
- 2) Опросная Анкета банка-нерезидента.

---

<sup>1</sup> Сведения о бенефициарных владельцах не предоставляются в случаях, перечисленных в статье 7 Федерального закона от 07.08.2001 №115-ФЗ «О противодействии легализации (отмыванию) доходов, полученных преступным путем, и финансированию терроризма».

В случае если владение юридическим лицом либо контроль за ним осуществляется через третьих лиц необходимо предоставить документы (при возможности их получения), подтверждающие право бенефициарного владельца в конечном счете прямо или косвенно (через третьих лиц) владеть юридическим лицом (иметь преобладающее участие более 25 процентов в капитале юридического лица) либо иметь возможность контролировать действия юридического лица, и/или ссылку на общедоступные источники информации. В случае невозможности предоставления подтверждающих документов и/или ссылки на общедоступные источники информации юридическое лицо предоставляет в Банк письмо о невозможности предоставления таких документов/ссылок.

- 3) Письмо – подтверждение (в произвольной форме) об осуществлении юридическим лицом мер по противодействию легализации (отмыванию) доходов, полученных преступным путем, и финансированию терроризма, подписанное уполномоченным лицом юридического лица (для Некредитных организаций - нерезидентов).
- 4) Действующие редакции учредительных документов и все изменения к ним.
- 5) Документ, подтверждающий государственную регистрацию юридического лица.
- 6) Документ о постановке на учет в налоговом органе юридического лица (при наличии).
- 7) Специальное разрешение (лицензия), выданное уполномоченным органом государства юридического лица, на право осуществления деятельности, осуществление которой в соответствии с национальным законодательством государства юридического лица возможно при наличии соответствующего специального разрешения уполномоченного органа.
- 8) Документ, подтверждающий постановку юридического лица на налоговый учет в Российской Федерации (копия, верность которой засвидетельствована нотариусом или самим юридическим лицом) (при наличии).
- 9) В отношении лица, уполномоченного действовать от имени юридического лица в соответствии с учредительными документами (далее по тексту – Руководитель):
  - документ, подтверждающий согласование кандидатуры Руководителя юридического лица уполномоченным органом государства учреждения юридического лица (если такое согласование предусмотрено законодательством государства учреждения юридического лица);
  - документ уполномоченного органа юридического лица, подтверждающий избрание (назначение) Руководителя;
  - копия документа, удостоверяющего личность Руководителя, или других документов, которые установлены федеральным законом или признаваемые в соответствии с международным договором Российской Федерации в качестве документа, удостоверяющего личность;
  - копия свидетельства о постановке на учет в налоговом органе (ИНН) Руководителя, заверенная подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии), либо письмо в произвольной форме с указанием ИНН (при наличии).
- 10) Доверенности на представителей юридического лица, уполномоченных подписывать необходимые документы во взаимоотношениях с Клиринговым центром. В случае если доверенность предоставляет полномочия на совершение операций с денежными средствами или иным имуществом, дополнительно предоставляются:
  - копия документа, удостоверяющего личность представителя, или других документов, которые установлены федеральным законом или признаваемые в соответствии с международным договором Российской Федерации в качестве документа, удостоверяющего личность;
  - копия свидетельства о постановке на учет в налоговом органе (ИНН) представителя, заверенная подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии), либо письмо в произвольной форме с указанием ИНН (при наличии).

- 11) Нотариально удостоверенная карточка или иной документ с образцами подписей и оттиска печати юридического лица (при наличии).
- 12) Отзывы о деловой репутации юридического лица в соответствии с пунктом 9.5 общей части Правил клиринга.
- 13) 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).
- 14) В случае если физическое лицо, на которое требуется предоставить копию документа, удостоверяющего личность, является иностранным гражданином (лицом без гражданства), то дополнительно необходимо предоставить:
  - заверенную подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии) копию документа, подтверждающего право иностранного гражданина (лица без гражданства) на пребывание (проживание) в Российской Федерации (вид на жительство, разрешение на временное проживание, виза, иной документ, подтверждающий в соответствии с законодательством Российской Федерации право иностранного гражданина или лица без гражданства на пребывание (проживание) в Российской Федерации);
  - заверенную подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии) копию миграционной карты;
  - письмо со сведениями об адресе места жительства (регистрации) или места пребывания (если такая информация не содержится в иных документах, предоставленных в соответствии с настоящим списком).
- 15) Отчетность, указанная в пункте б) приложения № 4 к общей части Правил клиринга в форме электронного документа: месячные формы отчетности - за три последние отчетные даты, квартальные формы отчетности - за последнюю отчетную дату.
- 16) Анкета физического лица – бенефициарного владельца в форме электронного документа.<sup>2</sup>

---

<sup>2</sup> Сведения о бенефициарных владельцах не предоставляются в случаях, перечисленных в статье 7 Федерального закона от 07.08.2001 №115-ФЗ «О противодействии легализации (отмыванию) доходов, полученных преступным путем, и финансированию терроризма».

В случае если владение юридическим лицом либо контроль за ним осуществляется через третьих лиц необходимо предоставить документы (при возможности их получения), подтверждающие право бенефициарного владельца в конечном счете прямо или косвенно (через третьих лиц) владеть юридическим лицом (иметь преобладающее участие более 25 процентов в капитале юридического лица) либо иметь возможность контролировать действия юридического лица, и/или ссылку на общедоступные источники информации. В случае невозможности предоставления подтверждающих документов и/или ссылки на общедоступные источники информации юридическое лицо предоставляет в Банк письмо о невозможности предоставления таких документов/ссылок.

- 17) Анкета FATCA в форме электронного документа, а также иные прилагаемые к Анкете FATCA документы и сведения, предоставляемые для целей FATCA, в том числе согласие на передачу информации в иностранный налоговый орган.
- 18) Иные документы, которые могут быть запрошены Клиринговым центром в необходимых случаях, также Клиринговый центр вправе потребовать уточнения информации, содержащейся в ранее предоставленных документах.

Документы (за исключением копий документов, удостоверяющих личность), составленные на территории иностранных государств, должны быть легализованы или апостилированы, если иное не предусмотрено международными договорами Российской Федерации.

Документы (за исключением копий документов, удостоверяющих личность, и документов, содержащих образцы подписей, выданных компетентными органами иностранных государств, составленных на нескольких языках, включая русский язык), составленные полностью или в какой-либо их части на иностранном языке, должны быть переведены на русский язык. Верность перевода или подлинность подписи переводчика должна быть засвидетельствована нотариусом.

Документы, предоставляемые юридическим лицом, должны быть действительными на дату их предъявления Клиринговому центру.

К предоставляемым документам прилагается сопроводительное письмо с описью направляемых Клиринговому центру документов.

### Отчетность, предоставляемая Участниками клиринга Клиринговому центру

- 1) Кредитные организации предоставляют Клиринговому центру:
  - 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) («Базель III») (форма 0409123) – ежемесячно;
  - отчет о финансовых результатах 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;
  - список аффилированных лиц (форма 0409051)<sup>3</sup> – ежеквартально.
- 2) Государственные корпорации и Международные организации предоставляют Клиринговому центру:
  - оборотную ведомость по счетам бухгалтерского учета (форма 0409101) - ежемесячно;
  - отчет о финансовых результатах (форма 0409102) - ежеквартально;
  - расчет собственных средств (капитала) («Базель III») (форма 0409123) – ежемесячно.
- 3) Некредитные организации, являющиеся профессиональными участниками рынка ценных бумаг, предоставляют Клиринговому центру:
  - показатели бухгалтерского баланса (форма 0420410), показатели отчета о финансовых результатах (форма 0420411), сведения о наиболее крупных дебиторах и кредиторах профессионального участника (форма 0420412), сведения о вложениях в выпущенные нерезидентами ценные бумаги (портфельные инвестиции) (форма 0420416)<sup>4</sup>, отчет о движении иностранных активов и пассивов профессионального участника по отношению к нерезидентам при наличии между ним и нерезидентами отношений в рамках прямых инвестиций (форма 0420421)<sup>5</sup>, сведения об аффилированных лицах

---

<sup>3</sup> На дату предоставления Отчета сведения, содержащиеся в нем, должны соответствовать последней актуальной информации об аффилированных лицах, предоставленной в Банк России.

<sup>4</sup> Для профессиональных участников рынка ценных бумаг, включенных в перечень профессиональных участников рынка ценных бумаг, представляющих отчетность по форме 0420416, определенный Банком России в соответствии с нормативным актом Банка России.

<sup>5</sup> Для профессиональных участников рынка ценных бумаг, входящих в перечень профессиональных участников рынка ценных бумаг, представляющих отчетность по форме 0420421, определенный Банком России в соответствии с нормативным актом Банка России.

- профессионального участника (форма 0420402)<sup>6</sup>, сведения об аффилированных лицах, принадлежащих к группе лиц, к которой принадлежит участник (форма 0420403)<sup>7</sup> – ежеквартально;
- расчет размера собственных средств (капитала), информация об участии в судебных процессах, ответчиком в которых выступил профессиональный участник (форма 0420408)<sup>8</sup>, отчет по ценным бумагам (форма 0420415), отчет о внебиржевых сделках (форма 0420417)<sup>9</sup>, сведения об осуществлении брокерской, депозитарной деятельности и деятельности по управлению ценными бумагами (форма 0420418) – ежемесячно.
- 4) Некредитные организации, не являющиеся профессиональными участниками рынка ценных бумаг, предоставляют Клиринговому центру:
- бухгалтерский баланс (форма 0710001) – ежегодно;
  - отчет о финансовых результатах (форма 0710002) – ежегодно.
- 5) Участники клиринга обязаны предоставлять отчетность, указанную в пунктах 1) -4) настоящего приложения к общей части Правилам клиринга, в следующие сроки:
- расчет собственных средств (капитала) («Базель III») (форма 0409123), оборотную ведомость по счетам бухгалтерского учета (форма 0409101), 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;
  - отчет о финансовых результатах (форма 0409102), список аффилированных лиц (форма 0409051) - не позднее 15 рабочего дня месяца, следующего за отчетным кварталом;
  - расчет размера собственных средств, информацию об участии в судебных процессах, ответчиком в которых выступил профессиональный участник (форма 0420408), отчет по ценным бумагам (форма 0420415), отчет о внебиржевых сделках (форма 0420417), сведения об осуществлении брокерской, депозитарной деятельности и деятельности по управлению ценными бумагами (форма 0420418) - не позднее одного календарного месяца, следующего за отчетным месяцем;
  - список аффилированных лиц (форма 0420402), сведения об аффилированных лицах, принадлежащих к группе лиц, к которой принадлежит участник (форма 0420403), показатели бухгалтерского баланса (форма 0420410),

---

<sup>6</sup> На дату предоставления Отчета сведения, содержащиеся в нем, должны соответствовать последней актуальной информации об аффилированных лицах, предоставленной в Банк России.

<sup>8</sup> На дату предоставления Отчета сведения, содержащиеся в нем, должны соответствовать последней актуальной информации об участии в судебных процессах, ответчиком в которых выступил профессиональный участник, предоставленной в Банк России.

<sup>9</sup> Для профессиональных участников, входящих в Список профессиональных участников рынка ценных бумаг, установленный Банком России в соответствии с нормативным актом Банка России, Отчет предоставляется за неделю, в которую входит последний календарный день отчетного месяца.

показатели отчета о финансовых результатах (форма 0420411), сведения о наиболее крупных дебиторах и кредиторах профессионального участника (форма 0420412), сведения о вложениях в выпущенные нерезидентами ценные бумаги (портфельные инвестиции) (форма 0420416), отчет о движении иностранных активов и пассивов профессионального участника по отношению к нерезидентам при наличии между ним и нерезидентами отношений в рамках прямых инвестиций (форма 0420421) – не позднее одного календарного месяца, следующего за отчетным кварталом;

- бухгалтерский баланс некредитной организации (форма 0710001), отчет о финансовых результатах некредитной организации (форма 0710002) - не позднее 15 апреля года, следующего за отчетным.

б) Банки-нерезиденты и Некредитные организации-нерезиденты, а также Банки ЕврАзЭС/ЕАЭС (далее – Нерезиденты) не позднее 15 (пятнадцати) рабочих дней с даты сдачи квартальной отчетности соответственно или с даты, определенной компетентным органом государства учреждения Нерезидента для сдачи квартальной отчетности соответственно (в случае если сроки сдачи отчетности устанавливаются компетентным органом государства учреждения Нерезидента), предоставляют Клиринговому центру следующие документы, составленные на русском или английском языке:

- финансовая отчетность по МСФО на русском или английском языке, а при ее отсутствии бухгалтерский баланс (оборотная ведомость по счетам бухгалтерского учета), отчет о прибылях и убытках и расчет собственных средств (капитала) (при наличии) в соответствии с установленными национальными стандартами бухгалтерского учета и отчетности - ежеквартально;
- основные показатели деятельности Нерезидента (по формам приложения № 3 (для банков ЕврАзЭС/ЕАЭС) и приложения № 4 (для Банков-Нерезидентов и некредитных организаций-нерезидентов) к Порядку предоставления информации и отчетности) - ежеквартально;
- документ, подтверждающий сведения о фактических и допустимых значениях обязательных нормативов деятельности, установленных компетентным органом, в случае если в соответствии с национальным законодательством государства учреждения Нерезидента такие обязательные нормативы устанавливаются – ежеквартально.

Нерезиденты не позднее 15 (пятнадцатого) рабочего дня с даты подписания отчетности организацией, проводившей аудит Нерезидента, предоставляют:

- финансовую отчетность по МСФО на русском или английском языке за последний отчетный год, заверенную аудитором, а при ее отсутствии аудированную финансовую отчетность, составленную в соответствии с требованиями национального законодательства государства учреждения Нерезидента - ежегодно.

7) Форматы предоставления отчетности, указанной в настоящем приложении к общей части Правил клиринга, определены Порядком предоставления информации и отчетности.

8) Документы, указанные в пункте б), должны быть апостилированы или легализованы в установленном порядке, переведены на русский язык. Верность

перевода или подлинность подписи переводчика должна быть засвидетельствована нотариусом.



**Приложение № 5**  
к общей части Правил клиринга

**Временной регламент**

№ п/п	Наименование операции	Время (московское)
1.	Передача Клиринговым центром Участникам клиринга Отчетов о гарантийных фондах, Отчетов об обеспечении под стресс.	до 10:15
2.	Исполнение Маржинальных требований по фондам, Маржинальных требований по обеспечению под стресс.	до 17:30 дня возникновения соответствующего Маржинального требования
3.	Передача Участником клиринга Клиринговому центру Распоряжений на внесение денежных средств в Гарантийные фонды / Обеспечение под стресс (с использованием Клиринговой системы).	с 09:30 до 20:00 Расчетного дня
4.	Передача Участником клиринга Клиринговому центру Запросов о возврате денежных средств из гарантийных фондов / обеспечения под стресс.	с 09:30 до 20:00 Расчетного дня
5.	Передача Участником клиринга Клиринговому центру Распоряжений на внесение ценных бумаг в Гарантийные фонды / Обеспечение под стресс (с использованием Клиринговой системы).	с 09:30 до 20:30 Расчетного дня
6.	Передача Участником клиринга Клиринговому центру Запросов о возврате ценных бумаг из гарантийных фондов / обеспечения под стресс (с использованием Клиринговой системы).	с 09:30 до 20:30 Расчетного дня
7.	Передача Обособленным клиентом Клиринговому центру Заявления на перевод обязательств и Обеспечения.	до 16:00 дня, следующего за днем начала процедуры Перевода обязательств и Обеспечения, при проведении процедуры Перевода обязательств и Обеспечения по основаниям, установленным законодательством; с 9:00 до 18:00 рабочего дня при проведении процедуры Перевода обязательств и Обеспечения по иным основаниям
8.	Передача Клиринговым центром Участнику клиринга – реципиенту сообщения о размере обязательств / требований Базового Участника клиринга в денежных средствах / ценных бумагах / драгоценных металлах по обязательствам, допущенным к клирингу, по сделкам, заключенным за счет Обособленного клиента, а также о размере Обеспечения Базового Участника клиринга в денежных средствах / ценных бумагах / драгоценных металлах, учитываемых по Расчетному коду Базового Участника клиринга, за которым закреплен Обособленный клиент, предоставивший Заявление на перевод обязательств и Обеспечения.	не позднее 17:45 дня, следующего за днем начала процедуры Перевода обязательств и Обеспечения, при проведении процедуры Перевода обязательств и Обеспечения по основаниям, установленным законодательством; не позднее 17:45 Расчетного дня, следующего за днем начала процедуры Перевода обязательств и Обеспечения, при проведении процедуры Перевода обязательств и Обеспечения по иным основаниям
9.	Передача Участником клиринга – реципиентом	не позднее 18:30 дня, следующего за

	Клиринговому центру Согласия на прием.	днем начала процедуры Перевода обязательств и Обеспечения, при проведении процедуры Перевода обязательств и Обеспечения по основаниям, установленным законодательством; не позднее 18:30 Расчетного дня, следующего за днем начала процедуры Перевода обязательств и Обеспечения, при проведении процедуры Перевода обязательств и Обеспечения по иным основаниям
--	--	--