

Центральный Банк
Российской Федерации (Банк России)

ЗАРЕГИСТРИРОВАНО

Дата 12 ноября 2015 г.

УТВЕРЖДЕНЫ

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

24 сентября 2015 года (Протокол № 4)

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



Лыков С.П.

**ПРАВИЛА КЛИРИНГА
БАНКА «НАЦИОНАЛЬНЫЙ КЛИРИНГОВЫЙ ЦЕНТР»
(АКЦИОНЕРНОЕ ОБЩЕСТВО).
ЧАСТЬ VI. ПРАВИЛА КЛИРИНГА НА ТОВАРНОМ РЫНКЕ**

**г. Москва
2015 г.**

СОДЕРЖАНИЕ

РАЗДЕЛ I. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ	4
Статья 1. Термины и определения	4
Статья 2. Общие положения	4
Статья 3. Особенности использования Аналога собственноручной подписи	6
Статья 4. Торговые и клиринговые счета	6
Статья 5. Клиринговые регистры	7
РАЗДЕЛ II. ТРЕБОВАНИЯ К УЧАСТНИКАМ КЛИРИНГА	8
Статья 6. Условия клирингового обслуживания. Порядок предоставления допуска к клиринговому обслуживанию	8
Статья 7. Особенности регистрации Участников клиринга, особенности открытия Участникам клиринга Расчетных кодов, порядок регистрации Торгово-клиринговых счетов Участников клиринга	9
Статья 8. Особенности регистрации Обособленных клиентов	10
Статья 9. Особенности приостановления и прекращения допуска к клиринговому обслуживанию	10
РАЗДЕЛ III. МЕРЫ, НАПРАВЛЕННЫЕ НА УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ ПРИ ОСУЩЕСТВЛЕНИИ КЛИРИНГА	11
Статья 10. Перечень мер, направленных на управление рисками при осуществлении клиринга	11
Статья 11. Единый лимит по Расчетному коду и риск-параметры	11
РАЗДЕЛ IV. ПОРЯДОК И УСЛОВИЯ ДОПУСКА ОБЯЗАТЕЛЬСТВ К КЛИРИНГУ ...	15
Статья 12. Порядок взаимодействия с Биржей при подаче заявок и заключении Договоров	15
РАЗДЕЛ V. ПОРЯДОК ПРОВЕДЕНИЯ КЛИРИНГА	19
ПОДРАЗДЕЛ V-I. ПОРЯДОК ВНЕСЕНИЯ И ВОЗВРАТА ОБЕСПЕЧЕНИЯ	19
Статья 13. Порядок внесения Обеспечения	19
Статья 14. Порядок возврата Обеспечения	20
ПОДРАЗДЕЛ V-II. КЛИРИНГОВЫЕ СЕССИИ	24
Статья 15. Порядок проведения клиринговых сессий. Порядок возникновения и исполнения Маржинальных требований	24
ПОДРАЗДЕЛ V-III. ПОРЯДОК ОПРЕДЕЛЕНИЯ И ИСПОЛНЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ	

ПО ДОГОВОРАМ	26
Статья 16. Порядок включения в клиринговый пул обязательств по Договорам.....	26
Статья 17. Порядок действий в случае наличия обязательств, не обеспеченных средствами под исполнение	28
ПОДРАЗДЕЛ V-IV. ПОРЯДОК ИСПОЛНЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ, ВКЛЮЧЕННЫХ В КЛИРИНГОВЫЙ ПУЛ	33
Статья 18. Порядок исполнения обязательств и требований Участников клиринга и/или Клирингового центра, включенных в клиринговый пул	33
РАЗДЕЛ VI. ПОРЯДОК ВЗАИМОДЕЙСТВИЯ С ОПЕРАТОРОМ ТОВАРНЫХ ПОСТАВОК	35
Статья 19. Порядок взаимодействия с Оператором товарных поставок	35
РАЗДЕЛ VII. ПОРЯДОК ОПЛАТЫ УСЛУГ. ОТЧЕТЫ ПО ИТОГАМ КЛИРИНГА	37
Статья 20. Порядок оплаты услуг Клирингового центра, Биржи, Технического центра, Оператора товарных поставок и Экспедитора	37
Статья 21. Порядок предоставления отчетов по итогам клиринга.....	41
РАЗДЕЛ VIII. ПРОЧИЕ УСЛОВИЯ	43
Статья 22. Особенности перевода обязательств и Обеспечения одного Участника клиринга другому Участнику клиринга	43
Приложение № 1 Временной регламент на товарном рынке	44

РАЗДЕЛ I. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ

Настоящие «Правила клиринга Банка «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество). Часть VI. Правила клиринга на товарном рынке» (далее – Правила клиринга на товарном рынке) являются неотъемлемой частью Правил клиринга Банка «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество) и совместно с «Правилами клиринга Банка «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество). Часть I. Общая часть» (далее – общая часть Правил клиринга) и «Правилами клиринга Банка «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество). Часть II. Тарифы» (далее – Тарифы Клирингового центра) регулируют отношения, связанные с исполнением договоров, являющихся производными финансовыми инструментами, базисным активом которых является товар, заключаемых на торгах, организуемых ЗАО НТБ.

Статья 1. Термины и определения

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

<i>Договор ПФИ-</i>	своп договор или форвардный договор, заключаемый на Торгах Биржи.
<i>Методика определения расчетной цены -</i>	внутренний документ Биржи, устанавливающий порядок определения Расчетной цены и Расчетной цены своп.
<i>Методика определения риск-параметров товарного рынка -</i>	внутренний документ Клирингового центра, устанавливающий порядок определения риск-параметров товарного рынка ЗАО НТБ.
<i>Нетто-обязательство по денежным средствам по спот договорам -</i>	обязательства Участника клиринга по оплате товара по спот договорам, не прекращенные в результате неттинга в ходе клиринга в соответствии с Правилами клиринга на товарном рынке.
<i>Нетто-требование по денежным средствам по спот договорам -</i>	требования Участника клиринга по оплате товара по спот договорам, не прекращенные в результате неттинга в ходе клиринга в соответствии с Правилами клиринга на товарном рынке.

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

Статья 2. Общие положения

2.1. Клиринговый центр осуществляет клиринг, выполняя функции центрального контрагента по всем Договорам ПФИ, стороной по которым являются Участники клиринга.

2.2. Клиринговый центр осуществляет клиринг по спот договорам без выполнения функций центрального контрагента.

- 2.3. Клиринговый центр осуществляет по Договорам ПФИ клиринг с частичным обеспечением и клиринг с полным обеспечением по товарам и/или денежным средствам.
- 2.3.1. Клиринговый центр осуществляет клиринг с частичным обеспечением по товару:
- по форвардным договорам, заключенным Участниками клиринга категории «Б», в которых количество дней между датой заключения и Датой исполнения больше или равно количеству дней, установленному решением Клирингового центра;
 - по вторым частям своп договоров.
- 2.3.2. Клиринговый центр осуществляет клиринг с частичным обеспечением по денежным средствам:
- по форвардным договорам, заключенным Участниками клиринга категории «Б»;
 - по вторым частям своп договоров.
- 2.3.3. Клиринговый центр осуществляет клиринг с полным обеспечением по товару:
- по форвардным договорам, заключенным Участниками клиринга категории «Б», в которых количество дней между датой заключения и Датой исполнения меньше количества дней, установленного решением Клирингового центра;
 - по форвардным договорам, заключенным Участниками клиринга категории «В»;
 - по первым частям своп договоров.
- 2.3.4. Клиринговый центр осуществляет клиринг с полным обеспечением по денежным средствам:
- по форвардным договорам, заключенным Участниками клиринга категории «В».
 - по первым частям своп договоров.
- 2.3.5. Участник клиринга категории «Б» при подаче заявки на продажу на заключение форвардного договора, у которого количество дней между датой заключения и Датой исполнения больше или равно количеству дней, установленному решением Клирингового центра, вправе указать, что по форвардному договору, заключенному на основании такой заявки должен осуществляться клиринг с полным обеспечением по товару.
- 2.4. Клиринговый центр осуществляет по спот договорам клиринг с полным обеспечением по товару и клиринг без предварительного обеспечения по денежным средствам.
- 2.5. Обмен электронными документами между Участником клиринга и Клиринговым центром осуществляется посредством ЭДО и/или системы S.W.I.F.T., порядок использования которых установлен общей частью Правил клиринга.
- 2.5.1. В случае несоответствия информации, содержащейся в электронном документе, направленном посредством 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 ЭДО, во вторую - посредством системы S.W.I.F.T.

- 2.6. Формы и форматы документов, предоставляемых Участниками клиринга и/или их клиентами Клиринговому центру в соответствии с Правилами клиринга на товарном рынке и способ их предоставления установлены документом «Формы и форматы документов, предоставляемых Участниками клиринга, клиентами Участников клиринга на товарном рынке», если иное не установлено Правилами клиринга.
- 2.7. Сроки исполнения обязательств, определенных Правилами клиринга на товарном рынке, время проведения клиринговых сессий, а также сроки проведения клиринговых операций, сроки предоставления документов Клиринговому центру / Клиринговым центром в процессе взаимодействия с Участниками клиринга при проведении клиринга и расчетов по Договорам в соответствии с Правилами клиринга на товарном рынке, установлены Временным регламентом на товарном рынке, являющимся приложением № 1 к Правилам клиринга на товарном рынке.
- 2.8. Техническим центром на товарном рынке является ЗАО НТБ.

Статья 3. Особенности использования Аналога собственноручной подписи

- 3.1. Аналогом собственноручной подписи признается Клиринговый идентификатор, позволяющий однозначно идентифицировать Участника клиринга или Клиринговый центр, направивших электронное сообщение и достоверно установить, что электронное сообщение исходит от Участника клиринга или Клирингового центра, которому присвоен данный Клиринговый идентификатор.
- 3.2. Присвоение Клирингового идентификатора Участнику клиринга или Клиринговому центру осуществляется Клиринговым центром.
Порядок присвоения Клирингового идентификатора Участнику клиринга определен общей частью Правил клиринга.
Включение информации о Клиринговом идентификаторе Участника клиринга в состав ежедневного Отчета о Клиринговых идентификаторах, считается уведомлением о присвоении Клирингового идентификатора Участнику клиринга.
Сведения о присвоенных Клиринговых идентификаторах относятся к конфиденциальным. Участник клиринга и Клиринговый центр обеспечивают соблюдение требований о конфиденциальности и несут риск последствий, связанных с нарушением таких требований.

Статья 4. Торговые и клиринговые счета

- 4.1. При осуществлении клиринга на товарном рынке Клиринговый центр использует следующие типы торговых товарных счетов Участников клиринга, открытых Оператором товарных поставок с указанием Клирингового центра в качестве клиринговой организации, которая вправе давать распоряжения по этим счетам:
 - торговый товарный счет для учета товаров Участника клиринга;
 - торговый товарный счет для учета товаров клиента Участника клиринга.

- 4.2. При осуществлении клиринга на товарном рынке Клиринговый центр использует:
- торговые разделы торговых товарных счетов, открытых Оператором товарных поставок (далее – торговые разделы);
 - поставочные разделы торговых товарных счетов, открытых Оператором товарных поставок (далее – поставочные разделы).
- 4.3. При осуществлении клиринга на товарном рынке Клиринговый центр использует клиринговые счета, предусмотренные общей частью Правил клиринга.

Статья 5. Клиринговые регистры

- 5.1. При осуществлении клиринга на товарном рынке Клиринговый центр открывает и ведет клиринговые регистры, предусмотренные общей частью Правил клиринга, а также на клиринговых регистрах Клиринговый центр учитывает:
- Единый лимит по Расчетным кодам;
 - обязанности и требования Участника клиринга по каждому Договору, обязательства по которому допущены к клирингу;
 - Нетто-обязательства / Нетто-требования Участника клиринга по денежным средствам в разрезе Счетов обеспечения и Дат исполнения, определенные по Договорам ПФИ;
 - Нетто-обязательства / Нетто-требования Участника клиринга по товарам в разрезе торговых разделов, товаров, Дат исполнения, определенные по Договорам ПФИ;
 - Нетто-обязательства / Нетто-требования Участника клиринга по денежным средствам по спот договорам в разрезе Счетов обеспечения;
 - Обеспечение Участника клиринга в денежных средствах в разрезе Счетов обеспечения и валют;
 - Обеспечение Участника клиринга в товарах в разрезе торговых разделов и товаров (с основными характеристиками);
 - Обеспечение Участника клиринга в товарах в разрезе торговых разделов и товаров с полным набором характеристик, включая основные и дополнительные характеристики. Обеспечение Участника клиринга в товарах с полным набором характеристик может учитываться с признаком «получено по договорам своп»;
 - Маржинальное требование Участника клиринга в разрезе Расчетных кодов (в случае наличия).
- 5.2. Обеспечение Участника клиринга в российских рублях и иностранной валюте по Расчетному коду учитывается по Счетам обеспечения в соответствующей валюте, соответствующим Расчетному коду.
- 5.3. Порядок ведения клиринговых регистров определен в соответствующих статьях разделов IV и V Правил клиринга на товарном рынке.

РАЗДЕЛ II. ТРЕБОВАНИЯ К УЧАСТНИКАМ КЛИРИНГА

Статья 6. Условия клирингового обслуживания. Порядок предоставления допуска к клиринговому обслуживанию

6.1. На товарном рынке Участникам клиринга могут быть присвоены следующие категории Участников клиринга:

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

6.2. Допуск к клиринговому обслуживанию на товарном рынке предоставляется Участнику клиринга, соответствующему требованиям, установленным для категории «Б» в общей части Правил клиринга, а также требованиям, указанным в пункте 6.3 Правил клиринга на товарном рынке.

6.3. Для допуска к клиринговому обслуживанию Участник клиринга должен дополнительно соответствовать следующим требованиям:

6.3.1. иметь хотя бы один зарегистрированный в Клиринговом центре Торгово-клиринговый счет;

6.3.2. Участник клиринга, не являющийся профессиональным участником рынка ценных бумаг, - иметь собственные средства (капитал) не менее 1 000 000 000 (одного миллиарда) российских рублей, либо

6.3.3. Участник клиринга, не являющийся профессиональным участником рынка ценных бумаг, - иметь собственные средства (капитал) не менее 100 000 000 (ста миллионов) российских рублей и предоставить письмо, выданное организацией, имеющей право прямо или косвенно осуществлять контроль за деятельностью Участника клиринга, собственные средства (капитал) которой не менее 1 000 000 000 (одного миллиарда) российских рублей, содержащее:

- 1) подтверждение, что указанная организация знает о намерении лица, в отношении которого выдается указанное письмо, получить статус Участника клиринга на товарном рынке ЗАО НТБ;
- 2) сведения о доле участия организации, выдающей указанное письмо, в организации, в отношении которой выдается указанное письмо и/или подтверждение осуществления контроля и заверение об отсутствии намерений уменьшить указанную долю / прекратить осуществлять контроль;
- 3) подтверждение намерения организации, выдающей указанное письмо, в случае недостаточности у Участника клиринга, в отношении которого выдается такое письмо, денежных средств для исполнения своих обязательств перед Клиринговым центром, предоставить Участнику клиринга необходимое финансирование.

Указанное в настоящем подпункте Правил клиринга на товарном рынке письмо может быть предоставлено на русском или английском языке.

6.4. Клиринговый центр вправе предоставить Участнику клиринга допуск к клиринговому обслуживанию как по всем инструментам, так и по ограниченному перечню инструментов.

- 6.5. Клиринговый центр вправе установить Участнику клиринга категорию «В» по основаниям, предусмотренным общей частью Правил клиринга.
- 6.6. Участник клиринга на товарном рынке не вправе предоставить Клиринговому центру Заявление об изменении категории Участника клиринга.

Статья 7. Особенности регистрации Участников клиринга, особенности открытия Участникам клиринга Расчетных кодов, порядок регистрации Торгово-клиринговых счетов Участников клиринга

7.1. Процедура регистрации Участника клиринга Клиринговым центром предусматривает присвоение Участнику клиринга следующего идентификатора, помимо кодов, установленных общей частью Правил клиринга:

- Идентификатор (присваивается Клиринговым центром на основании данных, полученных от Биржи).

7.2. При осуществлении клиринга на товарном рынке Участнику клиринга могут быть открыты собственные и клиентские Расчетные коды.

7.3. В состав Торгово-клирингового счета Участника клиринга, используемого на товарном рынке, входят Расчетный код и торговый раздел соответствующих типов:

- собственный Расчетный код и торговый раздел торгового товарного счета для учета товаров Участника клиринга;
- клиентский Расчетный код и торговый раздел торгового товарного счета для учета товаров клиента Участника клиринга.

Один торговый раздел может входить в состав только одного Торгово-клирингового счета.

Один Расчетный код может входить в состав нескольких Торгово-клиринговых счетов.

7.4. Для регистрации Торгово-клирингового счета Участника клиринга, устанавливающего однозначное соответствие между торговым разделом и Расчетным кодом, а также в случае необходимости изменения такого соответствия Участник клиринга обязан предоставить Клиринговому центру Заявление на регистрацию ТКС.

7.5. Клиринговый центр посредством Системы торгов передает Бирже информацию о зарегистрированных Участниками клиринга Торгово-клиринговых счетах и об Обособленных клиентах, для которых открыты отдельные клиентские Расчетные коды.

7.6. Расчет Единого лимита, определение Нетто-обязательств / Нетто-требований, Нетто-обязательств / Нетто-требований Участника клиринга по денежным средствам по спот договорам, Задолженностей Участника клиринга, проверка возможности регистрации заявок, перечисление и учет денежных средств Участника клиринга, исполнение (прекращение) обязательств по Договорам, возникновение и прекращение Маржинального требования, уплата комиссионных вознаграждений осуществляется по Расчетному коду Участника клиринга.

Статья 8. Особенности регистрации Обособленных клиентов

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

Статья 9. Особенности приостановления и прекращения допуска к клиринговому обслуживанию

- 9.1. Клиринговый центр вправе установить Участнику клиринга категории «Б» категорию «В», а также приостановить допуск к клиринговому обслуживанию Участника клиринга по всем сделкам или по отдельным видам сделок по основаниям, предусмотренным общей частью Правил клиринга, а также в следующем случае:
 - 9.1.1. при несоответствии размера собственных средств (капитала) Участника клиринга требованию, установленному подпунктом 6.3.2 или 6.3.3 Правил клиринга на товарном рынке.
- 9.2. Клиринговый центр вправе приостановить допуск к клиринговому обслуживанию Участника клиринга по всем сделкам или по отдельным видам сделок, по основаниям, указанным в пункте 9.1 Правил клиринга на товарном рынке, а также по следующему основанию:
 - 9.2.1. при отсутствии хотя бы одного зарегистрированного Торгово-клирингового счета.

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

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

- 10.1. В целях снижения рисков, связанных с осуществлением клиринга на товарном рынке, Клиринговый центр применяет меры, предусмотренные общей частью Правил клиринга.
- 10.2. Клиринговый центр вправе установить ограничение на количество товара, принимаемого в Обеспечение Участника клиринга, путем установления равной нулю любой из Нижних границ диапазона оценки рыночных рисков по такому товару для отдельного Участника клиринга или для всех Участников клиринга.
- 10.3. Гарантийный фонд формируется Клиринговым центром за счет взносов в Гарантийный фонд всех Участников клиринга категории «Б».
Размер взноса в Гарантийный фонд каждого Участника клиринга категории «Б» составляет 1 000 000 (один миллион) российских рублей.
- 10.4. Обеспечение под стресс обязаны вносить Участники клиринга категории «Б».
Порядок определения размера Обеспечения под стресс Участника клиринга установлен Методикой определения размера Обеспечения под стресс.
- 10.5. При неисполнении Участником клиринга Маржинального требования по фондам и/или Маржинального требования по обеспечению под стресс, порядок выставления и исполнения которых определен общей частью Правил клиринга Участнику клиринга категории «Б» устанавливается категория «В».
- 10.6. При использовании взноса Участника клиринга в Гарантийный фонд товарного рынка и/или Обеспечения под стресс на товарном рынке, Участнику клиринга категории «Б» устанавливается категория «В».
- 10.7. В случае возмещения Недобросовестным участником клиринга средств Гарантийного фонда товарного рынка и Обеспечения под стресс на товарном рынке в течение 1 (одного) Расчетного дня после направления Клиринговым центром такому Недобросовестному Участнику клиринга Маржинального требования по фонду и/или Маржинального требования по Обеспечению под стресс, Участнику клиринга категории «В» устанавливается категория «Б».
- 10.8. Выделенный капитал Клирингового центра на товарном рынке составляет 100 000 000 (сто миллионов) российских рублей.

Статья 11. Единый лимит по Расчетному коду и риск-параметры

- 11.1. Единый лимит по Расчетному коду рассчитывается Клиринговым центром при изменении размера Обеспечения Участника клиринга, при подаче Участником торгов заявок на заключение Договоров, стороной по которым будет являться Участник клиринга, при заключении Договоров или исполнении / прекращении

обязательств по Договорам, стороной по которым является Участник клиринга, изменении риск-параметров.

- 11.2. Единый лимит по Расчетному коду используется для проверки возможности подачи Участником торгов заявок на заключение Договоров, стороной по которым будет являться Участник клиринга, возврата Участнику клиринга Обеспечения в денежных средствах / товарах, а также выполнения иных операций, предусмотренных Правилами клиринга на товарном рынке. Указанная проверка осуществляется, исходя из анализа изменения значения Единого лимита по Расчетному коду до и после проведения соответствующей операции.
- 11.3. Единый лимит по Расчетному коду рассчитывается с учетом:
- Обеспечения Участника клиринга в российских рублях и иностранной валюте, учитываемого по Счетам обеспечения, относящимся к Расчетному коду;
 - Обеспечения Участника клиринга в товарах, учитываемых по торговым разделам, входящим в состав Торгово-клиринговых счетов совместно с Расчетным кодом;
 - Нетто-обязательств / Нетто-требований Участника клиринга в российских рублях / товарах, учитываемых по Счету обеспечения / всем торговым товарным счетам, относящимся к Расчетному коду, по всем Датам исполнения;
 - обязательств по уплате комиссионных вознаграждений учитываемых по Счету обеспечения в российских рублях, относящемуся к Расчетному коду, за исключением обязательств по уплате транспортного дифференциала;
 - Задолженности Участника клиринга перед Клиринговым центром, учитываемой по Счету обеспечения в российских рублях, относящемуся к Расчетному коду;
 - обязательства Участника клиринга по возврату Клиринговому центру денежных средств, указанного в пункте 17.5 Правил клиринга на товарном рынке, учитываемого по Счету обеспечения в российских рублях, относящемуся к Расчетному коду.
- 11.4. Единый лимит по Расчетному коду в ходе торгов рассчитывается Клиринговым центром с учетом поданных Участником торгов и зарегистрированных заявок на заключение Договоров, стороной которых будет являться Участник клиринга.
- 11.5. Базовыми риск-параметрами, используемыми Клиринговым центром для контроля и управления рисками, являются:
- Расчетная цена;
 - Верхняя и Нижняя границы ценового коридора;
 - Верхняя и Нижняя границы диапазона оценки рыночных рисков;
 - Расчетная цена своп;
 - Верхняя и Нижняя границы коридора цен своп;
 - Верхняя и Нижняя границы диапазона оценки процентных рисков.
- Помимо базовых риск-параметров Клиринговым центром используются

дополнительные риск-параметры, приведенные в Методике определения риск-параметров товарного рынка.

Расчетная цена и Расчетная цена своп определяются в соответствии с Методикой определения расчетной цены.

- 11.6. Верхняя и Нижняя границы диапазона оценки рыночных рисков и Верхняя и Нижняя граница диапазона оценки процентных рисков, используемые при расчете Единого лимита по Расчетному коду, зависят от объема обязательств Участника клиринга по передаче товаров по Договорам, учитываемых по Торгово-клиринговому счету, относящемуся к такому Расчетному коду.
- 11.7. Клиринговый центр вправе установить индивидуальные Верхние и Нижние границы диапазона оценки рыночных рисков и Верхние и Нижние границы диапазона оценки процентных рисков, расширяющие указанные диапазоны, для одного или нескольких Участников клиринга.
- 11.8. Участник клиринга категории «Б» вправе с использованием Клиринговой системы установить индивидуальные Верхние и Нижние границы диапазона оценки рыночных рисков и Верхние и Нижние границы диапазона оценки процентных рисков, расширяющие указанные диапазоны, для определенных Расчетных кодов Участника клиринга.
- 11.9. Расчет и изменение риск-параметров осуществляется Клиринговым центром каждый Расчетный день по состоянию на момент времени окончания Торгов, установленный Биржей.
Клиринговый центр может принять решение об изменении риск-параметров до начала и в ходе торгов.
Порядок расчета и изменения риск-параметров установлен Методикой определения риск-параметров товарного рынка.
- 11.10. Единый лимит Участника клиринга рассчитывается Клиринговым центром исходя из оценки в российских рублях максимально возможного уменьшения в течение срока, необходимого для прекращения обязательств по Договорам в случае неисполнения Участником клиринга Маржинального требования, общей стоимости активов и обязательств Участника клиринга, указанных в пункте 11.3 Правил клиринга на товарном рынке, в связи с изменением Расчетных цен товаров и/или изменением процентных ставок по своп договорам.
При расчете Единого лимита по Расчетному коду обязательства по Договорам, которые могут быть заключены на основании зарегистрированных заявок, Нетто-обязательства и Задолженности учитываются со знаком «минус», требования по Договорам, которые могут быть заключены на основании зарегистрированных заявок, Нетто-требования и Обеспечение— со знаком «плюс».
Для целей расчета Единого лимита по Расчетному коду Нетто-обязательства и Нетто-требования, учитываемые по одному Счету обеспечения / Торгово-клиринговому счету, относящемуся к Расчетному коду, в одной валюте / в одном и том же товаре с разными Датами исполнения складываются с учетом знака.
Указанная оценка проводится с использованием Верхних и Нижних границ диапазона оценки рыночных рисков и Верхних и Нижних границ диапазона оценки

процентных рисков.

Рассчитанный в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга на товарном рынке Единый лимит по Расчетному коду корректируется (складывается с учетом знака) с итоговой корректировкой Единого лимита по Расчетному коду с учетом Расчетных цен своп, рассчитанной как сумма с учетом знака корректировок Единого лимита по Расчетному коду с учетом Расчетных цен своп по каждому товару и каждой Дате исполнения, отстоящей от текущей даты более, чем на 1 (один) Расчетный день.

РАЗДЕЛ IV. ПОРЯДОК И УСЛОВИЯ ДОПУСКА ОБЯЗАТЕЛЬСТВ К КЛИРИНГУ

Статья 12. Порядок взаимодействия с Биржей при подаче заявок и заключении Договоров

- 12.1. Немедленно после того, как информация о поданной Участником торгов заявке на продажу, направленной на заключение форвардного договора, по которому осуществляется клиринг с полным обеспечением по товару, стороной по которому будет являться Участник клиринга, стала доступной Клиринговому центру посредством Системы торгов, Клиринговый центр:
- 12.1.1. проверяет, что значение цены, указанной в заявке, больше либо равно Нижней границе ценового коридора и меньше либо равно Верхней границе ценового коридора, установленных Клиринговым центром для товара, по которому подана заявка;
 - 12.1.2. проверяет, что размер обязательства по передаче товара по Договору, который может быть заключен на основании поданной заявки, не превышает Обеспечения Участника клиринга в таком товаре с полным набором характеристик, соответствующих набору характеристик товара, указанных в заявке, учитываемого по торговому разделу, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в заявке, и не имеющего признака «получено по договорам своп»;
 - 12.1.3. проверяет достаточность Единого лимита Участника клиринга по Расчетному коду, соответствующему Счету обеспечения, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в заявке, в соответствии с пунктом 12.5 Правил клиринга на товарном рынке.
- 12.2. Немедленно после того, как информация о поданной Участником торгов заявке на продажу, направленной на заключение своп договора, по которому осуществляется клиринг с полным обеспечением по товару, стороной по которому будет являться Участник клиринга, стала доступной Клиринговому центру посредством Системы торгов, Клиринговый центр:
- 12.2.1. проверяет, что значение цены, указанной в заявке, больше либо равно Нижней границе цен своп и меньше либо равно Верхней границе коридора цен своп, установленных Клиринговым центром для товара, по которому подана заявка;
 - 12.2.2. проверяет, что размер обязательства по передаче товара по первой части своп договора, который может быть заключен на основании поданной заявки, не превышает Обеспечения Участника клиринга в таком товаре, учитываемого по торговому разделу, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в заявке, учитываемого по тому же торговому разделу;
 - 12.2.3. проверяет достаточность Единого лимита Участника клиринга по Расчетному коду, соответствующему Счету обеспечения, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в заявке, в соответствии с пунктом 12.5 Правил клиринга на товарном рынке.
- 12.3. Немедленно после того как информация о поданной Участником торгов заявке на покупку, направленной на заключение Договора, по которому осуществляется клиринг с полным обеспечением по денежным средствам, стороной по которому

будет являться Участник клиринга, стала доступной Клиринговому центру посредством Системы торгов, Клиринговый центр:

- 12.3.1. проверяет, что значение цены, указанной в заявке, больше либо равно Нижней границе ценового коридора / Нижней границе цен своп и меньше либо равно Верхней границе ценового коридора / Нижней границе цен своп, установленных Клиринговым центром для товара, по которому подана заявка;
- 12.3.2. проверяет, что размер обязательства по оплате товара по Договору, который может быть заключен на основании поданной заявки, не превышает Обеспечения Участника клиринга в российских рублях, учитываемого по Счету обеспечения, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в заявке.
Для заявок на заключение своп договоров проверки, указанные в настоящем подпункте Правил клиринга на товарном рынке, осуществляются для первой части своп договора;
- 12.3.3. проверяет достаточность Единого лимита Участника клиринга по Расчетному коду, соответствующему Счету обеспечения, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в заявке, в соответствии с пунктом 12.5 Правил клиринга на товарном рынке.
- 12.4. Немедленно после того, как информация о поданной Участником торгов заявке, направленной на заключение Договора, по которому осуществляется клиринг с частичным обеспечением, стороной по которому будет являться Участник клиринга, стала доступной Клиринговому центру посредством Системы торгов, Клиринговый центр:
 - 12.4.1. проверяет, что значение цены, указанной в заявке, больше либо равно Нижней границе ценового коридора и меньше либо равно Верхней границе ценового коридора, установленных Клиринговым центром для товара, по которому подана заявка;
 - 12.4.2. рассчитывает значение Единого лимита по Расчетному коду, соответствующему Счету обеспечения, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в заявке, с учетом поданной заявки;
 - 12.4.3. проверяет достаточность Единого лимита по Расчетному коду, соответствующему Счету обеспечения, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в заявке, в соответствии с пунктом 12.5 Правил клиринга на товарном рынке.
- 12.5. Единый лимит по Расчетному коду является достаточным для подачи заявки, при условии, что значение Единого лимита с учетом обязательств по Договору, который может быть заключен на основании поданной заявки, не станет отрицательным, или, если Единый лимит по такому Расчетному коду был отрицательным до момента подачи заявки, при условии, что Единый лимит по такому Расчетному коду, рассчитанный с учетом указанных обязательств, не станет меньше, чем Единый лимит по этому Расчетному коду, рассчитанный до момента подачи заявки.
Для заявок на заключение своп договоров проверка, указанная в настоящем пункте Правил клиринга на товарном рынке, осуществляется по первой и второй части своп договора с учетом одновременности возникновения обязательств по первой и второй части своп договора.

- 12.6. Немедленно после проведения Клиринговым центром проверок, предусмотренных настоящей статьей Правил клиринга на товарном рынке для соответствующих заявок, информация о результате таких проверок становится доступной Бирже посредством Системы торгов: в случае положительного результата всех необходимых проверок – информация о возможности регистрации заявки, в случае отрицательного результата хотя бы одной из необходимых проверок – информация о невозможности регистрации заявки.
- 12.6.1. В случае возможности регистрации заявки, Клиринговый центр:
- уменьшает размер Обеспечения Участника клиринга в товаре (с основными характеристиками) и размер Обеспечения Участника клиринга в товаре с полным набором характеристик, учитываемых по соответствующему торговому разделу, на количество товара с соответствующими характеристиками, указанного в заявке (для заявок на продажу, направленных на заключение форвардного договора, по которому осуществляется клиринг с полным обеспечением по товару, и для заявок на продажу, направленных на заключение своп договора);
 - уменьшает размер Обеспечения Участника клиринга в российских рублях, учитываемого по соответствующему Счету обеспечения, на произведение цены и количества базисного актива, указанных в заявке (для заявок на покупку, направленных на заключение форвардного договора, по которому осуществляется клиринг с полным обеспечением по денежным средствам);
 - уменьшает размер Обеспечения Участника клиринга в российских рублях, учитываемого по соответствующему Счету обеспечения, на сумму заявки (для заявок на покупку, направленных на заключение своп договора);
 - начинает учитывать значение Единого лимита по соответствующему Расчетному коду, рассчитанное при проверке возможности регистрации заявки, в качестве нового значения Единого лимита по такому Расчетному коду.
- 12.6.2. В случае невозможности регистрации заявки, Клиринговый центр не изменяет значения Обеспечения Участника клиринга в товарах / денежных средствах и/или значение Единого лимита по Расчетному коду.
- 12.7. После того, как информация о снятии зарегистрированной заявки, в которой Участник клиринга был указан в качестве стороны по Договору, стала доступной Клиринговому центру посредством Системы торгов, Клиринговый центр:
- увеличивает размер Обеспечения Участника клиринга в товаре (с основными характеристиками), учитываемого по торговому разделу на количество товара с соответствующими характеристиками, указанного в заявке, и размер Обеспечения Участника клиринга в товаре с полным набором характеристик, соответствующих основным характеристикам, указанным в заявке, учитываемого по соответствующему торговому разделу, на количество товара, указанного в заявке; восстанавливает признак «получено по договорам своп» у Обеспечения Участника клиринга с полным набором характеристик, если такой признак учитывался до подачи заявки (для заявок на продажу, направленных на заключение форвардного договора, по которому осуществляется клиринг с полным обеспечением по товару, и для заявок на продажу, направленных на заключение своп договора);

- увеличивает размер Обеспечения Участника клиринга в российских рублях, учитываемого по соответствующему Счету обеспечения, на произведение цены и количества базисного актива, указанных в заявке (для заявок на покупку, направленных на заключение форвардного договора, по которому осуществляется клиринг с полным обеспечением по денежным средствам);
- увеличивает размер Обеспечения Участника клиринга в российских рублях, учитываемого по соответствующему Счету обеспечения, на сумму заявки (для заявок на покупку, направленных на заключение своп договора);
- рассчитывает Единый лимит по соответствующему Расчетному коду без учета отозванной заявки.

12.8. При регистрации заявки, являющейся в соответствии с Правилами торгов на товарном рынке допустимой встречной по отношению к ранее зарегистрированной заявке, Клиринговый центр заключает Договор с каждым из Участников клиринга, указанным в заявке в качестве стороны по Договору.

12.9. После того, как информация о регистрации Договора стала доступной Клиринговому центру посредством Системы торгов, Клиринговый центр:

- рассчитывает Единый лимит Участника клиринга по соответствующему Расчетному коду без учета заявки (части заявки), на основании которой заключен Договор, и с учетом заключенного Договора;
- допускает к клирингу обязательства по заключенному Договору;
- изменяет с учетом заключенного Договора ПФИ Нетто-обязательство и/или Нетто-требование Участника клиринга по денежным средствам по Расчетному коду, соответствующему Счету обеспечения, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в заявке, на основании которой заключен Договор ПФИ, с Датами исполнения, соответствующими Дате (Датам) исполнения обязательств по оплате товара по заключенному Договору;
- изменяет с учетом заключенного Договора ПФИ Нетто-обязательство и/или Нетто-требование Участника клиринга по товарам по торговому разделу, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в заявке, на основании которой заключен Договор ПФИ, с Датами исполнения, соответствующими Дате (Датам) исполнения обязательств по передаче товара по заключенному Договору ПФИ.

РАЗДЕЛ V. ПОРЯДОК ПРОВЕДЕНИЯ КЛИРИНГА

ПОДРАЗДЕЛ V-I. ПОРЯДОК ВНЕСЕНИЯ И ВОЗВРАТА ОБЕСПЕЧЕНИЯ

Статья 13. Порядок внесения Обеспечения

- 13.1. В качестве Обеспечения принимаются российские рубли, товары, а также иностранная валюта, входящая в установленный решением Клирингового центра Перечень иностранной валюты, принимаемой в качестве Обеспечения.
- 13.2. Внесение Обеспечения в российских рублях и иностранной валюте осуществляется путем зачисления денежных средств на соответствующий клиринговый банковский счет Клирингового центра, открытый в Расчетной организации и предназначенный для внесения индивидуального клирингового обеспечения.
 - 13.2.1. Зачисление денежных средств на клиринговый банковский счет Клирингового центра, с целью их учета в качестве Обеспечения должно осуществляться с обязательным указанием в назначении платежа соответствующего Расчетного кода Участника клиринга.
- 13.3. Клиринговый центр учитывает в Клиринговой системе денежные средства, перечисленные Участником клиринга, в качестве Обеспечения Участника клиринга, и увеличивает Единый лимит Участника клиринга с учетом перечисленной суммы денежных средств.
- 13.4. Денежные средства, учитываемые в качестве Обеспечения Участника клиринга, используются для расчета Единого лимита по Расчетному коду, обеспечения исполнения обязательств по Договору, исполнения Нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам по спот договорам и исполнения обязательств по уплате комиссионных вознаграждений, учитываемых по Счету обеспечения, по которому указанное Обеспечение учитывается.
- 13.5. Участник клиринга может перевести денежные средства, учитываемые в качестве Обеспечения, между своими Счетами обеспечения, подав в Клиринговый центр Заявление о переводе.

Данное заявление не принимается Клиринговым центром к исполнению, если сумма денежных средств в определенной валюте, указанная Участником клиринга в заявлении, превышает сумму денежных средств, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга по Счету обеспечения, с которого денежные средства должны быть списаны, или если Единый лимит Участника клиринга по Расчетному коду, соответствующему Счету обеспечения, с которого денежные средства, учитываемые в качестве Обеспечения Участника клиринга, должны быть списаны, в результате такого списания станет отрицательным, или отрицательный Единый лимит Участника клиринга по такому Расчетному коду, соответствующему Счету обеспечения, в результате такого списания уменьшится.

При исполнении Заявления о переводе, сумма денежных средств Участника клиринга, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга по Счету обеспечения, с которого списываются денежные средства, уменьшается, а по Счету обеспечения, на который зачисляются денежные средства, - увеличивается на

сумму переводимых денежных средств.

- 13.6. Обеспечение Участника клиринга в российских рублях используется в следующей очередности:
- 1) для погашения Задолженности Участника клиринга перед Клиринговым центром;
 - 2) для исполнения обязательства Участника клиринга по возврату Клиринговому центру денежных средств, указанного в пункте 17.5 Правил клиринга на товарном рынке;
 - 3) для обеспечения исполнения обязательств Участника клиринга по Договорам;
 - 4) для исполнения обязательств Участника клиринга в российских рублях по спот договорам;
 - 5) для исполнения обязательств Участника клиринга по уплате комиссионных вознаграждений;
 - 6) для уплаты пеней за наличие непогашенной Задолженности.
- 13.7. Обеспечение Участника клиринга в иностранной валюте используется для обеспечения исполнения обязательств Участника клиринга по Договорам.
- 13.8. После перечисления Участником клиринга денежных средств на счет Клирингового центра, открытый в Расчетной организации, и учета их в качестве Обеспечения Участника клиринга, у Клирингового центра возникает обязательство вернуть денежные средства Участнику клиринга в размере, определяемом в соответствии с пунктами 14.2, 14.3 Правил клиринга на товарном рынке.
- 13.9. Внесение Обеспечения в товарах осуществляется путем зачисления товаров на торговые разделы Участника клиринга.
- 13.10. При получении от Оператора товарных поставок информации о зачислении товаров на торговые разделы Участника клиринга Клиринговый центр увеличивает размер Обеспечения Участника клиринга в таком товаре (с основными характеристиками) и размер Обеспечения Участника клиринга в товаре с полным набором характеристик, учитываемые по торговому разделу, и увеличивает Единый лимит Участника клиринга с учетом зачисленного количества товара.
- 13.11. Товары, учитываемые в качестве Обеспечения Участника клиринга, используются для расчета Единого лимита по Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета совместно с торговым разделом, по которому такое Обеспечение учитывается, и для исполнения обязательств по передаче товара по торговому разделу, по которому указанное Обеспечение учитывается.
- 13.12. Обеспечение в товарах используется в следующей очередности:
- 1) для обеспечения исполнения обязательств Участника клиринга по Договорам;
 - 2) для исполнения обязательств в соответствующих товарах по спот договорам.

Статья 14. Порядок возврата Обеспечения

- 14.1. Возврат Клиринговым центром Участнику клиринга денежных средств,

учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга, осуществляется на основании Запроса о возврате и/или Постоянного поручения на возврат.

- 14.1.1. В случае если между Участником клиринга и Клиринговым центром предусмотрен обмен сообщениями по системе S.W.I.F.T., Участник клиринга вправе направить Запрос о возврате денежных средств в форме сообщения по системе S.W.I.F.T.
- 14.1.2. Запросы о возврате принимаются Клиринговым центром в Расчетные дни в период времени, установленный Временным регламентом на товарном рынке.
При предоставлении Запроса о возврате позднее времени, указанного во Временном регламенте на товарном рынке, Клиринговый центр вправе не исполнять Запрос о возврате.
Запрос о возврате действует в день его предоставления.
Запрос о возврате, полученный в сроки, установленные Временным регламентом на товарном рынке, исполняется после его получения при соблюдении условия, указанного в пункте 14.2 Правил клиринга на товарном рынке.
- 14.1.3. Постоянное поручение на возврат исполняется Клиринговым центром каждый Расчетный день, начиная с первого Расчетного дня, следующего за датой предоставления указанного поручения, после исполнения Участником клиринга Нетто-обязательств по денежным средствам по спот договорам и обязательств по уплате комиссионных вознаграждений в сумме, определенной в соответствии с пунктом 14.3 Правил клиринга на товарном рынке.
Клиринговый центр вправе принять решение об аннулировании действующих Постоянных поручений на возврат в случае, если у Клирингового центра возникнут основания полагать, что существует необходимость в уточнении информации, указанной в Постоянном поручении на возврат.
Постоянное поручение на возврат действует до его отмены Участником клиринга или до даты принятия Клиринговым центром решения об аннулировании Постоянных поручений на возврат.
Отмена Постоянного поручения на возврат Участником клиринга осуществляется с использованием Клиринговой системы или путем направления Участником клиринга Клиринговому центру документа на бумажном носителе в свободной форме или электронного документа.
- 14.2. Возврат Клиринговым центром Участнику клиринга денежных средств в соответствии с Запросом о возврате осуществляется при соблюдении следующих условий:
- Обеспечение Участника клиринга в соответствующей валюте, учитываемое по Счету обеспечения, соответствующему Расчетному коду, указанному в Запросе о возврате, не меньше, чем сумма денежных средств, указанная в Запросе о возврате;
 - Единый лимит по Расчетному коду, указанному в Запросе о возврате, рассчитанный без учета возвращаемой суммы денежных средств, не станет отрицательным.
- 14.3. Возврат Клиринговым центром Участнику клиринга денежных средств в соответствии с Постоянным поручением на возврат осуществляется в сумме, равной минимальному из следующих значений:

- Обеспечения Участника клиринга в соответствующей валюте, учитываемого по Счету обеспечения, соответствующему Расчетному коду;
 - максимальной суммы, без учета которой Единый лимит по Расчетному коду не станет отрицательным.
- 14.4. Для исполнения своего обязательства по возврату Участнику клиринга денежных средств в соответствующей валюте Клиринговый центр перечисляет денежные средства в данной валюте на соответствующий Счет для возврата, зарегистрированный в Клиринговом центре в порядке, установленном общей частью Правил клиринга.
- 14.5. Обязательство Клирингового центра по возврату денежных средств Участнику клиринга считается исполненным с момента списания Расчетной организацией, денежных средств с соответствующего клирингового счета Клирингового центра. Клиринговый центр не несет ответственности за неисполнение (ненадлежащее исполнение) Расчетной организацией распоряжения Клирингового центра о списании денежных средств в пользу Участника клиринга за исключением случаев, если такое неисполнение явилось следствием вины Клирингового центра.
- 14.6. При возврате Участнику клиринга денежных средств в соответствующей валюте размер Обеспечения Участника клиринга в этой валюте, учитываемого по Счету обеспечения, соответствующему Расчетному коду, уменьшается на сумму возвращаемых денежных средств.
- 14.7. Клиринговый центр вправе осуществить в любое время зачет денежных требований Участника клиринга по возврату ему денежных средств в соответствующей валюте с денежными требованиями Клирингового центра к этому Участнику клиринга в соответствующей валюте.
- 14.8. Возврат Клиринговым центром Участнику клиринга товаров, учитываемых в качестве Обеспечения, осуществляется на основании распоряжения на списание товара с торгового раздела, поданного Оператору товарных поставок. Исполнение указанного распоряжения осуществляется в порядке, установленном статьей 19 Правил клиринга на товарном рынке.
- 14.9. Возврат Клиринговым центром Участнику клиринга товаров в соответствии с запросом согласия Клирингового центра на списание товара с торгового раздела осуществляется при соблюдении следующих условий:
- количество товара с полным набором характеристик, учитываемое по торговому разделу, указанному в запросе согласия Клирингового центра на списание товара с торгового раздела, не имеющего признака «получено по договорам своп», не меньше, чем количество соответствующего товара, указанное в таком запросе;
 - если Единый лимит по Расчетному коду, соответствующему торговому разделу, указанному в запросе согласия Клирингового центра на списание товара с торгового раздела, рассчитанный без учета возвращаемого количества товара, не станет отрицательным.
- 14.10. При возврате Участнику клиринга товаров размер Обеспечения Участника

клиринга в таком товаре (с основными характеристиками) и размер Обеспечения Участника клиринга в товаре с полным набором характеристик, учитываемые по торговому разделу, уменьшаются на количество возвращаемого товара.

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

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

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

- 14.12. В случае прекращения допуска к клиринговому обслуживанию Клиринговый центр возвращает Участнику клиринга денежные средства, учитываемые в качестве Обеспечения на дату прекращения допуска к клиринговому обслуживанию, не позднее 3 (трех) рабочих дней с даты прекращения Договора об оказании клиринговых услуг, по реквизитам Счета для возврата в соответствующей валюте, зарегистрированного Участником клиринга в соответствии с правилами клиринга Клирингового центра, с учетом положений общей части Правил клиринга.

ПОДРАЗДЕЛ V-II. КЛИРИНГОВЫЕ СЕССИИ

Статья 15. Порядок проведения клиринговых сессий. Порядок возникновения и исполнения Маржинальных требований

- 15.1. До начала торгов в установленное Временным регламентом на товарном рынке время Клиринговый центр проводит клиринговую сессию, в ходе которой Клиринговый центр:
- устанавливает риск-параметры в соответствии с Методикой определения риск-параметров товарного рынка;
 - для каждого Участника клиринга рассчитывает и устанавливает новые значения Единых лимитов по Расчетному коду;
 - формирует и передает каждому Участнику клиринга, имеющему обязательства по Договорам, Отчет об обязательствах;
 - формирует и передает Участникам клиринга, у которых возникли Задолженности, Отчет «Требование о погашении Задолженности»;
 - определяет Участников клиринга, у которых возникли Маржинальные требования и суммы указанных Маржинальных требований: Маржинальное требование возникает у Участника клиринга, Единый лимит которого стал отрицательным; сумма Маржинального требования равна абсолютному значению текущего Единого лимита Участника клиринга;
 - формирует и передает Участникам клиринга, у которых возникли Маржинальные требования, Отчет о Маржинальном требовании, содержащий информацию о его сумме.
- 15.2. Маржинальное требование, возникшее у Участника клиринга по итогам клиринговой сессии, должно быть исполнено Участником клиринга не позднее установленного Временным регламентом на товарном рынке времени текущего Рабочего дня.
- 15.3. Маржинальное требование должно быть исполнено Участником клиринга путем перечисления денежных средств в любой валюте, принимаемой в качестве Обеспечения, на соответствующий клиринговый счет Клирингового центра либо путем внесения Обеспечения в товарах на соответствующий торговый товарной счет в порядке, определенном статьей 13 Правил клиринга на товарном рынке.
- 15.4. Маржинальное требование может быть также прекращено полностью или в части в случаях:
- прекращения обязательств по Договорам с наступившей Датой исполнения;
 - заключения Договоров, приводящих к увеличению Единого лимита по Расчетному коду.
- 15.5. Маржинальное требование по Расчетному коду, возникшее у Участника клиринга, считается прекращенным в момент времени, когда Единый лимит по такому Расчетному коду станет неотрицательным.
- 15.6. В случае неисполнения Участником клиринга Маржинального требования по

Расчетному коду в срок, установленный Временным регламентом на товарном рынке, между Клиринговым центром и Участником клиринга, не исполнившим Маржинальное требование по Расчетному коду, без подачи заявок заключаются закрывающие Договоры, приводящие к увеличению Единого лимита по Расчетному коду.

Условия указанных закрывающих Договоров соответствуют установленным в Правилах торгов на товарном рынке условиям соответствующих Договоров, а цены - ценам балансирующих сделок, порядок заключения которых определен общей частью Правил клиринга.

Указанные Договоры заключаются до момента исполнения Маржинального требования Участника клиринга по Расчетному коду или до момента невозможности заключения указанных Договоров.

Указанные Договоры не заключаются в случае, если у Участника клиринга, не исполнившего Маржинальное требование по Расчетному коду, отозвана (аннулирована) лицензия Банка России на осуществление банковских операций.

Договоры, заключенные в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга на товарном рынке, учитываются при расчете Нетто-обязательств / Нетто-требований Участника клиринга в денежных средствах / товарах по соответствующим Датам исполнения.

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

Статья 16. Порядок включения в клиринговый пул обязательств по Договорам

- 16.1. Для исполнения обязательств по Договорам Участники клиринга обязаны обеспечивать наличие денежных средств на Счетах обеспечения и/или товаров на торговых разделах, по которым должны исполняться обязательства по Договору.
- 16.1.1. Счетом обеспечения, по которому должны исполняться обязательства по оплате товаров по Договору, является счет обеспечения, входящий в состав Торгово-клирингового счета, указанного при подаче заявки на заключение Договора.
- 16.1.2. Торговым разделом, по которому должны исполняться обязательства по передаче / требования по получению товаров по Договору, является торговый раздел, входящий в состав Торгово-клирингового счета, указанного при подаче заявки на заключение Договора.
- 16.2. В Расчетный день, предшествующий Дате исполнения обязательств по форвардному договору на количество дней, установленное решением Клирингового центра, в срок, установленный Временным регламентом на товарном рынке, по форвардным договорам, по которым при подаче заявки на их заключение осуществлялся клиринг с частичным обеспечением по товару, Клиринговый центр осуществляет проверку наличия Обеспечения в товарах, учитываемого по торговому разделу, по которому должны исполняться обязательства по передаче товара по форвардному договору, в количестве, необходимом для исполнения указанных обязательств в полном объеме, и не имеющего признака «получено по договорам своп».
- В случае отсутствия указанного Обеспечения в необходимом количестве, обязательства по передаче товаров по Договору в полном объеме считаются не обеспеченными средствами под исполнение, Участник клиринга признается Недобросовестным участником клиринга, к нему применяются меры, предусмотренные статьей 17 Правил клиринга на товарном рынке.
- В случае наличия указанного Обеспечения в необходимом количестве Клиринговый центр уменьшает размер Обеспечения Участника клиринга в товаре (с основными характеристиками) и размер Обеспечения Участника клиринга в товаре с полным набором характеристик, учитываемых по соответствующему торговому разделу, на указанное количество товара с соответствующими характеристиками.
- 16.3. В Дату исполнения в срок, установленный Временным регламентом на товарном рынке:
- 16.3.1. обязательства и требования Участника клиринга и Клирингового центра по оплате и передаче / получению товара по Договорам ПФИ с наступившей Датой исполнения прекращаются заключением спот договоров на условиях, определенных Правилами торгов на товарном рынке, с учетом следующих особенностей:
- у Участника клиринга, имевшего обязанность по оплате и требование по получению товара по Договору ПФИ, возникают обязанность по оплате и

требование по получению товара по спот договору в том же размере, что и по Договору ПФИ. Такой Участник клиринга далее именуется Участник клиринга – покупатель. Указанные обязанности и требования учитываются по тем же Счету обеспечения и торговому разделу, что и по Договору ПФИ;

- у Участника клиринга, имевшего требование по оплате и обязанность по передаче товара по Договору ПФИ, возникают требование по оплате и обязанность по передаче товара по спот договору в том же размере, что и по Договору ПФИ. Такой Участник клиринга далее именуется Участник клиринга – продавец. Указанные требования и обязанности учитываются по тем же Счету обеспечения и торговому разделу, что и по Договору ПФИ;
- Датой исполнения обязательств по спот договору является день его заключения.

16.3.2. Клиринговый центр допускает к клирингу обязательства по спот договорам, заключенным в соответствии с подпунктом 16.3.1 Правил клиринга на товарном рынке;

16.3.3. Клиринговый центр включает в клиринговый пул:

- обязательства и требования Участников клиринга по оплате и передаче / получению товара по спот договорам, заключенным в соответствии с подпунктом 16.3.1 Правил клиринга на товарном рынке;
- обязательства Участника клиринга по уплате комиссионных вознаграждений, определенные в соответствии со статьей 20 Правил клиринга на товарном рынке, подлежащие исполнению в дату формирования клирингового пула, за исключением обязательств по уплате транспортного дифференциала;

16.3.4. осуществляет неттинг встречных однородных обязательств и требований Участников клиринга по оплате товаров, включенных в клиринговый пул и учитываемых по одному Счету обеспечения, и по итогам неттинга определяет Нетто-обязательства по денежным средствам по спот договорам и/или Нетто-требования по денежным средствам по спот договорам каждого Участника клиринга;

16.3.5. формирует и передает Участникам клиринга Клиринговые отчеты, содержащие информацию об обязательствах, включенных в клиринговый пул, и отчеты, содержащие информацию о Нетто-обязательствах / Нетто-требованиях по денежным средствам по спот договорам.

16.4. Участник клиринга обязан исполнить свои Нетто-обязательства по денежным средствам по спот договорам до времени, установленного Временным регламентом на товарном рынке.

16.5. Для исполнения Нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам по спот договорам, учитываемого по Счету обеспечения, используется Обеспечение Участника клиринга в соответствующих денежных средствах, внесенное Участником клиринга в порядке, определенном статьей 13 Правил клиринга на товарном рынке, учитываемое по тому же Счету обеспечения. Обеспечение, учитываемое по другим Счетам обеспечения этого же Участника клиринга, не используется.

16.5.1. Нетто-обязательство Участника клиринга по денежным средствам по спот

договорам, учитываемое по Счету обеспечения, является обеспеченным средствами под исполнение, если размер Обеспечения Участника клиринга в соответствующих денежных средствах, учитываемого по Счету обеспечения больше или равен величине указанного обязательства, учитываемого по тому же Счету обеспечения, и не обеспеченным – если меньше.

- 16.5.2. Участник клиринга, имеющий Нетто-обязательство по денежным средствам по спот договорам, не обеспеченное средствами под исполнение, признается Недобросовестным участником клиринга, к нему применяются меры, предусмотренные статьей 17 Правил клиринга на товарном рынке.
- 16.6. Нетто-обязательства / Нетто-требования Участников клиринга по денежным средствам по спот договорам и обязательства / требования по передаче / получению товаров, включенные в клиринговый пул, исполняются в порядке, определенном статьей 18 Правил клиринга на товарном рынке.

Статья 17. Порядок действий в случае наличия обязательств, не обеспеченных средствами под исполнение

- 17.1. В случае наличия у Участника клиринга обязательств по передаче товаров по Договору, не обеспеченных средствами под исполнение, в период времени, установленный Временным регламентом на товарном рынке, между Клиринговым центром и Недобросовестным участником клиринга без подачи заявок заключается закрывающий форвардный договор, условия которого определены в пункте 17.4 Правил клиринга на товарном рынке.
- 17.2. Клиринговый центр, действуя от имени Участника клиринга в отношении себя лично, осуществляет все юридические и фактические действия, необходимые для заключения сделок в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на товарном рынке без специального полномочия (доверенности), а также без согласия Участника клиринга.
- 17.3. Форвардный договор, указанный в пункте 17.1 Правил клиринга на товарном рынке, заключается при соблюдении следующих условий:
- 17.3.1. у Участника клиринга – кредитной организации не отозвана (не аннулирована) лицензия Банка России на осуществление банковских операций;
- 17.3.2. количество товара, в отношении которого необходимо заключить форвардный договор, больше или равно лоту такого товара, установленного Биржей.
- 17.4. Условия закрывающего форвардного договора, заключаемого между Клиринговым центром и Недобросовестным участником клиринга в случае, указанном в пункте 17.1 Правил клиринга на товарном рынке, соответствуют определенным Правилами торгов на товарном рынке условиям форвардных договоров с учетом следующих особенностей:
- 17.4.1. по закрывающему форвардному договору у Участника клиринга возникают требования по соответствующему товару в количестве, равном величине не обеспеченного средствами под исполнение обязательства по передаче товаров по Договору (в полном объеме);

- 17.4.2. цена закрывающего форвардного договора равна цене балансирующей сделки с соответствующим товаром, порядок заключения которой определен общей частью Правил клиринга;
- 17.4.3. Датой исполнения обязательств по закрывающему форвардному договору является Дата исполнения обязательств по Договору, не обеспеченному средствами под исполнение. Дата исполнения обязательств по закрывающему форвардному договору не может быть ранее, чем третий Расчетный день после даты его заключения.
- 17.5. В случае наличия у Участника клиринга Нетто-обязательства по денежным средствам по спот договорам, не обеспеченного средствами под исполнение, в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга, Участник клиринга возлагает на Клиринговый центр исполнение указанного обязательства (части указанного обязательства), не обеспеченного / не обеспеченной средствами под исполнение, за Участника клиринга, и, в свою очередь, такой Участник клиринга обязуется вернуть денежные средства в объеме исполненного обязательства (части указанного обязательства), не обеспеченного / не обеспеченной средствами под исполнение.
- 17.6. Клиринговый центр исполняет возложенное в соответствии с пунктом 17.5 Правил клиринга на товарном рынке обязательство за Участника клиринга в порядке, определенном статьей 18 Правил клиринга на товарном рынке.
- 17.7. Участник клиринга обязан исполнить обязательство по возврату Клиринговому центру денежных средств, указанное в пункте 17.5 Правил клиринга на товарном рынке, не позднее установленного Временным регламентом на товарном рынке времени следующего Расчетного дня.
- 17.8. В случае неисполнения Участником клиринга до времени, установленного Временным регламентом на товарном рынке, обязательства по возврату Клиринговому центру денежных средств, указанного в пункте 17.5 Правил клиринга на товарном рынке, и/или непогашения Участником клиринга до времени, установленного Временным регламентом на товарном рынке, Задолженности, указанной в пункте 20.10 Правил клиринга на товарном рынке, Участник клиринга обязан в срок, установленный Временным регламентом на товарном рынке, подать заявки на продажу на заключение форвардных договоров, в объеме, необходимом для исполнения указанных обязательств / погашения Задолженности. Подача указанных заявок осуществляется в соответствии с Правилами торгов на товарном рынке.
- 17.9. В случае неподачи Участником клиринга заявок, указанных в пункте 17.8 Правил клиринга на товарном рынке, в срок, установленный Временным регламентом на товарном рынке, и/или в случае незаключения в указанный срок форвардных договоров, в объеме, необходимом для исполнения обязательства по возврату Клиринговому центру денежных средств, указанного в пункте 17.5 Правил клиринга на товарном рынке, и/или для погашения Задолженности, указанной в пункте 20.10 Правил клиринга на товарном рынке:
- 17.9.1. В первую очередь, Клиринговый центр использует Обеспечение Участника клиринга в иностранной валюте для удовлетворения требований Клирингового

центра по указанному неисполненному обязательству / Задолженности Участника клиринга (или неисполненной части указанного обязательства / Задолженности) путем продажи Клиринговым центром иностранной валюты, являющейся Обеспечением Участника клиринга, за российские рубли по курсу, не меньшему, чем Нижняя граница диапазона оценки рыночных рисков по иностранной валюте, установленная Клиринговым центром в соответствии с Методикой определения риск-параметров валютного рынка и рынка драгоценных металлов на конец Расчетного дня даты удовлетворения требований.

Удовлетворение требований за счет Обеспечения Участника клиринга в иностранной валюте осуществляется Клиринговым центром без предварительного уведомления Участника клиринга.

Сумма, полученная по указанной конверсионной сделке засчитывается Клиринговым центром в счет погашения обязательства Участника клиринга по возврату Клиринговому центру денежных средств, указанного в пункте 17.5 Правил клиринга на товарном рынке / Задолженности Участника клиринга.

Размер Обеспечения в иностранной валюте, учитываемого по Счету обеспечения, уменьшается на сумму использованного Обеспечения Участника клиринга.

- 17.9.2. Во вторую очередь, в период времени, установленный Временным регламентом на товарном рынке, Клиринговым центром от имени Недобросовестного участника клиринга без подачи заявок заключаются закрывающие форвардные договоры, условия которых определены в пункте 17.10 Правил клиринга на товарном рынке.
- 17.10. Условия закрывающих форвардных договоров, заключаемых Клиринговым центром от имени Недобросовестного участника клиринга в случае, указанном в подпункте 17.9.2 Правил клиринга на товарном рынке, соответствуют определенным Правилами торгов на товарном рынке условиям форвардных договоров с учетом следующих особенностей:
- 17.10.1. у Участника клиринга возникают требования в российских рублях и обязательства по товарам;
- 17.10.2. количество товара в закрывающем форвардном договоре должно быть кратно лоту товара, установленному Биржей, и не может превышать суммы Обеспечения в товарах, учитываемого по торговому разделу. Количество товара в закрывающем форвардном договоре определяется таким образом, чтобы соответствующее ему требование по оплате товара было равно сумме Задолженности Участника клиринга / обязательства Участника клиринга по возврату Клиринговому центру денежных средств, указанного в пункте 17.5 Правил клиринга на товарном рынке, или превышало указанную Задолженность / указанное обязательство на величину, не большую, чем произведение лота товара, установленного Биржей, и цены заключаемого закрывающего форвардного договора;
- 17.10.3. закрывающий форвардный договор заключаются в отношении товара, учитываемого по торговому разделу, относящемуся к тому же Расчетному коду, что и Счет обеспечения, по которому учитывается Задолженность Участника клиринга или обязательство Участника клиринга по возврату Клиринговому центру денежных средств, указанное в пункте 17.5 Правил клиринга на товарном рынке. Выбор товара, в отношении которого заключается закрывающий форвардный договор, осуществляется Клиринговым центром;

- 17.10.4. цена закрывающего форвардного договора с товаром, указанным в подпункте 17.10.3 Правил клиринга на товарном рынке, или с иным товаром, отличающимся базисом от товара, указанного в подпункте 17.10.3 Правил клиринга на товарном рынке, определяется в порядке, аналогичном порядку определения цены при заключении балансирующей сделки в соответствии с общей частью Правил клиринга;
- 17.10.5. Датой исполнения обязательств по оплате и поставке товара по закрывающему форвардному договору является третий Расчетный день после даты его заключения;
- 17.10.6. Обязательства и требования Недобросовестного Участника и Клирингового центра по оплате и передаче / получению товара по закрывающему форвардному договору прекращаются в соответствии с пунктами 16.3-16.6 Правил клиринга на товарном рынке.
- 17.11. Обязательство Участника клиринга по возврату Клиринговому центру денежных средств, указанное в пункте 17.5 Правил клиринга на товарном рынке, не исполненное по итогам действий, указанных в пунктах 17.8-17.9 Правил клиринга на товарном рынке, учитывается как Задолженность Участника клиринга по Счету обеспечения, для ее погашения и/или для погашения Задолженности Участника клиринга по Счету обеспечения, указанной в пункте 20.10 Правил клиринга на товарном рынке, не погашенной полностью по итогам действий, указанных в пунктах 17.8-17.9 Правил клиринга на товарном рынке, Клиринговый центр использует Обеспечение Участника клиринга, учитываемое по иным собственным Расчетным кодам в соответствии с Правилами клиринга, а также средства гарантийных фондов и/или обеспечение под стресс в порядке, определенном общей частью Правил клиринга.
- 17.12. При наличии случаев, указанных в пунктах 17.1, 17.5 Правил клиринга на товарном рынке, с Участника клиринга взимается штраф, рассчитываемый по формуле:
$$\text{Penalty} = \text{ROUND} (\text{VAL_OBL} \times \text{C} \times \text{K} \times \text{R} / 365; 2),$$
 где
Penalty – сумма штрафа, в российских рублях,
VAL_OBL – необеспеченное средствами под исполнение обязательство по передаче товара по Договору (в полном объеме) / Нетто-обязательство по денежным средствам по спот договорам (в российских рублях),
C – Расчетная цена товара / C=1 для российских рублей;
K – коэффициент, установленный решением Клирингового центра; по умолчанию K=5;
R – штрафная ставка, равная ставке, установленной Клиринговым центром в соответствии с Методикой определения риск-параметров товарного рынка.
Сумма штрафа, рассчитанная в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга на товарном рынке, не облагается НДС.
Обязательство по уплате штрафа, рассчитанное в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга на товарном рынке, учитывается по Счету обеспечения, соответствующему основному Расчетному коду.
- 17.13. После заключения форвардных договоров в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на товарном рынке Клиринговый центр допускает к клирингу

обязательства по заключенным форвардным договорам, включает обязательства по указанным форвардным договорам с наступившей Датой исполнения в клиринговый пул.

- 17.13.1. Обязательства по форвардным договорам, заключенным в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на товарном рынке, учитываются в составе Нетто-обязательств / Нетто-требований Участника клиринга по денежным средствам / товарам с Датой исполнения, соответствующей дате исполнения указанных обязательств.

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

Статья 18. Порядок исполнения обязательств и требований Участников клиринга и/или Клирингового центра, включенных в клиринговый пул

- 18.1. Обязательства по передаче товаров по спот договорам, включенные в клиринговый пул, исполняются за счет товаров, учитываемых на торговом разделе Участника клиринга - продавца.
- 18.2. Обязательства / требования по передаче / получению товаров по спот договорам, включенные в клиринговый пул, включаются в распоряжение на перевод товаров, направляемое Клиринговым центром Оператору товарных поставок в соответствии с пунктом 19.6 Правил клиринга на товарном рынке и содержащее распоряжения на перевод товаров с торговых разделов Участников клиринга – продавцов на торговые разделы Участников клиринга – покупателей, не имеющих обязательство по уплате транспортного дифференциала, или на поставочные разделы торговых товарных счетов Участников клиринга – покупателей, имеющих обязательство по уплате транспортного дифференциала.
- 18.3. Обязательства Участника клиринга по оплате товаров, включенные в клиринговый пул, исполняются за счет денежных средств, учитываемых по Счету обеспечения Участника клиринга – покупателя, или за счет Клирингового центра.
- 18.3.1. Размер Обеспечения Участника клиринга в денежных средствах уменьшается на сумму Нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам по спот договорам, обеспеченного средствами под исполнение.
- 18.4. Нетто-требование Участника клиринга по денежным средствам в российских рублях по спот договорам прекращается возникновением обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга денежных средств в российских рублях, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга, в размере Нетто-требования Участника клиринга по денежным средствам по спот договорам.
- При этом размер Обеспечения Участника клиринга в российских рублях увеличивается на сумму прекращенного Нетто-требования Участника клиринга по денежным средствам по спот договорам.
- 18.5. После исполнения (прекращения) Нетто-обязательств / Нетто-требований Участников клиринга по денежным средствам по спот договорам в соответствии с пунктами 18.3 / 18.4 Правил клиринга на товарном рынке и направления Оператору товарных поставок распоряжения на перевод товаров в соответствии с пунктом 19.6 Правил клиринга на товарном рынке, обязательства / требования Участников клиринга по передаче / получению товаров, включенные в клиринговый пул, считаются прекращенными в клиринговом пуле.
- После получения от Оператора товарных поставок отчета об исполнении распоряжения на перевод товаров в соответствии с пунктом 19.7 Правил клиринга на товарном рынке, расчеты по товарам по итогам клиринга считаются завершенными, размер Обеспечения Участника клиринга в соответствующем

товаре увеличивается на сумму исполненного требования Участника клиринга по получению такого товара.

РАЗДЕЛ VI. ПОРЯДОК ВЗАИМОДЕЙСТВИЯ С ОПЕРАТОРОМ ТОВАРНЫХ ПОСТАВОК

Статья 19. Порядок взаимодействия с Оператором товарных поставок

- 19.1. Каждый Расчетный день до начала Торгов Оператор товарных поставок передает Клиринговому центру список торговых разделов и выписку по торговым и выписку по поставочным разделам.
- 19.2. После получения от Оператора товарных поставок выписки по торговым разделам Клиринговый центр устанавливает в Клиринговой системе:
- значения Обеспечения в товарах с полным набором характеристик, учитываемого по торговому разделу, в соответствии с информацией о количестве соответствующего товара, учитываемого на торговых разделах, полученной от Оператора товарных поставок в выписке по торговым разделам;
 - значения Обеспечения в товарах (с основными характеристиками), учитываемого по торговому разделу, как сумму значений Обеспечения в товарах с полным набором характеристик, учитываемого по тому же торговому разделу, основные характеристики которого соответствуют основным характеристикам товара.
- 19.3. Клиринговый центр соглашается с проведением любых операций, связанных с зачислением товаров на торговые разделы, по поручению лица, которому открыт торговый товарный счет.
- 19.4. Зачисление товаров на поставочные разделы осуществляется только по распоряжению Клирингового центра.
Списание товаров с поставочных разделов осуществляется по распоряжению или с согласия Клирингового центра в соответствии с пунктом 20.15 Правил клиринга на товарном рынке.
- 19.5. В случае необходимости списания товара с торгового раздела, в том числе в случае получения от Участника клиринга распоряжения на списание товара с торгового раздела, Оператор товарных поставок направляет Клиринговому центру запрос согласия Клирингового центра на списание товара с торгового раздела.
Списание товара с торгового раздела, в том числе на основании распоряжения Участника клиринга на списание товара с торгового раздела, осуществляется Оператором товарных поставок только в случае получения положительного ответа Клирингового центра на указанный запрос.
- 19.6. Проведение расчетов по товарам осуществляется Оператором товарных поставок на основании полученного от Клирингового центра распоряжения на перевод товаров, содержащего информацию об обязательствах / требованиях Участников клиринга по передаче / получению товаров.
Переводы товаров, включенные в распоряжение на перевод товаров, исполняются Оператором товарных поставок последовательно, в том порядке, в котором они содержатся в распоряжении на перевод товаров, полученном от Клирингового

центра.

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

РАЗДЕЛ VII. ПОРЯДОК ОПЛАТЫ УСЛУГ. ОТЧЕТЫ ПО ИТОГАМ КЛИРИНГА

Статья 20. Порядок оплаты услуг Клирингового центра, Биржи, Технического центра, Оператора товарных поставок и Экспедитора

20.1. На товарном рынке Клиринговый центр взимает:

- комиссионное вознаграждение в пользу Клирингового центра за клиринговое обслуживание (далее – комиссионное вознаграждение Клирингового центра);
- Биржевой сбор в пользу Биржи;
- вознаграждение в пользу Технического центра за предоставление интегрированного технологического сервиса (ИТС), при условии, что такой порядок оплаты услуг Технического центра предусмотрен внутренними документами / решением Технического центра;
- комиссионное вознаграждение в пользу Оператора товарных поставок за услуги Оператора товарных поставок;
- транспортный дифференциал в пользу Экспедитора.

20.2. Комиссионное вознаграждение в пользу Оператора товарных поставок рассчитывается и взимается Клиринговым центром в соответствии с действующими тарифами Оператора товарных поставок.

20.3. Информация о размере транспортного дифференциала за Доставку Товара, приобретенного по Договору, подлежащего уплате Участником клиринга в пользу Экспедитора, рассчитанная Биржей, становится доступной Клиринговому центру посредством Системы торгов сразу после заключения Договора.

20.4. Размер Биржевого сбора и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за клиринговое обслуживание рассчитывается после заключения Договора и удерживается Клиринговым центром с Участника клиринга в Расчетный день, следующий за датой заключения Договора, со Счета обеспечения в российских рублях, по которому должны исполняться обязательства по Договору.

20.5. Комиссионное вознаграждение в пользу Оператора товарных поставок, уплачиваемое ежедневно, рассчитывается Клиринговым центром по итогам каждого дня оказания услуг и удерживается Клиринговым центром с Участника клиринга в Расчетный день, следующий за днем оказания услуг, со Счета обеспечения в российских рублях, входящего в Торгово-клиринговый счет совместно с торговым разделом, за операции по которому взимается комиссионное вознаграждение Оператора товарных поставок.

20.6. Вознаграждение Технического центра за предоставление ИТС, комиссионное вознаграждение в пользу Оператора товарных поставок, уплачиваемое ежемесячно, удерживается Клиринговым центром с Участника клиринга в первый Рабочий день календарного месяца, следующего за месяцем фактического оказания услуг, по Счету обеспечения в российских рублях, соответствующему Расчетному коду, указанному Участником клиринга в Заявлении о выборе Расчетного кода для списания комиссионных вознаграждений (в случае предоставления указанного заявления) либо основному Расчетному коду.

- 20.6.1. Заявление о выборе Расчетного кода для списания комиссионных вознаграждений действует, начиная с дня, следующего за днем его предоставления.
- 20.6.2. В случае приостановки / прекращения допуска Участника торгов к торгам в течение календарного месяца, вознаграждение за предоставление ИТС, комиссионное вознаграждение в пользу Оператора товарных поставок, удерживается в последний Рабочий день, когда Участник торгов был допущен к торгам, за исключением случаев, предусмотренных Тарифами Технического центра / тарифами Оператора товарных поставок.
- 20.7. Комиссионное вознаграждение Клирингового центра за учет клирингового обеспечения удерживается Клиринговым центром с Участника клиринга в первый Рабочий день календарного месяца, следующего за месяцем оказания услуг, по Счету обеспечения в российских рублях, соответствующему Расчетному коду, указанному Участником клиринга в Заявлении о выборе Расчетного кода для списания комиссионных вознаграждений (в случае предоставления указанного заявления) либо основному Расчетному коду, за исключением случаев, предусмотренных Тарифами Клирингового центра.
Клиринговый центр ежемесячно направляет Участнику клиринга Отчет о комиссионном вознаграждении за учет клирингового обеспечения.
- 20.8. Информация о размере Биржевого сбора, комиссионного вознаграждения Клирингового центра, Оператора товарных поставок, вознаграждения Технического центра, транспортного дифференциала, начисленного в отчетную дату, указывается в Отчете о комиссионных вознаграждениях, направляемом Клиринговым центром Участникам клиринга в сроки, установленные Временным регламентом на товарном рынке.
- 20.9. Информация о рассчитанном Клиринговым центром размере Биржевого сбора, комиссионного вознаграждения Клирингового центра за клиринговое обслуживание по каждому Договору становится доступной Бирже посредством Системы торгов немедленно после его расчета.
- 20.10. В Дату исполнения обязательств по уплате соответствующих комиссионных вознаграждений в срок, установленный Временным регламентом на товарном рынке, Клиринговый центр проверяет достаточность Обеспечения Участника клиринга в российских рублях для исполнения обязательства по уплате комиссионных вознаграждений.
- 20.10.1. Обеспечение Участника клиринга в российских рублях является достаточным для исполнения обязательств по уплате комиссионных вознаграждений, если размер Обеспечения Участника клиринга в российских рублях не меньше, чем размер указанных обязательств.
- 20.10.2. Для исполнения обязательства по уплате комиссионных вознаграждений Клиринговый центр зачитывает соответствующее обязательство с требованием Участника клиринга по возврату денежных средств в российских рублях, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга по Счету обеспечения Участника клиринга в российских рублях, по которому должно исполняться обязательство по уплате комиссионного вознаграждения.
При этом размер Обеспечения Участника клиринга в российских рублях,

учитываемого по Счету обеспечения, уменьшается на сумму исполненного обязательства.

- 20.10.3. Обязательства Участника клиринга по уплате комиссионных вознаграждений, для исполнения которых недостаточно Обеспечения в российских рублях, учитываются как Задолженность Участника клиринга перед Клиринговым центром по Счету обеспечения.

Указанная Задолженность должна быть погашена Участником клиринга не позднее времени, установленного Временным регламентом на товарном рынке.

Информация о наличии у Участника клиринга Задолженности и ее размере передается Участнику клиринга в составе отчета «Требование о погашении задолженности», направляемом Участнику клиринга в соответствии с пунктом 15.1 Правил клиринга на товарном рынке.

- 20.10.4. В случае непогашения Участником клиринга до времени, установленного Временным регламентом на товарном рынке, Задолженности, учитываемой по Счету обеспечения, Участник клиринга обязан уплатить Клиринговому центру пени, рассчитываемую по формуле:

$$\text{Fine} = D \times 2 \times S \times n / 365, \text{ где}$$

Fine – сумма пени, в российских рублях,

D – сумма Задолженности, в российских рублях,

S – ключевая ставка, установленная Банком России на дату расчета суммы пени,

n - количество календарных дней между датой расчета суммы пени и следующим Рабочим днем.

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

Обязательство по уплате пени, рассчитанное в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга на товарном рынке, учитывается по Счету обеспечения в российских рублях, соответствующему основному Расчетному коду.

- 20.11. В Дату исполнения обязательств по спот договору, Клиринговый центр проверяет достаточность Обеспечения Участника клиринга в российских рублях для исполнения обязательства по уплате транспортного дифференциала за Доставку Товара, приобретенного по спот договору.

- 20.11.1. Обязательство по уплате транспортного дифференциала исполняются за счет денежных средств, учитываемых по Счету обеспечения Участника клиринга - покупателя в российских рублях, по которому должны исполняться обязательства по спот договору.

- 20.11.2. Обеспечение Участника клиринга в российских рублях является достаточным для исполнения обязательства по уплате транспортного дифференциала, если размер Обеспечения Участника клиринга в российских рублях не меньше, чем размер обязательства по уплате транспортного дифференциала.

- 20.11.3. Если Обеспечение Участника клиринга в российских рублях является достаточным для исполнения обязательства по уплате транспортного дифференциала, Клиринговый центр исполняет указанное обязательство в соответствии с пунктом 20.14 Правил клиринга на товарном рынке.

- 20.12. Если в Дату исполнения обязательств по спот договору Обеспечение Участника клиринга в российских рублях является не достаточным для исполнения обязательства по уплате транспортного дифференциала за Доставку Товара, приобретенного по спот договору, Клиринговый центр осуществляет проверку достаточности Обеспечения Участника клиринга для исполнения указанного обязательства в соответствии с пунктом 20.11 Правил клиринга на товарном рынке в течение 5 (пяти) Расчетных дней, следующих за Датой исполнения обязательств по спот договору.
- Если в один из указанных дней Обеспечение Участника клиринга в российских рублях является достаточным для исполнения обязательства по уплате транспортного дифференциала за Доставку Товара, приобретенного по спот договору, Клиринговый центр исполняет указанное обязательство в соответствии с пунктом 20.14 Правил клиринга на товарном рынке и взимает с Участника клиринга штраф за ненадлежащее исполнение обязательств по уплате транспортного дифференциала в пользу Экспедитора в соответствии с тарифами Экспедитора.
- Порядок уплаты штрафа за ненадлежащее исполнение обязательств по уплате транспортного дифференциала установлен пунктом 20.14 Правил клиринга на товарном рынке.
- 20.13. Если обязательство по уплате транспортного дифференциала за Доставку Товара, приобретенного по спот договору, не исполнены в течение срока, установленного пунктом 20.12 Правил клиринга на товарном рынке, обязательство по уплате транспортного дифференциала за Доставку Товара, приобретенного по спот договору, прекращается, Клиринговый центр направляет Оператору товарных поставок распоряжение на перевод товара с полным набором характеристик с соответствующего поставочного раздела на соответствующий торговый раздел со значением базиса, установленным Клиринговым центром.
- 20.14. Для исполнения обязательства по уплате транспортного дифференциала за Доставку Товара, приобретенного по спот договору / обязательства по уплате штрафа за ненадлежащее исполнение обязательств по уплате транспортного дифференциала за Доставку Товара, приобретенного по спот договору, Клиринговый центр зачитывает соответствующее обязательство с требованием Участника клиринга по возврату денежных средств в российских рублях, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга по Счету обеспечения Участника клиринга - покупателя в российских рублях, по которому должны исполняться обязательства по спот договору.
- При этом размер Обеспечения Участника клиринга в российских рублях, учитываемого по Счету обеспечения, уменьшается на сумму исполненного обязательства.
- 20.15. После исполнения обязательства по уплате транспортного дифференциала за Доставку Товара, приобретенного по спот договору, Клиринговый центр направляет Оператору товарных поставок согласие на списание с поставочного раздела товара с полным набором характеристик.

Статья 21. Порядок предоставления отчетов по итогам клиринга

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

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

21.2. Клиринговый центр формирует следующие отчеты по итогам клиринга для Участников клиринга:

- Отчет об обязательствах, содержащий информацию о допущенных к клирингу обязательствах по Договорам, по всем Датам исполнения;
- Клиринговый отчет, содержащий информацию об обязательствах, включенных в клиринговый пул;
- Отчет о Нетто-обязательствах / Нетто-требованиях по денежным средствам по спот договорам, содержащий информацию об обязательствах в денежных средствах, определенных по результатам клиринга;
- Отчет об Обеспечении, содержащий информацию о размере Обеспечения в денежных средствах и товарах и об изменении размера Обеспечения, включая информацию об использовании Обеспечения, в том числе для исполнения обязательств, определенных по итогам клиринга;
- Отчет о движении денежных средств, содержащий информацию об операциях с Обеспечением Участника клиринга в денежных средствах;
- Отчет о комиссионных вознаграждениях;
- Отчет о торгово-клиринговых счетах Участника клиринга;
- Отчет о Клиринговых идентификаторах;
- Требование о погашении Задолженности;
- Отчет о Маржинальном требовании;
- Отчет о комиссионном вознаграждении за учет клирингового обеспечения.

21.3. Отчеты, указанные в пункте 21.2 Правил клиринга на товарном рынке, направляются Участнику клиринга в форме электронных документов в соответствии с Порядком ЭДО.

По требованию Участника клиринга могут быть изготовлены (распечатаны) копии электронных документов на бумажном носителе.

Копии электронных документов на бумажном носителе и отчеты по итогам

клиринга на бумажном носителе подписываются уполномоченным лицом Клирингового центра и передаются сотруднику Участника клиринга, действующему на основании доверенности, либо направляются Участнику клиринга по почте заказным письмом с уведомлением.

- 21.4. Формы и форматы отчетов по итогам клиринга, предоставляемых Клиринговым центром Участникам клиринга в соответствии с Правилами клиринга на товарном рынке, установлены документом «Формы и форматы отчетов, предоставляемых Участникам клиринга на товарном рынке», раскрываемом на Сайте Клирингового центра.
- 21.5. Клиринговый центр предоставляет Участнику клиринга с использованием Клиринговой системы информацию о Нетто-обязательствах и/или Нетто-требованиях Участника клиринга по денежным средствам по спот договорам.
- В случае несоответствия информации, полученной Участником клиринга с использованием Клиринговой системы, и информации, содержащейся в полученном от Клирингового центра Отчете о Нетто-обязательствах / Нетто-требованиях по денежным средствам по спот договорам, исполнения обязательств должно осуществляться Участником клиринга на основании указанного отчета.

РАЗДЕЛ VIII. ПРОЧИЕ УСЛОВИЯ

Статья 22. Особенности перевода обязательств и Обеспечения одного Участника клиринга другому Участнику клиринга

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

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

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

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

22.3. После завершения процедуры Перевода обязательств и Обеспечения Клиринговый центр аннулирует регистрацию Торгово-клиринговых счетов, открытых Базовым Участником клиринга для Обособленного клиента.

Приложение № 1
к Правилам клиринга на товарном рынке

Временной регламент на товарном рынке

№ п/п	Наименование операции	Время (московское)
1.	Проведение клиринговой сессии.	с 9:30 до 10:00 Расчетного дня
2.	Передача Клиринговым центром Участникам клиринга Отчетов о Маржинальном требовании, Требований о погашении задолженности, Отчетов об Обеспечении, Отчетов о движении денежных средств.	до 10:15 Расчетного дня
3.	Исполнение Маржинальных требований.	до 15:00 дня возникновения Маржинального требования
4.	Заключение закрывающих Договоров в случае неисполнения Участником клиринга Маржинального требования.	с 15:00 дня возникновения Маржинального требования
5.	Проверка наличия Обеспечения в товарах, необходимого для исполнения обязательств по передаче товаров по форвардному договору.	10:00 Расчетного дня, предшествующего Дате исполнения обязательств по форвардному договору на количество дней, установленное решением Клирингового центра
6.	Заключение закрывающих форвардных договоров в случае наличия у Участника клиринга не обеспеченных средствами под исполнение обязательств по передаче товаров по форвардному договору.	с 10:00 до 16:00
7.	Подача Участником клиринга заявок на заключение форвардных договоров в случае неисполнения Участником клиринга до времени, установленного п.14 настоящего Временного регламента на товарном рынке, обязательства по возврату Клиринговому центру денежных средств, указанного в пункте 17.5 Правил клиринга на товарном рынке, и/или непогашения Участником клиринга до времени, установленного п.16 настоящего Временного регламента на товарном рынке, Задолженности.	с 10:00 до 12:00 Расчетного дня, следующего за днем исполнения соответствующих обязательств, установленным настоящим Временным регламентом на товарном рынке
8.	Заключение закрывающих форвардных договоров в случае неподачи Участником клиринга заявок, указанных в пункте 17.8 Правил клиринга на товарном рынке, в срок, установленный п.7 настоящего Временного регламента на товарном рынке, и/или в случае незаключения в указанный срок форвардных договоров, в объеме, необходимом для исполнения обязательства по возврату Клиринговому центру денежных средств, указанного в пункте 17.5 Правил клиринга на товарном рынке, и/или для погашения Задолженности Участника клиринга.	с 12:00 до 16:00 Расчетного дня, следующего за днем исполнения соответствующих обязательств, установленным настоящим Временным регламентом на товарном рынке

№ п/п	Наименование операции	Время (московское)
9.	Определение Нетто-обязательств / Нетто-требований по денежным средствам по спот договорам.	16:05 Даты исполнения
10.	Передача Клиринговым центром Участникам клиринга Клиринговых отчетов и Отчетов о Нетто-обязательствах / Нетто-требованиях по денежным средствам по спот договорам.	до 16:30 Даты исполнения
11.	Передача Клиринговым центром Участникам клиринга Отчетов об обязательствах, Отчетов о комиссионных вознаграждениях.	до 16:30
12.	Исполнение Участником клиринга Нетто-обязательств по денежным средствам по спот договорам.	до 20:00 Даты исполнения
13.	Исполнение Участником клиринга обязательств по уплате транспортного дифференциала.	до 20:00 Даты исполнения
14.	Исполнение Участником клиринга обязательства по возврату Клиринговому центру денежных средств в объеме исполненного Клиринговым центром за Участника клиринга Нетто-обязательства по денежным средствам по спот договорам.	до 20:00 ¹ Расчетного дня, следующего за датой заключения спот договора
15.	Исполнение Участником клиринга обязательств по уплате комиссионных вознаграждений.	до 20:00 ¹ Расчетного дня, следующего за датой получения Отчета о комиссионном вознаграждении
16.	Погашение Задолженности, возникшей в связи с неисполнением Участником клиринга обязательств по уплате комиссионных вознаграждений, за исключением обязательств по уплате транспортного дифференциала.	до 20:00 Расчетного дня, следующего за днем возникновения Задолженности
17.	Прекращение Клиринговым центром Нетто-требований Участников клиринга по денежным средствам по спот договорам.	В Дату исполнения
18.	Передача Участником клиринга в Клиринговый центр Запросов о возврате денежных средств.	до 20:00 Расчетного дня

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