



УТВЕРЖДЕНЫ

решением Наблюдательного совета
Банка НКЦ (АО)

от «06» февраля 2017 года (Протокол № 11)

Председатель Наблюдательного совета
Банка НКЦ (АО)



Денисов Ю.О.

**ПРАВИЛА КЛИРИНГА
БАНКА «НАЦИОНАЛЬНЫЙ КЛИРИНГОВЫЙ ЦЕНТР»
(АКЦИОНЕРНОЕ ОБЩЕСТВО).
ЧАСТЬ III. ПРАВИЛА КЛИРИНГА НА ФОНДОВОМ РЫНКЕ И РЫНКЕ
ДЕПОЗИТОВ**

Москва, 2017 г.

СОДЕРЖАНИЕ

РАЗДЕЛ I. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ	5
Статья 1. Термины и определения	5
Статья 2. Общие положения	9
Статья 3. Условия и порядок заключения / расторжения договора об имущественном пуле	12
Статья 4. Порядок формирования и прекращения имущественного пула.....	13
Статья 5. Права владельца клирингового сертификата участия	14
Статья 6. Особенности использования Аналога собственноручной подписи	15
Статья 7. Торговые и клиринговые счета.....	15
Статья 8. Клиринговые регистры	17
РАЗДЕЛ II. ТРЕБОВАНИЯ К УЧАСТНИКАМ КЛИРИНГА	21
Статья 9. Условия клирингового обслуживания. Порядок предоставления допуска к клиринговому обслуживанию	21
Статья 10. Особенности приостановления допуска к клиринговому обслуживанию	21
Статья 11. Требования к Держателям. Порядок получения (лишения) статуса Держателя	22
Статья 12. Особенности регистрации Участников клиринга, Торгово-клиринговых счетов Участников клиринга	24
Статья 13. Порядок открытия Торгово-клиринговых счетов имущественного пула.....	25
Статья 14. Особенности регистрации Обособленных клиентов	26
РАЗДЕЛ III. МЕРЫ, НАПРАВЛЕННЫЕ НА УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ ПРИ ОСУЩЕСТВЛЕНИИ КЛИРИНГА	27
Статья 15. Перечень мер, направленных на управление рисками при осуществлении клиринга	27
Статья 16. Перечень мер, направленных на управление рисками по операциям с клиринговыми сертификатами участия.....	27
Статья 17. Единый лимит по Расчетному коду и риск-параметры.....	28
Статья 18. Единый лимит по пулу	31
РАЗДЕЛ IV. ПОРЯДОК И УСЛОВИЯ ДОПУСКА ОБЯЗАТЕЛЬСТВ К КЛИРИНГУ	35
Статья 19. Порядок взаимодействия с Биржей при подаче заявок и заключении сделок, допуске к клирингу обязательств по биржевым сделкам и обязательств по внесению компенсационных взносов	35
Статья 20. Процедура контроля обеспечения по биржевым сделкам	39
Статья 21. Порядок допуска к клирингу обязательств по внебиржевым сделкам с ценными бумагами	43
РАЗДЕЛ V. ПОРЯДОК ПРОВЕДЕНИЯ КЛИРИНГА	45
ПОДРАЗДЕЛ V-I. ПОРЯДОК ВНЕСЕНИЯ И ВОЗВРАТА ОБЕСПЕЧЕНИЯ	45
Статья 22. Порядок внесения Обеспечения	45
Статья 23. Порядок возврата Обеспечения	49

ПОДРАЗДЕЛ V-II. ПОРЯДОК ВЫДАЧИ И ПОГАШЕНИЯ КЛИРИНГОВЫХ СЕРТИФИКАТОВ УЧАСТИЯ.....	56
Статья 24. Порядок внесения имущества в имущественный пул. Порядок выдачи клиринговых сертификатов участия	56
Статья 25. Порядок подачи и исполнения Запросов на подбор ценных бумаг	60
Статья 26. Порядок выдачи имущества из имущественного пула. Порядок погашения клиринговых сертификатов участия	61
Статья 27. Порядок замены имущества в имущественном пуле.....	64
ПОДРАЗДЕЛ V-III. КЛИРИНГОВЫЕ СЕССИИ	65
Статья 28. Порядок проведения клиринговых сессий mark-to-market. Порядок возникновения и исполнения Маржинальных требований	65
Статья 29. Порядок возникновения и исполнения Маржинальных требований по пулу	68
ПОДРАЗДЕЛ V-IV. ПОРЯДОК ВКЛЮЧЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ В КЛИРИНГОВЫЙ ПУЛ	73
Статья 30. Общие требования к порядку исполнения обязательств по сделкам и обязательств по внесению компенсационных взносов	73
Статья 31. Порядок подачи и регистрации Отчетов на исполнение.....	76
Статья 32. Проверки, выполняемые при подаче Отчетов на исполнение, Специальных отчетов на исполнение, Срочных отчетов на исполнение, поручений на внесение компенсационных взносов, поручений на отказ от компенсационных взносов, Поручений на отказ от исполнения сделки РЕПО / Поручений на отказ от исполнения сделки купли-продажи ценных бумаг	78
Статья 33. Порядок подачи и регистрации поручений на внесение компенсационных взносов и поручений на отказ от компенсационных взносов	79
Статья 34. Порядок подачи и исполнения Поручений на отказ от исполнения сделки РЕПО / Поручений на отказ от исполнения сделки купли-продажи ценных бумаг	81
Статья 35. Порядок подачи и регистрации Специальных и Срочных отчетов на исполнение	82
Статья 36. Порядок включения в клиринговый пул обязательств Участников клиринга по уплате Возмещения.....	85
Статья 37. Порядок включения в клиринговый пул обязательств по Сделкам Т+ ..	87
ПОДРАЗДЕЛ V-V. ПОРЯДОК ДЕЙСТВИЙ В СЛУЧАЯХ НЕИСПОЛНЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ	94
Статья 38. Порядок действий в случае неисполнения (ненадлежащего исполнения) обязательств по Сделкам Т+ и/или наличия Задолженности	94
Статья 39. Порядок выкупа клиринговых сертификатов участия у Банка России	101
Статья 40. Порядок заключения и условия сделок своп / сделки купли-продажи иностранной валюты, заключаемых с Недобросовестными участниками клиринга..	104
Статья 41. Порядок заключения и условия сделок РЕПО и сделок / сделки купли-продажи ценных бумаг, заключаемых с Недобросовестным участником клиринга..	107
Статья 42. Порядок заключения и условия сделок РЕПО и сделок / сделки купли-продажи ценных бумаг, заключаемых с Добросовестным участником клиринга	113

ПОДРАЗДЕЛ V-VI. ПОРЯДОК ИСПОЛНЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ, ВКЛЮЧЕННЫХ В КЛИРИНГОВЫЙ ПУЛ	115
Статья 43. Порядок исполнения обязательств и требований Участников клиринга и Клирингового центра, включенных в клиринговый пул	115
ПОДРАЗДЕЛ V-VII. ОСОБЕННОСТИ ВЗАИМОДЕЙСТВИЯ С РАСЧЕТНОЙ ОРГАНИЗАЦИЕЙ И РАСЧЕТНЫМ ДЕПОЗИТАРИЕМ.....	121
Статья 44. Особенности взаимодействия с Расчетной организацией	121
Статья 45. Особенности взаимодействия с Расчетным депозитарием	122
ПОДРАЗДЕЛ V-VIII. СДЕЛКИ РЕПО КЛИРИНГОВОГО ЦЕНТРА.....	127
Статья 46. Условия Сделок РЕПО Клирингового центра, порядок их заключения и исполнения	127
ПОДРАЗДЕЛ V-IX. ПОРЯДОК ПЕРЕДАЧИ ДОХОДА	130
Статья 47. Порядок передачи Доходов по сделкам РЕПО и сделкам купли-продажи ценных бумаг, заключенным с Клиринговым центром	130
РАЗДЕЛ VI. ПОРЯДОК ОПЛАТЫ УСЛУГ. ОТЧЕТЫ ПО ИТОГАМ КЛИРИНГА	134
Статья 48. Особенности оплаты услуг Клирингового центра, Биржи и Технического центра	134
Статья 49. Порядок представления отчетов по итогам клиринга	140
РАЗДЕЛ VII. ПРОЧИЕ УСЛОВИЯ	144
Статья 50. Особенности Перевода обязательств и Обеспечения одного Участника клиринга другому Участнику клиринга	144
Приложение № 1 Документы, предоставляемые юридическим лицом для получения статуса Держателя	146
Приложение № 2 Временной регламент на фондовом рынке и рынке депозитов	148
Приложение № 3 Порядок изменения значений клиринговых регистров Счет обеспечения Т0 и Торгово-клиринговый счет Т0.....	151

РАЗДЕЛ I. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ

Настоящие «Правила клиринга Банка «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество). Часть III. Правила клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов» (далее – Правила клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов) 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 сделок купли-продажи ценных бумаг, заключаемых в Секции Фондового рынка ПАО Московская Биржа, сделок РЕПО, заключаемых в Секции рынка РЕПО ПАО Московская Биржа, заключением и исполнением депозитных договоров на Рынке депозитов ПАО Московская Биржа, исполнением внебиржевых сделок купли-продажи ценных бумаг, а также отношения, связанные с заключением с центральным контрагентом в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов и исполнением сделок своп с иностранной валютой и сделок купли-продажи иностранной валюты, и определяют условия договора об имущественном пуле.

Статья 1. Термины и определения

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

<i>Биржевая сделка –</i>	сделка купли-продажи ценных бумаг, или сделка РЕПО, или депозитный договор, заключенная (заключенный) на Бирже, и информация о которой (о котором) передана Биржей Клиринговому центру в порядке, предусмотренном Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.
<i>Внебиржевая сделка с ценными бумагами / внебиржевая сделка -</i>	сделка купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов В0-В30 или сделка РЕПО с кодом расчетов Sn, заключенная между Участниками клиринга, информация о которой получена Клиринговым центром в порядке, предусмотренном Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов. Значения кодов расчетов, используемых при заключении внебиржевых сделок, соответствуют значениям кодов расчетов, определенных Правилами торгов на фондовом рынке и рынке депозитов. Термины «Дата внесения компенсационного взноса», «Дата прекращения исполнения» для внебиржевых сделок используются в значениях, определенных Правилами торгов на фондовом рынке и рынке депозитов, с учетом особенностей внебиржевых сделок.
<i>Возмещение –</i>	Переменное возмещение или Фиксированное возмещение, определенные Правилами торгов на фондовом рынке и рынке депозитов.
<i>Держатель -</i>	организация, получившая статус Держателя в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов с целью использования ценных бумаг, учитываемых на торговых

	счетах депо номинального держателя / торговых счетах депо иностранного номинального держателя, открытых такому Держателю, для проведения Клиринговым центром Процедуры контроля обеспечения по сделкам и расчетов по итогам клиринга сделок Участников клиринга, депозитарное обслуживание которых и/или их клиентов осуществляется Держателем.
Доход -	суммы денежных средств или количество ценных бумаг, соответствующие любым дивидендам, процентам, выплатам номинальной стоимости, доходам или иным распределениям на ценные бумаги, являющиеся предметом сделок, заключенных с Клиринговым центром.
Единый лимит по пулу -	величина, рассчитываемая Клиринговым центром в российских рублях по каждому Расчетному коду имущественного пула Участника клиринга в целях контроля за соответствием стоимости имущества, внесенного в соответствующий имущественный пул и учитываемого по такому Торгово-клиринговому счету, количеству выданных клиринговых сертификатов участия.
Клиринговый банк -	Участник клиринга, являющийся Кредитной организацией или Банком-нерезидентом.
Клиринговый пул для расчетов в ходе торгов -	клиринговый пул, состоящий из подлежащих исполнению в дату формирования клирингового пула обязательств по сделке с ценными бумагами с кодом расчетов Z0, X0 или из обязательств по сделкам, включенным в Срочный отчет на исполнение.
Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов -	клиринговый пул, состоящий из обязательств по сделкам и обязательств, возникших по итогам клиринга, подлежащих исполнению в определенный Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов момент времени в дату формирования клирингового пула.
Клиринговый пул для расчетов в ходе торгов по сделкам с центральным контрагентом -	клиринговый пул, состоящий из подлежащих исполнению в дату формирования клирингового пула обязательств по сделкам, заключенным с центральным контрагентом и включенным в Срочный отчет на исполнение.
Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов по сделкам с центральным контрагентом -	клиринговый пул, состоящий из подлежащих исполнению в определенный Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов момент времени в дату формирования клирингового пула обязательств по сделкам, заключенным с центральным контрагентом.
Клиринговый пул по Сделкам T+ -	клиринговый пул, состоящий из обязательств по Сделкам T+, подлежащих исполнению в определенный Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов момент времени в дату

	формирования клирингового пула.
Код ценной бумаги -	код, позволяющий однозначно идентифицировать ценную бумагу в Клиринговой системе.
Маржинальное требование по пулу -	требование Клирингового центра к Участнику клиринга, являющемуся Участником пула, о внесении дополнительного имущества в имущественный пул, предъявляемое в порядке и случаях, определенных Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.
Методика определения риск-параметров фондового рынка и рынка депозитов -	внутренний документ Клирингового центра, устанавливающий порядок определения риск-параметров Фондового и Денежного рынков ПАО Московская Биржа. Методика определения риск-параметров фондового рынка и рынка депозитов раскрывается на Сайте Клирингового центра.
Нетто-обязательство по денежным средствам / ценным бумагам по сделкам клирингового пула -	обязательство Участника клиринга или Клирингового центра по оплате / передаче ценных бумаг, возникшее в связи с прекращением всех обязательств, включенных в клиринговый пул, в результате неттинга в ходе клиринга в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, определяемое в отношении Расчетного кода / Торгово-клирингового счета Участника клиринга (Клирингового центра).
Нетто-обязательство по денежным средствам / ценным бумагам по Сделкам T+ -	сумма денежных средств в российских рублях / иностранной валюте или количество ценных бумаг, представляющие собой превышение обязательств Участника клиринга по Сделкам T+ над его требованиями к Клиринговому центру по Сделкам T+ / обязательств Участника клиринга, которые возникнут в случае заключения депозитного договора, над его требованиями к Клиринговому центру, которые возникнут в случае заключения депозитного договора, в российских рублях / иностранной валюте или ценных бумагах, определяемые по каждой Дате исполнения.
Нетто-требование по денежным средствам / ценным бумагам по сделкам клирингового пула -	требование Участника клиринга или Клирингового центра по оплате / передаче ценных бумаг, возникшее в связи с прекращением всех обязательств, включенных в клиринговый пул, в результате неттинга в ходе клиринга в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, определяемое в отношении Расчетного кода / Торгово-клирингового счета Участника клиринга (Клирингового центра).
Нетто-требование по денежным средствам / ценным бумагам по Сделкам T+ -	сумма денежных средств в российских рублях / иностранной валюте или количество ценных бумаг, представляющие собой превышение требований Участника клиринга по Сделкам T+ над его обязательствами перед Клиринговым центром по Сделкам T+ / требований Участника клиринга, которые возникнут в случае заключения депозитного договора, над его обязательствами перед Клиринговым центром, которые возникнут в случае заключения депозитного договора, в российских рублях / иностранной валюте или ценных бумагах,

	определяемые по каждой Дате исполнения.
Отчет на исполнение -	поручение Участника клиринга, направляемое Клиринговому центру с использованием Клиринговой системы в форме электронного сообщения, подписанного АСП Участника клиринга, и инициирующее включение обязательств по сделке с ценными бумагами, в том числе по первой/второй части сделки РЕПО, в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов / в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов по сделкам с центральным контрагентом.
Отчет на исполнение специальный / Специальный отчет на исполнение -	поручение Участника клиринга, направляемое Клиринговому центру с использованием Клиринговой системы в форме электронного сообщения, подписанного АСП Участника клиринга, и инициирующее включение обязательств по нескольким сделкам с ценными бумагами, в том числе по первым/вторым частям сделок РЕПО, и/или обязательств по внесению компенсационных взносов в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов / в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов по сделкам с центральным контрагентом.
Отчет на исполнение срочный / Срочный отчет на исполнение -	поручение Участника клиринга, направляемое Клиринговому центру с использованием Клиринговой системы в форме электронного сообщения, подписанного АСП Участника клиринга, и инициирующее включение обязательств по одной или нескольким сделкам с ценными бумагами, в том числе по первым/вторым частям сделок РЕПО, и/или обязательств по внесению компенсационных взносов в Клиринговый пул для расчетов в ходе торгов / в Клиринговый пул для расчетов в ходе торгов по сделкам с центральным контрагентом.
Период регистрации поручений -	период расчетного дня, установленный в соответствии с Временным регламентом на фондовом рынке и рынке депозитов, в течение которого Клиринговый центр регистрирует поручения от Участников клиринга и/или Клиринговых организаций.
Поручение на внесение компенсационного взноса -	поручение Участника клиринга, направляемое Клиринговому центру с использованием Клиринговой системы в форме электронного сообщения, подписанного АСП Участника клиринга, и инициирующее включение обязательства по внесению компенсационного взноса в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов.
Поручение на клиринг внебиржевой сделки -	поручение Участника клиринга, направляемое Клиринговому центру с целью осуществления клиринга по внебиржевой сделке и регистрации в Клиринговой системе параметров внебиржевой сделки, в том числе внебиржевой сделки РЕПО.
Поручение на отказ от компенсационного взноса -	поручение Участника клиринга, / направляемое Клиринговому центру с использованием Клиринговой системы в форме электронного сообщения, подписанного АСП Участника клиринга, с целью отказа от получения компенсационного взноса.

Процедура контроля обеспечения по сделке с ценными бумагами / Процедура контроля обеспечения -	механизм контроля достаточности индивидуального клирингового обеспечения Участника клиринга для обеспечения исполнения обязательств по денежным средствам и/или ценным бумагам, осуществляемого при подаче заявки на заключение сделки с ценными бумагами или при заключении сделки.
Регламент открытия Торгово-клиринговых счетов -	внутренний документ Клирингового центра, устанавливающий порядок кодификации и открытия в Клиринговой системе Торгово-клиринговых счетов, особенности проведения операций, осуществляемых в Клиринговой системе в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов. Регламент открытия Торгово-клиринговых счетов раскрывается на Сайте Клирингового центра.
Сделка -	биржевая сделка, внебиржевая сделка.
Сделка T+ -	сделка РЕПО с кодом расчетов T0/Yn, Ym/Yn, или сделка купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов Yn, или депозитный договор, заключенная (-ый) с Центральным контрагентом в соответствии с Правилами торгов на фондовом рынке и рынке депозитов или Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, сделка своп с иностранной валютой или сделка купли-продажи иностранной валюты, заключенная с Центральным контрагентом в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, а также Сделка РЕПО Клирингового центра.
Сделка РЕПО Клирингового центра -	сделка РЕПО, заключаемая Клиринговым центром с Участником клиринга в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов с целью исполнения обязательств Клирингового центра по Сделкам T+.
Торгово-клиринговый счет имущественного пула -	идентификатор, определяющий набор счетов, на которых учитываются денежные средства / ценные бумаги, внесенные Участником клиринга в соответствующий имущественный пул.
Участник пула -	Участник клиринга, внесший имущество в имущественный пул.

Статья 2. Общие положения

2.1. Клиринговый центр осуществляет клиринг, выполняя функции центрального контрагента по:

- сделкам купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов T0 (за исключением сделок размещения и выкупа), K0, Yn;
- сделкам РЕПО с кодом расчетов T0/Yn, Ym/Yn;
- депозитным договорам с кодом расчетов Ym/Yn;
- сделкам своп с иностранной валютой и сделкам купли-продажи иностранной валюты, заключаемым с центральным контрагентом в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

- 2.2. Клиринговый центр осуществляет клиринг без выполнения функций центрального контрагента по:
- сделкам купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов B0-B30, Z0;
 - сделкам РЕПО с кодом расчетов Rb, Sn, Z0;
 - сделкам размещения и выкупа с кодом расчетов T0;
 - сделкам размещения акций с кодом расчетов X0.
- 2.3. Клиринговый центр осуществляет клиринг с частичным обеспечением, клиринг с полным обеспечением и клиринг без предварительного обеспечения.
- 2.4. Клиринговый центр осуществляет клиринг с частичным обеспечением по следующим сделкам, стороной по которым является Участник клиринга категории «Б»:
- сделкам купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов Yn;
 - сделкам РЕПО с кодом расчетов Ym/Yn;
 - депозитным договорам с кодом расчетов Ym/Yn;
 - вторым частям сделок РЕПО с кодом расчетов T0/Yn;
 - сделкам своп с иностранной валютой и сделкам купли-продажи иностранной валюты, заключаемым с центральным контрагентом в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.
- 2.4.1. Клиринговый центр вправе установить признак «запрет коротких продаж» по ценной бумаге.
- Признак «запрет коротких продаж» по ценной бумаге означает, что по Сделкам T+ с такой ценной бумагой, стороной по которым является Участник клиринга категории «Б», осуществляется клиринг с полным обеспечением по ценным бумагам.
- 2.5. Клиринговый центр осуществляет клиринг с полным обеспечением по:
- сделкам купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов T0, Z0, X0, K0;
 - первым частям сделок РЕПО с кодом расчетов T0/Yn, Rb, Z0;
 - сделкам, перечисленным в пункте 2.4 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, стороной по которым является Участник клиринга категории «В».
- 2.6. Клиринговый центр осуществляет клиринг без предварительного обеспечения по:
- сделкам купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов B0-B30;
 - сделкам РЕПО с кодом расчетов Sn;
 - вторым частям сделок РЕПО с кодом расчетов Rb, Z0;
 - сделкам, стороной по которым является Участник клиринга категории «А», если Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов и/или договором, заключенным с таким Участником клиринга, не установлен иной порядок осуществления клиринга.
- 2.7. Клиринговый центр осуществляет клиринг по сделкам с ценными бумагами, заключенным с расчетами в российских рублях или в иностранной валюте.

- 2.8. Клиринговый центр не осуществляет клиринг по сделкам с ценными бумагами с кодами расчетов, отличными от кодов расчетов, предусмотренных Правилами торгов на фондовом рынке и рынке депозитов.
- 2.9. Расчеты по результатам клиринга осуществляются в ходе торгов и по итогам торгов.
- 2.10. Способы обеспечения исполнения обязательств, допущенных к клирингу, установлены общей частью Правил клиринга. Имущество, составляющее имущественный пул, сформированный Клиринговым центром в соответствии со статьей 4 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, также является обеспечением исполнения обязательств, допущенных к клирингу.
- 2.10.1. Имущество, составляющее имущественный пул, является обеспечением исполнения следующих обязательств, допущенных к клирингу, с учетом положений пункта 24.8 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов:
- 1) обязательств по договору об имущественном пуле;
 - 2) обязательств по Сделкам T+.
- 2.11. Перечень видов используемых в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов торговых и клиринговых счетов, предназначенных для внесения ценных бумаг / денежных средств в качестве Обеспечения / в имущественный пул, приведен в статье 7 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.
- 2.12. Формы и форматы документов, предоставляемых Участниками клиринга Клиринговому центру в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов и способ их предоставления установлены документом «Формы и форматы документов, предоставляемых Участниками клиринга, клиентами Участников клиринга и Держателями на фондовом рынке и рынке депозитов», если иное не установлено Правилами клиринга.
- 2.13. Сроки исполнения обязательств, определенных Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, время проведения клиринговых сессий, а также сроки проведения клиринговых операций, сроки предоставления документов Клиринговому центру / Клиринговым центром в процессе взаимодействия с Участниками клиринга при проведении клиринга и расчетов по сделкам в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, установлены Временным регламентом на фондовом рынке и рынке депозитов, являющимся приложением № 2 к Правилам клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.
- 2.14. Операции по объединению выпусков эмиссионных ценных бумаг и/или аннулированию индивидуальных номеров (кодов) дополнительных выпусков эмиссионных ценных бумаг осуществляются в Клиринговой системе на следующий Расчетный день после получения соответствующего уведомления от Расчетного депозитария и по окончании расчетов по сделкам с ценными бумагами по итогам клиринга этого дня. Проведение операций по объединению выпусков эмиссионных ценных бумаг и/или аннулированию индивидуальных номеров (кодов) дополнительных выпусков эмиссионных ценных бумаг в Клиринговой системе сопровождается корректировкой информации по сделкам с ценными

бумагами, в том числе по сделкам РЕПО, Дата исполнения которых еще не наступила. Коды объединяемых выпусков ценных бумаг в реквизитах указанных сделок заменяются кодом объединенного выпуска, а аннулируемый код дополнительного выпуска ценных бумаг - кодом выпуска, по отношению к которому данный выпуск является дополнительным.

- 2.15. Техническим центром на фондовом рынке и рынке депозитов является ПАО Московская Биржа.

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

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

- порядок формирования и прекращения имущественного пула (определен статьёй 4 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов);
- права владельца клирингового сертификата участия (определены статьёй 5 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов);
- права и обязанности Участников пула и Клирингового центра (определены Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов);
- порядок и условия выдачи клиринговых сертификатов участия (определены статьёй 24 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов);
- порядок и условия погашения клиринговых сертификатов участия (определены статьёй 26 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов);
- порядок замены имущества в имущественном пуле (определен статьёй 27 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов);
- порядок внесения в клиринговые регистры записей о внесенном в имущественный пул имуществе (определен в соответствующих статьях разделов IV-V Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов);
- порядок раскрытия и (или) предоставления информации об имущественном пуле (определен статьёй 49 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов).

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

Договор об имущественном пуле считается заключенным с даты исполнения Клиринговым центром первого Заявления Участника клиринга на открытие Торгово-клирингового счета имущественного пула.

Порядок подачи и исполнения указанного заявления установлен статьёй 13 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

- 3.3. Участник пула вправе отказаться от договора об имущественном пуле только при условии погашения всех выданных ему клиринговых сертификатов в порядке, установленном статьей 26 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.
- 3.4. Номинальная стоимость одного клирингового сертификата участия составляет 1 (один) российский рубль.
- 3.5. Клиринговый центр вправе использовать в своих интересах денежные средства, включенные в состав имущественного пула, с учетом ограничений, установленных внутренним документом Клирингового центра, определяющим критерии размещения временно свободных денежных средств Клирингового центра.
Доходы от такого использования указанных денежных средств не включаются в состав имущественного пула.

Статья 4. Порядок формирования и прекращения имущественного пула

- 4.1. Клиринговый центр вправе принять решение о формировании имущественного пула, которое содержит:
- код (индивидуальное обозначение) имущественного пула;
 - наименование депозитария, осуществляющего централизованное хранение клиринговых сертификатов участия и учет прав на них;
 - дату начала формирования имущественного пула.
- 4.2. Решение Клирингового центра о формировании имущественного пула публикуется на Сайте Клирингового центра не позднее, чем за 5 (пять) календарных дней до даты начала формирования имущественного пула.
- 4.3. Клиринговый центр не вправе вносить изменения в решение о формировании имущественного пула.
- 4.4. Клиринговый центр вправе сформировать несколько имущественных пулов.
- 4.5. Перечень имущества, которое может быть внесено в каждый имущественный пул, состоит из ценных бумаг и денежных средств, в том числе в иностранной валюте.
- 4.5.1. Перечень ценных бумаг и иностранных валют, принимаемых в каждый из имущественных пулов, устанавливается решением Клирингового центра и раскрывается на Сайте Клирингового центра.
- 4.5.2. Ценные бумаги, эмитентом которых является Участник пула или связанное с ним лицо, учитываемые по субсчету депо, открытому владельцу ценных бумаг, которым является Участник пула, не учитываются в качестве имущества, внесенного в соответствующий имущественный пул таким Участником пула.
- 4.6. Имущественный пул может быть прекращен по решению Клирингового центра только после погашения Клиринговым центром всех клиринговых сертификатов участия в порядке, установленном статьей 26 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

Статья 5. Права владельца клирингового сертификата участия

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

Требование о погашении клиринговых сертификатов участия считается предъявленным Участником пула Клиринговому центру при подаче Участником пула Запроса о возврате денежных средств или распоряжения на перевод денежных средств / ценных бумаг в целях выдачи имущества из имущественного пула в соответствии со статьей 26 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

При погашении клиринговых сертификатов участия Клиринговый центр выдает Участнику пула имущество в порядке и при соблюдении условий, установленных статьей 26 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

Выполнение условий погашения клиринговых сертификатов участия, предусмотренных статьей 26 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, означает отсутствие у Участника пула имущественных обязательств по договору об имущественном пуле в части погашения соответствующего количества клиринговых сертификатов участия.

5.1.1. В случае отзыва (аннулирования) у Участника пула лицензии на осуществление банковских операций или принятия арбитражным судом решения о введении в отношении Участника пула одной из процедур банкротства прекращение обязательств по договору об имущественном пуле осуществляется в ходе ликвидационного неттинга в отношении Участника пула, проводимого в соответствии с общей частью Правил клиринга.

5.1.2. В случае отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций прекращение обязательств по договору об имущественном пуле осуществляется в ходе ликвидационного неттинга в отношении Клирингового центра, проводимого в соответствии с общей частью Правил клиринга.

5.2. Владелец клирингового сертификата участия, не являющийся Участником пула, вправе потребовать от Клирингового центра погашения принадлежащих ему клиринговых сертификатов участия и выплаты денежных средств в размере номинальной стоимости клиринговых сертификатов участия в случае отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций.

5.3. Банк России вправе потребовать от Клирингового центра выкупа его клиринговых сертификатов участия в случае, если Участник клиринга / клиент Участника клиринга, являющийся продавцом по первой части договора репо с клиринговыми сертификатами участия, заключенного с Банком России, не исполнил обязательства по второй части договора репо, в том числе, в случае прекращения обязательств Участника клиринга по основаниям отзыв (аннулирование) Банком России у Участника клиринга / клиента Участника клиринга, являющегося Кредитной организацией, лицензии на осуществление банковских операций и назначение

временной администрации по управлению Участником клиринга - Кредитной организацией в рамках мер по предупреждению банкротства кредитной организации.

Порядок предъявления и исполнения требования о выкупе клиринговых сертификатов участия определен статьей 39 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

Статья 6. Особенности использования Аналога собственноручной подписи

- 6.1. Аналогом собственноручной подписи признается Клиринговый идентификатор, позволяющий однозначно идентифицировать Участника клиринга или Клиринговый центр, направивший электронное сообщение и достоверно установить, что электронное сообщение исходит от Участника клиринга или Клирингового центра, которому присвоен данный Клиринговый идентификатор.
- 6.2. Порядок присвоения Клирингового идентификатора Участнику клиринга определен общей частью Правил клиринга.

Статья 7. Торговые и клиринговые счета

- 7.1. При осуществлении клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов Клиринговый центр использует следующие виды торговых банковских счетов в российских рублях / иностранных валютах, открытых в Расчетной организации с указанием Клирингового центра в качестве клиринговой организации, которая вправе давать распоряжения по этим счетам:
 - торговый счет Участника клиринга / клиента Участника клиринга;
 - специальный брокерский счет Участника клиринга;
 - специальный торговый счет Участника клиринга;
 - торговый счет для учета денежных средств, находящихся в доверительном управлении Участника клиринга.
- 7.2. Для использования при осуществлении клиринга торгового счета клиента Участника клиринга Участник клиринга обязан предоставить Клиринговому центру Уведомление об использовании торгового счета клиента Участника клиринга от такого клиента.
- 7.3. Для использования при осуществлении клиринга торгового счета Участника клиринга, являющегося Клиринговым банком, такой Участник клиринга обязан предоставить Клиринговому центру Уведомление об использовании торгового счета Клирингового банка.

Направление Клиринговым банком Клиринговому центру Уведомления, предусмотренного настоящим подпунктом, означает согласие Клирингового банка на проведение расчетов через соответствующий торговый счет Клирингового банка по обязательствам и требованиям Участника клиринга по денежным средствам и по обязательствам Участника клиринга по уплате Комиссионного вознаграждения по сделкам, заключенным с указанием Торгово-клирингового счета, в состав которого входит Расчетный код, с которым связан торговый счет Клирингового банка.

- 7.4. Торговые банковские счета используются для внесения денежных средств, предназначенных для обеспечения исполнения и исполнения обязательств по сделкам, за исключением Сделок Т+.
- 7.5. При осуществлении клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов Клиринговый центр использует следующие типы торговых счетов депо, открытых в Расчетном депозитарии с указанием Клирингового центра в качестве клиринговой организации, которая вправе давать распоряжения по этим счетам, а также следующие типы счетов депо, открытых в Расчетном депозитарии:
- торговый счет депо владельца Участника клиринга, Клирингового центра или клиента Участника клиринга;
 - торговый счет депо номинального держателя Участника клиринга или Держателя;
 - торговый счет депо иностранного номинального держателя Держателя;
 - торговый счет депо доверительного управляющего Участника клиринга;
 - счет брокера Участника клиринга;
 - эмиссионный счет эмитента;
 - казначейский счет депо эмитента или Клирингового центра;
 - счет депо владельца Участника клиринга или клиента Участника клиринга;
 - счет депо номинального держателя Участника клиринга или Держателя.
- 7.6. При осуществлении клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов Клиринговый центр использует Разделы торговых счетов депо / счетов брокера, а также Разделы, заблокированные для торгов по реализации ценных бумаг, заложенных под ломбардные кредиты и по кредитам овернайт Банка России, счетов депо, открытых в Расчетном депозитарии.
- 7.7. **Раздел Т0** – Раздел, являющийся торговым разделом типа «Блокировано для клиринга в НКЦ») торгового счета депо и используемый для учета ценных бумаг, предназначенных для обеспечения исполнения и исполнения обязательств по сделкам, за исключением Сделок Т+.
- 7.8. **Раздел Т+** – Раздел, являющийся торговым разделом типа «Блокировано для клиринга в НКЦ. Обеспечение» торгового счета депо, предназначенный для учета Обеспечения в ценных бумагах.
- 7.9. Разделы Т0 и Т+, открытые в рамках одного торгового счета депо, являются связанными, если коды таких разделов, за исключением первых двух символов, совпадают.
- 7.10. При осуществлении клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов Клиринговый центр использует клиринговые счета, предусмотренные общей частью Правил клиринга, а также:
- клиринговые счета депо, предназначенные для внесения ценных бумаг в соответствующие имущественные пулы.
- Для каждого из имущественных пулов, формируемых Клиринговым центром, используется отдельный клиринговый счет депо.

7.11. При осуществлении клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов Клиринговый центр использует следующие типы субсчетов депо к клиринговому счету депо, предназначенному для внесения ценных бумаг в имущественный пул (далее – субсчета депо имущественного пула):

- субсчет депо, открытый владельцу ценных бумаг, которым является Участник клиринга или клиент Участника клиринга;
- субсчет депо, открытый номинальному держателю, которым является Участник клиринга или Держатель;
- субсчет депо, открытый иностранному номинальному держателю, которым является Держатель;
- субсчет депо, открытый доверительному управляющему, которым является Участник клиринга.

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

Статья 8. Клиринговые регистры

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

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

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

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

8.2.2. Счет обеспечения T0 в соответствующей валюте связывается с Расчетным кодом на основании Заявления на открытие Торгово-клирингового счета Участника клиринга, предоставляемого Участником клиринга Клиринговому центру в соответствии с пунктом 12.2 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

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

8.3. В состав Торгово-клирингового счета Участника клиринга, используемого на фондовом рынке и рынке депозитов, входят Расчетный код / Счет обеспечения T0 и Раздел, за исключением Торгово-клиринговых счетов, предназначенных для

- заключения депозитных договоров, указанных в подпункте 8.4.2 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.
- 8.3.1. Один Раздел может входить в состав только одного Торгово-клирингового счета.
- 8.3.2. Один Расчетный код / Счет обеспечения T0 может входить в состав нескольких Торгово-клиринговых счетов.
- 8.3.3. Допустимые соответствия типов Расчетного кода / Счетов обеспечения T0 и Раздела в составе Торгово-клирингового счета установлены Регламентом открытия Торгово-клиринговых счетов.
- 8.4. Для заключения Сделок T+ с ценными бумагами может использоваться только Торгово-клиринговый счет, в состав которого входят Раздел T+ и Расчетный код, к которому привязан Счет обеспечения (далее – Торгово-клиринговый счет T+).
- 8.4.1. Для заключения иных сделок может использоваться Торгово-клиринговый счет, в состав которого входят:
- Раздел T+ и Расчетный код, к которому привязан Счет обеспечения;
 - Раздел T0 и Расчетный код, к которому привязан Счет обеспечения;
 - Раздел T0 и Счет обеспечения T0.
- 8.4.2. Для заключения депозитных договоров может использоваться только Торгово-клиринговый счет, в состав которого входит только собственный Расчетный код Участника клиринга, к которому привязан Счет обеспечения.
- Такой Торгово-клиринговый счет имеет в Клиринговой системе специальный признак, означающий, что данный Торгово-клиринговый счет предназначен для заключения депозитных договоров.
- 8.5. Торгово-клиринговые счета, в состав которых входят связанные Раздел T0 и Раздел T+, также являются связанными.
- 8.6. Для заключения сделок РЕПО с клиринговыми сертификатами участия Участник клиринга, за исключением Участника клиринга категории «А», обязан зарегистрировать Торгово-клиринговый счет имущественного пула, в состав которого входят субсчет депо имущественного пула и отдельный Расчетный код Участника клиринга, предназначенный для учета иностранной валюты и российский рублей, внесенных в имущественный пул (далее – Расчетный код имущественного пула).
- 8.6.1. Один субсчет депо имущественного пула может входить в состав только одного Торгово-клирингового счета имущественного пула.
- 8.6.2. Один Расчетный код имущественного пула может входить в состав только одного Торгово-клирингового счета имущественного пула.
- 8.7. При осуществлении клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов на клиринговых регистрах Клиринговый центр учитывает:
- информацию о денежных средствах, внесенных для обеспечения исполнения и исполнения обязательств по сделкам, за исключением Сделок T+, в разрезе валют и Счетов обеспечения T0;
 - информацию об Обеспечении Участников клиринга в разрезе валют и Расчетных кодов Участника клиринга;

- информацию о ценных бумагах, внесенных для обеспечения исполнения и исполнения обязательств по сделкам, за исключением Сделок T+, в разрезе кодов ценных бумаг и Торгово-клиринговых счетов, в состав которых входит Раздел T0;
- информацию об Обеспечении Участников клиринга в ценных бумагах в разрезе кодов ценных бумаг и Торгово-клиринговых счетов T+;
- информацию о ценных бумагах, внесенных в соответствующий имущественный пул, в разрезе кодов ценных бумаг и Торгово-клиринговых счетов имущественного пула;
- информацию о денежных средствах, внесенных в соответствующий имущественный пул, в разрезе валют и Расчетных кодов имущественного пула;
- Единый лимит по Расчетному коду в разрезе Расчетных кодов;
- Единый лимит по пулу в разрезе Расчетных кодов имущественного пула;
- входящее значение номинальной стоимости выданных клиринговых сертификатов участия, поручение на выдачу которых исполнено Расчетным депозитарием (I); учитывается в разрезе Расчетных кодов имущественного пула;
- номинальную стоимость клиринговых сертификатов участия, подлежащих выдаче в ходе ближайшего взаимодействия с Расчетным депозитарием (C); учитывается в разрезе Расчетных кодов имущественного пула;
- номинальную стоимость клиринговых сертификатов участия, подлежащих погашению в ходе ближайшего взаимодействия с Расчетным депозитарием (D); учитывается в разрезе Расчетных кодов имущественного пула;
- текущее значение номинальной стоимости выданных клиринговых сертификатов участия, равное $I + C - D$; учитывается в разрезе Расчетных кодов имущественного пула;
- информацию об обязанностях и требованиях Участников клиринга по каждому допущенному к клирингу обязательству по сделке;
- Нетто-обязательство / Нетто-требование Участников клиринга по денежным средствам / ценным бумагам по сделкам клирингового пула в разрезе Расчетных кодов (Счетов обеспечения T0) / Торгово-клиринговых счетов, валют / кодов ценных бумаг;
- Нетто-обязательство / Нетто-требование Участников клиринга по денежным средствам / ценным бумагам по Сделкам T+ в разрезе Расчетных кодов / Торгово-клиринговых счетов T+, Дат исполнения, валют / кодов ценных бумаг;
- Итоговое нетто-обязательство / Итоговое нетто-требование Участников клиринга в разрезе Расчетных кодов / Торгово-клиринговых счетов T+, валют / кодов ценных бумаг;
- информацию о Маржинальных требованиях Участников клиринга в разрезе Расчетных кодов Участника клиринга (в случае наличия);
- информацию о Маржинальных требованиях по пулу в разрезе Расчетных кодов имущественного пула (в случае наличия).

- 8.8. Порядок и случаи изменения значений клиринговых регистров указаны в соответствующих статьях разделов IV-V Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, порядок изменения значений клиринговых регистров Счет обеспечения Т0 и Торгово-клиринговый счет Т0 приведен в приложении № 3 к Правилам клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

РАЗДЕЛ II. ТРЕБОВАНИЯ К УЧАСТНИКАМ КЛИРИНГА

Статья 9. Условия клирингового обслуживания. Порядок предоставления допуска к клиринговому обслуживанию

9.1. В соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов Участникам клиринга могут быть присвоены следующие категории Участников клиринга:

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

9.1.1. К клирингу без предварительного обеспечения допускаются Участники клиринга всех категорий.

9.1.2. Участники клиринга категории «А» имеют доступ к клирингу с частичным обеспечением, к клирингу с полным обеспечением, к клирингу без предварительного обеспечения.

9.2. Допуск к клиринговому обслуживанию на фондовом рынке и рынке депозитов предоставляется Участнику клиринга, соответствующему требованиям, установленным для соответствующей категории Участников клиринга в общей части Правил клиринга, а также требованиям, указанным в пункте 9.3 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

9.3. Для допуска к клиринговому обслуживанию Участник клиринга категории «В» должен дополнительно соответствовать следующим требованиям:

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

9.3.2. Участник клиринга - Некредитная организация, не являющийся профессиональным участником рынка ценных бумаг, иметь собственные средства (капитал) не менее, чем 1 000 000 000 (один миллиард) российских рублей.

9.4. Для допуска к клиринговому обслуживанию Участник клиринга - Некредитная организация категории «Б», не являющийся профессиональным участником рынка ценных бумаг, должен дополнительно соответствовать следующим требованиям:

9.4.1. иметь собственные средства (капитал) не менее, чем 10 000 000 000 (десять миллиардов) российских рублей;

9.4.2. иметь валюту баланса не менее, чем 50 000 000 000 (пятьдесят миллиардов) российских рублей.

Статья 10. Особенности приостановления допуска к клиринговому обслуживанию

10.1. Клиринговый центр вправе приостановить доступ к клиринговому обслуживанию Участника клиринга категории «Б» или категории «В» по всем сделкам или по отдельным видам сделок, а также по отдельным Режимам торгов, по основаниям,

предусмотренным общей частью Правил клиринга, а также по следующим основаниям:

- 10.1.1. при отсутствии хотя бы одного зарегистрированного Торгово-клирингового счета;
- 10.1.2. при несоответствии размера собственных средств (капитала) Участника клиринга - Некредитной организации, не являющегося профессиональным участником рынка ценных бумаг, требованию, установленному подпунктом 9.3.2 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов;
- 10.1.3. в случае если объем обязательств Клирингового центра по возврату депозитов Участнику клиринга по всем заключенным с таким Участником клиринга депозитным договорам превысит 1 000 000 000 000 (один триллион) российских рублей.
- 10.2. Клиринговый центр вправе установить Участнику клиринга категории «Б» категорию «В» по основаниям, предусмотренным общей частью Правил клиринга, а также в следующих случаях:
 - 10.2.1. при невыполнении Участником клиринга - Некредитной организацией, не являющимся профессиональным участником рынка ценных бумаг, любого из требований, предусмотренных пунктом 9.4 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов;
 - 10.2.2. при превышении установленного в подпункте 40.1.5, 41.1.5, 41.1.6 или 41.1.7 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов количества Расчетных дней, в течение которых у Участника клиринга может возникать Задолженность, или Итоговое нетто-обязательство по ценной бумаге, для исполнения которого недостаточно ценных бумаг, или отрицательный Единый лимит по Расчетному коду, входящий в состав Торгово-клирингового счета T+, по которому учитывается Итоговое нетто-требование в ценных бумагах, не принимаемых в качестве обеспечения исполнения обязательств по Сделкам T+.

Статья 11. Требования к Держателям. Порядок получения (лишения) статуса Держателя

- 11.1. Для получения статуса Держателя юридические лица, являющиеся Участниками клиринга, предоставляют Клиринговому центру:
 - Заявление о предоставлении статуса Держателя;
 - нотариально удостоверенную копию лицензии профессионального участника рынка ценных бумаг на осуществление депозитарной деятельности, выданной уполномоченным органом (для организаций, являющихся Резидентами).
- 11.2. Для получения статуса Держателя юридические лица, не являющиеся Участниками клиринга, помимо документов, указанных в пункте 11.1 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, предоставляют Клиринговому центру:
 - юридические лица - Резиденты - документы, указанные в разделе I приложения № 1 к Правилам клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов;
 - юридические лица - Нерезиденты - документы, указанные в разделе II приложения № 1 к Правилам клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

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

- 11.3. Решение о предоставлении (лишении) юридическому лицу статуса Держателя принимается Клиринговым центром.
- 11.4. Юридическое лицо / Участник клиринга может быть лишен статуса Держателя по любому из следующих оснований:
 - 11.4.1. в случае аннулирования или приостановления действия лицензии профессионального участника рынка ценных бумаг на осуществление депозитарной деятельности,
 - 11.4.2. в случае отзыва (аннулирования) Банком России лицензии на осуществление банковских операций (для Кредитных организаций);
 - 11.4.3. при невыполнении условий для получения в соответствии с Порядком ЭДО отчетных документов по итогам клиринга в форме электронных документов,
 - 11.4.4. нарушения Держателем требований по представлению документов, указанных в пункте 11.5 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов,
 - 11.4.5. письма Держателя о лишении его статуса Держателя;
 - 11.4.6. при применении к Держателю санкций уполномоченных органов за нарушение законодательства Российской Федерации, в том числе при применении административных наказаний;
 - 11.4.7. в случае назначения временной администрации или принятия арбитражным судом решения о введении в отношении Держателя одной из процедур банкротства;
 - 11.4.8. ликвидации Держателя, а также в случае реорганизации Держателя при условии, что деятельность Держателя в результате реорганизации прекращается;
 - 11.4.9. неоднократного (два и более) нарушения Держателем установленных Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов требований;
 - 11.4.10. в случае получения от иностранного налогового органа уведомления о невыполнении Держателем требований законодательства иностранного государства;
 - 11.4.11. в случае наличия риска потери деловой репутации Клирингового центра в связи с сохранением статуса Держателя;
 - 11.4.12. по иным основаниям.
- 11.5. Держатель обязан ежегодно предоставлять Клиринговому центру Анкету Участника клиринга (клиента) (Регистрационную карточку) в форме электронного документа.

В случае изменения сведений, содержащихся в Анкете Участника клиринга (клиента) (Регистрационной карточке) или в иных предоставленных Клиринговому центру документах, Держатель обязан в течение 5 (пяти) рабочих дней после таких изменений предоставить Клиринговому центру Анкету Участника клиринга (клиента) (Регистрационную карточку) с обновленной информацией в форме

электронного документа и соответствующие документы, подтверждающие такие изменения.

- 11.6. Форматы предоставления Держателем Анкеты Участника клиринга (клиента) (Регистрационной карточки) определены Порядком предоставления информации и отчетности.
- 11.7. Клиринговый центр извещает юридическое лицо / Участника клиринга о получении им статуса Держателя, а также о лишении его статуса Держателя путем размещения соответствующей информации на Сайте Клирингового центра в течение 3 (трех) рабочих дней со дня принятия соответствующего решения.

Статья 12. Особенности регистрации Участников клиринга, Торгово-клиринговых счетов Участников клиринга

- 12.1. Процедура регистрации Участника клиринга Клиринговым центром предусматривает присвоение Участнику клиринга следующего идентификатора, помимо кодов, установленных общей частью Правил клиринга:
- Идентификатор (присваивается Клиринговым центром). Если Участник клиринга является Участником торгов, Идентификатор присваивается на основании данных, полученных от Биржи.
- 12.2. Заявление на открытие Торгово-клирингового счета Участника клиринга должно содержать указание на открытый Расчетный код Участника клиринга, который будет входить в состав открываемого Торгово-клирингового счета Участника клиринга, либо указание на необходимость открытия нового Расчетного кода Участника клиринга, либо указание на торговый банковский счет Участника клиринга или его клиента (за исключением Торгово-клирингового счета, предназначенного для заключения депозитных договоров).
- 12.2.1. Заявление на открытие Торгово-клирингового счета Участника клиринга (за исключением Торгово-клирингового счета, предназначенного для заключения депозитных договоров) должно содержать указание на Раздел, который будет входить в состав открываемого Торгово-клирингового счета Участника клиринга.
- 12.2.2. На основании Заявления на открытие Торгово-клирингового счета Участника клиринга, содержащего указание на необходимость открытия нового Расчетного кода Участника клиринга, открывается Расчетный код Участника клиринга с типом, соответствующим типу Раздела, входящему в состав Торгово-клирингового счета совместно с таким Расчетным кодом.
- 12.2.3. Заявление на открытие Торгово-клирингового счета Участника клиринга, содержащее указание на необходимость открытия нового Расчетного кода Участника клиринга и не содержащее указание на Раздел, должно содержать указание на тип открываемого Расчетного кода.
- 12.2.4. Клиринговый центр вправе отказать в регистрации Торгово-клирингового счета Участника клиринга, в состав которого входит Раздел торгового счета депо Держателя, в случае, если по заключению Клирингового центра регистрация такого Торгово-клирингового счета Участника клиринга может повлечь увеличение принимаемых Клиринговым центром рисков и/или нарушение правил и порядка

внутреннего контроля, осуществляемого Клиринговым центром в соответствии с нормативными актами Банка России.

12.2.5. В случае наличия зарегистрированного Торгово-клирингового счета, в состав которого входит Раздел Т0, регистрация Торгово-клирингового счета Т+, в состав которого входит Раздел Т+, связанный с Разделом Т0, осуществляется Клиринговым центром без предоставления Участником клиринга Заявления на регистрацию ТКС.

12.3. Участник клиринга категории «Б» вправе с использованием Клиринговой системы установить для Торгово-клирингового счета Т+ признак «запрет коротких продаж» и/или признак «запрет необеспеченных покупок».

По Сделкам Т+, заключенным с указанием Торгово-клирингового счета Т+ с признаком «запрет коротких продаж», осуществляется клиринг с полным обеспечением по ценным бумагам.

По Сделкам Т+, заключенным с указанием Торгово-клирингового счета Т+ с признаком «запрет необеспеченных покупок», осуществляется клиринг с полным обеспечением по денежным средствам.

12.3.1. Для Торгово-клирингового счета Т+ Участник клиринга категории «Б» вправе с использованием Клиринговой системы установить ограничение на размер Нетто-обязательства по ценной бумаге по Сделкам Т+. Соблюдение указанного ограничения проверяется при подаче заявки на заключение Сделки Т+ с учетом обязательств и требований по Сделкам Т+, которые могут быть заключены на основании такой заявки.

Статья 13. Порядок открытия Торгово-клиринговых счетов имущественного пула

13.1. Открытие Торгово-клирингового счета имущественного пула осуществляется на основании Заявления на открытие Торгово-клирингового счета имущественного пула, предоставляемого Участником клиринга Клиринговому центру.

13.1.1. В Заявлении на открытие Торгово-клирингового счета имущественного пула Участник клиринга указывает:

- код (наименование) имущественного пула;
- Торгово-клиринговый счет Т+, в состав которого входит Раздел Т+, на который будут зачисляться выдаваемые клиринговые сертификаты участия.

13.2. На основании Заявления на открытие Торгово-клирингового счета имущественного пула, полученного от Участника клиринга, Клиринговый центр:

13.2.1. открывает Участнику клиринга Расчетный код имущественного пула с типом, соответствующим типу Расчетного кода, входящего в состав Торгово-клирингового счета Т+, указанного в Заявлении на открытие Торгово-клирингового счета имущественного пула;

13.2.2. для открытого в соответствии с подпунктом 13.2.1 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов Расчетного кода имущественного пула открывает один Счет обеспечения в российских рублях и по одному Счету обеспечения в каждой иностранной валюте, принимаемой в соответствующий имущественный пул;

- 13.2.3. открывает Торгово-клиринговый счет имущественного пула, в состав которого входит открытый в соответствии с подпунктом 13.2.1 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов Расчетный код имущественного пула;
- 13.2.4. устанавливает соответствие между открытым Торгово-клиринговым счетом имущественного пула и Торгово-клиринговым счетом Т+, указанным в Заявлении на открытие Торгово-клирингового счета имущественного пула;
- 13.2.5. направляет Расчетному депозитарию поручение на открытие субсчета депо соответствующего имущественного пула для депонента, которому открыт Раздел Т+, входящий в состав Торгово-клирингового счета Т+, указанного в Заявлении на открытие Торгово-клирингового счета имущественного пула, с типом, соответствующим типу указанного Раздела Т+;
- 13.2.6. после получения от Расчетного депозитария информации об открытии субсчета депо имущественного пула в составе списка Разделов / субсчетов депо, направляемого в соответствии с пунктом 45.2 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, включает в состав соответствующего Торгово-клирингового счета имущественного пула указанный субсчет депо имущественного пула.
- 13.3. Под каждый из имущественных пулов, формируемых Клиринговым центром, Участнику клиринга открываются отдельные субсчета депо имущественного пула, Расчетные коды имущественного пула и Торгово-клиринговые счета имущественного пула.
- 13.4. Торгово-клиринговый счет имущественного пула может указываться в заявке на продажу ценных бумаг / иностранной валюты из имущественного пула. По такой сделке будет осуществляться клиринг с полным обеспечением по ценным бумагам / иностранной валюте.

Статья 14. Особенности регистрации Обособленных клиентов

- 14.1. Помимо отдельного клиентского Расчетного кода Участник клиринга должен открыть для Обособленного клиента отдельный Раздел и отдельный Торгово-клиринговый счет, в состав которого входит такой Раздел и такой Расчетный код, а для Обособленных клиентов – владельцев клиринговых сертификатов участия открыть отдельный Торгово-клиринговый счет имущественного пула / отдельные Торгово-клиринговые счета имущественного пула.
- 14.2. В Заявлении на регистрацию Обособленного клиента помимо информации, предусмотренной общей частью Правил клиринга, Участник клиринга обязан указать Торгово-клиринговые счета, открытые для Обособленного клиента.
- 14.3. Участник клиринга не вправе указывать Расчетный код, открытый для Обособленного клиента и входящий в состав Торгово-клиринговых счетов для Обособленного клиента, при регистрации иных Торгово-клиринговых счетов.

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

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

- 15.1. В целях снижения рисков, связанных с осуществлением клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, Клиринговый центр применяет меры, предусмотренные общей частью Правил клиринга.
- 15.2. Гарантийный фонд формируется Клиринговым центром за счет взносов всех Участников клиринга категории «Б».
- 15.2.1. Для Участников клиринга категории «Б» на фондовом рынке размер взноса в Гарантийный фонд каждого Участника клиринга составляет 5 000 000 (пять миллионов) российских рублей.
- 15.2.2. Для Участников клиринга категории «Б» на рынке депозитов размер взноса в Гарантийный фонд каждого Участника клиринга составляет 1 000 000 (один миллион) российских рублей.
- 15.3. Обеспечение под стресс обязаны вносить Участники клиринга категории «Б». Порядок определения размера Обеспечения под стресс Участника клиринга установлен Методикой определения размера Обеспечения под стресс.
- 15.4. При неисполнении Участником клиринга Маржинального требования по фондам и/или Маржинального требования по обеспечению под стресс, порядок выставления и исполнения которых определен общей частью Правил клиринга, Участнику клиринга категории «Б» устанавливается категория «В».
- 15.5. При использовании взноса Участника клиринга в Гарантийный фонд фондового рынка и рынка депозитов и/или Обеспечения под стресс на фондовом рынке и рынке депозитов Участнику клиринга категории «Б» устанавливается категория «В».
- 15.6. В случае возмещения Участником клиринга средств Гарантийного фонда фондового рынка и рынка депозитов и Обеспечения под стресс на фондовом рынке и рынке депозитов в течение 1 (одного) Расчетного дня после направления Клиринговым центром такому Участнику клиринга Маржинального требования по фонду и/или Маржинального требования по Обеспечению, Участнику клиринга категории «В» устанавливается категория «Б».

Статья 16. Перечень мер, направленных на управление рисками по операциям с клиринговыми сертификатами участия

- 16.1. В целях снижения рисков, связанных с выдачей и обращением клиринговых сертификатов участия, Клиринговый центр кроме мер, предусмотренных статьей 15 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов:
- не реже, чем каждый Расчетный день, осуществляет переоценку стоимости имущества, внесенного каждым Участником клиринга в каждый из

имущественных пулов, и контроль достаточности указанного имущества для обеспечения исполнения обязательств Участника клиринга по договору об имущественном пуле, в случае недостаточности – предъявляет Участнику клиринга Маржинальное требование по пулу;

- при возврате имущества, внесенного в имущественный пул, осуществляет контроль достаточности указанного имущества для обеспечения исполнения обязательств Участника клиринга по договору об имущественном пуле.

16.2. Порядок расчета стоимости имущества, внесенного в имущественный пул, определен в статье 18 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

Порядок выставления и исполнения Маржинального требования по пулу определен в статье 29 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

Порядок возврата имущества, внесенного в имущественный пул, определен в статье 26 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

Статья 17. Единый лимит по Расчетному коду и риск-параметры

17.1. Единый лимит по Расчетному коду рассчитывается Клиринговым центром при изменении размера Обеспечения Участника клиринга, при подаче Участником торгов заявок на заключение сделок, стороной по которым будет являться Участник клиринга, при заключении сделок или исполнении / прекращении обязательств по сделкам, стороной по которым является Участник клиринга, изменении риск-параметров.

17.2. Единый лимит по Расчетному коду используется для проверки возможности подачи Участником торгов заявок на заключение сделок, стороной по которым будет являться Участник клиринга, исполнения / прекращения обязательств по сделкам, стороной по которым является Участник клиринга, возврата Участнику клиринга Обеспечения, а также выполнения иных операций, предусмотренных Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов. Указанная проверка осуществляется, исходя из анализа изменения значения Единого лимита по Расчетному коду до и после проведения операции.

17.3. Единый лимит по Расчетному коду рассчитывается с учетом:

- Обеспечения Участника клиринга в российских рублях и иностранной валюте, учитываемого по Расчетному коду;
- Обеспечения Участника клиринга в ценных бумагах, учитываемого по всем Торгово-клиринговым счетам Т+, в состав которых входит Расчетный код;
- Нетто-обязательств / Нетто-требований Участника клиринга по Сделкам Т+ в российских рублях / иностранной валюте, учитываемых по Расчетному коду, по всем Датам исполнения;
- Нетто-обязательств / Нетто-требований Участника клиринга по Сделкам Т+ в ценных бумагах, учитываемых по всем Торгово-клиринговым счетам Т+, в состав которых входит Расчетный код, по всем Датам исполнения;
- обязательств по уплате Комиссионных вознаграждений по Сделкам Т+, учитываемых по Расчетному коду;
- Задолженности Участника клиринга перед Клиринговым центром в

- российских рублях, учитываемой по Расчетному коду;
 - обязательств по передаче / требований по получению Дохода, учитываемых по Расчетному коду, и/или по Торгово-клиринговым счетам T+, относящимся к Расчетному коду;
 - иных обязательств / требований Участника клиринга, если это установлено Правилами клиринга.
- 17.4. Обязательства по передаче / требования по получению Дохода, определенные Клиринговым центром в соответствии со статьей 47 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, учитываются при расчете Единого лимита по Расчетному коду в Дату исполнения обязательств по передаче Дохода, а обязательства по передаче Дохода в форме денежных средств – дополнительно учитываются с даты заключения сделки до даты, предшествующей Дате исполнения обязательств по передаче такого Дохода (включительно), либо до даты, установленной решением Клирингового центра.
- 17.5. Клиринговый центр вправе с использованием Клиринговой системы установить ограничение на минимальное допустимое отрицательное значение Единого лимита по Расчетному коду, рассчитанного без учета Обеспечения Участника клиринга.
- 17.6. Участник клиринга вправе с использованием Клиринговой системы установить ограничение на минимальное допустимое значение, в том числе отрицательное, Единого лимита по Расчетному коду, рассчитанного без учета Обеспечения Участника клиринга.
- 17.7. При расчете Единого лимита по Расчетному коду в ходе торгов кроме величин, указанных в пункте 17.3 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, также учитываются зарегистрированные заявки на заключение Сделок T+, стороной по которым будет являться Участник клиринга.
- 17.8. Базовыми риск-параметрами, используемыми Клиринговым центром для контроля и управления рисками, являются:
- Расчетная цена;
 - Верхняя и Нижняя границы ценового коридора;
 - Верхняя и Нижняя границы диапазона оценки рыночных рисков;
 - дисконт;
 - Расчетная ставка РЕПО;
 - Верхняя и Нижняя границы коридора ставок РЕПО;
 - Верхняя и Нижняя границы диапазона оценки процентных рисков.
- Помимо базовых риск-параметров Клиринговым центром используются дополнительные риск-параметры, приведенные в Методике определения риск-параметров фондового рынка и рынка депозитов.
- 17.9. Для контроля и управления рисками по Сделкам T+ с расчетами в иностранной валюте, Клиринговый центр использует риск-параметры, перечень которых, а также порядок их установления и изменения определены Правилами клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.

- 17.10. Расчет и изменение риск-параметров осуществляется Клиринговым центром каждый Торговый день по состоянию на 19:00 по московскому времени.
- Клиринговый центр может принять решение об изменении риск-параметров до начала торгов, в том числе в ходе клиринговой сессии, и в ходе торгов.
- Изменения риск-параметров в ходе торгов, проводимых после 19:00 по московскому времени, не производится.
- Порядок расчета и изменения риск-параметров установлен Методикой определения риск-параметров фондового рынка и рынка депозитов и Методикой определения риск-параметров валютного рынка и рынка драгоценных металлов.
- 17.11. Верхняя или Нижняя границы диапазона оценки рыночных рисков 1-го уровня применяется при расчете Единого лимита по Расчетному коду к части суммы с учетом знака Нетто-обязательств и Нетто-требований Участника клиринга в ценных бумагах, учитываемых по Торгово-клиринговому счету Т+ совместно с Расчетным кодом, по всем Датам исполнения и Обеспечения в ценных бумагах, учитываемому по тому же Торгово-клиринговому счету Т+, не превышающей по абсолютной величине значения Лимита концентрации 1-го уровня, Верхняя или Нижняя границы диапазона оценки рыночных рисков 2-го уровня – к части указанной суммы, превышающей по абсолютной величине значение Лимита концентрации 1-го уровня и не превышающей по абсолютной величине Лимита концентрации 2-го уровня, Верхняя или Нижняя границы диапазона оценки рыночных рисков 3-го уровня – к части указанной суммы, превышающей по абсолютной величине значение Лимита концентрации 2-го уровня.
- 17.12. Верхняя или Нижняя граница диапазона оценки процентных рисков 1-го уровня, установленная для Даты исполнения, применяется при расчете Единого лимита по Расчетному коду к части суммы с учетом знака Нетто-обязательств и Нетто-требований Участника клиринга в ценных бумагах, учитываемых по Торгово-клиринговому счету Т+ совместно с Расчетным кодом, по такой Дате исполнения, не превышающей по абсолютной величине значения Лимита концентрации 1-го уровня, Верхняя или Нижняя границы диапазона оценки процентных рисков 2-го уровня – к части указанной суммы, превышающей по абсолютной величине значение Лимита концентрации 1-го уровня и не превышающей по абсолютной величине Лимита концентрации 2-го уровня, Верхняя или Нижняя границы диапазона оценки процентных рисков 3-го уровня – к части указанной суммы, превышающей по абсолютной величине значение Лимита концентрации 2-го уровня.
- 17.13. Участник клиринга категории «Б» вправе с использованием Клиринговой системы установить индивидуальные Верхние и Нижние границы диапазона оценки рыночных рисков 1-го, 2-го или 3-го уровня и Верхние и Нижние границы диапазона оценки процентных рисков 1-го, 2-го или 3-го уровня, расширяющие указанные диапазоны, для определенных Торгово-клиринговых счетов Участника клиринга по определенной ценной бумаге / иностранной валюте.
- 17.14. Единый лимит по Расчетному коду рассчитывается Клиринговым центром исходя из оценки в российских рублях максимально возможного уменьшения в течение срока, необходимого для прекращения обязательств по Сделкам Т+ в случае неисполнения Участником клиринга Маржинального требования, общей стоимости активов и обязательств, указанных в пункте 17.3 Правил клиринга на фондовом

рынке и рынке депозитов, в связи с изменением Расчетных цен ценных бумаг, являющихся предметом Сделок Т+, изменением Ставок по сделкам РЕПО, являющимся Сделками Т+, Центральных курсов иностранных валют и/или изменением процентных ставок по сделкам своп.

Указанная оценка проводится с использованием Верхних и Нижних границ диапазона оценки рыночных рисков 1-го, 2-го и 3-го уровня и Верхних и Нижних границ диапазона оценки процентных рисков 1-го, 2-го и 3-го уровня. В случае если Участником клиринга установлены индивидуальные значения указанных риск-параметров, указанная оценка проводится с использованием таких индивидуальных значений указанных риск-параметров.

Основные правила расчета Единого лимита по Расчетному коду определены в документе «Принципы расчета Единого лимита», раскрываемом на Сайте Клирингового центра.

Статья 18. Единый лимит по пулу

- 18.1. Единый лимит по пулу рассчитывается Клиринговым центром по Расчетному коду имущественного пула при внесении имущества в имущественный пул, при возврате имущества из имущественного пула, при подаче заявок на заключение Сделок Т+ с указанием Торгово-клирингового счета имущественного пула, при заключении Сделок Т+ или исполнении / прекращении обязательств по Сделкам Т+, заключенных с указанием Торгово-клирингового счета имущественного пула, а также при изменении базовых риск-параметров.
- 18.2. Единый лимит по пулу используется для контроля за соответствием стоимости имущества, внесенного в соответствующий имущественный пул, номинальной стоимости выданных клиринговых сертификатов участия при выполнении операций, указанных в пункте 18.1 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, а также иных операций, предусмотренных Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов. Указанный контроль осуществляется, исходя из анализа изменения значения Единого лимита по пулу до и после проведения операции.
- 18.3. Единый лимит по пулу по Расчетному коду имущественного пула рассчитывается с учетом:
- российских рублей и иностранной валюты, внесенных в имущественный пул и учитываемых по Расчетному коду имущественного пула (учитываются со знаком «плюс»);
 - ценных бумаг, внесенных в имущественный пул и учитываемых по Торгово-клиринговому счету имущественного пула (учитываются со знаком «плюс»);
 - текущего значения номинальной стоимости выданных клиринговых сертификатов участия, учитываемого по Расчетному коду имущественного пула (отражается в Клиринговой системе со знаком «плюс», при расчете Единого лимита по пулу вычитается из рассчитываемого значения);
 - Нетто-обязательств Участника клиринга по Сделкам Т+ в российских рублях / иностранной валюте, учитываемых по Расчетному коду имущественного пула, по всем Датам исполнения (учитываются со знаком «минус»);
 - Нетто-требований Участника клиринга по Сделкам Т+ в российских рублях /

- иностранной валюте, учитываемых по Расчетному коду имущественного пула, по всем Датам исполнения (учитываются со знаком «плюс»);
- Нетто-обязательств Участника клиринга по Сделкам T+ в ценных бумагах, учитываемых по Торгово-клиринговому счету имущественного пула, по всем Датам исполнения (учитываются со знаком «минус»);
 - Нетто-требований Участника клиринга по Сделкам T+ в ценных бумагах, учитываемых по Торгово-клиринговому счету имущественного пула, по всем Датам исполнения (учитываются со знаком «плюс»).
- 18.4. При расчете Единый лимит по пулу в ходе торгов кроме величин, указанных в пункте 18.3 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, также учитываются зарегистрированные заявки на заключение Сделок T+, стороной по которым будет являться Участник клиринга, поданных с указанием Торгово-клирингового счета имущественного пула.
- 18.5. Базовыми риск-параметрами, используемыми Клиринговым центром для контроля и управления рисками по имущественным пулам, являются следующие риск-параметры, установленные в соответствии со статьей 17 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов для соответствующей ценной бумаги, принимаемой в имущественный пул:
- Расчетная цена;
 - Верхняя и Нижняя границы ценового коридора;
 - Верхняя и Нижняя границы диапазона оценки рыночных рисков;
 - Расчетная ставка РЕПО;
 - Верхняя и Нижняя границы коридора ставок РЕПО;
 - Верхняя и Нижняя границы диапазона оценки процентных рисков.
- 18.6. Для расчета Единого лимита по пулу и управления рисками по иностранной валюте и Сделкам T+ с расчетами в иностранной валюте, Клиринговый центр использует риск-параметры, перечень которых, а также порядок их установления и изменения определены Правилами клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.
- 18.7. Верхняя или Нижняя границы диапазона оценки рыночных рисков 1-го уровня применяется при расчете Единого лимита по пулу к части суммы с учетом знака Нетто-обязательств и Нетто-требований Участника клиринга в ценных бумагах, учитываемых по Торгово-клиринговому счету имущественного пула совместно с Расчетным кодом имущественного пула, по всем Датам исполнения и количества ценных бумагах, внесенных в имущественный пул и учитываемых по тому же Торгово-клиринговому счету имущественного пула, не превышающей по абсолютной величине значения Лимита концентрации 1-го уровня, Верхняя или Нижняя границы диапазона оценки рыночных рисков 2-го уровня – к части указанной суммы, превышающей по абсолютной величине значение Лимита концентрации 1-го уровня и не превышающей по абсолютной величине Лимита концентрации 2-го уровня, Верхняя или Нижняя границы диапазона оценки рыночных рисков 3-го уровня – к части указанной суммы, превышающей по абсолютной величине значение Лимита концентрации 2-го уровня.

- 18.8. Верхняя или Нижняя граница диапазона оценки процентных рисков 1-го уровня, установленная для Даты исполнения, применяется при расчете Единого лимита по пулу к части суммы с учетом знака Нетто-обязательств и Нетто-требований Участника клиринга в ценных бумагах, учитываемых по Торгово-клиринговому счету имущественного пула совместно с Расчетным кодом имущественного пула, по такой Дате исполнения, не превышающей по абсолютной величине значения Лимита концентрации 1-го уровня, Верхняя или Нижняя границы диапазона оценки процентных рисков 2-го уровня – к части указанной суммы, превышающей по абсолютной величине значение Лимита концентрации 1-го уровня и не превышающей по абсолютной величине Лимита концентрации 2-го уровня, Верхняя или Нижняя границы диапазона оценки процентных рисков 3-го уровня – к части указанной суммы, превышающей по абсолютной величине значение Лимита концентрации 2-го уровня.
- 18.9. Если по Торгово-клиринговому счету Т+ Участника клиринга Участником клиринга установлены индивидуальные Верхние и Нижние границы диапазона оценки рыночных рисков и/или Верхние и Нижние границы диапазона оценки процентных рисков, такие же риск-параметры применяются для Торгово-клирингового счета имущественного пула, соответствующего такому Торгово-клиринговому счету Т+.
- 18.10. Единый лимит по пулу рассчитывается Клиринговым центром исходя из оценки в российских рублях максимально возможного уменьшения в течение срока, необходимого для прекращения обязательств по договору об имущественном пуле в случае неисполнения Участником клиринга Маржинального требования по пулу, общей стоимости активов и обязательств, указанных в пункте 18.3 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, в связи с изменением базовых риск-параметров.
- Указанная оценка проводится с использованием Верхних и Нижних границ диапазона оценки рыночных рисков 1-го, 2-го и 3-го уровня и Верхних и Нижних границ диапазона оценки процентных рисков 1-го, 2-го и 3-го уровня. В случае если Участником клиринга установлены индивидуальные значения указанных риск-параметров, указанная оценка проводится с использованием таких индивидуальных значений указанных риск-параметров.
- Основные правила расчета Единого лимита по пулу определены в документе «Принципы расчета Единого лимита», раскрываемом на Сайте Клирингового центра.
- 18.11. Если Единый лимит по пулу по Расчетному коду имущественного пула, рассчитанный в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, является неотрицательным, стоимость имущества, внесенного в имущественный пул и учитываемого по такому Расчетному коду имущественного пула, является соответствующей текущему значению номинальной стоимости выданных клиринговых сертификатов участия, учитываемой по тому же Расчетному коду имущественного пула.
- 18.11.1. При превышении стоимости имущества, внесенного в соответствующий имущественный пул, текущего значения номинальной стоимости выданных клиринговых сертификатов участия Клиринговый центр выдает Участнику пула

дополнительные клиринговые сертификаты участия в порядке, определенном статьей 24 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

- 18.11.2. Если Единый лимит по пулу по Расчетному коду имущественного пула, рассчитанный в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, является отрицательным, Клиринговый центр вправе погасить клиринговые сертификаты участия, при соблюдении условий и в порядке, указанном в статье 26 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, и/или предпринимает действия, предусмотренные статьей 29 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

РАЗДЕЛ IV. ПОРЯДОК И УСЛОВИЯ ДОПУСКА ОБЯЗАТЕЛЬСТВ К КЛИРИНГУ

Статья 19. Порядок взаимодействия с Биржей при подаче заявок и заключении сделок, допуске к клирингу обязательств по биржевым сделкам и обязательств по внесению компенсационных взносов

- 19.1. При подаче Участником торгов заявки, Биржа с использованием Системы торгов направляет Клиринговому центру информацию о поданной заявке.
- 19.2. Немедленно после получения информации о поданной заявке Клиринговый центр проверяет возможность регистрации заявки в Системе торгов.
- Регистрация заявки в Системе торгов является возможной при выполнении одновременно следующих условий:
- 1) активного состояния¹ в Клиринговой системе Торгово-клирингового счета, указанного в заявке;
 - 2) для заявок на заключение сделок с кодом расчетов Yn , если значение цены, указанной в заявке, больше либо равно Нижней границе ценового коридора и меньше либо равно Верхней границе ценового коридора, установленных Клиринговым центром для ценной бумаги, по которой подана заявка;
 - 3) для заявок на заключение сделок РЕПО с кодом расчетов $T0/Yn$, Ym/Yn , если значение ставки РЕПО, указанной в заявке, больше либо равно Нижней границе коридора ставок РЕПО и меньше либо равно Верхней границе коридора ставок РЕПО, установленных Клиринговым центром для ценной бумаги, по которой подана заявка;
 - 4) прохождения заявкой Процедуры контроля обеспечения в соответствии со статьей 20 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, за исключением заявок на заключение сделок с кодом расчетов $K0$.
- 19.3. Процедура контроля обеспечения по сделкам с кодом расчетов $T0$, $Z0$, Rb , $X0$, $B0$ - $B30$, Sn , $K0$ осуществляется по Торгово-клиринговому счету, указанному в заявке на заключение сделки, или по Расчетному коду / Счету обеспечения $T0$, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в заявке на заключение сделки.
- 19.3.1. Процедура контроля обеспечения по сделкам с кодом расчетом Yn , $T0/Yn$, Ym/Yn осуществляется по следующим Торгово-клиринговому счету $T+$ / Торгово-клиринговому счету имущественного пула и Расчетному коду:
- в случае если в заявке на заключение сделки указан Торгово-клиринговый счет $T+$, то по Торгово-клиринговому счету $T+$, указанному в заявке, и Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета $T+$, указанного в заявке;
 - в случае если в заявке на заключение сделки указан Торгово-клиринговый счет, в состав которого входят Раздел $T0$ и/или Счет обеспечения $T0$, то по

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

Торгово-клиринговому счету Т+, связанному с Торгово-клиринговым счетом, указанным в заявке, и по Расчетному коду, входящему в состав такого Торгово-клирингового счета Т+;

- в случае если в заявке на заключение сделки указан Торгово-клиринговый счет имущественного пула, то по такому Торгово-клиринговому счету имущественного пула и по Расчетному коду, входящему в состав такого Торгово-клирингового счета имущественного пула;
- по заявке на заключение депозитного договора - по Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в заявке.

19.4. При выполнении условий, указанных в пункте 19.2 настоящей статьи, Клиринговый центр с использованием Системы торгов направляет Бирже Отчет о возможности регистрации заявки, при невыполнении хотя бы одного из условий, указанных в пункте 19.2 настоящей статьи, - Отчет о невозможности регистрации заявки.

19.5. При снятии в Системе торгов заявки с любым кодом расчетов, за исключением кода расчетов К0, Биржа с использованием Системы торгов направляет Клиринговому центру Уведомление о снятии заявки.

19.5.1. После получения Уведомления о снятии заявки на заключение сделки с кодом расчетов Y_n , $T0/Y_n$, Y_m/Y_n , поданной Участником торгов, стороной которой будет являться Участник клиринга, Клиринговый центр рассчитывает Единый лимит по соответствующему Расчетному коду / Расчетному коду имущественного пула без учета отозванной заявки.

19.6. При регистрации в Системе торгов заявки, являющейся в соответствии с Правилами торгов на фондовом рынке и рынке депозитов допустимой встречной по отношению к ранее зарегистрированной в Системе торгов заявке на заключение сделок с Клиринговым центром, Клиринговый центр заключает сделку с каждым из Участников клиринга, указанным в заявке в качестве стороны по сделке (за исключением заявок на заключение сделок с кодом расчетов К0 и заявок на заключение депозитного договора).

19.7. Заключение сделок с кодом расчетов К0 осуществляется Клиринговым центром только по допустимым встречным заявкам, прошедшим Процедуру контроля обеспечения, с каждым из Участников клиринга, указанным в таких заявках в качестве стороны сделки.

Процедура контроля обеспечения по заявкам на заключение сделок с кодом расчетов К0 осуществляется на основании Запроса о возможности заключения сделок, полученного от Биржи, немедленно после его получения.

19.8. При регистрации в Системе торгов заявки на заключение сделки РЕПО с кодом расчетов Y_m/Y_n и заявки на заключение депозитного договора, являющихся в соответствии с Правилами торгов на фондовом рынке и рынке депозитов допустимыми встречными заявками, Клиринговый центр заключает сделку РЕПО с кодом расчетов Y_m/Y_n с Участником клиринга, указанным в заявке на заключение такой сделки РЕПО в качестве стороны по сделке, и принимает на себя обязательство по обеспечению условий для заключения депозитного договора, указанное в Правилах торгов на фондовом рынке и рынке депозитов. Заявки, по

которым Клиринговый центр принял обязательства по обеспечению условий для заключения депозитного договора, вносятся Биржей в реестр предложений в порядке, установленном Правилами торгов на фондовом рынке и рынке депозитов.

19.8.1. Обязательство Клирингового центра по обеспечению условий для заключения депозитного договора заключается в обязанности Клирингового центра включить в соответствующий клиринговый пул обязательства по депозитному договору, заключенному в период с плановой даты заключения депозитного договора по следующий Расчетный день на условиях и в порядке, предусмотренном Правилами торгов на фондовом рынке и рынке депозитов.

19.9. После того, как информация о регистрации сделки стала доступной Клиринговому центру посредством Системы торгов, Клиринговый центр допускает к клирингу обязательства по заключенной сделке.

19.9.1. После того, как информация о регистрации сделки купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов T0, K0, T0/Yn стала доступной Клиринговому центру посредством Системы торгов, Клиринговый центр также:

- включает в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов по сделкам с центральным контрагентом с ближайшим временем исполнения обязательства/требования Участников клиринга по оплате и передаче ценных бумаг по заключенной сделке с кодом расчетов T0, K0 / первой части заключенной сделки РЕПО с кодом расчетов T0/Yn;
- рассчитывает Единый лимит по соответствующему Расчетному коду / Расчетному коду имущественного пула без учета заявки (части заявки), на основании которой была заключена указанная сделка, и с учетом указанной заключенной сделки (для сделок, заключенных на основании заявок, поданных с указанием Торгово-клирингового счета T+ / Торгово-клирингового счета имущественного пула).

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

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

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

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

Т+ / Торгово-клиринговому счету имущественного пула (для ценных бумаг).

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

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

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

- включает в Клиринговый пул для расчетов в ходе торгов обязательства/требования Участников клиринга по оплате и передаче ценных бумаг по заключенной сделке (первой части заключенной сделки РЕПО) с кодом расчетов Z0, X0;
- рассчитывает Единый лимит по соответствующему Расчетному коду без учета заявки (части заявки), на основании которой была заключена указанная сделка, и с учетом указанной заключенной сделки (для сделок, заключенных на основании заявок, поданных с указанием Торгово-клирингового счета Т+);
- осуществляет взаимодействия с Расчетным депозитарием с целью проведения расчетов в ходе торгов по заключенной сделке (первой части заключенной сделки РЕПО) с кодом расчетов Z0, X0. Взаимодействие с Расчетным депозитарием с целью проведения расчетов по сделке с кодом расчетов X0 осуществляется с учетом требования, установленного подпунктом 45.7.1 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

19.11. После окончания торгов на Бирже в дату, предшествующую дате внесения компенсационных взносов информация об обязательствах по внесению / требованиях по получению Участниками клиринга компенсационных взносов становится доступной Клиринговому центру посредством Системы торгов.

19.11.1. После получения посредством Системы торгов информации об обязательствах по внесению / требованиях по получению Участниками клиринга компенсационных взносов Клиринговый центр допускает указанные обязательства / требования к клирингу.

19.11.2. В дату внесения компенсационных взносов Клиринговый центр посредством Системы торгов передает Бирже информацию об исполнении обязательств по внесению / требований по получению Участниками клиринга компенсационных взносов.

Статья 20. Процедура контроля обеспечения по биржевым сделкам

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

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

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

20.1.2. Для заявки на покупку ценных бумаг с кодом расчетов T0, Z0, Rb, X0, Процедура контроля обеспечения по которой осуществляется по Расчетному коду, соответствующему Счету обеспечения, в случае если сумма сделки, которая может быть заключена на основании поданной заявки, включая НКД, не превышает разности:

- максимального из двух значений: (1) значения Обеспечения в соответствующей валюте, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга; (2) суммы (с учетом знака) значения Обеспечения и Нетто-обязательства / Нетто-требования в соответствующей валюте с текущей Датой исполнения, учитываемых по соответствующему Расчетному коду,

и

- значения Ограничительного лимита, установленного по соответствующему Расчетному коду.

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

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

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

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

20.1.5. Для заявок на покупку или продажу ценных бумаг с кодом расчетов T0, Rb, Z0, X0 на заключение сделки, Процедура контроля обеспечения по которой осуществляется по Расчетному коду, соответствующему Счету обеспечения, или по Торгово-клиринговому счету T+, дополнительно к условиям, указанным в подпунктах 20.1.1-20.1.4 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, проверяется достаточность Единого лимита по такому Расчетному коду в

соответствии с подпунктом 20.1.8 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов. При этом сумма операции, в отношении которой осуществляется указанная проверка, определяется в соответствии с подпунктами 20.1.1-20.1.4 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

20.1.6. Для заявки на покупку или на продажу с кодом расчетов Y_n , Y_m/Y_n , для заявки на заключение депозитного договора с кодом расчетов Y_m/Y_n , в случае достаточности Единого лимита по соответствующему Расчетному коду / Расчетному коду имущественного пула в соответствии с подпунктом 20.1.8 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

20.1.7. Для заявки на покупку или продажу ценных бумаг с кодом расчетов $T0/Y_n$ в случае прохождения проверки в соответствии с подпунктом 20.1.1 20.1.2 или 20.1.3 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов и проверки в соответствии с подпунктом 20.1.6 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

20.1.8. Единый лимит по Расчетному коду / Расчетному коду имущественного пула является достаточным при условии, что значение Единого лимита по Расчетному коду / Расчетному коду имущественного пула с учетом поданной заявки не станет отрицательным, или, если Единый лимит по такому Расчетному коду / Расчетному коду имущественного пула был отрицательным до момента подачи заявки, при условии, что Единый лимит по такому Расчетному коду / Расчетному коду имущественного пула, рассчитанный с учетом поданной заявки, не станет меньше, чем Единый лимит по этому Расчетному коду / Расчетному коду имущественного пула, рассчитанный до момента подачи заявки.

20.1.9. Для заявки на покупку ценных бумаг с кодом расчетов Y_n , $T0/Y_n$, Y_m/Y_n и для заявки на заключение депозитного договора с кодом расчетов Y_m/Y_n на заключение Сделки $T+$, по которой должен осуществляться клиринг с полным обеспечением по денежным средствам, дополнительно к проверке условий, указанных в подпункте 20.1.6 или подпункте 20.1.7 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, и для заявки на покупку ценных бумаг с кодом расчетов $T0$, Rb , $Z0$, $X0$ на заключение сделки, Процедура контроля обеспечения по которой осуществляется по Расчетному коду, соответствующему Счету обеспечения, дополнительно к проверке условий, указанных в подпунктах 20.1.1 и 20.1.5 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, Клиринговый центр:

20.1.9.1. рассчитывает размер Обеспечения Участника клиринга в денежных средствах, которое может быть использовано для заключения сделки, с учетом:

- Обеспечения Участника клиринга в денежных средствах, учитываемых по соответствующему Расчетному коду;
- обязательств и/или требований Участника клиринга по сделкам, по которым осуществляется клиринг с полным обеспечением по денежным средствам, в таких денежных средствах, учитываемых по соответствующему Расчетному коду;
- всех зарегистрированных заявок, имеющих направленность «покупка», процедура контроля обеспечения по которым осуществляется по тому же Расчетному коду, что и в проверяемой заявке, и по которым осуществляется клиринг с полным обеспечением по денежным средствам.

Для заявок на заключение сделок РЕПО / депозитных договоров расчет, указанный в настоящем пункте Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, осуществляется с учетом обязательств по первой и второй части

сделок РЕПО / обязательств по внесению и возврату депозита, которые возникнут в случае заключения депозитного договора по такой заявке, и одновременности их возникновения;

20.1.9.2. проверяет, что размер обязательства по оплате ценных бумаг по сделке, которая может быть заключена на основании поданной заявки, в Дату ее исполнения не превышает размера Обеспечения Участника клиринга в денежных средствах, рассчитанного в соответствии с пунктом 20.1.9.1 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

20.1.10. Для заявки на продажу ценных бумаг с кодом расчетов Y_n , T_0/Y_n , Y_m/Y_n на заключение Сделки T_+ , по которой должен осуществляться клиринг с полным обеспечением по ценным бумагам, дополнительно к проверке условий, указанных в подпункте 20.1.6 или подпункте 20.1.7 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, и для заявки на продажу ценных бумаг с кодом расчетов T_0 , R_b , Z_0 , X_0 на заключение сделки, Процедура контроля обеспечения по которой осуществляется по Торгово-клиринговому счету T_+ , дополнительно к проверке условий, указанных в подпунктах 20.1.3-20.1.4 и подпункте 20.1.5 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, Клиринговый центр:

20.1.10.1. рассчитывает размер Обеспечения Участника клиринга в ценных бумагах, которое может быть использовано для заключения сделки, с учетом:

- Обеспечения Участника клиринга в ценных бумагах, учитываемых по соответствующему Торгово-клиринговому счету T_+ ;
- обязательств и/или требований Участника клиринга по сделкам, по которым осуществляется клиринг с полным обеспечением по ценным бумагам, в таких ценных бумагах, учитываемых по соответствующему Торгово-клиринговому счету T_+ ;
- всех зарегистрированных заявок, имеющих направленность «продажа», процедура контроля обеспечения по которым осуществляется по тому же Торгово-клиринговому счету T_+ , что и в проверяемой заявке, и по которым осуществляется клиринг с полным обеспечением по ценным бумагам.

Для заявок на заключение сделок РЕПО расчет, указанный в настоящем пункте Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, осуществляется с учетом обязательств по первой и второй части сделок РЕПО и одновременности их возникновения;

20.1.10.2. проверяет, что размер обязательства по передаче ценных бумаг по сделке, которая может быть заключена на основании поданной заявки, в Дату ее исполнения не превышает размера Обеспечения Участника клиринга в ценных бумагах, рассчитанного в соответствии с пунктом 20.1.10.1 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

20.1.11. Для заявки на покупку ценных бумаг с кодом расчетов T_0 , Z_0 , R_b , X_0 , заявки на продажу ценных бумаг с кодом расчетов T_0 , R_b , Z_0 , X_0 на заключение сделок с расчетами в иностранной валюте, для заявки на покупку или на продажу с кодом расчетов Y_n , T_0/Y_n , Y_m/Y_n дополнительно к проверке условий, указанных в подпунктах 20.1.1-20.1.7 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, а также для заявки на покупку или на продажу с кодом расчетов B_0 - B_{30} или S_n проверяется наличие Обеспечения, необходимого для исполнения обязательства по уплате комиссионного вознаграждения по сделке, которая может быть заключена на основании поданной заявки:

- для заявки на заключение сделки, Процедура контроля обеспечения по которой осуществляется по Счету обеспечения T0, - в сумме денежных средств, учитываемых по такому Счету обеспечения T0;
 - для заявки на заключение сделки, Процедура контроля обеспечения по которым осуществляется по Расчетному коду, соответствующему Счету обеспечения, или обязательства по уплате комиссионных вознаграждений по которой должны исполняться по такому Расчетному коду, - в Едином лимите по такому Расчетному коду.
- 20.1.12. Для заявок с кодом расчетов T0, Z0, Rb, X0, B0-B30 или Sn проверки, указанные в подпунктах 20.1.1-20.1.5, 20.1.9-20.1.11 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, осуществляются с учетом Ограничительного лимита, установленного по соответствующему Расчетному коду (Счету обеспечения T0) / Торгово-клиринговому счету.
- 20.1.13. Проверки, указанные в подпунктах 20.1.1-20.1.12 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, осуществляются с учетом поданной заявки, по которой осуществляется проверка, а также с учетом иных поданных заявок такой же направленности, а также зарегистрированных и не обеспеченных средствами под расчеты Отчетов на исполнение (Специальных отчетов на исполнение, Срочных отчетов на исполнение) такой же направленности, приводящих к изменению информации о денежных средствах / ценных бумагах, учитываемых по тому же клиринговому регистру, что и проверяемая заявка.
- 20.1.14. Для заявок на покупку ценных бумаг, поданных Участником клиринга категории «А», проверки, указанные в подпунктах 20.1.1, 20.1.5-20.1.7, 20.1.11, 20.1.12 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, не осуществляются.
- Для заявок на продажу ценных бумаг, поданных Участником клиринга категории «А», проверка, указанная в подпункте 20.1.3 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, осуществляется только в случае принятия Участником клиринга категории «А» на себя обязательств по внесению индивидуального клирингового обеспечения в ценных бумагах.
- 20.2. В случае прохождения заявки на покупку или на продажу Процедуры контроля обеспечения, в ходе которой осуществлялась проверка достаточности Единого лимита по Расчетному коду / Расчетному коду имущественного пула, Клиринговый центр начинает учитывать значение Единого лимита по соответствующему Расчетному коду / Расчетному коду имущественного пула, рассчитанное в соответствии с подпунктом 20.1.8 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, в качестве нового значения Единого лимита по Расчетному коду / Расчетному коду имущественного пула, в случае непрохождения - Клиринговый центр не изменяет учитываемое значение Единого лимита по Расчетному коду / Расчетному коду имущественного пула.
- 20.3. Для заявок с отложенной датой активации Процедура контроля обеспечения в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов осуществляется в дату активации во время, установленное Временным регламентом на фондовом рынке и рынке депозитов (далее – основная Процедура контроля обеспечения).

20.4. Для заявок с отложенной датой активации на условиях «Частичное обеспечение/отступное» осуществляется дополнительная Процедура контроля обеспечения при подаче такой заявки или в иной момент, установленный решением Биржи. Указанная процедура считается пройденной при соблюдении следующих условий:

- если сумма частичного обеспечения в денежных средствах по такой заявке, рассчитанная на основании информации о размере частичного обеспечения, полученной от Биржи, не превышает суммы Обеспечения, учитываемого по соответствующему Расчетному коду;
- в случае достаточности Единого лимита по соответствующему Расчетному коду с учетом указанной суммы частичного обеспечения в соответствии с подпунктом 20.1.8 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов;
- выполнении условия, указанного в подпункте 20.1.9 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, для указанной суммы частичного обеспечения.

20.4.1. В случае непрохождения заявки с отложенной датой активации на условиях «Частичное обеспечение/отступное» основной Процедуры контроля обеспечения Клиринговый центр включает в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов с ближайшим временем исполнения обязательство по уплате / требованию по получению отступного за отказ от исполнения обязательств по заключению сделки на основании заявки с отложенной датой активации на условиях «Частичное обеспечение/отступное», величина которого определяется в соответствии с Правилами торгов на фондовом рынке и рынке депозитов (далее – отступное за отказ от заключения сделки).

20.5. Процедура контроля обеспечения, осуществляемая при заключении биржевых сделок с ценными бумагами с кодом расчетов КО, считается пройденной в следующих случаях:

20.5.1. Для сделки, заключенной на основании заявки на покупку, в случае если сумма сделки, включая НКД, не превышает суммы денежных средств, учитываемых по соответствующему Расчетному коду, а также в случае прохождения соответствующих проверок, указанных в подпунктах 20.1.5, 20.1.9, 20.1.11, 20.1.12 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

20.5.2. Для сделки, заключенной на основании заявки на продажу, в случае если количество ценных бумаг в сделке не превышает количества ценных бумаг, учитываемого по соответствующему Торгово-клиринговому счету, а также в случае прохождения соответствующих проверок, указанных в подпунктах 20.1.5, 20.1.10, 20.1.11, 20.1.12 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

Статья 21. Порядок допуска к клирингу обязательств по внебиржевым сделкам с ценными бумагами

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

Поручение на клиринг внебиржевой сделки направляется с использованием Клиринговой системы в форме электронного сообщения, подписанного АСП, или в форме документа на бумажном носителе.

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

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

- 21.2. В Клиринговой системе после регистрации Поручений на клиринг внебиржевой сделки, полученных от Участников клиринга – сторон внебиржевой сделки в форме электронного сообщения, проводится сверка данных, содержащихся в Поручении на клиринг внебиржевой сделки, полученном от каждого из них.
- 21.3. Клиринговый центр регистрирует данные по внебиржевой сделке в Клиринговой системе и учитывает обязательства и требования по ней на соответствующих клиринговых регистрах, если реквизиты внебиржевой сделки, содержащиеся в Поручениях на клиринг внебиржевой сделки Участников клиринга - контрагентов, совпадают.
- 21.4. Клиринговый центр не регистрирует данные по внебиржевой сделке в Клиринговой системе и не учитывает обязательства и требования по ней на соответствующих клиринговых регистрах:
- если реквизиты внебиржевой сделки, содержащиеся в Поручении на клиринг внебиржевой сделки одного Участника клиринга, не совпадают с реквизитами внебиржевой сделки, содержащимися в Поручении на клиринг внебиржевой сделки Участника клиринга – его контрагента;
 - если до окончания периода регистрации поручений Клиринговый центр получил Поручение на клиринг внебиржевой сделки только от одного Участника клиринга;
 - если вид и объект обязательств по внебиржевой сделке не входят в Список видов и объектов обязательств по внебиржевым сделкам, утвержденный Клиринговым центром и раскрытый на Сайте Клирингового центра.
- 21.5. После регистрации данных по внебиржевой сделке в Клиринговой системе Клиринговый центр допускает обязательства по внебиржевой сделке к клирингу, а Участники клиринга обязаны совершить действия, необходимые для исполнения обязательств по ней, в порядке, предусмотренном статьей 30 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

РАЗДЕЛ V. ПОРЯДОК ПРОВЕДЕНИЯ КЛИРИНГА

ПОДРАЗДЕЛ V-I. ПОРЯДОК ВНЕСЕНИЯ И ВОЗВРАТА ОБЕСПЕЧЕНИЯ

Статья 22. Порядок внесения Обеспечения

22.1. Внесение Обеспечения в российских рублях и иностранной валюте возможно следующими способами:

- 1) путем перечисления денежных средств на соответствующий клиринговый банковский или корреспондентский счет Клирингового центра по реквизитам, размещенным на Сайте Клирингового центра, с обязательным указанием в назначении платежа Расчетного кода Участника клиринга;
- 2) путем исполнения распоряжения на перевод денежных средств, поданного Участником клиринга с использованием Клиринговой системы;
- 3) путем исполнения Заявления о переводе.

22.1.1. Обеспечение Участника клиринга в иностранной валюте, являющееся индивидуальным клиринговым обеспечением, вносится на клиринговый банковский счет Клирингового центра в Расчетной организации.

22.1.2. Обеспечение Участника клиринга в иностранной валюте, являющееся иным обеспечением, вносится на корреспондентский счет Клирингового центра в Расчетном банке.

22.2. Внесение Обеспечения в ценных бумагах возможно следующими способами:

- 1) путем зачисления ценных бумаг на Раздел Т+ на основании поручения, поданного владельцем торгового счета депо в Расчетный депозитарий
- 2) путем исполнения распоряжения на перевод ценных бумаг (за исключением клиринговых сертификатов участия) на Раздел Т+, поданного Участником клиринга с использованием Клиринговой системы;
- 3) в результате исполнения Запроса на подбор ценных бумаг, поданного Участником клиринга с использованием Клиринговой системы.

22.3. Ценные бумаги, не принимаемые в качестве обеспечения исполнения обязательств по Сделкам Т+, зачисленные на Раздел Т+, не участвуют в расчете Единого лимита по Расчетному коду.

22.4. Клиринговый центр учитывает в Клиринговой системе денежные средства, перечисленные на соответствующий клиринговый банковский счет или корреспондентский счет Клирингового центра, в качестве Обеспечения Участника клиринга по Расчетному коду Участника клиринга, указанному в назначении платежа, и увеличивает Единый лимит по такому Расчетному коду с учетом перечисленной суммы денежных средств.

22.4.1. Если Расчетный код Участника клиринга, указанный в назначении платежа, не найден среди зарегистрированных Клиринговым центром Расчетных кодов, Клиринговый центр вправе запросить у Участника клиринга уточнение назначения платежа. В случае получения от Участника клиринга или от банка плательщика уточнения назначения платежа, учет денежных средств в качестве Обеспечения

Участника клиринга в соответствии с пунктом 22.4 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, осуществляется Клиринговым центром после получения от Участника клиринга / банка плательщика такого уточнения назначения платежа с правильно указанным Расчетным кодом.

- 22.4.2. Если в течение 5 (пяти) Расчетных дней по соответствующей валюте с даты, следующей за датой зачисления денежных средств в российских рублях / иностранной валюте на соответствующий клиринговый банковский / корреспондентский счет Клирингового центра с не указанным / неправильно указанным Расчетным кодом Участника клиринга в назначении платежа, Участник клиринга / банк плательщика не предоставит Клиринговому центру уточнение назначения платежа с правильно указанным Расчетным кодом, Клиринговый центр возвращает указанные денежные средства по реквизитам плательщика.
- 22.4.3. Денежные средства, зачисленные на соответствующий клиринговый банковский или корреспондентский счет Клирингового центра, позднее времени, установленного Временным регламентом на фондовом рынке и рынке депозитов, учитываются Клиринговым центром в следующем Расчетном дне.
- 22.5. Денежные средства, учитываемые в качестве Обеспечения Участника клиринга, используются для обеспечения исполнения и исполнения обязательств по сделкам, учитываемых по Расчетному коду, по которому указанное Обеспечение учитывается, а также для исполнения обязательств по уплате комиссионных вознаграждений по Расчетному коду, по которому указанное Обеспечение учитывается.
- 22.6. Участник клиринга вправе предоставить Клиринговому центру Заявление об изменении статуса Обеспечения в иностранной валюте на фондовом рынке и рынке депозитов.
- 22.6.1. Для исполнения указанного заявления Клиринговый центр после учета всех клиринговых и иных операций текущего Расчетного дня:
- для каждого Расчетного кода Участника клиринга открывает Участнику клиринга Счета обеспечения в иностранных валютах, открытые на балансовом счете № 47405;
 - переводит Обеспечение в иностранной валюте, учитываемое по каждому Расчетному коду, со Счета обеспечения, соответствующего такому Расчетному коду и открытого на балансовом счете № 30420 (30421), на Счет обеспечения, соответствующий такому Расчетному коду и открытый на балансовом счете № 47405;
 - закрывает Счета обеспечения в иностранных валютах, открытые на балансовом счете № 30420 (30421);
 - уведомляет Участника клиринга о выполненных переводах Обеспечения в иностранных валютах по Счетам обеспечения в Отчетах о движении денежных средств, предоставляемых по итогам Расчетного дня исполнения Заявления об изменении статуса Обеспечения с иностранной валюте на фондовом рынке и рынке депозитов.
- 22.6.2. Начиная с Расчетного дня по соответствующей валюте, следующего за днем исполнения указанного заявления, Участник клиринга обязан вносить Обеспечение

в иностранной валюте в соответствии с подпунктом 22.1.2 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

22.7. Распоряжение на перевод денежных средств / ценных бумаг, подаваемое Участником клиринга с использованием Клиринговой системы, содержит указание на Торгово-клиринговые счета, по которым должна быть исполнена данная операция, код валюты / ценных бумаг, сумму денежных средств / количество ценных бумаг, которые необходимо перевести.

22.7.1. Распоряжение на перевод денежных средств / ценных бумаг исполняется за счет денежных средств / ценных бумаг, учитываемых по Расчетному коду / Счету обеспечения T0, входящему в состав Торгово-клирингового счета / по Торгово-клиринговому счету, указанному в распоряжении в качестве Торгово-клирингового счета, по которому осуществляется уменьшение суммы денежных средств / количества ценных бумаг, при соблюдении следующих условий:

- сумма денежных средств / количество ценных бумаг, указанные в распоряжении, не превышают суммы денежных средств / количества ценных бумаг, учитываемых по такому Расчетному коду / Счету обеспечения T0 / Торгово-клиринговому счету за вычетом соответствующего Ограничительного лимита;
- Единый лимит по Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета T+, указанного в распоряжении в качестве Торгово-клирингового счета, по которому осуществляется уменьшение суммы денежных средств / количества ценных бумаг, рассчитанный без учета суммы денежных средств / количества ценных бумаг, указанных в распоряжении, не станет отрицательным;
- в случае уменьшения суммы денежных средств / количества ценных бумаг по Торгово-клиринговому счету T+ с признаком «запрет необеспеченных покупок» / «запрет коротких продаж», и/или у Участника клиринга категории «B», и/или ценных бумаг с признаком «запрет коротких продаж», и/или ценных бумаг с субсчета депо имущественного пула, дополнительным условием исполнения распоряжения на перевод денежных средств / ценных бумаг является не превышение суммы денежных средств / количества ценных бумаг, подлежащих переводу, суммы денежных средств / количества ценных бумаг, рассчитанных в соответствии с пунктом 20.1.9.1 / 20.1.10.1 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов за вычетом соответствующего Ограничительного лимита.

22.7.2. Частичное исполнение распоряжения на перевод денежных средств / ценных бумаг невозможно.

22.7.3. В случае положительного результата проверки возможности исполнения распоряжения на перевод денежных средств / ценных бумаг, в Клиринговой системе незамедлительно уменьшается сумма денежных средств / ценных бумаг, учитываемых по Расчетному коду / Счету обеспечения T0 / Торгово-клиринговому счету, по которому осуществляется уменьшение суммы денежных средств / количества ценных бумаг, и увеличивается сумма денежных средств / количество ценных бумаг, учитываемых по Расчетному коду / Счету обеспечения T0 / Торгово-клиринговому счету, по которому осуществляется увеличение суммы денежных средств / количества ценных бумаг.

- 22.7.4. Обязательства по списанию / зачислению денежных средств / ценных бумаг по распоряжениям на перевод денежных средств / ценных бумаг, прошедшим проверку возможности их исполнения в соответствии с подпунктом 22.7.1 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, включаются в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов и учитываются при определении Нетто-обязательств / Нетто-требований Участников клиринга по денежным средствам / ценным бумагам по сделкам клирингового пула в соответствии со статьей 43 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.
- 22.8. Порядок исполнения Заявления о переводе определен общей частью Правил клиринга.
- 22.9. Порядок подачи и исполнения Запросов на подбор ценных бумаг определен статьей 25 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.
- 22.10. Обеспечение в российских рублях используется в следующей очередности:
- 1) для погашения Задолженности Участника клиринга перед Клиринговым центром;
 - 2) для обеспечения исполнения обязательств Участника клиринга по Сделкам T+;
 - 3) для исполнения обязательств, включенных в клиринговый пул;
 - 4) для исполнения обязательств по уплате отступного за непредоставление Обеспечения в сумме депозита, указанной в заявке на заключение депозитного договора, внесенной в реестр предложений, в плановую дату заключения депозитного договора в соответствии с кодом расчетов, указанным в заявке на заключение депозитного договора, внесенной в реестр предложений, и в Расчетный день, следующий за указанной датой;
 - 5) для заключения депозитных договоров;
 - 6) для исполнения обязательств по уплате Комиссионного вознаграждения;
 - 7) для исполнения обязательств по уплате Возмещений;
 - 8) для уплаты пеней за наличие непогашенной Задолженности.
- 22.11. Обеспечение в иностранной валюте используется в следующей очередности:
- 1) для обеспечения исполнения обязательств Участника клиринга по Сделкам T+;
 - 2) для исполнения обязательств в соответствующей иностранной валюте, включенных в клиринговый пул.
- 22.12. Обеспечение в ценных бумагах используется в следующей очередности:
- 1) для обеспечения исполнения обязательств Участника клиринга по Сделкам T+;
 - 2) для исполнения обязательств в соответствующих ценных бумагах, включенных в клиринговый пул.
- 22.13. После перечисления денежных средств на клиринговый банковский или корреспондентский счет Клирингового центра, открытый в Расчетной организации / Расчетном банке и учета их в качестве Обеспечения по Расчетному коду Участника клиринга, у Клирингового центра возникает обязательство вернуть

Обеспечение Участнику клиринга. Указанное обязательство по возврату Участнику клиринга Обеспечения исполняется с учетом условий, указанных в пункте 23.8, подпунктах 22.7.1, 23.13.2 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

Статья 23. Порядок возврата Обеспечения

- 23.1. Возврат Клиринговым центром Участнику клиринга денежных средств, учитываемых в качестве Обеспечения, осуществляется на основании:
- 1) Запроса о возврате;
 - 2) Постоянного поручения на возврат;
 - 3) Заявлений о переводе;
 - 4) распоряжений на перевод денежных средств, подаваемых Участниками клиринга с использованием Клиринговой системы;
 - 5) Заявления о порядке использования денежных средств и ценных бумаг.
- 23.2. Возврат Клиринговым центром Участнику клиринга ценных бумаг, учитываемых в качестве Обеспечения, осуществляется на основании:
- 1) распоряжений на перевод ценных бумаг (за исключением клиринговых сертификатов участия), подаваемых Участниками клиринга с использованием Клиринговой системы;
 - 2) Заявления о порядке использования денежных средств и ценных бумаг;
 - 3) поручения на списание ценных бумаг с Раздела Т+, поданного в Расчетный депозитарий.
- 23.3. Возврат денежных средств на основании Запроса о возврате или Постоянного поручения на возврат осуществляется на Счет для возврата, зарегистрированный в Клиринговом центре в порядке, установленном общей частью Правил клиринга.
- 23.4. Запрос о возврате / Постоянное поручение на возврат должны содержать указание на Расчетный код Участника клиринга.
- 23.5. Запрос о возврате может содержать:
- а) сумму денежных средств, или
 - б) признак, указывающий на необходимость возврата всей доступной суммы денежных средств.
- 23.5.1. Запросы о возврате соответствующей валюты принимаются Клиринговым центром в Расчетные дни по соответствующей валюте в период времени, установленный Временным регламентом на фондовом рынке и рынке депозитов.
- 23.5.2. При предоставлении Запроса о возврате позднее времени, указанного во Временном регламенте на фондовом рынке и рынке депозитов, Клиринговый центр вправе не исполнять Запрос о возврате.
- 23.5.3. Запрос о возврате действует в день его предоставления.
- 23.5.4. Запрос о возврате исполняется после его получения при соблюдении условий его исполнения.
- Запрос о возврате, содержащий сумму денежных средств, исполняется при соблюдении условий, указанных в пункте 23.8 Правил клиринга на фондовом

рынке и рынке депозитов, при этом проверка указанных условий осуществляется в отношении суммы денежных средств, указанных в Запросе о возврате.

Исполнение Клиринговым центром Запроса о возврате, содержащего признак, указывающий на необходимость возврата всей доступной суммы денежных средств, осуществляется в максимально возможной сумме денежных средств, при которой условия, указанные в пункте 23.8 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, будут выполняться, за вычетом суммы (сумм) денежных средств, указанных в Запросе на депонирование денежных средств и/или Постоянном поручении на депонирование денежных средств (в случае предоставления Участником клиринга Клиринговому центру Запроса на депонирование денежных средств и/или Постоянного поручения на депонирование денежных средств в соответствии с пунктом 23.7 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов).

- 23.5.5. Запрос о возврате, содержащий сумму денежных средств, не исполненный сразу после его получения по причине несоблюдения условий, указанных в пункте 23.8 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, может быть исполнен Клиринговым центром позднее, в период до установленного Временным регламентом на фондовом рынке и рынке депозитов времени исполнения Постоянных поручений на возврат в соответствующей валюте, содержащих признак, указывающий на необходимость возврата всей доступной суммы денежных средств, если будут соблюдены условия, указанные в пункте 23.8 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.
- 23.5.6. Запрос о возврате, содержащий признак, указывающий на необходимость возврата всей доступной суммы денежных средств, не исполненный сразу после его получения по причине, что условия, указанные в пункте 23.8 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, не выполняются ни для какой суммы денежных средств, аннулируется.
- 23.5.7. 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 в форме сообщения по системе S.W.I.F.T.
- 23.6. Постоянное поручение на возврат может содержать:
- в) признак, указывающий на необходимость возврата всей доступной суммы денежных средств, или
 - г) признак, указывающий на необходимость возврата денежных средств в размере Итогового нетто-требования.
- 23.6.1. Постоянное поручение на возврат исполняется Клиринговым центром каждый Расчетный день по соответствующей валюте, начиная с первого Расчетного дня по соответствующей валюте, следующего за датой предоставления указанного поручения, при соблюдении условий его исполнения.
- 23.6.2. Исполнение Клиринговым центром Постоянного поручения на возврат, содержащего признак, указывающий на необходимость возврата всей доступной суммы денежных средств, осуществляется в срок, установленный Временным регламентом на фондовом рынке и рынке депозитов, в максимально возможной сумме денежных средств, при которой условия, указанные в пункте 23.8 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, будут выполняться, за вычетом суммы (сумм) денежных средств, указанных в Запросе на депонирование денежных

- средств и/или Постоянном поручении на депонирование денежных средств (в случае предоставления Участником клиринга Клиринговому центру Запроса на депонирование денежных средств и/или Постоянного поручения на депонирование денежных средств в соответствии с пунктом 23.7 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов).
- 23.6.3. Исполнение Клиринговым центром Постоянного поручения на возврат, содержащего признак, указывающий на необходимость возврата денежных средств в размере Итогового нетто-требования, осуществляется после определения Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований Участника клиринга в соответствующей валюте в размере Итогового нетто-требования Участника клиринга в соответствующей валюте при соблюдении условий, указанных в пункте 23.8 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, при этом проверка указанных условий осуществляется в отношении указанного Итогового нетто-требования.
- 23.6.4. Постоянное поручение на возврат, содержащее признак, указывающий на необходимость возврата денежных средств в размере Итогового нетто-требования, не исполненное сразу после определения Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований Участника клиринга в соответствующей валюте по причине несоблюдения условий, указанных в пункте 23.8 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, может быть исполнено Клиринговым центром позднее, в период до установленного Временным регламентом на фондовом рынке и рынке депозитов времени исполнения Постоянных поручений на возврат в соответствующей валюте, содержащих признак, указывающий на необходимость возврата всей доступной суммы денежных средств, если будут соблюдены условия, указанные в пункте 23.8 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.
- 23.6.5. Постоянное поручение на возврат, содержащее признак, указывающий на необходимость возврата денежных средств в размере Итогового нетто-требования, не исполненное до установленного Временным регламентом на фондовом рынке и рынке депозитов времени исполнения Постоянных поручений на возврат в соответствующей валюте, содержащих признак, указывающий на необходимость возврата всей доступной суммы денежных средств, по причине несоблюдения условий, указанных в пункте 23.8 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, исполняется Клиринговым центром непосредственно в указанный срок в таком же порядке, как Постоянное поручение на возврат, содержащее признак, указывающий на необходимость возврата всей доступной суммы денежных средств.
- 23.6.6. Клиринговый центр вправе принять решение об аннулировании действующих Постоянных поручений на возврат не ранее, чем начиная с Расчетного дня, следующего за днем принятия такого решения, в случае, если у Клирингового центра возникнут основания полагать, что существует необходимость в уточнении информации, указанной в Постоянном поручении на возврат. Клиринговый центр уведомляет Участника клиринга о принятом решении об аннулировании Постоянного поручения на возврат не позднее рабочего дня, следующего за днем принятия такого решения.
- 23.6.7. Постоянное поручение на возврат действует до его отмены Участником клиринга или до даты принятия Клиринговым центром решения об аннулировании Постоянных поручений на возврат.

- 23.6.8. 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.
- 23.7. Участник клиринга вправе предоставить Клиринговому центру Запрос о депонировании денежных средств или Постоянное поручение на депонирование денежных средств, содержащие указание на сумму денежных средств в определенной валюте, которую необходимо оставить в составе Обеспечения Участника клиринга в такой валюте при возврате денежных средств.
- Запрос о депонировании денежных средств или Постоянное поручение на депонирование денежных средств не применяются при исполнении Запроса о возврате, содержащего сумму денежных средств, и Постоянного поручения на возврат, содержащего признак, указывающий на необходимость возврата денежных средств в размере Итогового нетто-требования.
- 23.7.1. Запрос о депонировании денежных средств или Постоянное поручение на депонирование денежных средств должны содержать:
- а) Расчетный код Участника клиринга;
 - б) код валюты;
 - в) сумму денежных средств.
- 23.7.2. Запросы о депонировании денежных средств в соответствующей валюте принимаются Клиринговым центром в Расчетные дни по соответствующей валюте в период времени, установленный Временным регламентом на фондовом рынке и рынке депозитов.
- 23.7.3. Запрос о депонировании денежных средств действует в день его предоставления.
- 23.7.4. Постоянное поручение на депонирование денежных средств исполняется Клиринговым центром каждый Расчетный день по соответствующей валюте, начиная с первого Расчетного дня по соответствующей валюте, следующего за датой предоставления указанного поручения.
- 23.7.5. Постоянное поручение на депонирование денежных средств действует до его отмены Участником клиринга.
- Отмена Постоянного поручения на депонирование денежных средств Участником клиринга осуществляется с использованием Клиринговой системы или путем направления Участником клиринга Клиринговому центру документа на бумажном носителе в свободной форме или электронного документа.
- 23.7.6. При наличии действующего Постоянного поручения на депонирование денежных средств в соответствующей валюте и подачи Запроса о депонировании денежных средств в такой валюте суммы денежных средств в такой валюте, указанные в таких документах складываются при определении суммы денежных средств, подлежащей возврату Участнику клиринга в соответствии с подпунктами 23.5.4, 23.6.2 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.
- 23.8. Возврат Клиринговым центром Участнику клиринга Обеспечения, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, осуществляется при соблюдении следующих условий:
- Единый лимит по Расчетному коду, рассчитанный без учета возвращаемой

- суммы денежных средств, не станет отрицательным;
- возвращаемая сумма денежных средств не превышает разности:
 - максимального из двух значений: (1) значения Обеспечения в соответствующей валюте, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга; (2) суммы (с учетом знака) значения Обеспечения и Нетто-обязательства / Нетто-требования в соответствующей валюте с текущей Датой исполнения, учитываемых по Расчетному коду,
 - и
 - значения Ограничительного лимита, установленного по Расчетному коду;
 - в случае возврата денежных средств с Расчетного кода Участника клиринга с признаком «запрет необеспеченных покупок» и/или с Расчетного кода Участника клиринга категории «В», - непревышение возвращаемой суммы денежных средств суммы Обеспечения в соответствующей валюте, рассчитанной в соответствии с пунктом 20.1.9.1 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.
- 23.9. Для исполнения своего обязательства по возврату Участнику клиринга денежных средств в соответствующей валюте на основании Запроса о возврате / Постоянного поручения на возврат Клиринговый центр перечисляет денежные средства в такой валюте на соответствующий Счет для возврата, зарегистрированный в Клиринговом центре для соответствующего Расчетного кода Участника клиринга.
- 23.9.1. Обязательство Клирингового центра по возврату денежных средств Участнику клиринга считается исполненным с момента списания Расчетной организацией / Расчетным банком денежных средств с клирингового банковского / корреспондентского счета Клирингового центра.
- Клиринговый центр не несет ответственности за неисполнение (ненадлежащее исполнение) Расчетной организацией / Расчетным банком распоряжения Клирингового центра о списании денежных средств в пользу Участника клиринга за исключением случаев, если такое неисполнение явилось следствием вины Клирингового центра.
- 23.9.2. При возврате Участнику клиринга Обеспечения в соответствующей валюте размер Обеспечения, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, в такой валюте уменьшается на сумму возвращаемых денежных средств.
- 23.10. Порядок исполнения Заявления о переводе определен общей частью Правил клиринга.
- 23.11. Распоряжение на перевод денежных средств / ценных бумаг, поданное Участником клиринга с использованием Клиринговой системы, исполняется в соответствии с пунктом 22.7 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.
- 23.12. Возврат денежных средств на основании Заявления о порядке использования денежных средств и ценных бумаг осуществляется на Счет обеспечения Т0, соответствующий Расчетному коду.
- Возврат ценных бумаг на основании Запроса о возврате ценных бумаг из Обеспечения или на основании Заявления о порядке использования денежных

средств и ценных бумаг осуществляется на Торгово-клиринговый счет T0, связанный с Торгово-клиринговым счетом T+.

23.13. Заявление о порядке использования денежных средств и ценных бумаг содержит указание Клиринговому центру:

- а) о порядке перечисления денежных средств / ценных бумаг со Счетов обеспечения T0 на Расчетные коды / с Торгово-клиринговых счетов T0 на Торгово-клиринговые счета T+ при исполнении обязательств по Сделкам T+:
 - не перечислять;
 - перечислять в сумме / количестве, недостающем для исполнения Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам;
 - перечислять в размере Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам.

В случае непредоставления Заявления о порядке использования денежных средств и ценных бумаг денежные средства / ценные бумаги со Счетов обеспечения T0 на Расчетные коды / с Торгово-клиринговых счетов T0 на Торгово-клиринговые счета T+ при исполнении обязательств по Сделкам T+ перечисляются в сумме / количестве, недостающем для исполнения Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам.

- б) о порядке возврата денежных средств / ценных бумаг с Расчетных кодов / с Торгово-клиринговых счетов T+ после прекращения обязательств по Сделкам T+:
 - не возвращать;
 - возвращать в размере Итогового нетто-требования Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам.

В случае непредоставления Заявления о порядке использования денежных средств и ценных бумаг денежные средства / ценные бумаги с Расчетных кодов / с Торгово-клиринговых счетов T+ после прекращения обязательств по Сделкам T+ не возвращаются.

23.13.1. Заявление о порядке использования денежных средств и ценных бумаг исполняется Клиринговым центром, начиная с Расчетного дня, следующего за датой предоставления указанного заявления.

23.13.2. Возврат Клиринговым центром Участнику клиринга денежных средств / ценных бумаг на основании Заявления о порядке использования денежных средств и ценных бумаг осуществляется после прекращения обязательств по Сделкам T+, включенных в Клиринговый пул по Сделкам T+ в соответствии со статьей 37 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, в размере прекращенного Итогового нетто-требования Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам, учитываемого по Расчетному коду / Торгово-клиринговому счету T+, но не превышающем суммы денежных средств / ценных бумаг, учитываемых в качестве Обеспечения Расчетному коду / Торгово-клиринговому счету, за вычетом соответствующего Ограничительного лимита, и при условии, что возврат этой суммы денежных средств / количества ценных бумаг из Обеспечения не приведет к возникновению у Участника клиринга отрицательного Единого лимита по такому Расчетному коду / Расчетному коду, входящему в состав такого Торгово-

- клирингового счета Т+, либо на максимально возможную сумму, не превышающую суммы денежных средств / количества ценных бумаг, учитываемых в качестве Обеспечения Расчетному коду / Торгово-клиринговому счету Т+, за вычетом соответствующего Ограничительного лимита, возврат которой из Обеспечения не приведет к возникновению у Участника клиринга отрицательного Единого лимита по такому Расчетному коду / Расчетному коду, входящему в состав такого Торгово-клирингового счета Т+.
- 23.13.3. Сразу после проверки возможности возврата денежных средств / ценных бумаг из Обеспечения, проведенной в соответствии с подпунктом 23.13.2 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, размер Обеспечения, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга / Торгово-клиринговому счету Т+ Участника клиринга уменьшается, а размер Обеспечения, учитываемого по Счету обеспечения Т0 / Торгово-клиринговому счету Участника клиринга, в состав которого входит Раздел Т0, увеличивается на возвращаемую сумму денежных средств / количество ценных бумаг.
- 23.13.4. Обязательства по списанию / зачислению денежных средств / ценных бумаг по Заявлениям о порядке использования денежных средств и ценных бумаг, прошедших проверку возможности их исполнения в соответствии с подпунктом 23.13.2 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, включаются в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов и учитываются при определении Нетто-обязательств / Нетто-требований Участников клиринга по денежным средствам / ценным бумагам по сделкам клирингового пула в соответствии со статьей 43 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.
- 23.14. Возврат ценных бумаг на основании поручения на списание ценных бумаг с Раздела Т+, поданного в Расчетный депозитарий, осуществляется на раздел торгового счета депо, указанный в поручении.
- Исполнение указанного поручения осуществляется в порядке, установленном статьей 45 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.
- 23.15. Клиринговый центр вправе осуществить в любое время зачет денежных требований Участника клиринга по возврату ему Обеспечения в соответствующей валюте, учитываемых по Расчетному коду Участника клиринга, с денежными требованиями Клирингового центра к этому Участнику клиринга в такой валюте, учитываемыми по тому же Расчетному коду.
- 23.16. В случае неисполнения Клиринговым центром обязательств по возврату Участнику клиринга денежных средств, учитываемых в качестве Обеспечения, Участник клиринга вправе инициировать дефолт Клирингового центра в отношении такого Участника клиринга в порядке, определенном общей частью Правил клиринга.

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

Статья 24. Порядок внесения имущества в имущественный пул. Порядок выдачи клиринговых сертификатов участия

- 24.1. Клиринговый центр выдает клиринговые сертификаты участия на имущество, внесенное в соответствующий имущественный пул.
- 24.2. Внесение российских рублей и иностранной валюты в имущественный пул возможно следующими способами:
- 1) путем перечисления денежных средств на соответствующий клиринговый банковский счет Клирингового центра по реквизитам, размещенным на Сайте Клирингового центра, с обязательным указанием в назначении платежа Расчетного кода имущественного пула;
 - 2) путем исполнения распоряжения на перевод денежных средств, поданного Участником клиринга с использованием Клиринговой системы;
 - 3) путем исполнения Заявления о переводе.
- 24.3. Внесение ценных бумаг в имущественный пул возможно двумя способами:
- 1) путем исполнения распоряжения на перевод ценных бумаг (за исключением клиринговых сертификатов участия), поданного Участником клиринга с использованием Клиринговой системы;
 - 2) в результате исполнения Запроса на подбор ценных бумаг, поданного Участником клиринга с использованием Клиринговой системы.
- 24.4. Клиринговый центр учитывает в Клиринговой системе денежные средства, перечисленные на соответствующий клиринговый банковский счет Клирингового центра, по Расчетному коду имущественного пула, указанному в назначении платежа, и увеличивает Единый лимит по пулу по такому Расчетному коду имущественного пула с учетом перечисленной суммы денежных средств.
- 24.4.1. Если Расчетный код имущественного пула, указанный в назначении платежа, не найден среди зарегистрированных Клиринговым центром Расчетных кодов имущественного пула, Клиринговый центр вправе запросить у Участника клиринга уточнение назначения платежа. В случае получения от Участника клиринга или от банка плательщика уточнения назначения платежа, учет денежных средств в соответствии с пунктом 24.4 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, осуществляется Клиринговым центром после получения от Участника клиринга / банка плательщика такого уточнения назначения платежа с правильно указанным Расчетным кодом имущественного пула.
- 24.4.2. Если в течение 5 (пяти) Расчетных дней по соответствующей валюте с даты, следующей за датой зачисления денежных средств в российских рублях / иностранной валюте на соответствующий клиринговый банковский счет Клирингового центра с не указанным / неправильно указанным Расчетным кодом имущественного пула в назначении платежа, Участник клиринга / банк плательщика не предоставит Клиринговому центру уточнение назначения платежа

с правильно указанным Расчетным кодом имущественного пула, Клиринговый центр возвращает указанные денежные средства по реквизитам плательщика.

- 24.4.3. Денежные средства, зачисленные на соответствующий клиринговый банковский счет Клирингового центра позднее времени, установленного Временным регламентом на фондовом рынке и рынке депозитов, учитываются Клиринговым центром в следующем Расчетном дне.
- 24.5. После перечисления денежных средств на клиринговый банковский счет Клирингового центра, открытый в Расчетной организации, и учета их в качестве имущества, внесенного в имущественный пул, у Клирингового центра возникает обязательство вернуть имущество из имущественного пула Участнику клиринга. Указанное обязательство исполняется в порядке и при соблюдении условий, определенных статьей 26 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.
- 24.5.1. Клиринговый центр вправе осуществить в любое время зачет денежных требований Участника клиринга по возврату ему денежных средств, внесенных в имущественный пул и учитываемых по Расчетному коду имущественного пула, с денежными требованиями Клирингового центра к этому Участнику клиринга, учитываемыми по такому Расчетному коду имущественного пула.
- 24.6. Порядок подачи и исполнения распоряжений на перевод денежных средств / ценных бумаг определен пунктом 22.7 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов с учетом следующих особенностей:
- 24.6.1. В распоряжении на перевод денежных средств / ценных бумаг, подаваемом с целью внесения имущества в имущественный пул, в качестве Торгово-клирингового счета, по которому осуществляется увеличение денежных средств / ценных бумаг, должен быть указан Торгово-клиринговый счет имущественного пула.
- 24.6.2. Участник клиринга вправе предоставить Клиринговому центру Заявление об ограничении Торгово-клиринговых счетов для внесения / выдачи имущества в имущественный пул / из имущественного пула.

Указанное заявление может содержать указание на один из следующих способов ограничения Торгово-клиринговых счетов для внесения / выдачи имущества в имущественный пул / из имущественного пула:

- 1) ограничение для всех Торгово-клиринговых счетов.

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

- 2) ограничение для Торгово-клиринговых счетов, в состав которых входят клиентские Расчетные коды или Расчетные коды ДУ.

В случае выбора указанного способа ограничений при подаче распоряжений на перевод денежных средств / ценных бумаг на Торгово-клиринговый счет имущественного пула / с Торгово-клирингового счета имущественного пула, в состав которого входит клиентский Расчетный код или Расчетный код ДУ, в качестве Торгово-клирингового счета, по которому осуществляется

уменьшение / увеличение денежных средств / ценных бумаг, может быть указан только Торгово-клиринговый счет T+, соответствующий Торгово-клиринговому счету имущественного пула, указанному в распоряжении. Ограничение на подачу распоряжений на перевод денежных средств / ценных бумаг для Торгово-клиринговых счетов, в состав которых входят собственные Расчетные коды, не устанавливается.

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

- 24.6.3. Распоряжение на перевод ценных бумаг / иностранной валюты, не принимаемых в соответствующий имущественный пул, не исполняется Клиринговым центром.
- 24.6.4. Распоряжение на перевод ценных бумаг, эмитентом которых является Участник клиринга или связанное с ним лицо, на Торгово-клиринговый счет имущественного пула, в состав которого входит субсчет депо имущественного пула, открытый владельцу ценных бумаг, которым является такой Участник клиринга, не исполняется Клиринговым центром.
- 24.6.5. Распоряжение на перевод ценных бумаг на Торгово-клиринговый счет имущественного пула, в состав которого входит субсчет депо имущественного пула, открытый иностранному номинальному держателю, для которого установлены ограничения на зачисление таких ценных бумаг на его счета депо, не исполняется Клиринговым центром.
- 24.6.6. После увеличения суммы денежных средств / количества ценных бумаг, учитываемых по Расчетному коду имущественного пула / Торгово-клиринговому счету имущественного пула значение Единого лимита по пулу по Расчетному коду имущественного пула, входящему в состав Торгово-клирингового счета имущественного пула, указанного в распоряжении, увеличивается с учетом переведенной суммы денежных средств / количества ценных бумаг.
- 24.7. Порядок подачи и исполнения Запросов на подбор ценных бумаг с целью их внесения в имущественный пул определен статьей 25 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.
- 24.7.1. После увеличения количества ценных бумаг, учитываемых по Торгово-клиринговому счету имущественного пула, значение Единого лимита по пулу по Расчетному коду имущественного пула, входящему в состав такого Торгово-клирингового счета имущественного пула, увеличивается с учетом зачисленного количества ценных бумаг.
- 24.8. Имущество, внесенное в имущественный пул, используется в следующей очередности:
- 1) для обеспечения исполнения обязательств по договору об имущественном пуле;
 - 2) для обеспечения исполнения обязательств по сделкам РЕПО с клиринговыми сертификатами участия при проведении ликвидационного неттинга в отношении Участника клиринга, клиента Участника клиринга или Клирингового центра в соответствии с общей частью Правил клиринга;
 - 3) для обеспечения исполнения обязательств Участника клиринга по Сделкам T+, в том числе по сделкам РЕПО с клиринговыми сертификатами участия (за исключением случая, указанного в подпункте 2) настоящего пункта);

- 4) для исполнения обязательств по Сделкам Т+, заключенных с указанием Торгово-клирингового счета имущественного пула;
 - 5) для исполнения обязательств по Сделкам Т+, заключенных с указанием Торгово-клирингового счета Т+, соответствующего Торгово-клиринговому счету имущественного пула.
- 24.9. Незамедлительно после увеличения в Клиринговой системе положительного значения Единого лимита по пулу по Расчетному коду имущественного пула в соответствии с пунктом 24.4, подпунктом 24.6.6, пунктом 29.3 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов Клиринговый центр:
- увеличивает номинальную стоимость клиринговых сертификатов участия, подлежащих выдаче в ходе ближайшего взаимодействия с Расчетным депозитарием, учитываемую по Расчетному коду имущественного пула, на номинальную стоимость выдаваемых клиринговых сертификатов участия, определенную в соответствии с подпунктом 24.9.2 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов;
 - увеличивает плановое значение позиции по ценной бумаге клиринговый сертификат участия, учитываемой по Торгово-клиринговому счету Т+, соответствующему Торгово-клиринговому счету имущественного пула, в состав которого входит указанный Расчетный код имущественного пула, на количество выдаваемых клиринговых сертификатов участия, определенное в соответствии с подпунктом 24.9.1 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, и учитывает указанные клиринговые сертификаты участия в качестве Обеспечения Участника клиринга;
 - учитывает новое значение Единого лимита по пулу по Расчетному коду имущественного пула;
 - допускает к клирингу обязательства по клиринговым сертификатам участия, учтенные по Расчетному коду имущественного пула.
- 24.9.1. Количество выдаваемых клиринговых сертификатов участия соответствует положительному значению Единого лимита по пулу по Расчетному коду имущественного пула (без учета копеек).
- 24.9.2. Номинальная стоимость выдаваемых клиринговых сертификатов участия равна произведению количества выдаваемых клиринговых сертификатов участия на номинальную стоимость одного клирингового сертификата участия.
- 24.10. Поручение на выдачу клиринговых сертификатов участия включается в состав распоряжения на проведение операций по Разделам / субсчетам депо, направляемого Клиринговым центром Расчетному депозитарию в соответствии с пунктом 45.8 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, или в состав согласия на списание ценных бумаг с Разделов, направляемого Клиринговым центром Расчетному депозитарию в соответствии с пунктом 45.6 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.
- 24.11. После исполнения Расчетным депозитарием поручения Клирингового центра на выдачу клиринговых сертификатов участия клиринговые сертификаты участия, зачисленные на Раздел Т+, становятся индивидуальным клиринговым обеспечением.

24.12. Информация о количестве ценных бумаг / сумме денежных средств, внесенных Участником клиринга в имущественный пул, предоставляется Участнику клиринга в составе Отчета об имуществе, внесенном в имущественные пулы.

Статья 25. Порядок подачи и исполнения Запросов на подбор ценных бумаг

25.1. Участник клиринга, соответствующий требованиям, установленным общей частью Правил клиринга, вправе с использованием WEB-сервиса Расчетного депозитария подавать Запросы на подбор ценных бумаг.

25.2. Запрос на подбор ценных бумаг может быть подан Участником клиринга в следующих целях:

- внесения ценных бумаг в имущественные пулы;
- внесения ценных бумаг в качестве взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс;
- внесения ценных бумаг в Обеспечение;
- исполнения обязательств по сделкам, в т.ч. Сделкам T+.

25.3. В Запросе на подбор ценных бумаг Участник клиринга указывает:

- Торгово-клиринговый счет, в состав которого входит Раздел T+ / Раздел T0 / субсчет депо, на который должен быть осуществлен подбор ценных бумаг;
- сумму (в российских рублях), в размере которой должен быть осуществлен подбор ценных бумаг, и/или
- код и количество ценных бумаг, которые необходимо подобрать.

25.3.1. Если в Запросе на подбор ценных бумаг указана сумма, в размере которой должен быть осуществлен подбор ценных бумаг, подбор ценных бумаг осуществляется на указанную сумму, если при этом также указаны код и количество ценных бумаг, которые необходимо подобрать, код ценных бумаг указывает на ценные бумаги, имеющие наивысший приоритет при подборе на указанную сумму, количество ценных бумаг – ограничение на максимальное количество указанных ценных бумаг при подборе на указанную сумму.

25.3.2. Если в Запросе на подбор ценных бумаг не указана сумма, в размере которой должен быть осуществлен подбор ценных бумаг, то в Запросе на подбор ценных бумаг должны быть указаны код и количество ценных бумаг, которые необходимо подобрать.

25.4. Запрос на подбор ценных бумаг, поданный Участником клиринга с использованием WEB-сервиса Расчетного депозитария, считается Запросом на подбор ценных бумаг, направленным Клиринговым центром Расчетному депозитарию.

25.5. В случаях, установленных Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, Клиринговый центр вправе с использованием WEB-сервиса Расчетного депозитария направить Расчетному депозитарию Запрос на подбор ценных бумаг в отношении Участника клиринга, соответствующего требованиям, установленным общей частью Правил клиринга.

25.6. На основании полученного от Клирингового центра / Участника клиринга Запроса на подбор ценных бумаг Расчетный депозитарий в соответствии с условиями

договора об оказании услуг по управлению обеспечением, заключенным с депонентом Расчетного депозитария, осуществляет подбор ценных бумаг, используя в первую очередь, приоритеты подбора, указанные депонентом Расчетного депозитария в поручении на маркирование ресурсов для подбора ценных бумаг для клиринга Банка НКЦ (АО), во вторую – приоритеты подбора, указанные в Запросе на подбор ценных бумаг (при наличии).

- 25.6.1. Если в Запросе на подбор ценных бумаг указана сумма, в размере которой должен быть осуществлен подбор ценных бумаг, Расчетный депозитарий осуществляет подбор ценных бумаг на указанную сумму с учетом цен ценных бумаг, а также ограничений на подбор, полученных от Клирингового центра в соответствии с пунктом 45.2 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.
- 25.7. По итогам исполнения полученного от Клирингового центра / Участника клиринга Запроса на подбор ценных бумаг Расчетный депозитарий с использованием WEB-сервиса Расчетного депозитария направляет Клиринговому центру / Участнику клиринга Ответ на запрос на подбор ценных бумаг, а также зачисляет ценные бумаги на Раздел T+ / Раздел T0 / субсчет депо, указанный в Запросе на подбор ценных бумаг, и направляет Клиринговому центру информацию об увеличении количества ценных бумаг, учитываемых на Разделе T+ / Разделе T0 / субсчете депо, в соответствии с пунктом 45.5 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.
- 25.8. В случае неполучения от Расчетного депозитария Ответа на запрос на подбор ценных бумаг в течение времени, установленного Временным регламентом на фондовом рынке и рынке депозитов, Клиринговый центр с использованием WEB-сервиса Расчетного депозитария направляет Расчетному депозитарию запрос на отмену ранее направленного Запроса на подбор ценных бумаг.

Статья 26. Порядок выдачи имущества из имущественного пула. Порядок погашения клиринговых сертификатов участия

- 26.1. Погашение клиринговых сертификатов участия осуществляется при выдаче имущества из имущественного пула по инициативе Участника пула при соблюдении условий, установленных настоящей статьей Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, а также в иных случаях, установленных Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.
- 26.2. Выдача ценных бумаг из имущественного пула осуществляется на основании распоряжений на перевод ценных бумаг, подаваемых Участниками пула с использованием Клиринговой системы.
- 26.3. Выдача денежных средств из имущественного пула осуществляется на основании:
- 1) Запроса о возврате;
 - 2) распоряжений на перевод денежных средств, подаваемых Участниками пула с использованием Клиринговой системы.
- 26.4. Распоряжение на перевод денежных средств / ценных бумаг, подаваемое Участником пула с использованием Клиринговой системы в целях выдачи имущества из имущественного пула, должно содержать указание на Торгово-

клиринговый счет имущественного пула в качестве Торгово-клирингового счета, по которому осуществляется уменьшение денежных средств / ценных бумаг.

Порядок подачи и исполнения распоряжения на перевод денежных средств / ценных бумаг соответствует порядку, определенному пунктом 22.5 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, с учетом особенности, установленной подпунктом 24.6.2 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, а также особенностей, установленных настоящей статьей Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

- 26.5. Запрос о возврате, подаваемый Участником пула в целях выдачи имущества из имущественного пула, должен содержать указание на Расчетный код имущественного пула.

Порядок подачи и исполнения Запроса о возврате соответствует порядку, определенному пунктом 23.4 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, с учетом особенностей, установленных настоящей статьей Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

- 26.6. Если ценная бумага / валюта принимается в соответствующий имущественный пул, то выдача данного имущества из имущественного пула осуществляется только в случае погашения соответствующего количества клиринговых сертификатов участия, за исключением случая, указанного в пункте 4.6 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, а также случаев проведения ликвидационного неттинга в отношении Участника клиринга, клиента Участника клиринга или Клирингового центра в соответствии с общей частью Правил клиринга.

- 26.7. Погашение клиринговых сертификатов участия при выдаче имущества из имущественного пула осуществляется при соблюдении следующих условий:

- 1) количество ценных бумаг клиринговый сертификат участия, учитываемое по Торгово-клиринговому счету T+, соответствующему Торгово-клиринговому счету имущественного пула, после погашения клиринговых сертификатов участия не становится отрицательным;
- 2) положительный Единый лимит по Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета T+, соответствующего Торгово-клиринговому счету имущественного пула, не становится отрицательным после погашения клиринговых сертификатов участия, или
- 3) отрицательный Единый лимит по Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета T+, соответствующего Торгово-клиринговому счету имущественного пула, не уменьшается после погашения клиринговых сертификатов участия;
- 4) при выдаче денежных средств из имущественного пула, возвращаемая сумма денежных средств не превышает максимального из двух значений: (1) суммы денежных средств в соответствующей валюте, учитываемой по Расчетному коду имущественного пула; (2) суммы (с учетом знака) денежных средств в соответствующей валюте, учитываемой по Расчетному коду имущественного пула, и Нетто-обязательства / Нетто-требования по Сделкам T+ в соответствующей валюте с текущей Датой исполнения, учитываемых по Расчетному коду имущественного пула;

- 5) непревышение возвращаемой суммы денежных средств / количества ценных бумаг суммы / количества, рассчитанных в порядке, аналогичном порядку, установленному пунктом 20.1.9.1 / 20.1.10.1 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

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

- 26.8. Погашение клиринговых сертификатов участия, проводимое при отрицательном значении Единого лимита по пулу по Расчетному коду имущественного пула, осуществляется при условии, что количество ценных бумаг клиринговой сертификат участия, учитываемое по Торгово-клиринговому счету Т+, соответствующему Торгово-клиринговому счету имущественного пула, в состав которого входит такой Расчетный код имущественного пула, после погашения клиринговых сертификатов участия не становится отрицательным.
- 26.9. При соблюдении условий погашения клиринговых сертификатов участия, указанных в пункте 26.7 или 26.8 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, Клиринговый центр незамедлительно:
- увеличивает номинальную стоимость клиринговых сертификатов участия, подлежащих погашению в ходе ближайшего взаимодействия с Расчетным депозитарием, учитываемую по Расчетному коду имущественного пула, на номинальную стоимость погашаемых клиринговых сертификатов участия, определенную в соответствии с подпунктом 26.9.2 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов;
 - уменьшает количество ценных бумаг клиринговой сертификат участия, учитываемых по Торгово-клиринговому счету Т+, соответствующему Торгово-клиринговому счету имущественного пула, в состав которого входит указанный Расчетный код имущественного пула, на количество погашаемых клиринговых сертификатов участия, определенное в соответствии с подпунктом 26.9.1 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов;
 - учитывает новое значение Единого лимита по пулу по Расчетному коду имущественного пула.
- 26.9.1. Количество погашаемых клиринговых сертификатов участия соответствует абсолютной величине отрицательного значения Единого лимита по пулу по Расчетному коду имущественного пула, округленного до ближайшего наименьшего целого значения российских рублей.

- 26.9.2. Номинальная стоимость погашаемых клиринговых сертификатов участия равна произведению количества погашаемых клиринговых сертификатов участия на номинальную стоимость одного клирингового сертификата участия.
- 26.10. Поручение на погашение клиринговых сертификатов участия включается в состав распоряжения на проведение операций по Разделам / субсчетам депо, направляемого Клиринговым центром Расчетному депозитарию в соответствии с пунктом 45.8 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

Статья 27. Порядок замены имущества в имущественном пуле

- 27.1. При невозможности выдачи имущества из имущественного пула по причине несоблюдения условий погашения клиринговых сертификатов участия, предусмотренных пунктом 26.7 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, Участник пула вправе заменить ранее переданное в пул имущество на другое имущество.
- 27.2. Для осуществления такой замены Участник пула обязан внести другое имущество в имущественный пул в порядке, установленном статьей 24 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, в том числе, путем подачи Запроса на подбор ценных бумаг, при этом стоимость вносимого имущества должна соответствовать стоимости имущества, подлежащего замене.
- После внесения другого имущества в имущественный пул, Участник пула вправе обратиться к Клиринговому центру за выдачей соответствующего имущества в порядке, установленном статьей 26 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.
- 27.3. Участник клиринга вправе использовать имущество, внесенное с имущественный пул, для исполнения обязательств по Сделкам Т+ в порядке, определенном подпунктом 37.6.2 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

ПОДРАЗДЕЛ V-III. КЛИРИНГОВЫЕ СЕССИИ

Статья 28. Порядок проведения клиринговых сессий mark-to-market. Порядок возникновения и исполнения Маржинальных требований

- 28.1. До начала торгов в установленное Временным регламентом на фондовом рынке и рынке депозитов время Клиринговый центр проводит клиринговую сессию в целях переоценки стоимости Обеспечения, а также обязательств и требований Участника клиринга (далее – клиринговая сессия mark-to-market), в ходе которой Клиринговый центр:
- устанавливает риск-параметры в соответствии с Методикой определения риск-параметров фондового рынка и рынка депозитов;
 - для каждого Участника клиринга рассчитывает и устанавливает новые значения Единых лимитов по Расчетному коду;
 - определяет Участников клиринга, у которых возникли Маржинальные требования и суммы указанных Маржинальных требований;
 - определяет Участников пула, у которых возникли Маржинальные требования по пулу в соответствии со статьей 29 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов;
 - формирует и направляет Участникам клиринга, у которых возникли Маржинальные требования, или Маржинальные требования по пулу, или Маржинальные требования по фондам, или Маржинальные требования по обеспечению под стресс Отчет о Маржинальных требованиях, содержащий информацию о суммах указанных маржинальных требований.
- 28.2. Клиринговый центр с использованием Системы торгов передает Бирже информацию об установленных риск-параметрах.
- 28.3. Маржинальное требование возникает у Участника клиринга, Единый лимит по Расчетному коду которого по итогам клиринговой сессии mark-to-market стал отрицательным. Сумма Маржинального требования равна абсолютному значению Единого лимита по Расчетному коду, определенного по итогам клиринговой сессии mark-to-market.
- 28.4. Маржинальное требование, возникшее у Участника клиринга по итогам клиринговой сессии mark-to-market, должно быть исполнено Участником клиринга не позднее установленного Временным регламентом на фондовом рынке и рынке депозитов времени текущего Расчетного дня.
- 28.5. Маржинальное требование должно быть исполнено Участником клиринга путем внесения денежных средств в российских рублях и иностранной валюте и/или ценных бумаг в Обеспечение в порядке, установленном статьей 22 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.
- 28.5.1. Маржинальное требование может быть также прекращено полностью или в части в случаях:
- прекращения обязательств по Сделкам T+ с наступившей Датой исполнения;
 - заключения Сделок T+, приводящих к увеличению Единого лимита по

Расчетному коду.

- 28.6. Маржинальное требование, учитываемое по Расчетному коду, возникшее у Участника клиринга, считается прекращенным в момент времени, когда Единый лимит по такому Расчетному коду станет неотрицательным.
- 28.7. В случае неисполнения Участником клиринга Маржинального требования, учитываемого по Расчетному коду, в срок, установленный Временным регламентом на фондовом рынке и рынке депозитов, Клиринговый центр осуществляет действия в следующей последовательности (каждое последующее действие выполняется в случае, если предыдущее действие не привело к исполнению Маржинального требования):
- 28.7.1. направляет Расчетному депозитарию Запрос на подбор ценных бумаг с указанием суммы Маржинального требования и Разделов T+, входящих в состав Торгово-клиринговых счетов совместно с Расчетным кодом, по которому учитывается неисполненное Маржинальное требование (только для Участников клиринга, соответствующих требованиям, установленным общей частью Правил клиринга);
- 28.7.2. направляет в Банк России инкассовое поручение на безакцептное списание российских рублей с корреспондентского счета Участника клиринга – кредитной организации в Банке России с зачислением на клиринговый банковский счет Клирингового центра, открытый в Расчетной организации и предназначенный для внесения индивидуального клирингового обеспечения (только для Участников клиринга, соответствующих требованиям, установленным общей частью Правил клиринга);
- 28.7.3. направляет Бирже уведомление о необходимости приостановления возможности подачи заявок с указанием Торгово-клиринговых счетов T+, в состав которых входит Расчетный код, по которому учитывается неисполненное Маржинальное требование, и Торгово-клиринговых счетов имущественного пула, соответствующих таким Торгово-клиринговым счетам T+;
- 28.7.4. вправе направить Бирже уведомление о необходимости снятия всех или части заявок, поданных с указанием Торгово-клиринговых счетов T+, в состав которых входит Расчетный код, по которому учитывается неисполненное Маржинальное требование;
- 28.7.5. заключает с Участником клиринга, не исполнившим Маржинальное требование, закрывающие сделки купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов Yn и/или сделки РЕПО с кодом расчетов Ym/Yn, и/или сделки купли-продажи иностранной валюты, приводящие к увеличению Единого лимита по такому Расчетному коду.

Указанные сделки заключаются без подачи заявок.

Условия указанных Сделок T+ соответствуют условиям, определенным Правилами торгов на фондовом рынке и рынке депозитов для сделок с кодом расчетов Yn, Ym/Yn, указанных Сделок T+, являющихся сделками купли-продажи иностранной валюты, – условиям, определенным Правилами торгов на валютном рынке, а цены – ценам балансирующих сделок, порядок заключения которых определен общей частью Правил клиринга.

Указанные сделки заключаются до момента исполнения Маржинального требования, учитываемого по Расчетному коду, или до момента невозможности заключения указанных сделок.

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

Клиринговый центр допускает к клирингу обязательства по Сделкам T+, заключенным в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

Сделки T+, заключенные в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, учитываются при расчете Нетто-обязательств / Нетто-требований Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам по Сделкам T+ с соответствующими Датами исполнения.

- 28.7.6. Если Участник клиринга, не исполнивший Маржинальное требование, является Участником пула, Клиринговый центр вправе заключить с таким Участником пула закрывающие Сделки T+, направленные на продажу имущества (ценных бумаг или иностранной валюты) из имущественного пула, при соблюдении условий погашения клиринговых сертификатов участия, установленных пунктом 26.7 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

Указанные сделки заключаются без подачи заявок.

Условия указанных Сделок T+, являющихся сделками купли-продажи ценных бумаг, соответствуют условиям, определенным Правилами торгов на фондовом рынке и рынке депозитов для сделок с кодом расчетов Yn, указанных Сделок T+, являющихся сделками купли-продажи иностранной валюты, – условиям, определенным Правилами торгов на валютном рынке, а цены – ценам балансирующих сделок, порядок заключения которых определен общей частью Правил клиринга.

Выбор имущества, с которым заключаются указанные сделки, осуществляется Клиринговым центром.

Указанные сделки заключаются до момента исполнения Маржинального требования или до момента невозможности заключения указанных сделок.

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

Клиринговый центр допускает к клирингу обязательства по Сделкам T+, заключенным в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

Сделки T+, заключенные в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, учитываются при расчете Нетто-обязательств / Нетто-требований Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам по Сделкам T+ с соответствующими Датами исполнения.

- 28.7.7. после завершения заключения сделок в соответствии с подпунктами 28.7.5-28.7.6 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов Клиринговый центр направляет Бирже уведомление о снятии ограничений на подачу заявок с указанием Торгово-клиринговых счетов T+, в состав которых входит Расчетный код, по которому учитывалось неисполненное Маржинальное требование, и Торгово-клиринговых счетов имущественного пула, соответствующих таким Торгово-клиринговым счетам T+.

- 28.8. Расчетный депозитарий исполняет Запрос Клирингового центра на подбор ценных бумаг в соответствии с пунктами 25.6-25.7 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.
- 28.9. Ценные бумаги, зачисленные на Разделы Т+ по итогам исполнения Расчетным депозитарием Запроса Клирингового центра на подбор ценных бумаг, российские рубли, зачисленные на клиринговый банковский счет Клирингового центра в результате исполнения Банком России инкассового поручения на безакцептное списание российских рублей с корреспондентского счета Участника пула – кредитной организации в Банке России, учитываются в качестве Обеспечения по соответствующему Торгово-клиринговому счету Т+ / Расчетному коду и участвуют в расчете Единого лимита по Расчетному коду, по которому учитывалось неисполненное Маржинальное требование.
- Обязательства и требования по сделкам, заключенным в соответствии с подпунктом 28.7.5 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, учитываются при расчете Единого лимита по Расчетному коду, по которому учитывалось неисполненное Маржинальное требование.
- 28.10. Порядок возникновения и исполнения Маржинальных требований по фондам / Маржинальных требований по обеспечению под стресс определен общей частью Правил клиринга.

Статья 29. Порядок возникновения и исполнения Маржинальных требований по пулу

- 29.1. В ходе клиринговой сессии mark-to-market, проводимой в соответствии со статьей 28 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, Клиринговый центр:
- для каждого Участника пула рассчитывает значения Единого лимита по пулу по каждому Расчетному коду имущественного пула в соответствии со статьей 18 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов;
 - осуществляет выдачу / погашение клиринговых сертификатов участия в связи с изменением стоимости имущества, внесенного в соответствующий имущественный пул, вызванной изменением базовых риск-параметров;
 - определяет Участников пула, у которых возникли Маржинальные требования по пулу.
- 29.2. При принятии Клиринговым центром решения об исключении ценной бумаги из перечня ценных бумаг, принимаемых в имущественный пул, или решения об исключении денежных средств в иностранной валюте из перечня имущества, которое может быть внесено в определенный имущественный пул, или при введении ограничения на зачисление ценных бумаг на субсчет депо имущественного пула, открытый иностранному номинальному держателю, начиная с клиринговой сессии mark-to-market, проводимой в соответствии с пунктом 29.1 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов в Расчетный день, установленный указанным решением / в Расчетный день введения указанного ограничения, при расчете Единого лимита по пулу по всем / соответствующим Расчетным кодам имущественного пула такая ценная бумага / иностранная валюта учитывается с Нижней границей диапазона оценки рыночных рисков равной нулю.

Выдача указанного имущества из имущественного пула Участнику пула осуществляется в порядке, установленном статьей 26 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

- 29.3. Если значение Единого лимита по пулу по Расчетному коду имущественного пула, рассчитанное в ходе клиринговой сессии mark-to-market, положительное, Клиринговый центр выдает Участнику пула клиринговые сертификаты участия в порядке, определенном пунктами 24.9-24.11 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.
- 29.4. Если значение Единого лимита по пулу по Расчетному коду имущественного пула, рассчитанное в ходе клиринговой сессии mark-to-market, отрицательное, Клиринговый центр в порядке, установленном пунктами 26.8-26.10 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, погашает клиринговые сертификаты участия в количестве, указанном в подпункте 26.9.1 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, или в максимальном количестве, при котором условие, указанное в пункте 26.8 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, будет соблюдаться.
- 29.5. Если погашение клиринговых сертификатов участия невозможно или не привело к тому, что значение Единого лимита по пулу по Расчетному коду имущественного пула стало равным нулю, Клиринговый центр предъявляет Участнику пула Маржинальное требование по пулу.
- Сумма Маржинального требования по пулу, учитываемого по Расчетному коду имущественного пула, равна абсолютному значению отрицательного Единого лимита по пулу по Расчетному коду имущественного пула, определенного по итогам клиринговой сессии mark-to-market и после погашения клиринговых сертификатов участия в соответствии с пунктом 29.4 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.
- Информация о Маржинальном требовании по пулу направляется Участнику пула в составе Отчета о Маржинальных требованиях.
- 29.6. Маржинальное требование по пулу должно быть исполнено Участником пула не позднее установленного Временным регламентом на фондовом рынке и рынке депозитов времени текущего Расчетного дня.
- 29.7. Маржинальное требование по пулу должно быть исполнено Участником пула путем внесения имущества в имущественный пул в порядке, установленном статьей 24 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.
- Маржинальное требование по пулу может быть также прекращено полностью или в части путем:
- 29.7.1. погашения в ходе торгов клиринговых сертификатов участия при соблюдении условия, указанного в пункте 26.8 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, в количестве, не превышающем количества, указанного в подпункте 26.9.1 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов;
- 29.7.2. заключения Участником пула Сделок Т+ с указанием Торгово-клирингового счета Т+, соответствующего Торгово-клиринговому счету имущественного пула, в состав которого входит Расчетный код имущественного пула, по которому учитывается Маржинальное требование по пулу, приводящих к получению клиринговых

- сертификатов участия, которые погашаются при соблюдении условия, установленного пунктом 26.8 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов;
- 29.7.3. заключения Участником пула Сделок Т+ с указанием Торгово-клирингового счета имущественного пула, направленных на продажу имущества (ценных бумаг или иностранной валюты) из имущественного пула.
- Процедура контроля обеспечения по заявкам на заключение таких Сделок Т+ осуществляется в соответствии со статьей 20 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.
- 29.8. Маржинальное требование по пулу, учитываемое по Расчетному коду имущественного пула, считается прекращенным в момент времени, когда Единый лимит по пулу по такому Расчетному коду имущественного пула станет неотрицательным.
- 29.9. В случае неисполнения Участником пула Маржинального требования по пулу в срок, установленный Временным регламентом на фондовом рынке и рынке депозитов, Клиринговый центр осуществляет действия в следующей последовательности (каждое последующее действие выполняется в случае, если предыдущее действие не привело к исполнению Маржинального требования по пулу):
- 29.9.1. в порядке, установленном пунктами 26.8-26.10 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, погашает клиринговые сертификаты участия в количестве, необходимом для исполнения Маржинального требования по пулу, при соблюдении условия, указанного в пункте 26.8 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, или в максимальном количестве, при котором условие, указанное в пункте 26.8 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, будет соблюдаться;
- 29.9.2. направляет Расчетному депозитарию Запрос на подбор ценных бумаг с указанием суммы Маржинального требования по пулу и субсчета депо имущественного пула, входящего в состав Торгово-клирингового счета имущественного пула совместно с Расчетным кодом имущественного пула, по которому учитывается неисполненное Маржинальное требование по пулу (только для Участников пула, соответствующих требованиям, установленным общей частью Правил клиринга);
- 29.9.3. направляет в Банк России инкассовое поручение на безакцептное списание российских рублей с корреспондентского счета Участника пула – кредитной организации в Банке России с зачислением на клиринговый банковский счет Клирингового центра, открытый в Расчетной организации и предназначенный для внесения имущества в имущественный пул (только для Участников пула, соответствующих требованиям, установленным общей частью Правил клиринга);
- 29.9.4. направляет Бирже уведомление о необходимости приостановления возможности подачи заявок с указанием Торгово-клиринговых счетов имущественного пула, в состав которых входит Расчетный код имущественного пула, по которому учитывается неисполненное Маржинальное требование по пулу;
- 29.9.5. вправе направить Бирже уведомление о необходимости снятия всех или части заявок, поданных с указанием Торгово-клиринговых счетов имущественного пула,

в состав которых входит Расчетный код имущественного пула, по которому учитывается неисполненное Маржинальное требование по пулу;

- 29.9.6. заключает с Участником пула закрывающие Сделки T+, направленные на продажу имущества (ценных бумаг или иностранной валюты) из имущественного пула.

Указанные сделки заключаются без подачи заявок.

Условия указанных Сделок T+, являющихся сделками купли-продажи ценных бумаг, соответствуют условиям, определенным Правилами торгов на фондовом рынке и рынке депозитов для сделок с кодом расчетов Yn, указанных Сделок T+, являющихся сделками купли-продажи иностранной валюты, – условиям, определенным Правилами торгов на валютном рынке, а цены – ценам балансирующих сделок, порядок заключения которых определен общей частью Правил клиринга.

Выбор имущества, с которым заключаются указанные сделки, осуществляется Клиринговым центром.

Указанные сделки заключаются до момента исполнения Маржинального требования по пулу или до момента невозможности заключения указанных сделок.

Указанные сделки не заключаются в случае, если у Участника пула, не исполнившего Маржинальное требование по пулу, отозвана (аннулирована) лицензия Банка России на осуществление банковских операций.

Клиринговый центр допускает к клирингу обязательства по Сделкам T+, заключенным в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

Сделки T+, заключенные в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, учитываются при расчете Нетто-обязательств / Нетто-требований Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам по Сделкам T+ с соответствующими Датами исполнения.

- 29.9.7. после завершения заключения сделок в соответствии с подпунктом 29.9.6 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов Клиринговый центр направляет Бирже уведомление о снятии ограничений на подачу заявок с указанием Торгово-клиринговых счетов имущественного пула, в состав которых входит Расчетный код имущественного пула, по которому учитывалось неисполненное Маржинальное требование по пулу.

- 29.10. Расчетный депозитарий и Клиринговый центр совершают действия, необходимые для исполнения Запроса Клирингового центра на подбор ценных бумаг в соответствии с пунктами 25.6-25.8 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

- 29.11. Ценные бумаги, зачисленные на субсчет депо имущественного пула по итогам исполнения Расчетным депозитарием Запроса Клирингового центра на подбор ценных бумаг, российские рубли, зачисленные на клиринговый банковский счет Клирингового центра в результате исполнения Банком России инкассового поручения на безакцептное списание российских рублей с корреспондентского счета Участника пула – кредитной организации в Банке России, вносятся в имущественный пул и учитываются при расчете Единого лимита по пулу по

Расчетному коду имущественного пула, по которому учитывалось неисполненное Маржинальное требование по пулу.

Обязательства и требования по сделкам, заключенным в соответствии с подпунктом 29.9.6 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, учитываются при расчете Единого лимита по пулу по Расчетному коду имущественного пула, по которому учитывалось неисполненное Маржинальное требование по пулу.

29.12. После осуществления действий в соответствии с пунктами 29.9-29.11 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов Клиринговый центр осуществляет проверку исполнения Маржинального требования по пулу.

29.13. Если по итогам действий, осуществленных в соответствии с пунктами 29.9-29.11 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, Маржинальное требование по пулу осталось неисполненным, Клиринговый центр формирует в Клиринговой системе распоряжение на перевод денежных средств в российских рублях с Торгово-клирингового счета Т+, соответствующего Торгово-клиринговому счету имущественного пула, в состав которого входит Расчетный код имущественного пула, по которому учитывается неисполненное Маржинальное требование по пулу, на Торгово-клиринговый счет имущественного пула в сумме, необходимой для исполнения Маржинального требования по пулу.

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

Указанная Задолженность Участника пула урегулируется в порядке, установленном статьей 38 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

29.14. В случае принятия Клиринговым центром решения об изменении риск-параметров в ходе торгов в соответствии с пунктом 17.10 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, Клиринговый центр рассчитывает новые значения Единого лимита по пулу по каждому Расчетному коду имущественного пула в соответствии со статьей 18 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов и осуществляет погашение клиринговых сертификатов участия в связи с изменением стоимости имущества, внесенного в соответствующий имущественный пул, в порядке, аналогичном порядку, указанному в пункте 29.4 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

Выставление Маржинальных требований по пулу в ходе торгов не осуществляется.

ПОДРАЗДЕЛ V-IV. ПОРЯДОК ВКЛЮЧЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ В КЛИРИНГОВЫЙ ПУЛ

Статья 30. Общие требования к порядку исполнения обязательств по сделкам и обязательств по внесению компенсационных взносов

30.1. Для исполнения обязательств по сделкам / дополнительных обязательств, принятых при подаче заявки на заключение депозитного договора, Участники клиринга категории «Б» и «В» обязаны обеспечивать наличие денежных средств / ценных бумаг, учитываемых по Расчетным кодам / Торгово-клиринговым счетам, по которым осуществлялась проверка достаточности обеспечения при подаче заявок на заключение соответствующих сделок, определяемых в соответствии со статьей 19 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

30.2. Участник клиринга категории «А» может заключать биржевые сделки без предварительного внесения индивидуального клирингового обеспечения в денежных средствах.

Для исполнения обязательств по заключенным Сделкам Т+ Участник клиринга категории «А» обязан внести денежные средства на клиринговый банковский или корреспондентский счет Клирингового центра по реквизитам, размещенным на Сайте Клирингового центра, с обязательным указанием в назначении платежа Расчетного кода Участника клиринга, и/или ценные бумаги на Разделы Т+ до установленного Временным регламентом на фондовом рынке и рынке депозитов времени исполнения Участниками клиринга Итоговых нетто-обязательств перед Клиринговым центром (для Сделок Т+).

Для исполнения обязательств по денежным средствам по сделкам, за исключением Сделок Т+, Участник клиринга категории «А» обязан внести денежные средства на клиринговый банковский или корреспондентский счет Клирингового центра по реквизитам, размещенным на Сайте Клирингового центра, с обязательным указанием в назначении платежа Расчетного кода Участника клиринга, до установленного Временным регламентом на фондовом рынке и рынке депозитов момента окончания Процедуры контроля обеспечения по сделкам с расчетами в соответствующей валюте.

Денежные средства, перечисленные Участником клиринга категории «А» на клиринговый банковский или корреспондентский счет Клирингового центра, учитываются по Расчетному коду, указанному в назначении платежа.

30.3. Исполнение обязательств по сделкам купли-продажи с кодом расчетов T0, K0, первым частям сделок РЕПО с кодом расчетов Rb, а также по Сделкам Т+ осуществляется в моменты времени, установленные Временным регламентом на фондовом рынке и рынке депозитов.

30.3.1. Порядок включения в клиринговый пул обязательств по Сделкам Т+ определен статьей 37 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

30.4. Участник клиринга вправе в Дату исполнения обязательств по сделкам купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов Yn (за исключением сделок, заключенных на основании заявок с указанием Торгово-клирингового счета имущественного пула), первой или второй части сделок РЕПО с кодом расчетов Ym/Yn (за

исключением сделок РЕПО, которым соответствует депозитный договор или заявка на заключение депозитного договора, внесенная в реестр предложений), второй части сделок РЕПО с кодом расчетов T0/Un, заключенным на основании адресных заявок, исполнить их досрочно, путем подачи в Клиринговую систему Отчета на исполнение, Специального отчета на исполнение или Срочного отчета на исполнение при выполнении условий, установленных пунктами 31.9, 35.9, 35.10 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов соответственно.

30.5. Порядок подачи и регистрации в Клиринговой системе Отчета на исполнение определен в статье 31 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, Специального и Срочного отчета на исполнение - в статье 35 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

30.6. Исполнение обязательств по сделкам купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов B0-B30, первым и вторым частям сделок РЕПО с кодом расчетов Sn, вторым частям сделок РЕПО с кодом расчетов Z0 или Rb осуществляется путем подачи Участником клиринга в Клиринговую систему Отчета на исполнение, Специального отчета на исполнение или Срочного отчета на исполнение.

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

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

Порядок подачи и регистрации в Клиринговой системе Поручений на внесение компенсационных взносов и Поручений на отказ от компенсационных взносов определен в статье 32 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

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

30.8. Участник клиринга, имеющий обязательства по внесению компенсационных взносов и/или по сделкам купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов B0-B30, первым и вторым частям сделок РЕПО с кодом расчетов Sn, вторым частям сделок РЕПО с кодом расчетов Z0 или Rb, Дата исполнения обязательств по которым наступила и которые были включены им в Специальный или Срочный отчет на исполнение, но не были обеспечены средствами под исполнение до момента окончания периода получения Клиринговым центром от Участников клиринга Специальных и Срочных отчетов на исполнение, обязан до момента окончания периода регистрации поручений зарегистрировать в Клиринговой системе Отчет на исполнение по каждой такой сделке (первой или второй части такой сделки РЕПО), и/или Поручение на внесение каждого такого компенсационного взноса.

30.9. По сделкам, за исключением Сделок T+, не обеспеченным средствами под исполнение, Участник клиринга вправе до момента окончания периода регистрации поручений Расчетного дня, предшествующего Дате исполнения, заменить Торгово-клиринговый счет в сделках.

Для осуществления указанной замены Участник клиринга предоставляет Клиринговому центру Заявление о замене Торгово-клирингового счета.

Информация о замене Торгово-клирингового счета, выполненной по инициативе Участника клиринга, доводится до сведения Участника клиринга путем предоставления Уведомления о замене Торгово-клирингового счета.

- 30.10. После замены Торгово-клирингового счета в сделке обязательства по сделке и обязательства по уплате компенсационных взносов по такой сделке исполняются по Счетам обеспечения и Разделам, входящим в состав нового Торгово-клирингового счета.
- 30.11. Для исполнения обязательств по сделкам, Маржинальных требований и Маржинальных требований по пулу Участник клиринга / Клиринговый центр вправе с использованием WEB-сервиса Расчетного депозитария подать Запрос на подбор ценных бумаг в соответствии со статьей 25 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.
- 30.12. Для исполнения обязательств по сделкам, Маржинальных требований и Маржинальных требований по пулу Клиринговый центр вправе направить в Банк России инкассовое поручение на безакцептное списание российских рублей с корреспондентского счета Участника клиринга – кредитной организации в Банке России (только для Участников клиринга, соответствующих требованиям, установленным общей частью Правил клиринга).
- 30.12.1. В случае неисполнения направленного в Банка России инкассового поручения в течение времени, установленного Временным регламентом на фондовом рынке и рынке депозитов, Клиринговый центр вправе направить Банку России запрос на отмену ранее направленного инкассового поручения.
- 30.13. Участник клиринга вправе по согласованию с контрагентом отказаться от исполнения обязательств по сделке РЕПО с кодом расчетов Sn до момента исполнения первой части такой сделки РЕПО.
Порядок подачи и исполнения Поручений на отказ от исполнения сделки РЕПО определен в статье 34 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.
- 30.14. Участник клиринга вправе по согласованию с контрагентом отказаться от исполнения обязательств по сделке купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов B0-B30, не обеспеченной средствами под исполнение.
Порядок подачи и исполнения Поручений на отказ от исполнения сделки купли-продажи ценных бумаг определен в статье 34 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.
- 30.15. В случаях если между датой заключения Сделки T+ и Датой исполнения обязательств по Сделке T+ в отношении ценных бумаг, с которыми заключена Сделка T+, происходят корпоративные действия, такие как реорганизация эмитента ценных бумаг, конвертация ценных бумаг, проводимая без реорганизации эмитента ценных бумаг, или иные действия, влияющие на исполнение обязательств по Сделкам T+, в том числе, которые приводят к изменению предмета Сделки T+, Клиринговый центр вправе принять в отношении таких Сделок T+ одно из следующих решений:

- 30.15.1. об изменении в одностороннем порядке предмета (объекта) Сделок Т+, обязательства по которым не исполнены, и/или порядка исполнения обязательств по Сделкам Т+, с учетом условий реорганизации эмитента ценных бумаг или условий иного действия, установленных эмитентом ценных бумаг;
- 30.15.2. о том, что Дата исполнения обязательств по Сделкам Т+ считается наступившей в Расчетный день, предшествующий дню приостановления операций с ценными бумагами по счетам депо, проводимого в связи с корпоративным действием, в случае если информация о таком приостановлении получена Клиринговым центром от Расчетного депозитария до 18:00 указанного Расчетного дня.

Статья 31. Порядок подачи и регистрации Отчетов на исполнение

- 31.1. Отчет на исполнение может быть подан по сделке купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов В0-В30, первой части сделки РЕПО с кодом расчетов Sn, второй части сделки РЕПО с кодом расчетов Sn, Z0 и Rb, а также по сделке купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов Yn (за исключением сделок, заключенных на основании заявок с указанием Торгово-клирингового счета имущественного пула), первой или второй части сделки РЕПО с кодом расчетов Ym/Yn (за исключением сделок РЕПО, которым соответствует депозитный договор или заявка на заключение депозитного договора, внесенная в реестр предложений), второй части сделки РЕПО с кодом расчетов T0/Yn, заключенным на основании адресных заявок.
- 31.2. Отчет на исполнение может быть подан Участником клиринга в Клиринговую систему в ходе периода регистрации поручений в следующие даты:
- по биржевой сделке с кодом расчетов В0 - с даты заключения до Даты прекращения исполнения;
 - по внебиржевой сделке с кодом расчетов В0 - с даты регистрации данных о сделке в Клиринговой системе до Даты прекращения исполнения;
 - по биржевой сделке с кодом расчетов В01-В30 - с Расчетного дня, следующего за датой ее заключения, до Даты прекращения исполнения;
 - по внебиржевой сделке с кодом расчетов В01-В30 - с Расчетного дня, следующего за датой регистрации данных о сделке в Клиринговой системе до Даты прекращения исполнения;
 - по первой части сделки РЕПО с кодом расчетов Sn - с Даты исполнения первой части сделки РЕПО до Даты прекращения ее исполнения;
 - по второй части сделки РЕПО с кодом расчетов Sn, Z0 и Rb - с Даты исполнения первой части сделки РЕПО до Даты прекращения исполнения второй части сделки РЕПО;
 - по сделке купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов Yn, первой или второй части сделки РЕПО с кодом расчетов Ym/Yn, второй части сделки РЕПО с кодом расчетов T0/Yn, заключенным на основании адресных заявок, - в Дату исполнения.
- 31.3. Отчет на исполнение по второй части сделки РЕПО с кодом расчетов Sn, Z0 и Rb может быть подан Участником клиринга в Клиринговую систему при условии, что первая часть сделки РЕПО является обеспеченной средствами под исполнение.

- Отчет на исполнение по второй части сделки РЕПО с кодом расчетов T0/Yn, Ym/Yn, заключенной на основании адресных заявок, может быть подан Участником клиринга в Клиринговую систему при условии исполнения первой части сделки РЕПО.
- 31.4. Отчет на исполнение, поданный Участником клиринга - покупателем, регистрируется в Клиринговой системе при прохождении в момент подачи Отчета на исполнение всех соответствующих проверок, предусмотренных статьей 32 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, в отношении обязательства данного Участника клиринга по денежным средствам, возникшего по данной сделке (первой или второй части сделки РЕПО) (с учетом НКД).
- 31.5. Отчет на исполнение, поданный Участником клиринга - продавцом, регистрируется в Клиринговой системе при прохождении в момент подачи Отчета на исполнение всех соответствующих проверок, предусмотренных статьей 32 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, в отношении обязательства данного Участника клиринга по ценным бумагам, возникшего по данной сделке (первой или второй части сделки РЕПО).
- 31.6. Отсутствие в Клиринговой системе зарегистрированного Отчета на исполнение по не обеспеченной средствами под исполнение сделке купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов B0-B30, первой части сделки РЕПО с кодом расчетов Sn, второй части сделки РЕПО с кодом расчетов Sn, Z0 и Rb в Дату ее исполнения по состоянию на момент окончания периода регистрации поручений признается нарушением со стороны Участника клиринга требований Правил клиринга, повлекшим неисполнение обязательств по данной сделке (первой или второй части сделки РЕПО) в Дату исполнения.
- 31.7. Участнику клиринга в Клиринговой системе раскрывается информация о регистрации Отчета на исполнение по сделке купли-продажи ценных бумаг, первой или второй части сделки РЕПО, поданного в Клиринговую систему его контрагентом / конечным контрагентом.
- 31.8. Участники клиринга вправе до окончания периода регистрации поручений отзываться зарегистрированные Отчеты на исполнение и подавать новые Отчеты на исполнение при условии, что сделки (первые или вторые части сделки РЕПО), по которым подан Отчет на исполнение, не являются обеспеченными средствами под исполнение в соответствии с пунктом 31.9 настоящей статьи Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.
- 31.9. При условии регистрации в Клиринговой системе Отчетов на исполнение по сделке купли-продажи ценных бумаг (первой или второй части сделки РЕПО), поданных обоими Участниками клиринга - сторонами по данной сделке / конечными контрагентами по парным сделкам, данная сделка / сделки (первая или вторая часть сделки РЕПО) считается обеспеченной / обеспеченными средствами под исполнение, и обязательства по данной сделке / сделкам (первой или второй части сделки РЕПО) включаются в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов / в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов по сделкам с центральным контрагентом с ближайшим временем исполнения.

31.10. В случае если вторая часть биржевой сделки РЕПО становится обеспеченной средствами под исполнение до Даты исполнения, Клиринговый центр формирует и передает Бирже Отчет о досрочном исполнении сделок РЕПО.

31.11. Отчет на исполнение по Сделке T+, не обеспеченной средствами под исполнение на установленное Временным регламентом на фондовом рынке и рынке депозитов время исполнения обязательств по Сделкам T+, исключается из Клиринговой системы и не подлежит исполнению. Исполнение (прекращение) обязательств по такой Сделке T+ осуществляется в сроки, установленные Временным регламентом на фондовом рынке и рынке депозитов, путем включения их в Клиринговый пул по Сделкам T+ в порядке, определенном статьей 37 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

Отчет на исполнение по сделке, не обеспеченной средствами под исполнение до окончания периода регистрации поручений, после его окончания исключается из Клиринговой системы и не подлежит исполнению.

Статья 32. Проверки, выполняемые при подаче Отчетов на исполнение, Специальных отчетов на исполнение, Срочных отчетов на исполнение, поручений на внесение компенсационных взносов, поручений на отказ от компенсационных взносов, Поручений на отказ от исполнения сделки РЕПО / Поручений на отказ от исполнения сделки купли-продажи ценных бумаг

32.1. Проверка достаточности денежных средств по Счету обеспечения T0 считается пройденной при условии превышения (равенства) суммы денежных средств, учитываемой по соответствующему Счету обеспечения T0, за вычетом соответствующего Ограничительного лимита, величины(е) обязательства Участника клиринга по денежным средствам, в отношении которого осуществляется проверка.

32.2. Проверка достаточности денежных средств по Расчетному коду, соответствующему Счету обеспечения, считается пройденной при соблюдении следующих условий:

- Единый лимит по Расчетному коду с учетом обязательства Участника клиринга по денежным средствам, в отношении которого осуществляется проверка, не станет отрицательным, или, если Единый лимит по такому Расчетному коду был отрицательным до момента проверки, - проверку того, что Единый лимит по такому Расчетному коду, рассчитанный с учетом указанного обязательства, не станет меньше, чем Единый лимит по этому Расчетному коду, рассчитанный до момента проверки;
- сумма обязательства Участника клиринга по денежным средствам, в отношении которого осуществляется проверка, не превышает разности:
 - максимального из двух значений: (1) значения Обеспечения в соответствующей валюте, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга; (2) суммы (с учетом знака) значения Обеспечения и Нетто-обязательства / Нетто-требования в соответствующей валюте с текущей Датой исполнения, учитываемых по Расчетному коду,

и

- значения Ограничительного лимита, установленного по Расчетному коду;
 - для Расчетного кода Участника клиринга с признаком «запрет необеспеченных покупок» и/или для Расчетного кода Участника клиринга категории «В», - непревышение суммы обязательства Участника клиринга по денежным средствам, в отношении которого осуществляется проверка, суммы Обеспечения в соответствующей валюте, рассчитанной в соответствии с пунктом 20.1.9.1 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.
- 32.3. Проверка достаточности ценных бумаг по Торгово-клиринговому счету Т0 считается пройденной при условии превышения (равенства) количества ценных бумаг, учитываемых по соответствующему Торгово-клиринговому счету Т0, за вычетом соответствующего Ограничительного лимита, величины(е) обязательства Участника клиринга по ценным бумагам, в отношении которого осуществляется проверка.
- 32.4. Дополнительно к условию, указанному в пункте 32.3 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, проверка достаточности ценных бумаг по Торгово-клиринговому счету Т+ считается пройденной при соблюдении следующих условий:
- Единый лимит по Расчетному коду с учетом величины обязательства Участника клиринга по ценным бумагам, в отношении которого осуществляется проверка, не станет отрицательным, или, если Единый лимит по такому Расчетному коду был отрицательным до момента проверки, - проверку того, что Единый лимит по такому Расчетному коду, рассчитанный с учетом указанного обязательства, не станет меньше, чем Единый лимит по этому Расчетному коду, рассчитанный до момента проверки;
 - для Торгово-клирингового счета Т+ с признаком «запрет коротких продаж», и/или для Участника клиринга категории «В», и/или ценных бумаг с признаком «запрет коротких продаж» - непревышение величины обязательства Участника клиринга по ценным бумагам, в отношении которого осуществляется проверка, количества ценных бумаг, рассчитанного в соответствии с пунктом 20.1.10.1 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.
- 32.5. Проверки, указанные в настоящей статье Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, осуществляются с учетом положений подпункта 20.1.13 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

Статья 33. Порядок подачи и регистрации поручений на внесение компенсационных взносов и поручений на отказ от компенсационных взносов

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

- 33.2. Поручение на внесение компенсационного взноса может быть подано в Клиринговую систему в ходе периода регистрации поручений в Дату внесения компенсационного взноса.
- 33.3. Поручение на внесение компенсационного взноса в виде денежных средств, поданное Участником клиринга, регистрируется в Клиринговой системе при прохождении в момент подачи Поручения всех соответствующих проверок, предусмотренных статьей 32 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, в отношении обязательства данного Участника клиринга по внесению компенсационного взноса.
- 33.4. Поручение на внесение компенсационного взноса в виде ценных бумаг, поданное Участником клиринга, регистрируется в Клиринговой системе при прохождении в момент подачи Поручения всех соответствующих проверок, предусмотренных статьей 32 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, в отношении обязательства данного Участника клиринга по внесению компенсационного взноса.
- 33.5. При условии регистрации в Клиринговой системе Поручения на внесение компенсационного взноса, поданного Участником клиринга, компенсационный взнос считается обеспеченным средствами под исполнение, и обязательства по внесению данного компенсационного взноса включаются в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов с ближайшим временем исполнения.
- 33.6. Участнику клиринга в Клиринговой системе раскрывается информация о регистрации Поручения на внесение компенсационного взноса, поданного в Клиринговую систему его контрагентом по соответствующей сделке.
- 33.7. Участник клиринга вправе отказаться от получения компенсационного взноса. Для этого Участники клиринга, являющиеся контрагентами по биржевой сделке РЕПО, до окончания периода регистрации поручений в Дату внесения компенсационного взноса формируют и подают в Клиринговую систему Поручения на отказ от компенсационного взноса.
- Поручение на отказ от компенсационного взноса может быть подано при условии, что компенсационный взнос не является обеспеченным средствами под исполнение в соответствии с пунктом 33.5 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.
- При регистрации в Клиринговой системе Поручений на отказ от компенсационного взноса со стороны каждого из Участников клиринга – контрагентов по биржевой сделке РЕПО, внесение компенсационного взноса по данной сделке не осуществляется и факт неисполнения обязательств по внесению компенсационного взноса со стороны Участника клиринга, имеющего обязательство по внесению компенсационного взноса, не регистрируется.
- 33.8. Участнику клиринга в Клиринговой системе раскрывается информация о регистрации Поручения на отказ от компенсационного взноса, поданного в Клиринговую систему его контрагентом.
- 33.9. Отзыв Участником клиринга ранее зарегистрированного в Клиринговой системе Поручения на отказ от компенсационного взноса возможен только до момента

регистрации в Клиринговой системе Поручения на отказ от компенсационного взноса, поданного его контрагентом.

Статья 34. Порядок подачи и исполнения Поручений на отказ от исполнения сделки РЕПО / Поручений на отказ от исполнения сделки купли-продажи ценных бумаг

- 34.1. Поручение на отказ от исполнения сделки РЕПО с кодом расчетов Sn / Поручение на отказ от исполнения сделки купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов В0-В30 может быть подано в Клиринговую систему Участником клиринга, являющимся стороной по сделке, в ходе периода регистрации поручений с даты заключения сделки РЕПО / сделки купли-продажи ценных бумаг до Даты исполнения обязательств по первой части сделки РЕПО / сделке купли-продажи ценных бумаг.
- 34.2. Поручение на отказ от исполнения сделки РЕПО / Поручение на отказ от исполнения сделки купли-продажи ценных бумаг не может быть подано Участником клиринга, если обязательства по первой части сделки РЕПО / сделке купли-продажи ценных бумаг исполнены, или первая часть сделки РЕПО / сделка купли-продажи ценных бумаг является обеспеченной средствами под исполнение в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.
- 34.3. Если по первой части сделки РЕПО / сделке купли-продажи ценных бумаг подан Отчет на исполнение (информация о первой части сделки РЕПО / сделке купли-продажи ценных бумаг включена в Специальный или Срочный отчет на исполнение), но первая часть сделки РЕПО / сделка купли-продажи ценных бумаг не является обеспеченной средствами под исполнение, то для подачи Поручения на отказ от исполнения сделки РЕПО / Поручения на отказ от исполнения сделки купли-продажи ценных бумаг необходимо сначала отозвать Отчет на исполнение (исключить информацию о первой части сделки РЕПО / сделке купли-продажи ценных бумаг из Специального или Срочного отчета на исполнение).
- 34.4. Поручение на отказ от исполнения сделки РЕПО / Поручение на отказ от исполнения сделки купли-продажи ценных бумаг содержит номер первой части сделки РЕПО / номер сделки купли-продажи ценных бумаг, от исполнения которой Участник клиринга желает отказаться, а также величину отступного за отказ от исполнения сделки РЕПО / сделки купли-продажи ценных бумаг.
- 34.4.1. Величина отступного может быть указана в процентах от суммы РЕПО / сделки купли-продажи ценных бумаг или как сумма отступного в той валюте, в которой проводятся расчеты по сделке РЕПО / сделке купли-продажи ценных бумаг.
- 34.4.2. В качестве величины отступного может быть указано отрицательное значение. Положительная величина отступного означает, что Участник клиринга, подавший Поручение на отказ от исполнения сделки РЕПО / Поручение на отказ от исполнения сделки купли-продажи ценных бумаг, обязан получить сумму отступного от контрагента по сделке, отрицательная – уплатить.
- 34.5. Поручение на отказ от исполнения сделки РЕПО / Поручение на отказ от исполнения сделки купли-продажи ценных бумаг, поданное Участником клиринга, обязанным уплатить отступное, регистрируется в Клиринговой системе при

прохождении в момент подачи Поручения на отказ от исполнения сделки РЕПО / Поручения на отказ от исполнения сделки купли-продажи ценных бумаг всех соответствующих проверок, предусмотренных статьей 32 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, в отношении обязательства данного Участника клиринга по уплате отступного.

- 34.6. Участнику клиринга в Клиринговой системе раскрывается информация о регистрации Поручения на отказ от исполнения сделки РЕПО / Поручения на отказ от исполнения сделки купли-продажи ценных бумаг, поданного в Клиринговую систему его контрагентом по соответствующей сделке.
- 34.7. При условии регистрации в Клиринговой системе Поручений на отказ от исполнения сделки РЕПО / Поручений на отказ от исполнения сделки купли-продажи ценных бумаг, поданных обоими Участниками клиринга – сторонами по сделке:
- обязательство по уплате отступного считается обеспеченными средствами под исполнение, и включается в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов;
 - обязательства по сделке РЕПО / сделке купли-продажи ценных бумаг считаются прекращенными выплатой отступного.

Статья 35. Порядок подачи и регистрации Специальных и Срочных отчетов на исполнение

- 35.1. Участник клиринга вправе включить в Специальный или Срочный отчет на исполнение:
- сделки купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов В0-В30;
 - первые части сделок РЕПО с кодом расчетов Sn;
 - вторые части сделок РЕПО с кодом расчетов Sn, Z0 и Rb;
 - обязательства по внесению компенсационных взносов по биржевым и внебиржевым сделкам РЕПО,
- или
- сделки купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов Yn, заключенные на основании адресных заявок (за исключением сделок, заключенных на основании заявок с указанием Торгово-клирингового счета имущественного пула);
 - первые и вторые части сделок РЕПО с кодом расчетов Ym/Yn, заключенных на основании адресных заявок (за исключением сделок РЕПО, которым соответствует депозитный договор или заявка на заключение депозитного договора, внесенная в реестр предложений, и за исключением включения в Срочный отчет на исполнение сделок РЕПО с клиринговыми сертификатами участия);
 - вторые части сделок РЕПО с кодом расчетов T0/Yn, заключенных на основании адресных заявок (за исключением включения в Срочный отчет на исполнение сделок РЕПО с клиринговыми сертификатами участия).

- 35.2. Специальный или Срочный отчет на исполнение может быть подан в Клиринговую систему в ходе периода регистрации поручений до установленного Временным регламентом на фондовом рынке и рынке депозитов момента окончания периода получения Клиринговым центром от Участников клиринга Специальных и Срочных отчетов на исполнение.
- 35.3. В Специальный или Срочный отчет на исполнение могут быть включены сделки и/или обязательства, возникшие из сделок, заключенных с одним контрагентом / парных сделок, заключенных с одним конечным контрагентом.
- 35.4. По всем сделкам и/или обязательствам, указанным в пункте 35.1 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов и включенным в Специальный или Срочный отчет на исполнение, Клиринговый центр для каждого Расчетного кода и Торгово-клирингового счета, по которым проводится Процедура контроля обеспечения по сделкам, включенным в Специальный или Срочный отчет на исполнение, рассчитывает нетто-обязательство (нетто-требование) Участника клиринга по денежным средствам или ценным бумагам.
- 35.4.1. Нетто-обязательство (нетто-требование) Участника клиринга по денежным средствам рассчитывается по формуле:
$$POS_VAL = ST - SO,$$
 где:
POS_VAL - нетто-обязательство (нетто-требование) Участника клиринга по денежным средствам;
ST - сумма требований, а SO – сумма обязательств Участника клиринга по денежным средствам по включенным в Специальный или Срочный отчет на исполнение сделкам и/или обязательствам.
Отрицательное значение POS_VAL означает нетто-обязательство Участника клиринга по денежным средствам, положительное значение POS_VAL — нетто-требование Участника клиринга по денежным средствам.
Нетто-обязательство (нетто-требование) Участника клиринга по денежным средствам, рассчитанное в соответствии с настоящим подпунктом Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов по обязательствам, включенным в Срочный отчет на исполнение, является Нетто-обязательством (нетто-требованием) по денежным средствам по сделкам клирингового пула (для Клирингового пула для расчетов в ходе торгов).
- 35.4.2. Нетто-обязательство (нетто-требование) Участника клиринга по ценным бумагам, рассчитывается по формуле:
$$POS_C = STC - SOC,$$
 где:
POS_C - нетто-обязательство (нетто-требование) Участника клиринга по ценной бумаге;
STC - сумма требований, а SOC – сумма обязательств Участника клиринга по соответствующей ценной бумаге по включенным в Специальный или Срочный отчет на исполнение сделкам и/или обязательствам.
Отрицательное значение POS_C означает нетто-обязательство Участника клиринга по ценной бумаге, положительное значение POS_C — нетто-требование Участника клиринга по ценной бумаге.

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

- 35.5. Специальный или Срочный отчет на исполнение Участника клиринга, имеющего нетто-обязательство по денежным средствам, регистрируется в Клиринговой системе при прохождении в момент подачи Специального или Срочного отчета на исполнение всех соответствующих проверок, предусмотренных статьей 32 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, в отношении нетто-обязательства данного Участника клиринга по денежным средствам.

Специальный отчет на исполнение Участника клиринга, имеющего нетто-обязательство по ценным бумагам, регистрируется в Клиринговой системе при прохождении в момент подачи Специального отчета на исполнение всех соответствующих проверок, предусмотренных статьей 32 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, в отношении нетто-обязательства данного Участника клиринга по ценным бумагам.

Срочный отчет на исполнение Участника клиринга, имеющего нетто-обязательство по ценным бумагам, регистрируется в Клиринговой системе при прохождении в момент подачи Срочного отчета на исполнение всех соответствующих проверок, предусмотренных статьей 32 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, в отношении нетто-обязательства данного Участника клиринга по ценным бумагам, а также при условии непревышения в момент подачи Срочного отчета на исполнение данного нетто-обязательства по ценным бумагам меньшей из двух величин: количества ценных бумаг, учитываемых по соответствующему Торгово-клиринговому счету, за вычетом соответствующего Ограничительного лимита, и количества ценных бумаг, учитываемых на соответствующем Разделе по информации, полученной от Расчетного депозитария.

- 35.6. Участнику клиринга в Клиринговой системе раскрывается информация о регистрации Специального или Срочного отчета на исполнение, поданного в Клиринговую систему его контрагентом / конечным контрагентом.

- 35.7. Участники клиринга вправе до окончания периода регистрации поручений отзывать зарегистрированные Специальные или Срочные отчеты на исполнение и подавать новые Специальные или Срочные отчеты на исполнение при условии, что сделки и/или обязательства, включенные в Специальный или Срочный отчет на исполнение, еще не являются обеспеченными средствами под исполнение в соответствии с пунктом 35.9 / 35.10 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

- 35.8. Специальные и Срочные отчеты на исполнение, содержащие Сделки T+ и не обеспеченные средствами под исполнение на установленное Временным регламентом на фондовом рынке и рынке депозитов время исполнения обязательств по Сделкам T+, исключаются из Клиринговой системы и не подлежат исполнению. Исполнение (прекращение) обязательств по Сделкам T+, ранее включенным в такие отчеты, осуществляется в сроки, установленные Временным регламентом на фондовом рынке и рынке депозитов, путем включения их в

Клиринговый пул по Сделкам Т+ в порядке, определенном статьей 37 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

Специальные и Срочные отчеты на исполнение, не обеспеченные средствами под исполнение до окончания периода регистрации поручений, после его окончания исключаются из Клиринговой системы и не подлежат исполнению.

- 35.9. При условии регистрации в Клиринговой системе Специальных отчетов на исполнение, поданных обоими Участниками клиринга - контрагентами / конечными контрагентами и содержащих одинаковый набор сделок / парных сделок и/или обязательств, указанные сделки и/или обязательства считаются обеспеченными средствами под исполнение, а обязательства (требования) Участников клиринга по денежным средствам или ценным бумагам по сделкам и/или обязательствам, включенным в такие Специальные отчеты на исполнение, включаются в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов / Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов по сделкам с центральным контрагентом с ближайшим временем исполнения.
- 35.10. При условии регистрации в Клиринговой системе Срочных отчетов на исполнение, поданных обоими Участниками клиринга - контрагентами / конечными контрагентами и содержащих одинаковый набор сделок / парных сделок и/или обязательств, указанные сделки и/или обязательства считаются обеспеченными средствами под исполнение, а нетто-обязательства (нетто-требования) Участников клиринга по денежным средствам или ценным бумагам, рассчитанные по сделкам и/или обязательствам, включенным в такие Срочные отчеты на исполнение, включаются в Клиринговый пул для расчетов в ходе торгов / Клиринговый пул для расчетов в ходе торгов по сделкам с центральным контрагентом.

Статья 36. Порядок включения в клиринговый пул обязательств Участников клиринга по уплате Возмещения

- 36.1. Определение и учет обязательств и требований Участников клиринга по уплате Возмещения осуществляется в Клиринговой системе в российских рублях в отдельности по каждой биржевой сделке с ценными бумагами.
- 36.2. Обязательства и требования Участников клиринга по уплате Возмещения определяются в Клиринговой системе только по биржевым сделкам, в том числе по сделкам РЕПО, неисполненным до Даты прекращения исполнения, по которым только одним из Участников клиринга нарушены требования Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, повлекшим неисполнение обязательств по биржевой сделке с ценными бумагами в Дату исполнения.
- Обязательства и требования Участников клиринга по уплате Возмещения определяются в Клиринговой системе в Дату прекращения исполнения этих сделок на основании информации, полученной от Биржи посредством Системы торгов, и допускаются к клирингу.
- 36.3. Обязательство Участника клиринга по уплате Возмещения подлежит исполнению начиная с Расчетного дня, следующего за Датой прекращения исполнения соответствующей биржевой сделки. При этом в Расчетный день, следующий за Датой прекращения исполнения биржевой сделки с ценными бумагами, величина

обязательства по уплате Возмещения по этой сделке, учитываемая по Счету обеспечения T0, включается в Ограничительный лимит по соответствующему Счету обеспечения T0, определенному в соответствии с пунктом 48.3 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

В случае неисполнения обязательств по уплате Возмещения, учитываемого по Счету обеспечения T0, значение Ограничительного лимита устанавливается в размере совокупных неисполненных обязательств Участника клиринга по уплате Возмещения ежедневно до тех пор, пока обязательства по уплате Возмещения учитываются в Клиринговой системе.

- 36.4. Учет обязательства Участника клиринга по уплате Возмещения может быть прекращен в Клиринговой системе (до удержания с этого Участника клиринга денежных средств в размере его обязательства по уплате Возмещения) на основании полученной от Биржи информации об отказе от получения Переменного возмещения или Фиксированного возмещения, подлежащего уплате в соответствии с условиями заключенной биржевой сделки.
- 36.5. Обязательства Участника клиринга по уплате Возмещения исполняются после исполнения обязательств Участника клиринга по денежным средствам, определенных в соответствии со статьей 43 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, и обязательств Участника клиринга по уплате комиссионных вознаграждений и неустоек в соответствии со статьей 48 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.
- 36.5.1. Возмещение по биржевым сделкам с ценными бумагами удерживается с Участников клиринга в порядке возрастания номеров сделок.
- 36.5.2. Возмещение по биржевой сделке с ценными бумагами может быть удержано только в полном объеме, частичное удержание Возмещения по биржевой сделке не допускается.
- 36.6. Обеспечение Участника клиринга в российских рублях является достаточным для исполнения обязательств по уплате Возмещения, учитываемых по Расчетному коду Участника клиринга, если размер Обеспечения Участника клиринга в российских рублях, учитываемого по такому Расчетному коду, не меньше, чем размер указанных обязательств.
- 36.6.1. Для исполнения обязательства по уплате Возмещения, учитываемых по Расчетному коду Участника клиринга, Клиринговый центр зачитывает соответствующее обязательство с требованием Участника клиринга по возврату денежных средств в российских рублях, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга в российских рублях по такому Расчетному коду Участника клиринга.
При этом размер Обеспечения Участника клиринга в российских рублях, учитываемого по Расчетному коду, уменьшается на сумму исполненного обязательства.
- 36.6.2. Обязательства Участника клиринга по уплате Возмещения, учитываемые по Расчетному коду, для исполнения которых недостаточно Обеспечения в российских рублях, учитываются как Задолженность Участника клиринга перед Клиринговым центром по такому Расчетному коду.
- 36.6.3. Указанная Задолженность Участника клиринга урегулируется в порядке, установленном статьей 38 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

36.7. Неисполненные обязательства по уплате Возмещения по сделкам РЕПО, учитываемые по Счету обеспечения Т0, учитываются в Клиринговой системе только в Расчетный день, следующий за Датой прекращения исполнения сделки, по иным сделкам - в течение 3 (трех) месяцев с Расчетного дня, следующего за Датой прекращения исполнения сделки, по которой возникли указанные обязательства по уплате Возмещения.

По истечении указанного срока обязательства по уплате Возмещения не подлежат исполнению в Клиринговой системе.

36.7.1. Прекращение учета обязательств по уплате Возмещения в Клиринговой системе не влечет прекращение указанных обязательств. Требования о надлежащем исполнении указанных обязательств могут быть предъявлены любой из сторон в соответствии с гражданским законодательством при условии соблюдения порядка разрешения споров, предусмотренного общей частью Правил клиринга и Правилами торгов на фондовом рынке и рынке депозитов.

Клиринговый центр уведомляет Биржу о неисполнении обязательств по уплате Возмещения в Дату прекращения обязательств по сделке, а также о прекращении учета обязательств по уплате Возмещения в Клиринговой системе.

Статья 37. Порядок включения в клиринговый пул обязательств по Сделкам Т+

37.1. В срок, установленный Временным регламентом на фондовом рынке и рынке депозитов как время начала формирования соответствующего Клирингового пула по Сделкам Т+, Клиринговый центр:

37.1.1. включает в соответствующий Клиринговый пул по Сделкам Т+:

- Задолженности Участника клиринга в российских рублях, возникшие в предыдущий Расчетный день и не погашенные по состоянию на момент начала формирования соответствующего Клирингового пула по Сделкам Т+;
- обязательства и требования Участника клиринга и Клирингового центра по денежным средствам и ценным бумагам по Сделкам Т+ с наступившей Датой исполнения, не обеспеченных средствами под исполнение на момент формирования Клирингового пула (обязательства Клирингового центра по возврату Участникам клиринга депозитов – только для третьего Клирингового пула по Сделкам Т+);
- обязательства / требования Участника клиринга и Клирингового центра по Сделкам РЕПО Клирингового центра, заключенным в соответствии с пунктом 38.14.1 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов;
- обязательства по передаче / требования по получению Дохода, определенные в соответствии со статьей 47 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов (только для первого Клирингового пула по Сделкам Т+);
- обязательства Участника клиринга уплатить Клиринговому центру денежные средства в сумме, равной номинальной стоимости клиринговых сертификатов участия, в отношении которых Участником клиринга не были исполнены обязательства перед Банком России по второй части договора репо, и требования Участника клиринга к Клиринговому центру по получению клиринговых сертификатов участия в количестве, равном полученному Клиринговым центром от Банка России, с наступившей Датой исполнения, определенные в соответствии с пунктом 39.5 Правил клиринга на фондовом

рынке и рынке депозитов.

- 37.1.2. зачитывает встречные однородные обязательства и требования Участника клиринга и Клирингового центра по денежным средствам и ценным бумагам, включенные в соответствующий Клиринговый пул по Сделкам T+, учитываемые по определенному Расчетному коду / Торгово-клиринговому счету T+, за исключением обязательства Клирингового центра по возврату Участникам клиринга депозитов, а в части, в которой обязательства и требования не были зачтены – определяет Итоговые нетто-обязательства и/или Итоговые нетто-требования по денежным средствам / ценным бумагам каждого Участника клиринга по каждому Расчетному коду / Торгово-клиринговому счету T+;
- 37.1.3. формирует и передает Участникам клиринга отчеты, содержащие информацию об Итоговых нетто-обязательствах / Итоговых нетто-требованиях по денежным средствам / ценным бумагам;
- 37.2. Участник клиринга обязан исполнить свои Итоговые нетто-обязательства по денежным средствам или ценным бумагам, определенные в соответствующем Клиринговом пуле, до времени, установленного Временным регламентом на фондовом рынке и рынке депозитов.
- 37.3. Клиринговый центр исполняет Итоговые нетто-требования Участника клиринга, учитываемые по Расчетному коду / Торгово-клиринговому счету T+, в состав которого входит расчетный код, определенные в соответствующем Клиринговом пуле по Сделкам T+, при условии исполнения Участником клиринга своих Итоговых нетто-обязательств, учитываемых по такому Расчетному коду / Торгово-клиринговому счету T+, в состав которого входит такой Расчетный код, определенных в том же Клиринговом пуле по Сделкам T+, и/или наличия Обеспечения Участника клиринга, достаточного для прекращения таких Итоговых нетто-обязательств.
- 37.4. Клиринговый центр вправе устанавливать Ограничительные лимиты по Расчетному коду / Торгово-клиринговому счету T+ в размере Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам, учитываемого по Расчетному коду / Торгово-клиринговому счету T+, с момента определения Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований до момента исполнения Клиринговым центром Итоговых нетто-требований Участника клиринга.
- 37.5. В срок, установленный Временным регламентом на фондовом рынке и рынке депозитов, Клиринговый центр проводит расчетные клиринговые сессии, в ходе которых:
- проверяет наличие денежных средств / ценных бумаг, необходимых для исполнения Итоговых нетто-обязательств;
 - в случае недостаточности денежных средств / ценных бумаг и/или наличия у Участника клиринга Задолженности выполняет действия, предусмотренные Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов;
 - проводит исполнение (прекращение) Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований по денежным средствам / ценным бумагам;
 - проводит исполнение обязательств по возврату депозитов и проверяет достаточность денежных средств для заключения депозитных договоров;

- осуществляет взаимодействие с Расчетным депозитарием с целью проведения расчетов по ценным бумагам по итогам клиринга.

37.6. Для исполнения Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам, учитываемого по Расчетному коду / Торгово-клиринговому счету Т+, используется Обеспечение Участника клиринга в соответствующих денежных средствах / ценных бумагах, внесенное Участником клиринга в порядке, определенном статьей 22 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, учитываемое по тому же Расчетному коду / Торгово-клиринговому счету Т+. Обеспечение, учитываемое по другим Расчетным кодам / Торгово-клиринговым счетам этого же Участника клиринга, не используется, за исключением случая, установленного подпунктом 37.6.2 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

Для исполнения Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам, учитываемого по Расчетному коду имущественного пула / Торгово-клиринговому счету имущественного пула, используется имущество, внесенное в имущественный пул в порядке, определенном статьей 24 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, учитываемое по тому же Расчетному коду имущественного пула / Торгово-клиринговому счету имущественного пула. Имущество, учитываемое по другим Расчетным кодам имущественного пула / Торгово-клиринговым счетам имущественного пула этого же Участника клиринга, не используется.

Сумма денежных средств / количество ценных бумаг, внесенных Участником клиринга, является достаточной (-ым) для исполнения Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам, учитываемого по Расчетному коду / Торгово-клиринговому счету, если сумма денежных средств / количество ценных бумаг, учитываемое по тому же Расчетному коду / Торгово-клиринговому счету больше или равно величине указанного обязательства, и не достаточной (-ым) – если меньше.

37.6.1. Если для исполнения Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам, учитываемого по Расчетному коду / Торгово-клиринговому счету Т+, недостаточно денежных средств / ценных бумаг, и у Участника клиринга открыт Расчетный код, связанный со Счетом обеспечения Т0 / Торгово-клиринговый счет Т0, соответствующий / связанный с указанным Расчетным кодом / Торгово-клиринговым счетом Т+, Клиринговый центр вправе с момента определения Итоговых нетто-обязательств и Итоговых нетто-требований по денежным средствам / ценным бумагам Участников клиринга и до установленного Временным регламентом на фондовом рынке и рынке депозитов времени исполнения Участниками клиринга Итоговых нетто-обязательства по денежным средствам и ценным бумагам, сформировать в Клиринговой системе распоряжение на перевод денежных средств / ценных бумаг с целью их внесения в Обеспечение в сумме / количестве, недостающем для исполнения Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам, либо в размере Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам, в случае предоставления Участником клиринга Заявления о порядке использования денежных средств и ценных бумаг, предусмотренного пунктом 23.13 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов и содержащего соответствующее указание.

Указанное в настоящем подпункте Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов распоряжение на перевод денежных средств / ценных бумаг формируется при выполнении условий, указанных в подпункте 22.7.1 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

Указанное в настоящем подпункте Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов распоряжение на перевод денежных средств / ценных бумаг не формируется, в случае предоставления Участником клиринга Заявления о порядке использования денежных средств и ценных бумаг, предусмотренного пунктом 23.13 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов и содержащего указание не перечислять денежные средства / ценные бумаги со Счетов обеспечения Т0 на Счета обеспечения / с Разделов Т0 на Разделы Т+ при исполнении обязательств по Сделкам Т+.

- 37.6.2. Если по итогам действий, предусмотренных подпунктом 37.6.1 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, для исполнения Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам, учитываемого по Расчетному коду / Торгово-клиринговому счету Т+, недостаточно денежных средств / ценных бумаг, и при этом Участник клиринга является Участником пула и указанный Расчетный код входит в состав Торгово-клирингового счета Т+, которому соответствует Торгово-клиринговый счет имущественного пула / указанному Торгово-клиринговому счету Т+ соответствует Торгово-клиринговый счет имущественного пула, Клиринговый центр формирует в Клиринговой системе распоряжение на перевод соответствующих денежных средств / ценных бумаг с указанного Торгово-клирингового счета имущественного пула на соответствующий Торгово-клиринговый счет Т+ в сумме / количестве, недостающем для исполнения Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам.

Указанное в настоящем подпункте Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов распоряжение на перевод денежных средств / ценных бумаг формируется при выполнении условий, указанных в подпункте 22.7.1 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, а распоряжение на перевод денежных средств в российских рублях формируется также при выполнении условий погашения клиринговых сертификатов участия, указанных в пункте 26.7 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов для выдачи имущества из имущественного пула.

Одновременно с формированием распоряжения на перевод ценных бумаг или денежных средств в иностранной валюте, приводящего к нарушению условий погашения клиринговых сертификатов участия, указанных в пункте 26.7 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов для выдачи денежных средств из имущественного пула, Клиринговый центр формирует в Клиринговой системе распоряжение на перевод денежных средств в российских рублях с Расчетного кода, входящего в состав Торгово-клирингового счета Т+, на Расчетный код имущественного пула, входящий в состав Торгово-клирингового счета имущественного пула, в сумме, недостающей для выполнения условий погашения клиринговых сертификатов участия, указанных в пункте 26.7 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

Если денежных средств, учитываемых по Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета Т+, недостаточно для исполнения указанного

перевода, недостающая сумма денежных средств учитывается как Задолженность Участника пула перед Клиринговым центром по такому Расчетному коду.

Указанная Задолженность Участника пула урегулируется в порядке, установленном статьей 38 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

- 37.6.3. Если по итогам действий, предусмотренных подпунктами 37.6.1-37.6.2 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, для исполнения Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам и/или ценным бумагам недостаточно денежных средств / ценных бумаг, данный Участник клиринга признается Недобросовестным участником клиринга, и Клиринговый центр выполняет действия, предусмотренные статьей 38 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.
- 37.7. Исполнение обязательств по возврату депозитов с наступившей Датой исполнения и проверка достаточности денежных средств для заключения депозитного договора осуществляются в ходе третьей расчетной клиринговой сессии.
- 37.8. Заключение депозитных договоров осуществляется за счет Обеспечения, внесенного до начала третьей расчетной клиринговой сессии, или за счет Обеспечения, полученного Участником клиринга в результате исполнения Клиринговым центром обязательств по возврату Участнику клиринга депозитов с наступившей Датой исполнения, в порядке возрастания плановой даты заключения депозитного договора, а для заявок на заключение депозитных договоров с одинаковой плановой датой заключения депозитных договоров – в порядке возрастания даты и времени внесения заявки на заключение депозитного договора в реестр предложений.
- 37.9. Обязательство Клирингового центра по возврату Участнику клиринга депозита с наступившей Датой исполнения включает в себя обязательство по возврату суммы депозита, на которую был заключен депозитный договор, и суммы процентов, рассчитанной в соответствии с условиями заключенного депозитного договора. Датой исполнения обязательств Клирингового центра по возврату Участнику клиринга депозита является дата возврата депозита, определенная в соответствии с Правилами торгов на фондовом рынке и рынке депозитов.
- 37.10. Обязательство Клирингового центра по возврату Участнику клиринга депозита в российских рублях, учитываемое по Расчетному коду Участника клиринга, прекращается возникновением обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга Обеспечения в российских рублях, учитываемого по тому же Расчетному коду. При этом размер Обеспечения Участника клиринга в российских рублях, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, увеличивается на размер обязательства по возврату депозита.
- 37.11. Проверка достаточности денежных средств для заключения депозитного договора осуществляется в плановую дату заключения депозитного договора в соответствии с кодом расчетов, указанным в заявке на заключение депозитного договора, внесенной в реестр предложений, и в Расчетный день, следующий за указанной датой, в случае недостаточности в плановую дату заключения депозитного договора денежных средств для заключения депозитного договора в сумме депозита, указанной в заявке на заключение депозитного договора, внесенной в реестр предложений.

37.11.1. Сумма денежных средств Участника клиринга является достаточной для заключения депозитного договора, если сумма Обеспечения в денежных средствах, учитываемая по Расчетному коду (с учетом исполнения Клиринговым центром обязательств по возврату Участнику клиринга депозитов с наступившей Датой исполнения) больше или равна сумме депозита, указанной в заявке на заключение депозитного договора, внесенной в реестр предложений, поданной с указанием Торгово-клирингового счета, в состав которого входит такой Расчетный код, и не достаточной – если меньше.

37.11.2. Депозитный договор заключается за счет денежных средств, учитываемых в качестве Обеспечения по Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в заявке на заключение депозитного договора, внесенной в реестр предложений, на максимальную сумму, не превышающую одновременно сумму депозита, указанную в заявке на заключение депозитного договора, внесенной в реестр предложений, и сумму Обеспечения в денежных средствах, учитываемую по соответствующему Расчетному коду, учитывающую уменьшение на сумму исполненных в текущую дату обязательств по уплате оборотных частей комиссионных вознаграждений по депозитным договорам.

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

37.11.3. Депозитный договор на сумму, равную разности суммы депозита, указанной в заявке на заключение депозитного договора, внесенной в реестр предложений, и суммы депозитных договоров, заключенных на основании такой заявки, может быть заключен в следующий Расчетный день (за исключением депозитных договоров с кодом расчетов Y0/Y1).

За обеспечение возможности заключения депозитного договора в следующий Расчетный день Клиринговый центр взимает с Участника клиринга комиссионное вознаграждение, установленное Тарифами Клирингового центра на фондовом рынке и рынке депозитов. Указанное комиссионное вознаграждение учитывается по Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в заявке на заключение депозитного договора, внесенной в реестр предложений.

Порядок действий Клирингового центра в случае непредоставления Участником клиринга Обеспечения в сумме депозита, указанной в заявке на заключение депозитного договора, внесенной в реестр предложений, в плановую дату заключения депозитного договора (для депозитных договоров с кодом расчетов Y0/Y1) или в следующий Расчетный день (для иных депозитных договоров) определен в статье 38 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

37.11.4. После заключения депозитного договора Клиринговый центр:

- рассчитывает Единый лимит по соответствующему Расчетному коду без учета заявки (части заявки) на заключение депозитного договора, внесенной в реестр предложений;
- изменяет с учетом заключенного депозитного договора Нетто-обязательство и/или Нетто-требование Участника клиринга по Сделкам Т+ в российских рублях с Датой исполнения, соответствующими дате заключения депозитного договора и дате возврата депозита, по соответствующему Расчетному коду;
- допускает к клирингу обязательства по заключенному депозитному договору;

- включает в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов третьей расчетной клиринговой сессии обязательства по внесению депозитов.
- 37.12. По Итоговым нетто-обязательствам Участников клиринга по денежным средствам / ценным бумагам, для исполнения которых достаточно денежных средств / ценных бумаг, и по соответствующим им Итоговым нетто-требованиям Участников клиринга по денежным средствам / ценным бумагам, в том числе определенным по итогам выполнения действий, предусмотренных статьей 38 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, обязательствам по возврату депозитов с наступившей Датой исполнения, а также обязательствам по внесению депозитов по заключенным депозитным договорам Клиринговый центр изменяет суммы денежных средств / количества ценных бумаг Участников клиринга, учитываемых по соответствующим Расчетным кодам / Торгово-клиринговым счетам.
- 37.12.1. В случае если Участником клиринга предоставлено Заявление о порядке использования денежных средств и ценных бумаг, в соответствии с которым Участник клиринга дает указание Клиринговому центру перечислять денежные средства / ценные бумаги со Счетов обеспечения / Разделов T+ на Счета обеспечения T0 / Разделы T0 после прекращения обязательств по Сделкам T+, Клиринговый центр изменяет суммы денежных средств / количества ценным бумагам, учитываемых по Расчетным кодам / Торгово-клиринговым счетам T+ / Торгово-клиринговым счетам T0 в соответствии с Заявлением о порядке использования денежных средств и ценных бумаг.
- Порядок предоставления и исполнения Заявления о порядке использования денежных средств и ценных бумаг определен в статье 22 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.
- 37.13. Итоговые нетто-обязательства / Итоговые нетто-требования Участников клиринга по денежным средствам / ценным бумагам, в том числе определенные по итогам выполнения действий, предусмотренных статьей 38 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, Клиринговый центр включает в ближайший Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов и исполняет (прекращает) их в порядке, определенном статьей 43 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

ПОДРАЗДЕЛ V-V. ПОРЯДОК ДЕЙСТВИЙ В СЛУЧАЯХ НЕИСПОЛНЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ

Статья 38. Порядок действий в случае неисполнения (ненадлежащего исполнения) обязательств по Сделкам Т+ и/или наличия Задолженности

38.1. В случае если для исполнения Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по ценным бумагам (за исключением клиринговых сертификатов участия), определенного в соответствующем Клиринговом пуле по Сделкам Т+, недостаточно ценных бумаг, Клиринговый центр осуществляет действия в следующей последовательности (каждое последующее действие выполняется в случае, если предыдущее действие не привело к исполнению соответствующего обязательства):

- 1) направляет Расчетному депозитарию Запрос на подбор ценных бумаг с указанием кода и количества ценных бумаг, соответствующих не обеспеченному средствами под исполнение Итоговому нетто-обязательству Участника клиринга по ценным бумагам, и Раздела Т+, входящего в состав Торгово-клирингового счета Т+, по которому учитывается указанное обязательство (только для Участников клиринга, соответствующих требованиям, установленным общей частью Правил клиринга);
- 2) без подачи заявок заключает с Недобросовестным участником клиринга сделку РЕПО или сделки / сделку купли-продажи ценных бумаг в соответствии со статьей 41 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

38.2. В случае если для исполнения Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по ценной бумаге клиринговый сертификат участия, определенного в соответствующем Клиринговом пуле, недостаточно ценных бумаг, Клиринговый центр осуществляет действия в следующей последовательности (каждое последующее действие выполняется в случае, если предыдущее действие не привело к исполнению соответствующего обязательства):

- 1) направляет Расчетному депозитарию Запрос на подбор ценных бумаг с указанием суммы, соответствующей количеству клиринговых сертификатов участия в не обеспеченном средствами под исполнение Итоговом нетто-обязательстве Участника клиринга по ценной бумаге, и субсчетов депо имущественного пула, входящих в состав Торгово-клирингового счета имущественного пула, соответствующего Торгово-клиринговому счету Т+, по которому учитывается указанное Итоговое нетто-обязательство (только для Участников клиринга, соответствующих требованиям, установленным общей частью Правил клиринга);
- 2) направляет в Банк России инкассовое поручение на безакцептное списание российских рублей в сумме, соответствующей количеству клиринговых сертификатов участия в не обеспеченном средствами под исполнение Итоговом нетто-обязательстве Участника клиринга по ценной бумаге, с корреспондентского счета Участника клиринга – кредитной организации в Банке России с зачислением на клиринговый банковский счет Клирингового центра, открытый в Расчетной организации и предназначенный для внесения имущества в имущественный пул (только для Участников клиринга,

соответствующих требованиям, установленным общей частью Правил клиринга);

- 3) формирует в Клиринговой системе распоряжение на перевод денежных средств в российских рублях с Торгово-клирингового счета Т+, по которому учитывается не обеспеченное средствами под исполнение Итоговое нетто-обязательство по ценной бумаге клиринговый сертификат участия, на Торгово-клиринговый счет имущественного пула, соответствующий указанному Торгово-клиринговому счету Т+, в сумме, соответствующей номинальной стоимости клиринговых сертификатов участия, недостающих для исполнения Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по ценной бумаге.

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

Указанная Задолженность Участника пула урегулируется в порядке, установленном настоящей статьей Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

- 38.3. В случае если у Участника клиринга имеется Итоговое нетто-требование в ценных бумагах, не принимаемых в качестве обеспечения исполнения обязательств по Сделкам Т+, учитываемое по Торгово-клиринговому счету Т+, и в результате исполнения (прекращения) указанных обязательств и требований Единый лимит по Расчетному коду, входящий в состав такого Торгово-клирингового счета Т+, станет отрицательным, Клиринговый центр без подачи заявок заключает с Недобросовестным участником клиринга сделку РЕПО или сделки / сделку купли-продажи ценных бумаг в соответствии со статьей 41 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.
- 38.4. В случае если для исполнения Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам в российских рублях или иностранной валюте, учитываемого по Расчетному коду, недостаточно денежных средств в соответствующей валюте, указанное Итоговое нетто-обязательство (или его часть) учитывается как Задолженность Участника клиринга перед Клиринговым центром в соответствующей валюте по такому Расчетному коду.
- 38.4.1. Задолженность Участника клиринга, возникшая по итогам первой расчетной клиринговой сессии, может быть погашена путем внесения Обеспечения в соответствующей валюте в порядке, установленном статьей 22 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, или в результате зачета с Итоговым нетто-требованием в соответствующей валюте, определенным в ходе второй расчетной клиринговой сессии.
- 38.4.2. Задолженность Участника клиринга, возникшая по итогам второй расчетной клиринговой сессии, может быть погашена путем внесения Обеспечения в соответствующей валюте в порядке, установленном статьей 22 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.
- 38.4.3. Задолженность Участника клиринга в соответствующей валюте считается погашенной, если значение Обеспечения в такой валюте, учитываемого по

- Расчетному коду Участника клиринга, по которому учитывалась Задолженность, станет неотрицательным.
- 38.5. В случае наличия у Участника клиринга Задолженности в российских рублях на момент начала третьей расчетной клиринговой сессии Клиринговый центр осуществляет действия в следующей последовательности (каждое последующее действие выполняется в случае, если предыдущее действие не привело к исполнению соответствующего обязательства):
- 1) направляет в Банк России инкассовое поручение на безакцептное списание российских рублей в сумме Задолженности Участника клиринга с корреспондентского счета Участника клиринга – кредитной организации в Банке России с зачислением на клиринговый банковский счет Клирингового центра (только для Участников клиринга, соответствующих требованиям, установленным общей частью Правил клиринга);
 - 2) без подачи заявок заключает с Недобросовестным участником клиринга сделку своп или сделку купли-продажи иностранной валюты в соответствии со статьей 40 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов;
 - 3) без подачи заявок заключает с Недобросовестным участником клиринга сделку РЕПО или сделки / сделку купли-продажи ценных бумаг в соответствии со статьей 41 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.
- 38.6. В случаях наличия у Участника клиринга Задолженности в иностранной валюте на момент начала третьей расчетной клиринговой сессии Клиринговый центр без подачи заявок заключает с Недобросовестным участником клиринга сделку своп или сделку купли-продажи иностранной валюты в соответствии со статьей 40 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.
- 38.7. Расчетный депозитарий исполняет Запрос Клирингового центра на подбор ценных бумаг в соответствии с пунктами 25.6-25.7 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.
- 38.8. Распоряжения на перевод ценных бумаг / денежных средств между Торгово-клиринговым счетом имущественного пула и Торгово-клиринговым счетом Т+ исполняются в соответствии с пунктом 22.7 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.
- 38.9. Российские рубли, зачисленные на клиринговый банковский счет Клирингового центра, предназначенный для внесения индивидуального клирингового обеспечения, в результате исполнения Банком России инкассового поручения на безакцептное списание российских рублей с корреспондентского счета Участника пула – кредитной организации в Банке России, учитываются в качестве Обеспечения Участника клиринга по соответствующему Расчетному коду и используются для погашения Задолженности в российских рублях, учитываемой по такому Расчетному коду.
- 38.10. Ценные бумаги, зачисленные на Раздел Т+ по итогам исполнения Расчетным депозитарием Запроса Клирингового центра на подбор ценных бумаг, или распоряжения на перевод ценных бумаг с Торгово-клирингового счета имущественного пула на Торгово-клиринговый счет Т+, учитываются в качестве

Обеспечения Участника клиринга по соответствующему Торгово-клиринговому счету Т+ и используются для исполнения Итогового нетто-обязательства по ценным бумагам, учитываемого по такому Торгово-клиринговому счету Т+.

38.11. Ценные бумаги, зачисленные на субсчет депо имущественного пула по итогам исполнения Расчетным депозитарием Запроса Клирингового центра на подбор ценных бумаг, российские рубли, зачисленные на клиринговый банковский счет Клирингового центра, предназначенный для внесения имущества в имущественный пул, в результате исполнения Банком России инкассового поручения на безакцептное списание российских рублей с корреспондентского счета Участника пула – кредитной организации в Банке России, и/или распоряжения на перевод денежных средств с Торгово-клирингового счета Т+ на Торгово-клиринговый счет имущественного пула, вносятся в соответствующий имущественный пул. На имущество, внесенное в соответствующий имущественный пул, Клиринговый центр выдает клиринговые сертификаты участия в соответствии с пунктами 24.9-24.11 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов. Выданные клиринговые сертификаты участия используются для исполнения Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по ценной бумаге клиринговый сертификат участия.

38.12. При превышении количества Расчетных дней, в течение которых у Участника клиринга может возникать Итоговое нетто-обязательство по денежным средствам / ценным бумагам, для исполнения которого недостаточно денежных средств / ценных бумаг, по одному Расчетному коду / Торгово-клиринговому счету с Участника клиринга взимается штраф, рассчитываемый по формуле:

$Penalty = ROUND (VAL_OBL \times C \times K \times R / 365; 2)$, где

Penalty – сумма штрафа, в российских рублях,

VAL_OBL –Итоговое нетто-обязательство по ценным бумагам / денежным средствам, для исполнения которого не достаточно денежных средств / ценных бумаг,

C – Центральный курс иностранной валюты, определенный в соответствии с Методикой риск-параметров валютного рынка и рынка драгоценных металлов / Расчетная цена ценной бумаги / C=1 для Итогового нетто-обязательства в российских рублях;

K – коэффициент, установленный решением Клирингового центра; по умолчанию K=5;

R – штрафная ставка, равная ставке РЕПО, применяемой для случаев урегулирования обязательств по Сделкам Т+, для исполнения которых недостаточно денежных средств / ценных бумаг, установленная Клиринговым центром в соответствии с Методикой определения риск-параметров фондового рынка и рынка депозитов, или ставке, установленной Клиринговым центром в соответствии с Методикой определения риск-параметров валютного рынка и рынка драгоценных металлов.

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

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

Расчетному коду, порядок определения которого установлен пунктом 48.3 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

Если денежных средств, учитываемых по такому Расчетному коду, недостаточно для исполнения обязательства по уплате штрафа, недостающая сумма денежных средств учитывается как Задолженность Участника клиринга перед Клиринговым центром по такому Расчетному коду.

Указанная Задолженность Участника клиринга урегулируется в порядке, установленном настоящей статьей Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

38.12.1. Клиринговый центр зачитывает обязательство Участника клиринга по уплате штрафа, учитываемое по Расчетному коду, сумма которого рассчитана в соответствии с пунктом 38.12 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, с требованием Участника клиринга по возврату Обеспечения в российских рублях, учитываемого по тому же Расчетному коду, за исключением случаев введения в отношении Участника клиринга одной из процедур банкротства, а в отношении Участника клиринга – кредитной организации - отзыва (аннулирования) у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций.

38.13. Участник клиринга обязан уплатить Клиринговому центру пеню за наличие Задолженности, учитываемой по итогам третьей расчетной клиринговой сессии, рассчитываемую по формуле:

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

Fine – сумма пени, в российских рублях,

D – сумма Задолженности, в российских рублях,

S – ставка РЕПО, применяемая для случаев урегулирования обязательств по Сделкам T+, не обеспеченных средствами под исполнение, установленная Клиринговым центром в соответствии с Методикой определения риск-параметров фондового рынка и рынка депозитов;

n - количество календарных дней между датой расчета суммы пени и следующим Расчетным днем,

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

Обязательство по уплате пени, рассчитанное в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, учитывается по тому же Расчетному коду, что и Задолженность.

Если денежных средств, учитываемых по такому Расчетному коду, недостаточно для исполнения обязательства по уплате пени, недостающая сумма денежных средств учитывается как Задолженность Участника клиринга перед Клиринговым центром по такому Расчетному коду.

Указанная Задолженность Участника клиринга урегулируется в порядке, установленном настоящей статьей Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

38.13.1. Указанная Задолженность Участника клиринга, у которого отсутствует Маржинальное требование, учитываемое по тому же Расчетному коду и не исполненное в срок, установленный Правилами клиринга на фондовом рынке и

рынке депозитов, должна быть погашена не позднее времени, установленного Временным регламентом на фондовом рынке и рынке депозитов.

Информация о наличии у Участника клиринга Задолженности и ее размере передается Участнику клиринга в составе отчета «Требование о погашении задолженности».

- 38.14. Если Задолженность Участника клиринга не погашена полностью по итогам действий, выполненных в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, и/или Участником клиринга в срок, установленный Временным регламентом на фондовом рынке и рынке депозитов, Клиринговый центр использует Обеспечение Участника клиринга, учитываемое по иным Расчетным кодам в соответствии с Правилами клиринга, а также средства Гарантийных фондов и/или Обеспечение под стресс в порядке, определенном общей частью Правил клиринга (начинает процедуру кросс-дефолта в отношении Участника клиринга) в следующих случаях:
- 38.14.1. Если у Участника клиринга по такому Расчетному коду учитывается Маржинальное требование, не исполненное в срок, установленный Правилами клиринга, или
- 38.14.2. Если Участник клиринга, у которого отсутствует Маржинальное требование по Расчетному коду, не исполненное в срок, установленный Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, не погасил Задолженность, учитываемую по такому Расчетному коду, в срок, установленный Временным регламентом на фондовом рынке и рынке депозитов.
- 38.15. При наличии Недобросовестных участников клиринга, имеющих Итоговые нетто-обязательства по денежным средствам / ценным бумагам, для исполнения которых недостаточно денежных средств / ценных бумаг, для исполнения Итоговых нетто-требований по денежным средствам / ценным бумагам Добросовестных участников клиринга Клиринговый центр выполняет действия в следующей последовательности:
- 38.15.1. использует свободные собственные денежные средства и/или собственные ценные бумаги;
- 38.15.2. в случае недостаточности свободных собственных ценных бумаг заключает Сделки РЕПО Клирингового центра в соответствии со статьей 46 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов;
- 38.15.3. в случае невозможности заключения Сделок РЕПО Клирингового центра в соответствии со статьей 46 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов без подачи заявок заключает сделки РЕПО и/или две сделки / сделку купли-продажи ценных бумаг с Добросовестными участниками клиринга в соответствии со статьей 42 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.
- 38.16. После заключения с Участниками клиринга сделок, указанных в настоящей статье Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, Клиринговый центр включает обязательства по указанным сделкам с наступившей Датой исполнения в соответствующий Клиринговый пул по Сделкам T+ и зачитывает встречные однородные Итоговые нетто-обязательства / Итоговые нетто-требования по денежным средствам и ценным бумагам и/или Задолженности Участника клиринга

с обязательствами и требованиями по указанным заключенным сделкам с наступившей Датой исполнения.

В результате такого зачета Итоговые нетто-обязательства / Итоговые нетто-требования Участников клиринга по ценным бумагам прекращаются (становятся равными нулю), у Участника клиринга может учитываться новое Итоговое нетто-обязательство / Итоговое нетто-требование по денежным средствам, значение которого отлично от нуля.

Прекращение указанного Итогового нетто-обязательства / Итогового нетто-требования Участника клиринга по денежным средствам осуществляется в порядке, определенном статьей 43 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

38.16.1. Обязательства и требования по вторым частям сделок РЕПО (вторым сделкам купли-продажи) / вторым частям сделок своп, вторым частям Сделок РЕПО Клирингового центра, заключенным с Участниками клиринга, учитываются в составе Нетто-обязательств / Нетто-требований Участника клиринга по Сделкам Т+ с Датой исполнения, соответствующей дате исполнения указанных обязательств и требований.

38.17. В случае непредоставления Обеспечения в сумме депозита, указанной в заявке на заключение депозитного договора, внесенной в реестр предложений, в плановую дату заключения депозитного договора в соответствии с кодом расчетов, указанным в заявке на заключение депозитного договора, внесенной в реестр предложений, и в Расчетный день, следующий за указанной датой (для всех депозитных договоров, за исключением депозитных договоров с кодом расчетов Y0/Y1), Клиринговый центр заключает балансирующие сделки РЕПО на основании пункта 3.18 общей части Правил клиринга.

38.18. В случае непредоставления Обеспечения в сумме депозита, указанной в заявке на заключение депозитного договора, внесенной в реестр предложений, в плановую дату заключения депозитного договора в соответствии с кодом расчетов, указанным в заявке на заключение депозитного договора, внесенной в реестр предложений, и в Расчетный день, следующий за указанной датой (для всех депозитных договоров, за исключением депозитных договоров с кодом расчетов Y0/Y1), Участник клиринга обязан уплатить Клиринговому центру отступное, сумма которого рассчитывается не позднее второго Расчетного дня, следующего за указанной датой, по формуле:

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

Penalty – сумма отступного, в российских рублях,

VAL_OBL – сумма, равная разности суммы депозита, указанной в заявке на заключение депозитного договора, внесенной в реестр предложений, для заключения которого не достаточно денежных средств, и сумме депозитных договоров, заключенных на основании такой заявки в плановую дату заключения депозитного договора, или в Расчетный день, следующий за указанной датой.

S – срок депозитного договора, указанный в заявке на заключение депозитного договора, внесенной в реестр предложений, уменьшенный на количество календарных дней между плановой датой заключения депозитного договора (включая эту дату) и следующим Расчетным днем (не включая эту дату);

R1 – ставка отступного, равная ставке РЕПО, применяемой для случаев урегулирования обязательств по Сделкам T+, для исполнения которых недостаточно денежных средств в российских рублях, установленная Клиринговым центром в соответствии с Методикой определения риск-параметров фондового рынка и рынка депозитов;

R2 - ставка РЕПО / процентная ставка в балансирующей сделке, заключенной в соответствии с пунктом 38.17 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов;

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

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

Обязательство по уплате отступного, рассчитанное в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, учитывается по Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в заявке на заключение такого депозитного договора.

Датой исполнения обязательства Участника клиринга по уплате отступного является второй Расчетный день, следующий за плановой датой заключения депозитного договора в соответствии с кодом расчетов, указанным в заявке на заключение депозитного договора, внесенной в реестр предложений.

Если денежных средств, учитываемых по такому Расчетному коду, недостаточно для исполнения обязательства по уплате отступного, недостающая сумма денежных средств учитывается как Задолженность Участника клиринга перед Клиринговым центром по такому Расчетному коду.

Указанная Задолженность Участника клиринга урегулируется в порядке, установленном настоящей статьей Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

Статья 39. Порядок выкупа клиринговых сертификатов участия у Банка России

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

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

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

В случае отзыва (аннулирования) Банком России у клиента Участника клиринга – Кредитной организации лицензии на осуществление банковских операций,

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

Уведомление о выкупе клиринговых сертификатов участия, содержащее информацию, предусмотренную пунктом 39.1 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, должно быть направлено Банком России Клиринговому центру в дату отзыва (аннулирования) Банком России у Участника клиринга / клиента Участника клиринга, являющегося Кредитной организацией, лицензии на осуществление банковских операций.

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

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

- 39.4. В случае недостаточности у Клирингового центра свободных собственных денежных средств для выкупа клиринговых сертификатов участия у Банка России, Клиринговый центр заключает сделки своп с Уполномоченными участниками клиринга в соответствии с Правилами клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.

- 39.5. С даты заключения договора об имущественном пуле в случае выкупа Клиринговым центром у Банка России клиринговых сертификатов участия, переданных таким Участником клиринга / клиентом Участника клиринга Банку России по первой части договора репо, у Участника клиринга возникает обязательство перед Клиринговым центром уплатить денежные средства в сумме, равной номинальной стоимости клиринговых сертификатов участия, в отношении которых Участником клиринга / клиентом Участника клиринга не были исполнены обязательства перед Банком России по второй части договора репо и требование к Клиринговому центру по получению клиринговых сертификатов участия в количестве, равном полученному Клиринговым центром от Банка России.

- 39.5.1. В случае отзыва (аннулирования) Банком России у Участника клиринга – Кредитной организации лицензии на осуществление банковских операций срок исполнения обязательства по уплате денежных средств Клиринговому центру в сумме, равной номинальной стоимости клиринговых сертификатов участия, в отношении которых Участником клиринга не были исполнены обязательства перед Банком России по второй части договора репо, и срок исполнения требования к Клиринговому центру по получению клиринговых сертификатов участия в количестве, равном полученному Клиринговым центром от Банка России, считаются наступившими в дату, предшествующую дате отзыва (аннулирования)

- Банком России у Участника клиринга – Кредитной организации лицензии на осуществление банковских операций.
- 39.5.2. В случае отзыва (аннулирования) Банком России у клиента Участника клиринга, являющегося Кредитной организацией, лицензии на осуществление банковских операций и проведения вследствие этого Клиринговым центром ликвидационного неттинга в отношении такого клиента Участника клиринга в порядке, предусмотренном общей частью Правил клиринга, срок исполнения обязательства Участника клиринга по уплате денежных средств Клиринговому центру в сумме, равной номинальной стоимости клиринговых сертификатов участия, в отношении которых клиентом Участника клиринга не были исполнены обязательства перед Банком России по второй части договора репо, и срок исполнения требования к Клиринговому центру по получению клиринговых сертификатов участия в количестве, равном полученному Клиринговым центром от Банка России, считаются наступившими в дату, предшествующую дате отзыва (аннулирования) Банком России у клиента Участника клиринга, являющегося Кредитной организацией, лицензии на осуществление банковских операций.
- 39.6. Датой исполнения обязательства Участника клиринга уплатить Клиринговому центру денежные средства в сумме, равной номинальной стоимости клиринговых сертификатов участия, в отношении которых Участником клиринга / клиентом Участника клиринга не были исполнены обязательства перед Банком России по второй части договора репо, и Датой исполнения требования Участника клиринга к Клиринговому центру по получению клиринговых сертификатов участия в количестве, равном полученному Клиринговым центром от Банка России, является дата исполнения Клиринговым центром обязательства по выкупу клиринговых сертификатов участия у Банка России, за исключением случаев, установленных подпунктами 39.5.1-39.5.2 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.
- 39.6.1. Указанные обязательства и требования Участника клиринга, возникшие в связи с неисполнением Участником клиринга обязательств перед Банком России по второй части договора репо, учитываются по собственному Расчетному коду и по Торгово-клиринговому счету Т+ Участника клиринга, в состав которого входит такой собственный Расчетный код и который соответствует Торгово-клиринговому счету имущественного пула. Выбор Расчетного кода и Торгово-клирингового счета Т+ из нескольких Торгово-клиринговых счетов Т+, отвечающих указанным условиям, осуществляется Клиринговым центром.
- 39.6.2. Указанные обязательства и требования Участника клиринга, возникшие в связи с неисполнением клиентом Участника клиринга обязательств перед Банком России по второй части договора репо, при проведении ликвидационного неттинга в отношении клиента Участника клиринга учитываются по клиентскому Расчетному коду и по Торгово-клиринговому счету Т+ Участника клиринга, указанным Участником клиринга в Заявлении о проведении ликвидационного неттинга в отношении клиента Участника клиринга.
- 39.6.3. Указанные обязательства и требования Участника клиринга, возникшие в связи с неисполнением клиентом Участника клиринга обязательств перед Банком России по второй части договора репо, в случае если Участник клиринга не представил Клиринговому центру Заявление о проведении ликвидационного неттинга в отношении клиента Участника клиринга в порядке, предусмотренном общей частью Правил клиринга, или в случае непринятия Клиринговым центром данного

заявления к исполнению, учитываются по клиентскому Расчетному коду и по Торгово-клиринговому счету Т+ Участника клиринга, указанным Участником клиринга Клиринговому центру. В случае непредоставления Участником клиринга указанной информации в течение 1 (одного) Расчетного дня с даты предъявления Банком России требования о выкупе клиринговых сертификатов участия клиента Участника клиринга, указанные обязательства и требования Участника клиринга учитываются по собственному Расчетному коду и по Торгово-клиринговому счету Т+ Участника клиринга, в состав которого входит такой собственный Расчетный код и который соответствует Торгово-клиринговому счету имущественного пула.

- 39.6.4. Клиринговый центр допускает к клирингу указанные обязательства и требования Участника клиринга и Клирингового центра.
- 39.6.5. Исполнение указанных обязательств, а также их урегулирование в случае неисполнения осуществляется в стандартном порядке, определенном статьями 37-38 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

Статья 40. Порядок заключения и условия сделок своп / сделки купли-продажи иностранной валюты, заключаемых с Недобросовестными участниками клиринга

- 40.1. Сделки своп с иностранной валютой, указанные в пунктах 38.5, 38.6 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, заключаются при соблюдении следующих условий:
- 40.1.1. у Участника клиринга не отозвана (не аннулирована) лицензия Банка России на осуществление банковских операций со средствами в рублях и иностранной валюте;
- 40.1.2. у Участника клиринга – Банка-нерезидента не отозвано (не аннулировано) специальное разрешение (лицензия или иное основание) компетентного органа государства учреждения Банка-нерезидента, в соответствии с которым Банк-нерезидент имеет право осуществлять банковские операции;
- 40.1.3. допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию на фондовом рынке и рынке депозитов не приостановлен;
- 40.1.4. у Клирингового центра отсутствует информация об обстоятельствах в отношении Участника клиринга, перечисленных в общей части Правил клиринга, при наступлении которых допуск к клиринговому обслуживанию Участника клиринга будет приостановлен в следующий Расчетный день;
- 40.1.5. количество Расчетных дней, в течение которых у Участника клиринга возникает Задолженность в соответствующей валюте по одному Расчетному коду, не превышает 2 (двух) Расчетных дней подряд.
- 40.2. Условие, указанное в подпункте 40.1.5 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, не применяется, если причиной непогашения Задолженности является несвоевременное зачисление денежных средств на клиринговый банковский или корреспондентский счет Клирингового центра, вызванное проведением процедур комплаенс-контроля в банках-корреспондентах, сбоями в работе платежных систем, а также обстоятельствами непреодолимой силы, определенными в пункте 40.5 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

Участник клиринга обязан предоставить Клиринговому центру документы, подтверждающие действие причин, указанных в настоящем пункте Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

40.3. Условия сделок своп с иностранной валютой, заключаемых Клиринговым центром от имени Недобросовестного участника клиринга в отношении себя лично в случаях, установленных пунктами 38.5, 38.6 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, соответствуют определенным Правилами торгов на валютном рынке условиям сделок своп с учетом следующих особенностей:

40.3.1. в случае наличия у Участника клиринга Задолженности в российских рублях, учитываемой по Расчетному коду Участника клиринга, по первой части сделки своп у Участника клиринга возникают требования в российских рублях и обязательства в иностранной валюте в объеме, соответствующем размеру Задолженности в российских рублях и кратном лоту, установленному Биржей, с округлением в большую сторону, а также не превышающем суммы Обеспечения Участника клиринга в такой иностранной валюте, учитываемого по тому же Расчетному коду Участника клиринга ;

40.3.2. в случае наличия у Участника клиринга Задолженности в иностранной валюте, учитываемой по Расчетному коду Участника клиринга, по первой части сделки своп у Участника клиринга возникают требования в иностранной валюте в объеме, равном размеру Задолженности в иностранной валюте, и обязательства в другой валюте, в том числе в российских рублях, в объеме, соответствующем размеру Задолженности в иностранной валюте и кратном лоту, установленному Биржей, с округлением в большую сторону, а также не превышающем суммы Обеспечения Участника клиринга в такой другой валюте, учитываемого по тому же Расчетному коду Участника клиринга;

40.3.3. Датой исполнения обязательств по первой части сделке своп является день ее заключения;

40.3.4. Датой исполнения обязательств по второй части сделки своп является Расчетный день, следующий за датой заключения сделки своп;

40.3.5. Базовый курс сделки своп устанавливается равным Центральному курсу, определенному в соответствии с Правилами клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов в 19:00 по московскому времени текущего Торгового дня.

40.3.6. Цена сделки своп рассчитывается по следующей формуле:

$$\text{Swap_Price} = K \times R_{c_RUB_VAL} \times S \times n / 365, \text{ где}$$

Swap_Price – цена сделки своп,

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

R_{c_RUB_VAL} – Центральный курс сделок купли-продажи иностранной валюты / драгоценного металла VAL за российские рубли, рассчитанный в соответствии с Правилами клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов в 19:00 по московскому времени текущего Торгового дня,

VAL – валюта лота сделки своп,

S – ставка, установленная Клиринговым центром в соответствии с Методикой определения риск-параметров валютного рынка и рынка драгоценных металлов,
n – количество календарных дней между датой исполнения первой и второй части сделки своп.

40.4. При несоблюдении любого из условий, указанных в подпунктах 40.1.3-40.1.5 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, Клиринговый центр от имени Недобросовестного участника клиринга в отношении себя лично заключает закрывающую сделку купли-продажи иностранной валюты, условия которой соответствуют определенным Правилами торгов на валютном рынке условиям сделок своп с учетом следующих особенностей:

40.4.1. в случае наличия у Участника клиринга Задолженности в российских рублях, учитываемой по Расчетному коду Участника клиринга, у Участника клиринга возникают требования в российских рублях и обязательства в иностранной валюте в объеме, соответствующем размеру Задолженности в российских рублях и не превышающем суммы Обеспечения Участника клиринга в такой иностранной валюте, учитываемого по тому же Расчетному коду Участника клиринга;

40.4.2. в случае наличия у Участника клиринга Задолженности в иностранной валюте, учитываемой по Расчетному коду Участника клиринга, у Участника клиринга возникают требования в иностранной валюте в объеме, равном размеру Задолженности в иностранной валюте, и обязательства в другой валюте, в том числе в российских рублях, в объеме, соответствующем размеру Задолженности в иностранной валюте и не превышающем суммы Обеспечения Участника клиринга в такой другой валюте, учитываемого по тому же Расчетному коду Участника клиринга;

40.4.3. Датой исполнения обязательств по сделке является день ее заключения;

40.4.4. цена сделки устанавливается равной цене балансирующей сделки с соответствующей иностранной валютой, порядок заключения которой определен общей частью Правил клиринга.

40.5. В случае непогашения Участником клиринга Задолженности вследствие непреодолимой силы или сбоя в платежной системе Банка России / иных платежных системах, сделки своп с иностранной валютой, заключаемые Клиринговым центром с Недобросовестным участником клиринга в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, заключаются с ценой сделки своп, равной нулю.

Под обстоятельствами непреодолимой силы понимаются:

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

О возникновении обстоятельств непреодолимой силы, вследствие которых погашение Участником клиринга своей Задолженности невозможно, Участник клиринга обязан уведомить Клиринговый центр любыми доступными средствами связи до установленного Временным регламентом на фондовом рынке и рынке депозитов времени погашения Задолженности.

Участник клиринга обязан предоставить Клиринговому центру документы, подтверждающие обстоятельства непреодолимой силы в течение 7 (семи) дней. В случае непредоставления Участником клиринга Клиринговому центру таких документов в указанный срок с Участника клиринга по решению Клирингового центра взыскивается неустойка по цене сделки своп, определенной в соответствии с подпунктом 40.3.6 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, в расчете на количество календарных дней между датой исполнения первой части сделки своп и датой расчета неустойки.

- 40.6. Клиринговый центр вправе принять решение о заключении с Недобросовестными участниками клиринга сделок своп с иностранной валютой в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов с ценой сделки своп, равной нулю, при наличии обстоятельств, не указанных в пункте 40.5 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов и свидетельствующих об отсутствии вины такого Участника клиринга.
- 40.7. 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 фондовом рынке и рынке депозитов без специального полномочия (доверенности), а также без согласия Участника клиринга.

Статья 41. Порядок заключения и условия сделок РЕПО и сделок / сделки купли-продажи ценных бумаг, заключаемых с Недобросовестным участником клиринга

- 41.1. Сделки РЕПО (сделки купли-продажи ценных бумаг), указанные в пунктах 38.1, 38.3, 38.5 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, заключаются при соблюдении следующих условий:
- 41.1.1. у Участника клиринга не отозвана (не аннулирована) лицензия Банка России на осуществление банковских операций и/или лицензия профессионального участника рынка ценных бумаг на осуществление брокерской деятельности, дилерской деятельности и/или деятельности по управлению ценными бумагами;
- 41.1.2. у Участника клиринга – Банка-нерезидента не отозвано (не аннулировано) специальное разрешение (лицензия или иное основание) компетентного органа государства учреждения Банка-нерезидента, в соответствии с которым Банк-нерезидент имеет право осуществлять банковские операции;
- 41.1.3. допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию не приостановлен;
- 41.1.4. у Клирингового центра отсутствует информация об обстоятельствах в отношении Участника клиринга, перечисленных в общей части Правил клиринга, при наступлении которых допуск к клиринговому обслуживанию Участника клиринга будет приостановлен в следующий Расчетный день;

- 41.1.5. количество Расчетных дней, в течение которых у Участника клиринга возникает отрицательный Единый лимит по Расчетному коду, входящий в состав Торгово-клирингового счета Т+, по которому учитывается Итоговое нетто-требование в ценных бумагах, не принимаемых в качестве обеспечения исполнения обязательств по Сделкам Т+, не превышает 2 (двух) Расчетных дней подряд;
- 41.1.6. количество Расчетных дней, в течение которых у Участника клиринга возникает Задолженность в соответствующей валюте по одному Расчетному коду не превышает 2 (двух) Расчетных дней подряд;
- 41.1.7. количество Расчетных дней, в течение которых у Участника клиринга возникает Итоговое нетто-обязательство по соответствующей ценной бумаге, учитываемое по одному Торгово-клиринговому счету Т+, для исполнения которого недостаточно ценных бумаг, не превышает 4 (четырёх) Расчетных дней подряд;
- 41.1.8. у Клирингового центра отсутствует информация о прекращении проведения депозитарных операций с ценной бумагой со следующего Расчетного дня;
- 41.1.9. у Держателя, по Разделу Т+ торгового счета депо которого должны исполняться обязательства по Сделкам Т+, не отозвана (не аннулирована) лицензия профессионального участника рынка ценных бумаг на осуществление депозитарной деятельности, или действие указанной лицензии не приостановлено.
- 41.2. Условие, указанное в подпункте 41.1.6 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, не применяется, если причиной непогашения Задолженности является несвоевременное зачисление денежных средств на клиринговый банковский или корреспондентский счет Клирингового центра, вызванное проведением процедур комплаенс-контроля в банках-корреспондентах, сбоями в работе платежных систем, а также обстоятельствами непреодолимой силы, определенными в пункте 41.9 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.
- Участник клиринга обязан предоставить Клиринговому центру документы, подтверждающие действие причин, указанных в настоящем пункте Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.
- 41.3. Две сделки купли-продажи ценных бумаг заключаются Клиринговым центром с Участником клиринга по Торгово-клиринговым счетам, предназначенным для учета ценных бумаг, находящихся в доверительном управлении Участника клиринга, и в состав которых входит Расчетный код, предназначенный для учета денежных средств, находящихся в доверительном управлении.
- 41.4. Участник клиринга вправе предоставить Клиринговому центру Заявление о заключении сделок купли-продажи, в котором указать на необходимость при неисполнении (ненадлежащем исполнении) обязательств по Сделкам Т+ в случаях, установленных Правилами клиринга:
- а) заключения сделок купли-продажи по иным Торгово-клиринговым счетам, кроме Торгово-клиринговых счетов, указанных в пункте 41.3 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов;
 - б) заключения сделок РЕПО по Торгово-клиринговым счетам, указанным в пункте 41.3 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

В случае предоставления указанного заявления заключение сделок РЕПО / двух сделок купли-продажи в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов осуществляется в соответствии с таким заявлением.

- 41.5. Условия сделок РЕПО (двух сделок купли-продажи ценных бумаг), заключаемых Клиринговым центром от имени Недобросовестного участника клиринга в отношении себя лично в случаях, установленных пунктами 38.1, 38.3, 38.5 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, соответствуют определенным Правилами торгов на фондовом рынке и рынке депозитов условиям сделок РЕПО с кодом расчетов Y0/Y1 (сделок купли-продажи с кодами расчетов Y0, Y1), заключаемых в Секции рынка РЕПО / Секции Фондового рынка, с учетом следующих особенностей:
- 41.5.1. в случае наличия у Участника клиринга Итогового нетто-обязательства по ценным бумагам, для исполнения которого недостаточно ценных бумаг, по первой части сделки РЕПО (по первой сделке купли-продажи ценных бумаг) у Участника клиринга возникают обязательства в российских рублях и требования по соответствующим ценным бумагам в объеме, равном величине Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по ценным бумагам (или его части), для исполнения которого (которой) недостаточно ценных бумаг;
- 41.5.2. в случае наличия у Участника клиринга Итогового нетто-требования по ценным бумагам, не принимаемым в качестве обеспечения исполнения обязательств по Сделкам Т+, и Итогового нетто-обязательства по денежным средствам, в результате исполнения (прекращения) которых Единый лимит по Расчетному коду станет отрицательным, по первой части сделки РЕПО (по первой сделке купли-продажи ценных бумаг) у Участника клиринга возникают обязательства в соответствующих ценных бумагах и требования в российских рублях в объемах, необходимых для сохранения неотрицательного Единого лимита по Расчетному коду;
- 41.5.3. в случае наличия у Участника клиринга Задолженности в российских рублях, учитываемой по Расчетному коду Участника клиринга, по первой части сделки РЕПО (по первой сделке купли-продажи ценных бумаг) у Участника клиринга возникают требования в российских рублях в объеме, равном размеру Задолженности, и обязательства по ценным бумагам в объеме, соответствующем размеру Задолженности и не превышающем суммы Обеспечения Участника клиринга в ценных бумагах, учитываемого по Торгово-клиринговому счету Т+ совместно с Расчетным кодом, по которому учитывается Задолженность. Выбор ценных бумаг (за исключением ценных бумаг, не принимаемых в качестве обеспечения исполнения обязательств по Сделкам Т+), в отношении которых заключается сделка РЕПО (сделки купли-продажи), осуществляется Клиринговым центром, при этом, в первую очередь, сделки РЕПО заключаются с клиринговыми сертификатами участия;
- 41.5.4. Датой исполнения обязательств по первой части сделки РЕПО (первой сделке купли-продажи ценных бумаг) является день ее заключения;
- 41.5.5. Датой исполнения обязательств по второй части сделки РЕПО (второй сделке купли-продажи ценных бумаг) является Расчетный день, следующий за днем ее заключения;

41.5.6. Сумма РЕПО (сумма первой сделки купли-продажи ценных бумаг) определяется как произведение количества ценных бумаг в сделке и последней определенной Клиринговым центром Расчетной цены ценных бумаг;

41.5.7. Стоимость обратного выкупа (сумма второй сделки купли-продажи ценных бумаг) определяется по формуле:

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

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

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

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

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

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

41.6. При несоблюдении любого из условий, указанных в подпунктах 41.1.3-41.1.8 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, Клиринговый центр от имени Недобросовестного участника клиринга в отношении себя лично заключает закрывающую сделку купли-продажи ценных бумаг (за исключением клиринговых сертификатов участия) с кодом расчетов Y0, условия которой соответствуют определенным Правилами торгов на фондовом рынке и рынке депозитов условиям Сделок Т+, заключаемых в Секции Фондового рынка, с учетом следующих особенностей:

41.6.1. в случае наличия у Участника клиринга Итогового нетто-обязательства по ценным бумагам, для исполнения которого недостаточно ценных бумаг, по сделке купли-продажи ценных бумаг у Участника клиринга возникают обязательства в российских рублях и требования по соответствующим ценным бумагам в объеме, равном величине Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по ценным бумагам (или его части), для исполнения которого (которой) недостаточно ценных бумаг;

41.6.2. в случае наличия у Участника клиринга Итогового нетто-требования по ценным бумагам, не принимаемым в качестве обеспечения исполнения обязательств по Сделкам Т+, и Итогового нетто-обязательства по денежным средствам, в результате исполнения (прекращения) которых Единый лимит по Расчетному коду станет отрицательным, по сделке купли-продажи ценных бумаг у Участника клиринга возникают обязательства в соответствующих ценных бумагах и требования в российских рублях в объемах, необходимых для сохранения неотрицательного Единого лимита по Расчетному коду;

- 41.6.3. в случае наличия у Участника клиринга Задолженности в российских рублях, учитываемой по Расчетному коду Участника клиринга, по сделке купли-продажи ценных бумаг у Участника клиринга возникают требования в российских рублях в объеме, равном размеру Задолженности, и обязательства по ценным бумагам в объеме, соответствующем размеру Задолженности и не превышающем суммы Обеспечения Участника клиринга в ценных бумагах, учитываемого по Торгово-клиринговому счету Т+ совместно с Расчетным кодом, по которому учитывается Задолженность. Выбор ценных бумаг (за исключением клиринговых сертификатов участия и ценных бумаг, не принимаемых в качестве обеспечения исполнения обязательств по Сделкам Т+), в отношении которых заключается сделка купли-продажи, осуществляется Клиринговым центром;
- 41.6.4. Датой исполнения обязательств по сделке купли-продажи ценных бумаг является день ее заключения;
- 41.6.5. сумма (в российских рублях) сделки купли-продажи ценных бумаг определяется как произведение количества ценных бумаг в сделке и цены балансирующей сделки / средневзвешенной цены балансирующих сделок с ценными бумагами, порядок заключения которых определен общей частью Правил клиринга.
- 41.7. Клиринговый центр вправе принять решение о заключении вместо сделки РЕПО, условия которой предусмотрены пунктом 41.5 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, сделки купли-продажи ценных бумаг, условия которой предусмотрены пунктом 41.6 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов:
- при принятии Клиринговым центром решения об установлении по ценной бумаге, по которой учитывается Итоговое нетто-обязательство, для исполнения которого недостаточно ценных бумаг, признака «запрет коротких продаж»;
 - при наличии у Клирингового центра информации о планируемом приостановлении проведения депозитарных операций с ценной бумагой.
- 41.8. При принятии Клиринговым центром решения в соответствии с подпунктом 30.15.2 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, Клиринговым центром от имени Недобросовестного участника клиринга в отношении себя лично заключается закрывающая сделка купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов Y0, условия которой соответствуют условиям, определенным в пункте 41.6 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, за исключением суммы сделки купли-продажи, которая определяется как произведение количества ценных бумаг в сделке и Расчетной цены ценных бумаг, определенной Клиринговым центром в соответствии с Методикой определения риск-параметров фондового рынка и рынка депозитов.
- 41.9. В случае невозможности исполнения Участником клиринга своих Итоговых нетто-обязательств по ценным бумагам или непогашения Участником клиринга Задолженности вследствие непреодолимой силы или сбоя в платежной системе Банка России / иных платежных системах, сделки РЕПО (две сделки купли-продажи ценных бумаг), заключаемые Клиринговым центром с Недобросовестным участником клиринга в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, заключаются со ставкой РЕПО, равной нулю. Под обстоятельствами непреодолимой силы понимаются:

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

О возникновении обстоятельств непреодолимой силы, вследствие которых исполнение Участником клиринга своих Итоговых нетто-обязательств по ценным бумагам / погашение своей Задолженности невозможно, Участник клиринга обязан уведомить Клиринговый центр любыми доступными средствами связи до установленного Временным регламентом на фондовом рынке и рынке депозитов времени исполнения Итоговых нетто-обязательств по ценным бумагам / погашения Задолженности.

Участник клиринга обязан предоставить Клиринговому центру документы, подтверждающие обстоятельства непреодолимой силы в течение 7 (семи) дней. В случае непредоставления Участником клиринга Клиринговому центру таких документов в указанный срок с Участника клиринга по решению Клирингового центра взыскивается неустойка по ставке РЕПО, определенной в соответствии с подпунктом 41.5.7 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, в расчете на количество календарных дней между датой исполнения первой части сделки РЕПО (первой сделки купли-продажи) и датой расчета неустойки.

- 41.10. Клиринговый центр вправе принять решение о заключении с Недобросовестными участниками клиринга сделок РЕПО (двух сделок купли-продажи ценных бумаг) в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов со ставкой РЕПО, равной нулю, при наличии обстоятельств, не указанных в пункте 41.9 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов и свидетельствующих об отсутствии вины такого Участника клиринга.
- 41.11. В случае отзыва (аннулирования) или приостановления действия лицензии профессионального участника рынка ценных бумаг на осуществление депозитарной деятельности у Держателя, Клиринговый центр вправе принять решение о том, что Дата исполнения обязательств по Сделкам Т+ Участника клиринга, учитываемых по Торгово-клиринговому счету Т+, в состав которого входит Раздел Т+ торгового счета депо такого Держателя, считается наступившей в текущий Расчетный день.
- 41.11.1. Обязательства по Сделкам Т+, в отношении которых Клиринговым центром принято решение в соответствии с пунктом 41.11 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, включаются в Клиринговый пул по Сделкам Т+ и участвуют в определении Итогового нетто-обязательства / Итогового нетто-требования Участника клиринга в соответствии со статьей 37 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, при этом при наличии неисполненного Итогового нетто-обязательства Участника клиринга в ценных бумагах между Клиринговым центром и Недобросовестным участником клиринга заключается закрывающая сделка купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов Y0, условия

которой соответствуют условиям, определенным в пункте 41.6 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

- 41.12. 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 фондовом рынке и рынке депозитов без специального полномочия (доверенности), а также без согласия Участника клиринга.

Статья 42. Порядок заключения и условия сделок РЕПО и сделок / сделки купли-продажи ценных бумаг, заключаемых с Добросовестным участником клиринга

- 42.1. В случае, указанном в подпункте 38.15.3 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, Клиринговый центр от имени Добросовестного участника клиринга в отношении себя лично заключает сделку РЕПО с кодом расчетов Y0/Y1 (две сделки купли-продажи ценных бумаг с кодами расчетов Y0, Y1), условия которых соответствуют определенным Правилами торгов на фондовом рынке и рынке депозитов условиям сделок РЕПО с кодом расчетов Y0/Y1 (сделок купли-продажи с кодами расчетов Y0, Y1), заключаемых в Секции рынка РЕПО / Секции Фондового рынка, с учетом следующих особенностей:
- 42.1.1. в случае недостаточности у Клирингового центра ценных бумаг для исполнения Итоговых нетто-требований Добросовестного участника клиринга, по первой части сделки РЕПО (по первой сделке купли-продажи) у такого Участника клиринга возникают требования в российских рублях и обязательства по таким ценным бумагам, в объеме, не превышающем Итогового нетто-требования Добросовестного участника клиринга по таким ценным бумагам;
 - 42.1.2. Датой исполнения обязательств по первой части сделки РЕПО (первой сделке купли-продажи ценных бумаг) является день ее заключения;
 - 42.1.3. Датой исполнения обязательств по второй части сделки РЕПО (второй сделке купли-продажи ценных бумаг) является Расчетный день, следующий за днем ее заключения;
 - 42.1.4. Сумма РЕПО (сумма первой сделки купли-продажи ценных бумаг) определяется как произведение количества ценных бумаг в сделке и последней определенной Клиринговым центром Расчетной цены ценных бумаг;
 - 42.1.5. Стоимость обратного выкупа (сумма второй сделки купли-продажи ценных бумаг) определяется по формуле, указанной в подпункте 41.5.7 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов;
 - 42.1.6. разница между суммой первой и второй части сделки РЕПО (между суммой первой и второй сделки купли-продажи) уплачивается в пользу Добросовестного участника клиринга.
- 42.2. Сделки РЕПО (две сделки купли-продажи) могут заключаться Клиринговым центром с одним Добросовестным участником клиринга не более, чем 4 (четыре) Расчетных дня подряд, при наличии у Добросовестного участника клиринга Итогового нетто-требования по ценным бумагам.

- 42.2.1. В случае отсутствия у Клирингового центра возможности в течение 4 (четырёх) Расчетных дней подряд исполнить Итоговые нетто-требования по ценной бумаге одного или нескольких Добросовестных участников клиринга, Клиринговый центр:
- устанавливает по такой ценной бумаге признак «запрет коротких продаж»;
 - заключает от имени Добросовестного участника клиринга в отношении себя лично сделку купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов Y0, условия которой соответствуют условиям первой сделки купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов Y0, определенным в пункте 42.1 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, за исключением суммы сделки купли-продажи, которая определяется как произведение количества ценных бумаг в сделке и Расчетной цены ценных бумаг, определенной Клиринговым центром в соответствии с Методикой определения риск-параметров фондового рынка и рынка депозитов.
- 42.3. 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 фондовом рынке и рынке депозитов без специального полномочия (доверенности), а также без согласия Участника клиринга.

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

Статья 43. Порядок исполнения обязательств и требований Участников клиринга и Клирингового центра, включенных в клиринговый пул

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

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

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

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

43.2.2. По обязательствам, включенным в Клиринговый пул для расчетов в ходе торгов, проводится неттинг, по итогам которого определяются Нетто-обязательства / нетто-требования Участников клиринга и Клирингового центра по денежным средствам и по ценным бумагам по сделкам клирингового пула в соответствии с подпунктами 35.4.1 и 35.4.2 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

43.3. Исполнение обязательств по сделкам, включенным в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов и Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов по сделкам с центральным контрагентом, осуществляется в ходе расчетных клиринговых сессии, время проведения которых установлено Временным регламентом на фондовом рынке и рынке депозитов. Для каждой расчетной клиринговой сессии формируется отдельный Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов и отдельный Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов по сделкам с центральным контрагентом.

43.4. По обязательствам по сделкам с ценными бумагами с кодами расчетов Т0, К0 и обязательствам по первым частям сделок РЕПО с кодом расчетов Т0/Уп, а также обязательствам по иным Сделкам Т+, включенным в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов по сделкам с центральным контрагентом, проводится неттинг, по итогам которого определяются нетто-обязательства / нетто-требования

Участников клиринга и Клирингового центра по денежным средствам и по ценным бумагам, которые затем включаются в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов.

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

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

$POS_VAL = ST - SO$, где:

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

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

- нетто-обязательствам / нетто-требованиям, определенным по итогам неттинга обязательств по сделкам, включенным в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов по сделкам с центральным контрагентом, в соответствии с пунктом 43.4 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов;
- первым частям сделок РЕПО с кодом расчетов Rb;
- сделкам купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов B0-B30;
- первым частям сделок РЕПО с кодом расчетов Sn;
- вторым частям сделок РЕПО с кодом расчетов Sn, Z0 и Rb;
- обязательствам по внесению / требованиям по получению компенсационных взносов;
- обязательствам по уплате / требованиям по получению отступного за отказ от исполнения сделки РЕПО / сделки купли-продажи ценных бумаг;
- обязательствам по уплате / требованиям по получению отступного за отказ от заключения сделки;
- требованиям по зачислению денежных средств на Счет обеспечения T0 / Расчетный код по распоряжениям на перевод денежных средств / Заявлениям о порядке использования денежных средств и ценных бумаг;
- обязательствам по списанию денежных средств со Счета обеспечения T0 / Расчетного кода по распоряжениям на перевод денежных средств / Заявлениям о порядке использования денежных средств и ценных бумаг;
- Итоговым нетто-обязательствам / Итоговым нетто-требованиям Участников клиринга по денежным средствам, определенным по Сделкам T+, обязательства по которым были включены в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов, в соответствии с пунктом 37.13 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов (только для Расчетных кодов).

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

Участника клиринга (Клирингового центра) по денежным средствам по сделкам клирингового пула.

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

$POS_C = STC - SOC$, где:

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

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

- нетто-обязательствам / нетто-требованиям, определенным по итогам неттинга обязательств по сделкам, включенным в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов по сделкам с центральным контрагентом, в соответствии с пунктом 43.4 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов;
- первым частям сделок РЕПО с кодом расчетов Rb;
- сделкам купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов B0-B30;
- первым частям сделок РЕПО с кодом расчетов Sn;
- вторым частям сделок РЕПО с кодом расчетов Sn, Z0 и Rb;
- обязательствам по внесению / требованиям по получению компенсационных взносов;
- требованиям по зачислению ценных бумаг на Торгово-клиринговый счет T0 / Торгово-клиринговый счет T+ / Торгово-клиринговый счет имущественного пула по распоряжениям на перевод ценных бумаг / Заявлениям о порядке использования денежных средств и ценных бумаг;
- обязательствам по списанию ценных бумаг с Торгово-клирингового счета T0 / Торгово-клирингового счета T+ / Торгово-клирингового счета имущественного пула по распоряжениям на перевод ценных бумаг / Заявлениям о порядке использования денежных средств и ценных бумаг;
- Итоговым нетто-обязательствам / Итоговым нетто-требованиям Участников клиринга по ценным бумагам, определенным по Сделкам T+, обязательства по которым были включены в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов, в соответствии с пунктом 37.13 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов (только для Торгово-клиринговых счетов T+ и Торгово-клиринговых счетов имущественного пула).

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

43.6. Нетто-обязательства (нетто-требования) Участников клиринга по ценным бумагам по сделкам клирингового пула, рассчитанные в соответствии с подпунктом 43.5.2 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, включаются в распоряжение на проведение операций по Разделам / субсчетам депо, направляемое

Клиринговым центром Расчетному депозитарию в соответствии с пунктом 45.8 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

- 43.7. Обязательства / требования по передаче ценных бумаг по сделкам купли-продажи с кодом расчетов Z0, X0 и первым частям сделок РЕПО с кодом расчетов Z0 или Нетто-обязательства (нетто-требования) Участников клиринга по ценным бумагам по сделкам клирингового пула, рассчитанные в соответствии с подпунктом 35.4.2 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов по обязательствам, включенным в Срочный отчет на исполнение, включаются в распоряжение на проведение операций по Разделам / субсчетам депо, направляемое Клиринговым центром Расчетному депозитарию в соответствии с пунктом 45.7 / 45.9 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.
- 43.8. Обязательства по оплате ценных бумаг по сделкам купли-продажи с кодом расчетов Z0, X0 и первым частям сделок РЕПО с кодом расчетов Z0, Нетто-обязательства Участников клиринга по денежным средствам по сделкам клирингового пула, рассчитанные в соответствии с подпунктом 35.4.1 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов по обязательствам, включенным в Срочный отчет на исполнение, или в соответствии с подпунктом 43.5.1 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов в отношении Счета обеспечения T0 или Расчетного кода, исполняются за счет денежных средств, учитываемых по тому же Счету обеспечения T0 / Расчетному коду.
- 43.8.1. Обязательство по оплате ценных бумаг или Нетто-обязательство Участника клиринга по денежным средствам по сделкам клирингового пула, определенное в отношении Счета обеспечения T0 / Расчетному коду, считается исполненным, если сумма денежных средств, учитываемая по тому же Счету обеспечения T0 / Расчетному коду не меньше, чем соответствующее обязательство / Нетто-обязательство Участника клиринга.
- 43.8.2. Если сумма денежных средств, учитываемая по Счету обеспечения T0, меньше, чем Обязательство по оплате ценных бумаг или Нетто-обязательство Участника клиринга по денежным средствам по сделкам клирингового пула, определенное в отношении такого Счета обеспечения T0, соответствующее обязательство / Нетто-обязательство прекращается в части, соответствующей размеру указанной суммы денежных средств, а неисполненная часть соответствующего обязательства / Нетто-обязательства на следующий Расчетный день включается в Ограничительный лимит по такому Счету обеспечения T0.
- 43.8.3. Если сумма Обеспечения в денежных средствах, учитываемая по Расчетному коду, меньше, чем Обязательство по оплате ценных бумаг или Нетто-обязательство Участника клиринга по денежным средствам по сделкам клирингового пула, определенное в отношении такого Расчетного кода, соответствующее обязательство / Нетто-обязательство прекращается в части, соответствующей указанной сумме Обеспечения, а неисполненная часть соответствующего обязательства / Нетто-обязательства учитывается как Задолженность по такому Расчетному коду.
- Указанная Задолженность Участника пула урегулируется в порядке, установленном статьей 38 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.
- 43.8.4. Клиринговый центр зачитывает Обязательство по оплате ценных бумаг, Нетто-обязательство Участника клиринга по денежным средствам по сделкам

клирингового пула (или его часть), определенное в отношении Счета обеспечения Т0 / Расчетного кода, с требованием Участника клиринга по возврату денежных средств, учитываемых по тому же Счету обеспечения Т0 / Расчетного кода, а значение суммы денежных средств, учитываемой по тому же Счету обеспечения Т0 / Расчетному коду, уменьшается на сумму такого исполненного обязательства / Нетто-обязательства (или его части).

- 43.9. Требование по оплате ценных бумаг по сделкам купли-продажи с кодом расчетов Z0, X0 и первым частям сделок РЕПО с кодом расчетов Z0 или Нетто-требование Участника клиринга по денежным средствам, рассчитанные в соответствии с подпунктом 35.4.1 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов по обязательствам, включенным в Срочный отчет на исполнение, или в соответствии с подпунктом 43.5.1 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов в отношении Счета обеспечения Т0 / Расчетного кода, прекращается возникновением обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга денежных средств, учитываемых по тому же Счету обеспечения Т0 / Расчетному коду, в размере соответствующего требования / Нетто-требования Участника клиринга.

При этом значение суммы денежных средств, учитываемой по соответствующему Счету обеспечения Т0 / Расчетному коду, увеличивается на сумму такого прекращенного требования / Нетто-требования.

- 43.10. После исполнения (прекращения) Нетто-обязательств (нетто-требований) Участников клиринга по денежным средствам по сделкам клирингового пула в соответствии с пунктами 43.8 или 43.9 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов и направления в Расчетный депозитарий распоряжения на проведение операций по Разделам / субсчетам депо в соответствии с пунктом 45.7 или 45.8 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов обязательства Участников клиринга и Клирингового центра, включенные в соответствующий клиринговый пул, считаются прекращенными в соответствующем клиринговом пуле.

После получения от Расчетного депозитария отчета о проведении операций по Разделам / субсчетам депо в соответствии с пунктом 45.9 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов расчеты по ценным бумагам по итогам клиринга считаются завершенными.

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

С Даты прекращения исполнения обязательства Участников клиринга по сделкам исключаются из числа обязательств, допущенных к клирингу, и не подлежат исполнению в Клиринговой системе, неисполненные сделки исключаются из Клиринговой системы.

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

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

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

Статья 44. Особенности взаимодействия с Расчетной организацией

44.1. Каждый Расчетный день до начала Торгов, Клиринговый центр направляет Расчетной организации запрос выписки по торговым банковским счетам, в ответ на который Расчетная организация передает Клиринговому центру выписку по торговым банковским счетам.

44.2. После получения от Расчетной организации выписки по торговым банковским счетам Клиринговый центр передает Расчетной организации распоряжение на перевод на клиринговый банковский счет Клирингового центра, открытый в Расчетной организации и предназначенный для учета индивидуального клирингового обеспечения, денежных средств с торговых банковских счетов в суммах, указанных в полученной от Расчетной организации выписки по торговым банковским счетам.

После получения от Расчетной организации отчета об исполнении указанного распоряжения Клиринговый центр учитывает переведенные денежные средства на Счетах обеспечения T0, открытых к соответствующим торговым банковским счетам.

44.3. При увеличении в ходе торгов суммы денежных средств, учитываемых на торговом банковском счете, Расчетная организация передает Клиринговому центру информацию о таком увеличении, а Клиринговый центр учитывает это увеличение по Счету обеспечения T0 и передает Расчетной организации распоряжение на перевод на клиринговый банковский счет Клирингового центра денежных средств с торгового банковского счета в сумме указанного увеличения.

44.4. В случае необходимости в ходе Торгов списания денежных средств с торгового банковского счета, Расчетная организация направляет Клиринговому центру запрос согласия Клирингового центра на списание денежных средств с торговых банковских счетов.

Клиринговый центр дает согласие на списание денежных средств с торгового банковского счета при условии, что сумма списания не превышает суммы денежных средств, учитываемой по соответствующему Счету обеспечения T0, за вычетом соответствующего Ограничительного лимита, и направляет Расчетной организации распоряжение на перевод денежных средств с клирингового банковского счета на торговый банковский счет на сумму списания.

44.5. После окончания торгов Клиринговый центр направляет Расчетной организации распоряжение на проведение операций по торговым банковским счетам, содержащее распоряжения на перевод денежных средств с клирингового банковского счета на торговые банковские счета в суммах денежных средств, учитываемых по Счетам обеспечения T0 после прекращения обязательств, включенных в последний в течение Расчетного дня Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов, увеличенных на сумму обязательств / нетто-обязательств по денежным средствам в отчетах на исполнение, не обеспеченных средствами под

исполнение на момент формирования последнего в течение Расчетного дня Клирингового пула для расчетов по итогам торгов.

- 44.6. После исполнения Расчетной организацией распоряжения на проведение операций по торговым банковским счетам, направленного Клиринговым центром в соответствии с пунктом 44.5 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, Клиринговый центр направляет Расчетной организации уведомление о согласии на проведение операций по торговым банковским счетам.

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

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

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

Статья 45. Особенности взаимодействия с Расчетным депозитарием

- 45.1. Учет ценных бумаг, внесенных Участником клиринга в имущественный пул, осуществляется на соответствующих субсчетах депо имущественного пула.

- 45.1.1. Списание / зачисление ценных бумаг с субсчетов / на субсчета депо имущественного пула осуществляется на основании распоряжений Клирингового центра.

- 45.1.2. Доходы и иные выплаты по ценным бумагам, учитываемым на субсчетах депо имущественного пула, перечисляются на соответствующий клиринговый счет Клирингового центра, предназначенный для внесения имущества в имущественный пул, в порядке, предусмотренном договором Клирингового центра с Расчетным депозитарием, в случае, если это предусмотрено внутренними документами Расчетного депозитария.

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

- 45.2. Каждый Расчетный день до начала Торгов, а также в ходе Торгов в случае изменения, Клиринговый центр с использованием WEB-сервиса Расчетного депозитария передает Расчетному депозитарию:
- перечень ценных бумаг, принимаемых в каждый из имущественных пулов, в качестве Обеспечения, взносов в Гарантийные фонды, Обеспечение под стресс, и информацию о ценах соответствующих ценных бумаг, которые необходимо использовать при подборе. В качестве таких цен указываются Нижние границы диапазона оценки рыночных рисков 1-го уровня;
 - список Разделов / субсчетов депо и кодов ценных бумаг, запрещенных к подбору на указанные Разделы / субсчета депо.
- 45.3. Каждый Расчетный день до начала Торгов Расчетный депозитарий передает Клиринговому центру список Разделов / субсчетов депо и выписку по Разделам / субсчетам депо.
- 45.4. После получения от Расчетного депозитария выписки по Разделам / субсчетам депо Клиринговый центр устанавливает значение количества ценных бумаг, учитываемых по Торгово-клиринговым счетам в соответствии с информацией о количестве ценных бумаг, учитываемых на Разделах / субсчетах депо, полученной от Расчетного депозитария в Выписке по Разделам / субсчетам депо.
- 45.5. При увеличении в ходе торгов количества ценных бумаг, учитываемых на Разделе, Расчетный депозитарий передает Клиринговому центру информацию о таком увеличении, а Клиринговый центр учитывает это увеличение по Торгово-клиринговым счетам T0 / Торгово-клиринговым счетам T+.
- 45.6. В случае необходимости в ходе Торгов списания ценных бумаг с Раздела, Расчетный депозитарий направляет Клиринговому центру запрос согласия Клирингового центра на списание ценных бумаг с Разделов.

Клиринговый центр дает согласие на списание ценных бумаг с Разделов T0 при условии, что количество ценных бумаг, подлежащих списанию, не превышает количества ценных бумаг, учитываемого по Торгово-клиринговому счету T0, и количества ценных бумаг, учитываемых на Разделе T0 по информации, полученной от Расчетного депозитария.

Клиринговый центр дает согласие на списание ценных бумаг (за исключением клиринговых сертификатов участия) с Раздела T+ при условии, что количество ценных бумаг, подлежащих списанию, не превышает количества ценных бумаг, учитываемого по Торгово-клиринговому счету T+, и количества ценных бумаг, учитываемых на Разделе T+, входящем в состав такого Торгово-клирингового счета T+, по информации, полученной от Расчетного депозитария, и в результате такого списания Единый лимит по Расчетному коду, к которому относится указанный Раздел T+, не станет отрицательным.

В случае если в соответствии с полученным Клиринговым центром запросом, списание ценных бумаг осуществляется с Раздела T+, входящего в состав Торгово-клирингового счета с признаком «запрет коротких продаж», и/или с Раздела T+ Участника клиринга категории «B», и/или по ценной бумаге с признаком «запрет коротких продаж», дополнительным условием для получения согласия Клирингового центра на такое списание является не превышение количества ценных бумаг, подлежащего списанию, количества таких ценных бумаг,

рассчитанного в соответствии с пунктом 20.1.10.1 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

Клиринговый центр дает согласие на списание клиринговых сертификатов участия с Раздела Т+ при условии, что количество ценных бумаг, подлежащих списанию, не превышает количества ценных бумаг, учитываемого по Торгово-клиринговому счету Т+, и в результате такого списания Единый лимит по Расчетному коду, к которому относится указанный Раздел Т+, не станет отрицательным. При этом согласие на списание клиринговых сертификатов участия в количестве превышения количества ценных бумаг, учитываемого по Торгово-клиринговому счету Т+, над количества ценных бумаг, учитываемых на Разделе Т+, входящем в состав такого Торгово-клирингового счета Т+, по информации, полученной от Расчетного депозитария, включает поручение Расчетному депозитарию на выдачу клиринговых сертификатов участия в количестве, равном такому превышению.

При согласии Клирингового центра на списание ценных бумаг количество ценных бумаг, учитываемое по Торгово-клиринговому счету Т+, и количество ценных бумаг, учитываемое на Разделе Т+, входящем в состав такого Торгово-клирингового счета Т+, по информации, полученной от Расчетного депозитария, уменьшается на количество ценных бумаг, указанное в запросе; номинальная стоимость клиринговых сертификатов участия, подлежащих выдаче в ходе ближайшего взаимодействия с Расчетным депозитарием, уменьшается на количество клиринговых сертификатов участия, указанное в поручении на выдачу клиринговых сертификатов участия, направленном Расчетному депозитарию в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

- 45.7. Проведение расчетов по ценным бумагам в ходе торгов осуществляется Расчетным депозитарием на основании полученного от Клирингового центра распоряжения на проведение операций по Разделам / субсчетам депо, содержащего обязательства и требования Участника клиринга по передаче ценных бумаг по сделкам с кодом расчетов Z0 / X0, включенные в Клиринговый пул для расчетов в ходе торгов.
- 45.7.1. Распоряжение на проведение операций по Разделам / субсчетам депо, содержащее обязательства и требования Участника клиринга по передаче размещаемых ценных бумаг по сделкам размещения с кодом расчетов X0, направляется Клиринговым центром Расчетному депозитарию сразу после получения от Расчетного депозитария информации о зачислении всех размещаемых ценных бумаг на счет Расчетного депозитария в реестре.
- 45.8. Проведение расчетов по ценным бумагам по итогам торгов осуществляется Расчетным депозитарием на основании полученного от Клирингового центра распоряжения на проведение операций по Разделам / субсчетам депо, содержащего:
- поручение на выдачу клиринговых сертификатов участия в количестве, соответствующем номинальной стоимости клиринговых сертификатов участия, подлежащих выдаче в ходе ближайшего взаимодействия с Расчетным депозитарием, учитываемой по Расчетному коду имущественного пула;
 - Нетто-обязательства и Нетто-требования Участника клиринга и Клирингового центра по ценным бумагам по сделкам клирингового пула, определенные на основании обязательств, включенных в Клиринговый пул для расчетов по

итогам торгов;

- поручение на погашение клиринговых сертификатов участия в количестве, соответствующем номинальной стоимости клиринговых сертификатов участия, подлежащих погашению в ходе ближайшего взаимодействия с Расчетным депозитарием, учитываемой по Расчетному коду имущественного пула.
- 45.8.1. Распоряжения на проведение операций по Разделам / субсчетам депо, содержащие Нетто-обязательства и Нетто-требования Участника клиринга и Клирингового центра по ценным бумагам по сделкам клирингового пула (за исключением клиринговых сертификатов участия) исполняются Расчетным депозитарием в корреспонденции с субсчетом депо Клирингового центра, открытым в рамках клирингового счета депо Клирингового центра, предназначенного для исполнения операций по ценным бумагам по Разделам / субсчетам депо по итогам клиринга.
- 45.8.2. Распоряжения на проведение операций по Разделам / субсчетам депо, содержащие Нетто-обязательства и Нетто-требования Участника клиринга и Клирингового центра по клиринговым сертификатам участия исполняются Расчетным депозитарием в корреспонденции с торговым разделом казначейского счета депо Клирингового центра.
- 45.8.3. Поручения на выдачу / погашение клиринговых сертификатов участия исполняются Расчетным депозитарием в корреспонденции с основным разделом счета места хранения.
- 45.9. Проведение расчетов по ценным бумагам в ходе торгов осуществляется Расчетным депозитарием на основании полученного от Клирингового центра распоряжения на проведение операций по Разделам / субсчетам депо, содержащего Нетто-обязательства и Нетто-требования Участника клиринга и Клирингового центра по ценным бумагам по сделкам клирингового пула, определенные на основании обязательств, включенных в Клиринговый пул для расчетов в ходе торгов.
- Указанного распоряжение исполняется Расчетным депозитарием в корреспонденции с субсчетом депо Клирингового центра, открытым в рамках клирингового счета депо Клирингового центра, предназначенного для исполнения операций по ценным бумагам по Разделам / субсчетам депо по итогам клиринга.
- 45.10. После исполнения распоряжения на проведение операций по Разделам / субсчетам депо, полученного от Клирингового центра, Расчетный депозитарий направляет Клиринговому центру отчет о проведении операций по Разделам / субсчетам депо.
- После получения отчета о проведении операций по Разделам / субсчетам депо по итогам торгов Клиринговый центр устанавливает равной нулю номинальную стоимость клиринговых сертификатов участия, подлежащих выдаче в ходе ближайшего взаимодействия с Расчетным депозитарием, и номинальную стоимость клиринговых сертификатов участия, подлежащих погашению в ходе ближайшего взаимодействия с Расчетным депозитарием.
- 45.11. После окончания третьей расчетной клиринговой сессии, Клиринговый центр направляет Расчетному депозитарию Уведомление о согласии на проведение операций по Разделам.

Направление Расчетному депозитарию указанного уведомления означает согласие Клирингового центра на проведение любых операций по Разделам T0 до момента передачи Клиринговому центру Расчетным депозитарием выписки по Разделам / субсчетам депо, за исключением Разделов T0, в отношении которых Клиринговым центром от Расчетного депозитария получена информация об обращении взыскания или наложении ареста на имущество Участника клиринга, находящееся на торговом счете депо, на котором открыт Раздел T0.

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

ПОДРАЗДЕЛ V-VIII. СДЕЛКИ РЕПО КЛИРИНГОВОГО ЦЕНТРА

Статья 46. Условия Сделок РЕПО Клирингового центра, порядок их заключения и исполнения

- 46.1. Сделки РЕПО Клирингового центра заключаются между Клиринговым центром и Участником клиринга в случае, установленном подпунктом 38.15.3 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.
- 46.2. Предметом Сделок РЕПО Клирингового центра могут являться ценные бумаги, с которыми возможно заключение Сделок Т+ (далее в настоящей статье – Ценные бумаги).
- 46.3. Сделки РЕПО Клирингового центра в случае недостаточности у Клирингового центра свободных собственных ценных бумаг для исполнения обязательств перед Добросовестными Участниками клиринга заключаются в следующем порядке и на следующих условиях.
- 46.3.1. Продавцом по первой части Сделки РЕПО Клирингового центра является Участник клиринга, покупателем - Клиринговый центр.
- 46.3.2. Клиринговый центр вправе заключить Сделку РЕПО Клирингового центра с любым Участником клиринга категории «Б» с использованием любого Торгово-клирингового счета Т+, в состав которого входит Раздел Т+, открытый на торговом счете депо владельца Участника клиринга в Расчетном депозитарии.
- 46.3.3. Заключение Сделок РЕПО Клирингового центра с Участником клиринга категории «А» осуществляется в случае, если возможность и порядок заключения таких сделок предусмотрены договором, заключенным между Участником клиринга категории «А» и Клиринговым центром.
- 46.3.4. Для предоставления Клиринговому центру возможности заключения Сделок РЕПО Клирингового центра с использованием иных Торгово-клиринговых счетов Т+ Участников клиринга, кроме указанных в подпункте 46.3.2 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, или с иными Участниками клиринга, Участник клиринга предоставляет Клиринговому центру Заявление о Торгово-клиринговых счетах для заключения сделок с Клиринговым центром.
- 46.3.5. Участник клиринга, предоставляя указанное заявление Клиринговому центру, гарантирует Клиринговому центру, что он обладает всеми необходимыми поручениями и полномочиями на заключение сделок в отношении ценных бумаг, учитываемых на Разделе Т+, входящем в состав Торгово-клирингового счета Т+, указанного в заявлении.
- 46.3.6. Выбор Участника клиринга, с которым, в случае необходимости, заключается Сделка РЕПО Клирингового центра, и выбор Торгово-клирингового счета Т+ Участника клиринга, с использованием которого будет заключена Сделка РЕПО Клирингового центра, а также определение количества ценных бумаг, в отношении которых заключается Сделка РЕПО Клирингового центра, осуществляется Клиринговым центром.
- 46.3.7. Условия Сделки РЕПО Клирингового центра соответствуют условиям сделок РЕПО, заключаемых в Режиме торгов «РЕПО с ЦК – Адресные заявки»,

определенным Правилами торгов на фондовом рынке и рынке депозитов, с учетом следующих особенностей:

- 1) в дату заключения Сделки РЕПО Клирингового центра Участник клиринга (продавец по первой части Сделки РЕПО Клирингового центра) обязан передать Клиринговому центру (покупателю по первой части Сделки РЕПО Клирингового центра) Ценные бумаги в количестве, определенном Клиринговым центром, а Клиринговый центр обязан уплатить Участнику клиринга сумму РЕПО;
- 2) в Расчетный день, следующий за датой заключения Сделки РЕПО Клирингового центра, Клиринговый центр обязан вернуть Участнику клиринга Ценные бумаги, полученные по первой части Сделки РЕПО Клирингового центра, а Участник клиринга обязан уплатить Клиринговому центру сумму РЕПО, уменьшенную исходя из Ставки по Сделкам РЕПО Клирингового центра;
- 3) срок Сделки РЕПО Клирингового центра составляет один Расчетный день;
- 4) сумма РЕПО рассчитывается как произведение количества Ценных бумаг, переданных по первой части Сделки РЕПО Клирингового центра, и последней Расчетной цены Ценных бумаг, определенной в соответствии с Методикой определения риск-параметров фондового рынка и рынка депозитов;
- 5) Ставка по Сделкам РЕПО Клирингового центра устанавливается в процентах годовых. Информация о Ставке по Сделкам РЕПО Клирингового центра публикуется на Сайте Клирингового центра. Ставка по заключенным Сделкам РЕПО Клирингового центра не может быть изменена;
- 6) в случае если на дату заключения Сделки РЕПО Клирингового центра приходится дата составления списка лиц, имеющих право на получение Дохода, Клиринговый центр обязан передать Доход Участнику клиринга. Порядок и сроки передачи Дохода в форме денежных средств, а также сумма Дохода, подлежащая передаче, определяются статьей 47 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов. Иной Доход Клиринговый центр передает Участнику клиринга в течение десяти Расчетных дней, следующих за днем получения Клиринговым центром такого Дохода.

46.3.8. Клиринговый центр заключает Сделки РЕПО Клирингового центра в случае недостаточности у него ценных бумаг для исполнения Итоговых нетто-требований Добросовестных участников клиринга с Участниками клиринга и с использованием Торгово-клиринговых счетов Т+, указанных в подпункте 46.3.2 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, или с Участниками клиринга, предоставившими заявление, указанное в подпункте 46.3.4 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, с использованием Торгово-клиринговых счетов Т+, указанных в данном заявлении, при условии, что на Разделе Т+, входящем в состав такого Торгово-клирингового счета Т+, учитываются недостающие у Клирингового центра ценные бумаги.

46.4. Сделки РЕПО Клирингового центра заключаются без подачи заявок.

46.5. Обязательства по передаче и возврату Ценных бумаг во исполнение Сделки РЕПО Клирингового центра, а также обязательства по оплате ценных бумаг по соответствующим частям Сделок РЕПО Клирингового центра включаются в

Клиринговый пул по Сделкам T+ в Дату их исполнения в порядке, установленном статьей 37 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

- 46.6. В дату заключения Сделки РЕПО Клирингового центра информация о заключенной Сделке РЕПО Клирингового центра включается в Выписку из реестра сделок, принятых в клиринг, предоставляемую Участнику клиринга в соответствии со статьей 49 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов. Указанный отчет является документом, удостоверяющим передачу Ценных бумаг Участником клиринга Клиринговому центру / Клиринговым центром Участнику клиринга.

ПОДРАЗДЕЛ V-IX. ПОРЯДОК ПЕРЕДАЧИ ДОХОДА

Статья 47. Порядок передачи Доходов по сделкам РЕПО и сделкам купли-продажи ценных бумаг, заключенным с Клиринговым центром

47.1. Обязательства по передаче Дохода возникают:

- по сделке РЕПО, заключенной с Клиринговым центром, в том числе Сделке РЕПО Клирингового центра, с ценными бумагами, по которым принято решение о выплате Дохода, и список лиц, имеющих право на его получение, определяется в период после исполнения обязательств по передаче ценных бумаг по первой части сделки РЕПО и до исполнения обязательств по передаче ценных бумаг по второй части сделки РЕПО;
- по заключенной в соответствии с пунктом 41.5 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов второй сделке купли-продажи ценных бумаг, по которым принято решение о выплате Дохода, и список лиц, имеющих право на его получение, определяется в период после исполнения обязательств по передаче ценных бумаг по первой сделке купли-продажи ценных бумаг и до исполнения обязательств по передаче ценных бумаг по второй сделке купли-продажи ценных бумаг.

47.2. По сделке с акциями российских организаций, номинированными в российских рублях, размер обязательства по передаче / требования по получению Дохода в форме денежных средств рассчитывается по формуле:

$Inc = ROUND (N \times d \times (1 - T \times \max((D1 - D2); 0) / D1); 2)$, где	
Inc	размер обязательства по передаче / требования по получению Дохода по сделке (в российских рублях);
N	размер обязательства / требования Участника клиринга по ценным бумагам по сделке, указанной в пункте 47.1 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов (в штуках);
d	сумма начисления на одну акцию, установленная эмитентом ценных бумаг (в российских рублях);
T	налоговая ставка, установленная в отношении доходов от долевого участия в деятельности организаций, полученных в виде дивидендов юридическими и физическими лицами, являющимися налоговыми резидентами Российской Федерации;
D1	общая сумма дивидендов, подлежащая распределению российской организацией (эмитентом) в пользу всех получателей; (D1)
D2	общая сумма дивидендов, полученных российской организацией (эмитентом) в текущем отчетном (налоговом) периоде и предыдущих отчетных (налоговых) периодах (за исключением дивидендов, указанных в подпункте 1 пункта 3 статьи 284 Налогового кодекса Российской Федерации) к моменту распределения дивидендов в пользу налогоплательщиков - получателей дивидендов, при условии, что указанные суммы дивидендов ранее не учитывались при определении налоговой базы, определяемой в отношении доходов, полученных российской организацией (эмитентом) в виде дивидендов. (D2)

- 47.3. По сделке с акциями иностранных организаций, номинированными в иностранной валюте, размер обязательства по передаче / требованию по получению Дохода в форме денежных средств рассчитывается по формуле:

$Inc = ROUND(N \times d \times (1 - T); 2)$, где	
Inc	размер обязательства по передаче / требованию по получению Дохода по сделке (в валюте, в которой эмитентом объявлена выплата);
N	размер обязательства / требования Участника клиринга по ценным бумагам по сделке, указанной в пункте 47.1 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов (в штуках);
d	сумма начисления на одну акцию, установленная эмитентом ценных бумаг (в валюте, в которой эмитентом объявлена выплата);
T	налоговая ставка, примененная к доходам в виде дивидендов по ценным бумагам в соответствии с налоговым законодательством страны, резидентом которой является эмитент ценной бумаги.

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

$Inc = N \times d$, где	
Inc	размер обязательства по передаче / требованию по получению Дохода по сделке (в штуках);
N	размер обязательства / требования Участника клиринга по ценным бумагам по сделке, указанной в пункте 47.1 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов (в штуках);
d	количество ценных бумаг, передаваемых эмитентом на одну акцию, установленное эмитентом ценных бумаг (в штуках).

- 47.5. По сделке с облигациями, номинированными в российских рублях, размер обязательства по передаче / требованию по получению Дохода в форме денежных средств рассчитывается по формуле:

$Inc = ROUND(N \times (d + m); 2)$, где	
Inc	размер обязательства по передаче / требованию по получению Дохода по сделке (в российских рублях);
N	размер обязательства / требования Участника клиринга по ценным бумагам по сделке, указанной в пункте 47.1 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов (в штуках);
d	размер начисленного купона на одну облигацию, установленный эмитентом ценных бумаг (в российских рублях);
m	сумма номинальной стоимости облигации либо ее часть, выплачиваемая эмитентом при погашении, включая сумму премии за досрочное погашение, в случае ее выплаты эмитентом (досрочном, частичном или окончательном) (в российских рублях);

- 47.6. По сделке с облигациями, номинированными в иностранной валюте, размер обязательства по передаче / требованию по получению Дохода в форме денежных средств рассчитывается по формуле:

$Inc = ROUND(N \times (d \times (1 - T) + m); 2)$, где	
---	--

Inc	размер обязательства по передаче / требования по получению Дохода по сделке (в валюте, в которой эмитентом объявлена выплата);
N	размер обязательства / требования Участника клиринга по ценным бумагам по сделке, указанной в пункте 47.1 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов (в штуках);
d	размер начисленного купона на одну облигацию, установленный эмитентом ценных бумаг (в валюте, в которой эмитентом объявлена выплата);
T	налоговая ставка, примененная к доходам в виде НКД по ценным бумагам в соответствии с налоговым законодательством страны, резидентом которой является эмитент ценной бумаги.
m	сумма номинальной стоимости облигации либо ее часть, выплачиваемая эмитентом при погашении (досрочном, частичном или окончательном), включая сумму премии за досрочное погашение, в случае ее выплаты эмитентом (в валюте, в которой эмитентом объявлена выплата);

47.7. По сделке с ценными бумагами, за исключением ценных бумаг, указанных в пунктах 47.2-47.3, 47.5-47.6 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, размер обязательства по передаче / требования по получению Дохода в форме денежных средств рассчитывается по формуле:

Inc = ROUND(N × (d × (1 - T) - f); 2), где	
Inc	размер обязательства по передаче / требования по получению Дохода по сделке (в валюте, в которой эмитентом объявлена выплата);
N	размер обязательства / требования Участника клиринга по ценным бумагам по сделке, указанной в пункте 47.1 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов (в штуках);
d	сумма начисления на одну ценную бумагу, установленная эмитентом ценных бумаг (в валюте, в которой эмитентом объявлена выплата);
T	налоговая ставка, примененная к соответствующему Доходу по соответствующей ценной бумаге в соответствии с налоговым законодательством страны, резидентом которой является эмитент ценной бумаги.
f	размер комиссионного вознаграждения и/или других удержаний эмитента ценных бумаг и/или иного лица, уменьшающий сумму начисления на одну ценную бумагу, установленную эмитентом ценных бумаг.

47.8. Датой исполнения обязательств по передаче / требований по получению Дохода, определенных в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, является:

- Расчетный день, следующий за датой выплаты / передачи Расчетным депозитарием Дохода, по информации, полученной от Расчетного депозитария, в случае если Доход выплачивается / передается через Расчетный депозитарий, или
- Расчетный день, следующий за датой раскрытия эмитентом ценных бумаг

информации о факте исполнения (полностью или частично) своих обязательств по выплате / передаче Дохода, в случае если Доход не выплачивается / не передается через Расчетный депозитарий.

- 47.9. Отчет об обязательствах по передаче / требованиям по получению Дохода, содержащий информацию об указанных обязательствах по каждой сделке, формируется Клиринговым центром и направляется Участникам клиринга в Дату исполнения указанных обязательств и требований.
- 47.10. В Дату исполнения обязательств по передаче / требований по получению Дохода, определенных в соответствии с пунктами 47.2-47.7 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, Клиринговый центр зачитывает встречные однородные обязательства по передаче и требования по получению Дохода по сделке, определенные в отношении одного Торгово-клирингового счета Т+ Участника клиринга.
- Обязательства по передаче / требования по получению Дохода, определенные после проведения зачета в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, учитываются в Клиринговой системе и являются обязательствами, подлежащими исполнению.
- 47.11. Клиринговый центр передает Доход Участнику клиринга, имеющему требование по получению Дохода в отношении одного или нескольких своих Торгово-клиринговых счетов Т+, в случае, если данный Участник клиринга не имеет не исполненных в установленный срок (просроченных) обязательств по передаче Дохода перед Клиринговым центром в отношении другого (других) своих Торгово-клиринговых счетов Т+.
- 47.12. Обязательства по передаче / требования по получению Дохода включаются в Клиринговый пул по Сделкам Т+ в порядке, установленном статьей 37 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.
- 47.13. Информация об исполненных обязательствах по передаче Дохода включается в Отчет об Обеспечении.

РАЗДЕЛ VI. ПОРЯДОК ОПЛАТЫ УСЛУГ. ОТЧЕТЫ ПО ИТОГАМ КЛИРИНГА

Статья 48. Особенности оплаты услуг Клирингового центра, Биржи и Технического центра

- 48.1. На фондовом рынке и рынке депозитов Клиринговый центр взимает:
- комиссионное вознаграждение за клиринг в пользу Клирингового центра;
 - комиссионное вознаграждение за операции с клиринговыми сертификатами участия в пользу Клирингового центра;
 - комиссионное вознаграждение в пользу Биржи за услуги по организации торгов на фондовом рынке и рынке депозитов;
 - вознаграждение в пользу Технического центра за предоставление интегрированного технологического сервиса (ИТС), включая дополнительное вознаграждение за предоставление ИТС, установленное документами Технического центра (далее – Дополнительное вознаграждение);
 - неустойки, установленные Правилами торгов на фондовом рынке и рынке депозитов.
- 48.1.1. В случаях, установленных Тарифами Клирингового центра, комиссионное вознаграждение за клиринг по сделкам РЕПО включает комиссионное вознаграждение за операции с клиринговыми сертификатами участия.
- 48.2. Участник клиринга исполняет обязательства по уплате комиссионных вознаграждений Биржи и Технического центра за Участников торгов, имеющих право подавать заявки с указанием Торгово-клиринговых счетов данного Участника клиринга.
- 48.3. Удержание Клиринговым центром с Участника клиринга:
- абонентской платы;
 - постоянной части комиссионного вознаграждения по сделкам РЕПО;
 - постоянной части комиссионного вознаграждения по сделкам купли-продажи;
 - комиссионного вознаграждения за предоставление по запросам Участников клиринга дубликатов отчетов по итогам клиринга, предусмотренных Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов;
 - комиссионного вознаграждения по тарифному плану «Размещения-фиксированный»;
 - дополнительного вознаграждения в случае, предусмотренном пунктом 48.15 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов;
 - комиссионного вознаграждения Биржи и Технического центра по сделкам, клиринг по которым осуществляет иная клиринговая организация;
 - комиссионного вознаграждения Клирингового центра за учет Обеспечения;
 - Возмещения,
- а также зачисление Возмещения осуществляется в отношении Расчетного кода / Счета обеспечения Т0 в российских рублях, указанного Участником клиринга в

представленном Клиринговому центру Заявлении о счете для возмещения и комиссии.

В случае непредоставления Участником клиринга Заявления о счете для возмещения и комиссии операции, указанные в настоящем пункте Правил клиринга, осуществляются в отношении основного Расчетного кода.

- 48.3.1. Удержание Клиринговым центром с Участника клиринга оборотной части комиссионного вознаграждения по сделкам с расчетами в российских рублях и в иностранной валюте осуществляется в российских рублях по Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в заявке на заключение сделки.

В Заявлении о счете для возмещения и комиссии Участником клиринга может быть указан признак, означающий, что с Расчетного кода, указанного в таком заявлении, необходимо также удерживать оборотную часть комиссионного вознаграждения по сделкам с расчетами в российских рублях и/или иностранной валюте.

- 48.3.2. Удержание Клиринговым центром с Участника клиринга комиссионного вознаграждения по сделкам, заключенным с использованием Торгово-клирингового счета имущественного пула, осуществляется с Расчетного кода, входящего в состав Торгово-клирингового счета Т+, соответствующего Торгово-клиринговому счету имущественного пула, указанного в заявке на заключение сделки.

- 48.3.3. Неустойки, установленные Правилами торгов на фондовом рынке и рынке депозитов, удерживаются с Расчетного кода / Счета обеспечения Т0, входящего в состав Торгово-клирингового счета, указанного в заявке на заключение сделки.

- 48.3.4. Расчетный код / Счет обеспечения Т0, определенный в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, далее именуется Счетом для возмещения и комиссии.

- 48.4. В случае получения от Расчетной организации информации о закрытии и/или невозможности проведения операций по торговому банковскому счету, к которому открыт Счет обеспечения Т0, являющийся Счетом для возмещения и комиссии, включая получение от Расчетной организации уведомления о приостановлении или прекращении участия Участника клиринга / клиента Участника клиринга в платежной системе Расчетной организации, Клиринговый центр вправе установить в качестве Счета для возмещения и комиссии любой собственной Расчетный код.

- 48.5. Размер обязательства Участника торгов / Участника клиринга по уплате комиссионного вознаграждения по биржевым сделкам РЕПО, по биржевым сделкам купли-продажи акций и по биржевым сделкам купли-продажи облигаций федерального займа, а также комиссионного вознаграждения за операции с клиринговыми сертификатами участия рассчитывается с учетом выбранного Участником торгов / Участником клиринга тарифного плана.

- 48.5.1. Выбор или изменение тарифного плана осуществляется Участником торгов / Участником клиринга путем предоставления Клиринговому центру соответствующего Заявления о выборе (смене) тарифного плана.

Тарифные планы применяются с первого числа календарного месяца, за исключением тарифного плана REPO_0 (по биржевым сделкам РЕПО) и Тарифного плана 1 (по биржевым сделкам купли-продажи акций и по биржевым сделкам

купли-продажи облигаций федерального займа), которые, в случае первоначального допуска к клиринговому обслуживанию, могут применяться с любого числа календарного месяца.

Заявление о выборе (смене) тарифного плана предоставляется в Клиринговый центр не позднее, чем за 5 (пять) рабочих дней до первого числа месяца, начиная с которого будет действовать выбранный тарифный план, за исключением случаев первоначального допуска к торгам / клиринговому обслуживанию.

- 48.5.2. Участником торгов / Участникам клиринга, не выбравшим ни один из тарифных планов, устанавливается тарифный план РЕПО_0 по биржевым сделкам РЕПО, и/или Тарифный план 1 по биржевым сделкам купли-продажи акций, и/или Тарифный план 1 по биржевым сделкам купли-продажи облигаций федерального займа, который, в случае первоначального допуска к торгам / клиринговому обслуживанию, устанавливается с даты допуска Участника торгов к торгам / Участника клиринга к клиринговому обслуживанию и действует до начала применения иного тарифного плана, выбранного Участником торгов / Участником клиринга.
- 48.6. В случае выбора Участником торгов / Участником клиринга тарифного плана по сделкам РЕПО или по сделкам купли-продажи акций, содержащего постоянную часть комиссионного вознаграждения, такая постоянная часть комиссионного вознаграждения, а также постоянная часть комиссионного вознаграждения по биржевым сделкам купли-продажи облигаций, еврооблигаций, депозитарных расписок на облигации подлежит уплате Участником клиринга в первый Расчетный день календарного месяца, за который взимается постоянная часть Комиссионного вознаграждения, и, по окончании Торгов в данный Расчетный день, включается в состав определяемого для последнего в течение Расчетного дня Клирингового пула для расчетов в ходе торгов Нетто-обязательства по сделкам клирингового пула по денежным средствам по Счету для возмещения и комиссии, порядок определения которого установлен пунктом 48.3 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.
- 48.7. Обратная часть комиссионного вознаграждения по биржевым сделкам РЕПО, по сделкам купли-продажи акций, по биржевым сделкам купли-продажи облигаций, еврооблигаций, депозитарных расписок на облигации, а также комиссионное вознаграждение по биржевым сделкам купли-продажи облигаций, еврооблигаций, депозитарных расписок, процедура контроля обеспечения по которым осуществляется по Счету обеспечения T0, рассчитывается при подаче заявки на заключение сделки (при наступлении времени активации заявки в случае его наличия), на ее сумму уменьшается сумма денежных средств, учитываемая по такому Счету обеспечения T0, порядок определения которого установлен пунктом 48.3 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.
- 48.8. Комиссионное вознаграждение за операции с клиринговыми сертификатами участия, не включенное в состав комиссионного вознаграждения за клиринг по сделкам РЕПО, рассчитывается и взимается в Расчетный день, следующий за днем оказания услуги, по окончании Торгов в данный Расчетный день.
- 48.9. Премия предоставляется по итогам календарного месяца Участникам торгов / Участникам клиринга, выполнившим условия, необходимые для получения премии, предусмотренные Тарифами Клирингового центра и Тарифами Биржи.

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

Премия перечисляется Участнику торгов / Участнику клиринга Биржей и Клиринговым центром на Счет для возмещения и комиссии, порядок выбора которого установлен пунктом 48.3 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, не позднее третьего Расчетного дня месяца, следующего за месяцем оказания клиринговых услуг.

- 48.10. Комиссионное вознаграждение по внебиржевым сделкам рассчитывается и взимается по окончании Торгов в дату регистрации Поручения на клиринг внебиржевой сделки по Счету обеспечения Т0, соответствующего торговому банковскому счету, указанному в Поручении на клиринг внебиржевой сделки (за исключением внебиржевых сделок, заключаемых в иностранной валюте).
- 48.11. Абонентская плата, определенная в соответствии с Тарифами Биржи, подлежит уплате Участником торгов в первый Расчетный день календарного квартала, следующего за кварталом, за который взимается абонентская плата, по окончании Торгов в данный Расчетный день.
- 48.12. Неустойка, установленная Правилами торгов на фондовом рынке и рынке депозитов, взимается Клиринговым центром в Расчетный день нарушения Участником торгов обязательства, за которое установлена соответствующая неустойка, по окончании Торгов в данный Расчетный день.
- 48.13. Комиссионное вознаграждение за предоставление по запросам Участников клиринга дубликатов отчетов по итогам клиринга, предусмотренных Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, подлежат уплате Участником клиринга в день предоставления указанных дубликатов, по окончании Торгов в данный Расчетный день, по Расчетному коду / Счету обеспечения Т0, указанному Участником клиринга в запросе на предоставление дубликатов отчетов по итогам клиринга.
- 48.14. Участник торгов / Участник клиринга вправе выбрать тарифный план «Размещения-фиксированный».

Выбор тарифного плана «Размещения-фиксированный» осуществляется на основании Заявления о выборе тарифного плана «Размещения-фиксированный» предоставленного Участником торгов / Участником клиринга в бумажной форме.

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

Период действия тарифного плана «Размещения-фиксированный» составляет 12 (двенадцать) календарных месяцев, начиная с первого числа месяца, указанного в заявлении.

В случае выбора Участником торгов / Участником клиринга тарифного плана «Размещения-фиксированный» Участник торгов / Участник клиринга уплачивает Комиссионное вознаграждение Биржи, Клирингового центра и вознаграждение

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

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

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

- 48.15. Определенное в соответствии с Тарифами Технического центра, отличное от нуля Дополнительное вознаграждение, рассчитанное в отношении Участника торгов / Клиента, подлежит уплате Участником торгов в Расчетный день, по итогам которого указанное дополнительное вознаграждение рассчитано, по окончании Торгов в данный Расчетный день, по Счету обеспечения Т0 / Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета, с указанием которого Участником торгов в течение данного Расчетного дня были поданы заявки на заключение сделок за свой счет или за счет указанного Клиента, если такой Торгово-клиринговый счет – единственный, либо по Счету для возмещения и комиссии, порядок определения которого установлен пунктом 48.3 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, если Участником торгов в течение данного Расчетного дня были поданы заявки на заключение сделок за свой счет или за счет указанного Клиента с указанием нескольких Торгово-клиринговых счетов.
- 48.16. Комиссионное вознаграждение Клирингового центра за учет индивидуального клирингового и иного обеспечения удерживается Клиринговым центром с Участника клиринга по Расчетному коду, указанному Участником клиринга в Заявлении о счете для возмещения и комиссии (в случае предоставления указанного заявления) либо основному Расчетному коду.
- 48.17. Комиссионное вознаграждение Биржи и Технического центра по сделкам, клиринг по которым осуществляет иная клиринговая организация, рассчитывается при подаче заявки на заключение сделки, на его сумму уменьшается сумма денежных средств, учитываемая по Счету для возмещения и комиссии, порядок определения которого установлен пунктом 48.3 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

Клиринговый центр взимает комиссионное вознаграждение Биржи и Технического центра по сделкам, клиринг по которым осуществляет иная клиринговая организация, только с Участников клиринга, являющихся Участниками торгов.

- 48.18. Обязательства Участника торгов / Участника клиринга по уплате комиссионного вознаграждения и неустоек исполняются за счет денежных средств, учитываемых по соответствующему Расчетному коду / Счету обеспечения Т0, после исполнения обязательств Участника клиринга по денежным средствам, определенных в соответствии со статьей 43 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.
- 48.19. В Дату исполнения обязательств по уплате соответствующих комиссионных вознаграждений в срок, установленный Временным регламентом на фондовом рынке и рынке депозитов, Клиринговый центр проверяет достаточность денежных средств Участника клиринга в российских рублях для исполнения обязательства по уплате комиссионных вознаграждений.
- 48.20. В случае недостаточности денежных средств на соответствующем Счете обеспечения Т0 для исполнения обязательств Участника торгов / Участника клиринга по уплате комиссионного вознаграждения, указанные обязательства исполняются в следующей очередности:
- в первую очередь исполняются обязательства по уплате комиссионного вознаграждения, начисленного в предыдущие Расчетные дни;
 - во вторую очередь – обязательства по уплате неустойки, установленные Правилами торгов на фондовом рынке и рынке депозитов;
 - в третью очередь - обязательства по уплате комиссионного вознаграждения, начисленного в текущий Расчетный день.

В случае недостаточности денежных средств на соответствующем Счете обеспечения Т0 для исполнения обязательств Участника торгов / Участника клиринга по уплате комиссионного вознаграждения соответствующей очереди, обязательства, входящие в соответствующую очередь, исполняются с учетом следующих приоритетов по видам комиссионного вознаграждения:

- 1) оборотная часть комиссионного вознаграждения;
- 2) постоянные части комиссионных вознаграждений;
- 3) комиссионное вознаграждение по тарифному плану «Размещения – фиксированный»;
- 4) комиссионное вознаграждение за учет клирингового обеспечения;
- 5) дополнительное вознаграждение;
- 6) абонентская плата;
- 7) комиссионное вознаграждение за предоставление дубликатов отчетов по итогам клиринга;
- 8) комиссионное вознаграждение Биржи и Технического центра по сделкам, клиринг по которым осуществляет иная клиринговая организация.

В случае недостаточности денежных средств на соответствующем Счете обеспечения Т0 для исполнения обязательств Участника торгов / Участника клиринга по уплате комиссионного вознаграждения соответствующей очереди и соответствующего вида, обязательства по уплате соответствующего вида комиссионного вознаграждения, входящие в соответствующую очередь, исполняются с учетом следующих приоритетов по получателям комиссионного вознаграждения:

- 1) Клиринговый центр;

- 2) Биржа;
- 3) Технический центр.

48.21. Обеспечение Участника клиринга в российских рублях является достаточным для исполнения обязательств по уплате комиссионных вознаграждений, учитываемых по Расчетному коду Участника клиринга, если размер Обеспечения Участника клиринга в российских рублях, учитываемого по такому Расчетному коду, не меньше, чем размер указанных обязательств.

48.21.1. Для исполнения обязательства по уплате комиссионных вознаграждений, учитываемых по Расчетному коду Участника клиринга, Клиринговый центр зачитывает соответствующее обязательство с требованием Участника клиринга по возврату денежных средств в российских рублях, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга в российских рублях по такому Расчетному коду Участника клиринга.

При этом размер Обеспечения Участника клиринга в российских рублях, учитываемого по Расчетному коду, уменьшается на сумму исполненного обязательства.

48.21.2. Обязательства Участника клиринга по уплате комиссионных вознаграждений, учитываемые по Расчетному коду, для исполнения которых недостаточно Обеспечения в российских рублях, учитываются как Задолженность Участника клиринга перед Клиринговым центром по такому Расчетному коду.

48.21.3. Указанная Задолженность Участника клиринга урегулируется в порядке, установленном статьей 38 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

Статья 49. Порядок представления отчетов по итогам клиринга

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

- Выписка из реестра сделок, принятых в клиринг, содержащая информацию об обязательствах по сделкам, допущенных к клирингу;
- Выписка из реестра неисполненных сделок;
- Выписка из протокола исполнения сделок и обязательств по внесению компенсационных взносов, содержащая информацию о допущенных к клирингу обязательствах по внесению компенсационных взносов;
- Отчет по обязательствам Участника клиринга по комиссионному вознаграждению;
- Отчет о торгово-клиринговых счетах Участника клиринга;
- Отчет о Клиринговых идентификаторах Участника клиринга;
- Выписка из протокола внесения компенсационных взносов;
- Уведомление о замене Торгово-клирингового счета;
- Отчет об обязательствах по Сделкам Т+, содержащий информацию о допущенных к клирингу обязательствах по Сделкам Т+;
- Отчет об Итоговых нетто-обязательствах / нетто-требованиях, содержащий информацию об обязательствах по Сделкам Т+, определенных по результатам клиринга;

- Отчет об Обеспечении, содержащий информацию о размере Обеспечения Участника клиринга в денежных средствах и ценных бумагах и об изменении размера такого Обеспечения;
- Отчет об имуществе, внесенном в имущественные пулы;
- Отчет об обязательствах по передаче / требованиям по получению Дохода;
- Отчет о гарантийных фондах;
- Отчет об обеспечении под стресс;
- Требование о погашении Задолженности;
- Отчет о Маржинальном требовании;
- Отчет о премии;
- Отчет о нормативной стоимости клиринговых сертификатов участия, содержащий информацию об отношении стоимости всего имущества в каждом имущественном пуле, рассчитанной с учетом дисконтов, установленных Банком России для расчета обязательных нормативов банков, к суммарной номинальной стоимости всех выданных клиринговых сертификатов участия такого имущественного пула;
- Отчет о движении денежных средств.

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

- 49.2. Для клиентов Участника клиринга Клиринговый центр формирует Выписку из реестра сделок, принятых в клиринг (по сделкам клиентов), содержащую информацию о допущенных к клирингу обязательствах по сделкам, заключенным за счет клиента Участника клиринга, для которого формируется отчет.

Указанный отчет направляется Участнику клиринга (для передачи их клиенту Участника клиринга) и/или уполномоченной им организации.

Для Держателей Клиринговый центр формирует Отчет о дополнительных торговых разделах, открытых для проведения операций Участниками клиринга, и иных реквизитах.

Указанный отчет направляется Держателям и/или уполномоченным ими организациям.

- 49.3. В случае предоставления Участником клиринга Клиринговому центру Заявления о предоставлении отчетов Держателю, для Держателя, указанного в заявлении, Клиринговый центр формирует Выписку из реестра сделок, принятых в клиринг (для Держателей), содержащую информацию о допущенных к клирингу обязательствах по сделкам, заключенным Участником клиринга с указанием Торгово-клиринговых счетов, в состав которых входят позиции по ценным бумагам, определяемые в отношении торговых разделов Держателя.

Указанный отчет направляется Держателю и/или уполномоченной им организации.

- 49.4. В случае предоставления Участником клиринга Клиринговому центру Заявления о предоставлении отчетов Клиринговому банку, для Клирингового банка, указанного в заявлении, Клиринговый центр формирует Выписку из реестра сделок, принятых в клиринг (для Клиринговых банков), содержащую информацию о допущенных к клирингу обязательствах по сделкам, заключенным Участником клиринга с

указанием Торгово-клиринговых счетов, в состав которых входят позиции по денежным средствам, определяемые в отношении торговых банковских счетов Клирингового банка.

Указанный отчет направляется Клиринговому банку.

49.5. Отчеты, указанные в пунктах 49.1 и 49.2 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, направляются Участнику клиринга (Держателю, Клиринговому банку) в форме электронных документов в соответствии с Порядком ЭДО.

49.6. Отчеты, направляемые в форме электронных документов, имеют категорию «В»² и составляются в текстовом формате (ASCII) в соответствии с Порядком ЭДО.

49.7. Отчеты в форме электронных документов направляются Участнику клиринга / Держателю / Клиринговому банку ежедневно при условии совершения им (по его поручению / с использованием его торговых разделов (торговых банковских счетов)) операций в Клиринговой системе.

Отчет о торгово-клиринговых счетах и иных реквизитах Участника клиринга и Отчет о дополнительных торговых разделах, открытых для проведения операций Участниками клиринга направляются, соответственно, Участнику клиринга и Держателю дополнительно каждый первый Расчетный день месяца.

Отчеты о премии направляются Участникам клиринга, выполнившим условия, необходимые для получения премии по итогам календарного месяца, в первый Расчетный день месяца, следующего за отчетным.

Отчет о Клиринговых идентификаторах направляется Участнику клиринга дополнительно каждый первый Расчетный день месяца.

49.8. Участнику клиринга на основании его письменного запроса могут быть выданы повторно отчеты в бумажной форме или в форме электронных документов, а также отчеты, не предусмотренные пунктами 49.1 и 49.2 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов (далее - нестандартные отчеты), в бумажной форме.

49.9. Для получения в бумажной форме отчетов, указанных в пункте 49.8 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, Участник клиринга обязан предоставить Клиринговому центру Доверенность на получение и предоставление документов.

49.10. Отчеты в бумажной форме или в форме электронных документов, указанные в пункте 49.8 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, а также нестандартные отчеты в бумажной форме предоставляются/направляются Участникам клиринга в течение 5-ти рабочих дней после получения Клиринговым центром от Участника клиринга соответствующего запроса.

49.11. В случае обнаружения ошибок Клиринговый центр имеет право сформировать и направить Участникам клиринга исправленные отчеты. При этом правильным

² Понятие категории электронного документа определяется в Правилах ЭДО

отчетом считается отчет, имеющий более позднюю дату и время формирования отчета.

- 49.12. Формы и форматы отчетов, предоставляемых Клиринговым центром в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, установлены документом «Формы и форматы отчетов, предоставляемых Участникам клиринга, клиентам Участников клиринга, Держателям и Клиринговым банкам на фондовом рынке и рынке депозитов», раскрываемом на Сайте Клирингового центра.

РАЗДЕЛ VII. ПРОЧИЕ УСЛОВИЯ

Статья 50. Особенности Перевода обязательств и Обеспечения одного Участника клиринга другому Участнику клиринга

50.1. При Переводе обязательств и Обеспечения Участника пула также осуществляется уступка прав и перевод долга по договору об имущественном пуле, а также передача имущества Обособленного клиента, внесенного Базовым Участником клиринга в имущественный пул.

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

Согласие на прием может содержать информацию о Торгово-клиринговых счетах и Расчетных кодах, 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.

50.3. 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 Раздел, открытый Участником клиринга – реципиентом для обособленного учета Обеспечения в ценных бумагах Обособленного клиента в соответствии с требованием общей части Правил клиринга, если в Согласии на прием Торгово-клиринговый счет Участника клиринга – реципиента не был указан;
- для Обособленных клиентов – владельцев клиринговых сертификатов участия, регистрирует Торгово-клиринговый счет имущественного пула;
- направляет Расчетному депозитарию распоряжение на перевод ценных бумаг с Раздела(-ов) / субсчетов депо имущественного пула, входящего(-их) в состав Торгово-клирингового(-ых) счета(-ов) / Торгово-клиринговых счетов имущественного пула Базового Участника клиринга, открытого(-ых) для такого Обособленного клиента, на Раздел(-ы) / субсчета депо имущественного пула, входящий(-ие) в состав Торгово-клирингового(-ых) счета(-ов) / Торгово-клирингового счета имущественного пула Участника клиринга – реципиента.

50.4. После завершения процедуры Перевода обязательств и Обеспечения Клиринговый центр закрывает Торгово-клиринговые счета / Торгово-клиринговые счета

имущественного пула, открытые Базовым Участником клиринга для Обособленного клиента.

Приложение № 1
к Правилам клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов

**Документы, предоставляемые юридическим лицом для получения
статуса Держателя**

I. Список документов, предоставляемых юридическим лицом – Резидентом

- 1) Заверенные подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии) копии учредительных документов юридического лица с изменениями и дополнениями с отметкой о регистрации федеральным органом исполнительной власти, уполномоченным на осуществление государственной регистрации юридических лиц.
- 2) Заверенные подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии) копии свидетельств о внесении записей в Единый государственный реестр юридических лиц (ЕГРЮЛ), выданных уполномоченным органом, осуществляющим государственную регистрацию юридических лиц, и подтверждающую факт внесения в ЕГРЮЛ записей о государственной регистрации юридического лица (либо о юридическом лице, зарегистрированном до 1 июля 2002 года).
- 3) Заверенная подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии) копия свидетельства о постановке на учет в налоговом органе юридического лица.
- 4) Заверенная подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии) копия решения уполномоченного органа юридического лица (также могут быть предоставлены заверенная подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии) выписка из решения или подлинник выписки, заверенный подписью лица, уполномоченного на подписание решения) об избрании (назначении) единоличного исполнительного органа.
- 5) Оригинал доверенности, или нотариально удостоверенная копия, или копия, заверенная лицом, выдавшим указанную доверенность на представителя юридического лица, уполномоченного осуществлять прием и передачу информации и отчетных документов от имени юридического лица во взаимоотношениях с Клиринговым центром, включая полномочия по подписанию необходимых документов.
- 6) Согласие лиц, указанных в документах юридического лица, направляемых им в Клиринговый центр в соответствии с Правилами клиринга, на обработку персональных данных по форме, размещенной на Сайте Клирингового центра (в случае, если документы содержат персональные данные субъекта персональных данных в соответствии с Федеральным законом «О персональных данных» и если иное не вытекает из требований законодательства).
- 7) Иные документы, которые могут быть запрошены Клиринговым центром в необходимых случаях, также Клиринговый центр вправе потребовать уточнения информации, содержащейся в ранее предоставленных документах.

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

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

II. Список документов, предоставляемых юридическим лицом – Нерезидентом

- 1) Действующие редакции учредительных документов и все изменения к ним.
- 2) Документ, подтверждающий государственную регистрацию юридического лица.
- 3) Документ о постановке на учет в налоговом органе юридического лица (при наличии).
- 4) Документ, подтверждающий постановку юридического лица на налоговый учет в Российской Федерации (копия, верность которой засвидетельствована нотариусом или самим юридическим лицом) (при наличии).
- 5) Документ уполномоченного органа юридического лица, подтверждающий избрание (назначение) лица, уполномоченного действовать от имени юридического лица в соответствии с учредительными документами.
- 6) Доверенности на представителей юридического лица, уполномоченных осуществлять прием и передачу информации и отчетных документов от имени юридического лица во взаимоотношениях с Клиринговым центром, включая полномочия по подписанию необходимых документов.
- 7) Согласие лиц, указанных в документах юридического лица, направляемых им в Клиринговый центр в соответствии с Правилами клиринга, на обработку персональных данных по форме, размещенной на Сайте Клирингового центра (в случае, если документы содержат персональные данные субъекта персональных данных в соответствии с Федеральным законом «О персональных данных» и если иное не вытекает из требований законодательства).
- 8) Иные документы, которые могут быть запрошены Клиринговым центром в необходимых случаях, также Клиринговый центр вправе потребовать уточнения информации, содержащейся в ранее предоставленных документах.

Документы, составленные на территории иностранных государств, должны быть легализованы или апостилированы, если иное не предусмотрено международными договорами Российской Федерации.

Документы, составленные полностью или в какой-либо их части на иностранном языке, должны быть переведены на русский язык. Верность перевода или подлинность подписи переводчика должна быть засвидетельствована нотариусом.

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

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

Приложение № 2
к Правилам клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов

Временной регламент на фондовом рынке и рынке депозитов

№ п/п	Наименование операции	Время (московское)
1.	Получение от Расчетного депозитария выписки по Разделам / субсчетах депо.	до 9:30
2.	Операции по сделкам с ценными бумагами	
2.1.	Процедура контроля обеспечения.	9:30– 19:00
2.2.	Период регистрации поручений. Получение Клиринговым центром от Участников клиринга Специальных и Срочных отчетов на исполнение.	9:30 – 18:30
2.3.	Период регистрации поручений. Получение Клиринговым центром от Участников клиринга Отчетов на исполнение, Поручений на внесение компенсационных взносов и Поручений на отказ от компенсационных взносов по сделкам.	9:30 – 19:00
2.4.	Период регистрации поручений. Получение Клиринговым центром от Участников клиринга Поручений на клиринг внебиржевых сделок.	9:30 – 19:00
2.5.	Процедура контроля обеспечения по сделкам с отложенной датой активации.	В дату активации во время, установленное по согласованию с Биржей
2.6.	Направление Клиринговым центром Расчетному депозитарию запроса на отмену ранее направленного Запроса на подбор ценных бумаг.	в случае неполучения от Расчетного депозитария Ответа на запрос на подбор ценных бумаг в течение 15 минут после направления запроса
2.7.	Направление Клиринговым центром Банку России запроса на отмену ранее направленного инкассового поручения.	в случае неисполнения инкассового поручения в течение 15 минут после направления его Банку России
3.	Время (сроки) проведения клиринговых сессий	
3.1.	Проведение клиринговой сессии mark-to-market.	до 10:00 Расчетного дня
3.2.	Проведение первой расчетной клиринговой сессии.	с 17:30 до 18:00
3.3.	Проведение второй расчетной клиринговой сессии.	с 19:00 до 20:00
3.4.	Проведение третьей расчетной клиринговой сессии.	с 20:00 до 20:45
4.	Время (сроки) внесения и возврата Обеспечения	
4.1.	Зачисление денежных средств на клиринговый банковский или корреспондентский счет Клирингового центра для учета в текущем Расчетном дне.	до 21:00
4.2.	Передача Участником клиринга Клиринговому центру распоряжений на перевод денежных средств с целью внесения / возврата Обеспечения (с использованием Клиринговой системы).	с 09:30 до 20:00 Расчетного дня
4.3.	Передача Участником клиринга Клиринговому центру распоряжений на перевод ценных бумаг с целью внесения / возврата Обеспечения (с использованием Клиринговой системы).	с 09:30 до 20:30 Расчетного дня
4.4.	Передача Участником клиринга Клиринговому центру распоряжений	с 09:30 до 19:00

	на перевод денежных средств / ценных бумаг с целью внесения имущества в имущественный пул / выдачи имущества из имущественного пула (с использованием Клиринговой системы).	Расчетного дня
4.5.	Передача Участником клиринга Клиринговому центру Запросов о возврате с целью выдачи имущества из имущественного пула.	до 19:00 Расчетного дня
4.6.	Прием Клиринговым центром от Участников клиринга Запросов о возврате и Запросов о депонировании денежных средств:	
	- евро, фунтах стерлингов;	до 17:00 Расчетного дня
	- долларов США, российских рублей.	до 20:00 Расчетного дня
4.7.	Исполнение Постоянных поручений на возврат, содержащих признак, указывающий на необходимость возврата всей доступной суммы денежных средств, для внешних платежей ¹ в:	
	- евро, фунтах стерлингов;	17:40 ² / 18:40
	- долларах США, российских рублях.	20:00
4.8.	Исполнение Постоянных поручений на возврат, содержащих признак, указывающий на необходимость возврата всей доступной суммы денежных средств, для внутренних платежей ¹ в:	
	- евро, фунтах стерлингов;	19:00 ² / 20:00
	- долларах США, российских рублях.	20:00
4.9.	Возврат Клиринговым центром Участникам клиринга денежных средств, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга, на основании Запроса о возврате / Постоянного поручения на возврат ³ .	в являющийся Расчетным днем день получения Запроса о возврате / в Расчетный день
5.	Сроки исполнения обязательств	
5.1.	Исполнение Маржинальных требований, Маржинальных требований по пулу.	До 17:30 дня возникновения Маржинального требования
5.2.	Начисление пени за наличие Задолженности.	20:00 Расчетного дня возникновения Задолженности
5.3.	Погашение Задолженности.	до 20:00 Расчетного дня, следующего за днем возникновения Задолженности
5.4.	Формирование первого Клирингового пула по Сделкам T+.	16:00
5.4.1.	Формирование первого Клирингового пула по Сделкам T+ в отношении Участников клиринга, которыми превышено количество Расчетных дней, в течение которых у Участника клиринга может возникнуть Задолженность, или Итоговое нетто-обязательство по ценной бумаге, для исполнения которого недостаточно ценных бумаг, или отрицательный Единый лимит по Расчетному коду, входящий в состав Торгово-клирингового счета T+, по которому учитывается Итоговое нетто-требование в ценных бумагах, не принимаемых в качестве обеспечения исполнения обязательств по Сделкам T+.	10:00
5.5.	Исполнение Участниками клиринга Итоговых нетто-обязательств, определенных в первом Клиринговом пуле по Сделкам T+.	17:00 Даты исполнения
5.5.1.	Исполнение Итоговых нетто-обязательств, определенных в первом Клиринговом пуле по Сделкам T+, Участниками клиринга, которыми превышено количество Расчетных дней, в течение которых у Участника клиринга может возникнуть Задолженность, или Итоговое	10:00 Даты исполнения

	нетто-обязательство по ценной бумаге, для исполнения которого недостаточно ценных бумаг, или отрицательный Единый лимит по Расчетному коду, входящий в состав Торгово-клирингового счета T+, по которому учитывается Итоговое нетто-требование в ценных бумагах, не принимаемых в качестве обеспечения исполнения обязательств по Сделкам T+.	
5.6.	Формирование второго Клирингового пула по Сделкам T+.	19:00
5.7.	Исполнение Участниками клиринга Итоговых нетто-обязательств, определенных во втором Клиринговом пуле по Сделкам T+.	19:00 Даты исполнения
5.8.	Исполнение Участниками клиринга обязательств по уплате комиссионных вознаграждений по Сделкам T+, в т.ч. по депозитным договорам, заявки на заключение которых внесены в реестр предложений.	до 19:40 дня заключения сделки / внесения заявки на заключение депозитных договоров в реестр предложений
5.9.	Формирование третьего Клирингового пула по Сделкам T+.	20:00
5.10.	Исполнение Участниками клиринга обязательств по уплате комиссионного вознаграждения за клиринговую услугу по обеспечению возможности заключения депозитного договора в следующий Расчетный день и обязательств по уплате отступного за непредоставление Обеспечения в сумме депозита.	до 20:00 дня начисления комиссионного вознаграждения / отступного
6.	Сроки предоставления отчетов по итогам клиринга	
6.1.	Передача Клиринговым центром Участникам клиринга Требований о погашении задолженности, Отчетов об Обеспечении, Отчетов об обязательствах по Сделкам T, Отчетов об имуществе, внесенном в имущественные пулы, Отчета о нормативной стоимости клиринговых сертификатов участия и иных отчетов, предусмотренных статьей 49 Правил клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, за исключением Отчетов о Маржинальных требованиях.	до 9:00
6.2.	Передача Клиринговым центром Участникам клиринга Отчетов о Маржинальных требованиях.	9:30 – 10:00
6.3.	Передача Клиринговым центром Участникам клиринга Отчета по обязательствам Участника клиринга по комиссионному вознаграждению, содержащего информацию о сумме отступного за непредоставление Обеспечения в сумме депозита.	до 19:15 дня начисления отступного

¹ – под внутренним платежом понимается возврат денежных средств в иностранной валюте на Счет для возврата, открытый в кредитной организации, являющейся Расчетным банком по такой иностранной валюте, под внешним платежом - возврат денежных средств в иностранной валюте на Счет для возврата, открытый в кредитной организации, не являющейся Расчетным банком по такой иностранной валюте.

² – в период действия летнего времени на территории Европейского союза.

³ - зачисление на Счет для возврата будет произведено в соответствии со сроками исполнения распоряжений в иностранной валюте по корреспондентским счетам Расчетного банка, опубликованными на официальном сайте Расчетного банка в сети Интернет.

Все иные документы передаются Клиринговому центру и/или предоставляются Клиринговым центром в процессе взаимодействия Клирингового центра с Участниками клиринга с 9:00 до 19:00 по московскому времени по Расчетным дням.

Приложение №3
к Правилам клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов

**Порядок изменения значений клиринговых регистров
Счет обеспечения T0 и Торгово-клиринговый счет T0**

Обозначения, используемые в таблицах:

S – сумма операции, указанная в заявке, запросе или реестре (в рублях, если не указано иное).

V – объем операции, указанный в заявке, запросе, сделке или реестре (в шт. ценных бумаг).

K – сумма комиссионного вознаграждения, рассчитанная по заявке (в рублях).

Сделки - сумма операции в соответствии с условиями сделки (в рублях, если не указано иное), где Сделки $\leq S$ для заявок на покупку, Сделки $\geq S$ для заявок на продажу.

Ксделки – сумма комиссионного вознаграждения (в рублях), рассчитанная по сделке, где Ксделки $\leq K$ для заявок на покупку, Ксделки $\geq K$ для заявок на продажу.

↑ - увеличение.

↓ - уменьшение.

1. Порядок изменения информации о денежных средствах

№	Операция	Значение суммы денежных средств (в соответствующей валюте), учитываемое по Счету обеспечения T0
1.	Исполнение Расчетной организацией распоряжения на перевод денежных средств с торговых банковских счетов на клиринговый банковский счет после получения от Расчетной организации выписки по торговым банковским счетам (S – сумма денежных средств, учитываемых на торговом банковском счете)	$= S$
2.	Зачисление / списание денежных средств	
2.1.	Зачисление денежных средств на клиринговый банковский счет после увеличения суммы денежных средств на торговом банковском счете на сумму S	↑ на S
2.2.	Исполнение распоряжения Участника клиринга или Клирингового центра на перевод денежных средств со Счета обеспечения T0 с использованием Клиринговой системы	↓ на S
2.3.	Списание денежных средств со Счета обеспечения T0 на основании Заявления о порядке использования денежных средств и ценных бумаг в сумме, недостающей для исполнения Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам либо в размере Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам.	↓ на S
2.4.	Исполнение распоряжения Участника клиринга на перевод денежных средств со Счета обеспечения T0.	↓ на S
2.5.	Исполнение распоряжения Участника клиринга на перевод денежных средств на Счет обеспечения T0.	↑ на S
2.6.	Списание в ходе Торгов денежных средств с торгового банковского счета на основании запроса Расчетной организации	↓ на S
2.7.	Возврат денежных средств на Счет обеспечения T0 в размере Итогового нетто-требования Участника клиринга по денежным средствам на основании Заявления о порядке использования денежных средств и ценных бумаг	↑ на S

3.	Регистрация и снятие заявок на заключение сделок с кодом расчетов T0, Z0, X0, Rb, B0 – B30, Sn	
3.1.	Регистрация заявки на покупку на заключение сделки с кодом расчетов T0, Rb; $X=S+K$ (здесь и далее – в российских рублях, если не указано иное)	↓ на X
3.2.	Регистрация заявки на покупку на заключение сделки купли-продажи или сделки РЕПО с кодом расчетов Z0, X0; $X=S+K$	↓ на X
3.3.	Регистрация заявки на продажу на заключение сделки купли-продажи или сделки РЕПО с кодом расчетов Z0, X0	↓ на K
3.4.	Регистрация заявки на покупку / продажу на заключение сделки с кодом расчетов B0 – B30, Sn	↓ на K
3.5.	Регистрация заявки на покупку на заключение сделки с кодом расчетов T0, Rb в иностранной валюте; S – в иностранной валюте, K – в российских рублях; позиции в иностранной валюте и в российских рублях проверяются и изменяются отдельно	↓ на S ↓ на K
3.6.	Регистрация заявки на покупку на заключение сделки купли-продажи или сделки РЕПО с кодом расчетов Z0, X0 в иностранной валюте; S – в иностранной валюте, K – в российских рублях; позиции в иностранной валюте и в российских рублях проверяются и изменяются отдельно	↓ на S ↓ на K
3.7.	Регистрация заявки на покупку на заключение сделки с кодом расчетов B0 – B30, Sn в иностранной валюте; S – в иностранной валюте, K – в российских рублях	↓ на K
3.8.	Регистрация заявки на продажу на заключение сделки с любым кодом расчетов в иностранной валюте; S – в иностранной валюте, K – в российских рублях	↓ на K
3.9.	Снятие заявки на покупку на заключение сделки с кодом расчетов T0, Rb в российских рублях; $X=S+K$	↑ на X
3.10.	Снятие заявки на покупку на заключение сделки купли-продажи или сделки РЕПО с кодом расчетов Z0, X0; $X=S+K$	↑ на X
3.11.	Снятие заявки на продажу на заключение сделки купли-продажи или сделки РЕПО с кодом расчетов Z0, X0	↑ на K
3.12.	Снятие заявки на покупку на заключение сделки купли-продажи или сделки РЕПО с кодом расчетов Z0, X0 в иностранной валюте; S – в иностранной валюте, K – в российских рублях	↑ на S ↑ на K
3.13.	Снятие заявки на покупку / продажу на заключение сделки с кодом расчетов B0 – B30, Sn, в российских рублях и иностранной валюте	↑ на K
3.14.	Снятие заявки на покупку на заключение сделки с кодом расчетов T0, Rb в иностранной валюте; S – в иностранной валюте, K – в российских рублях	↑ на S ↑ на K
3.15.	Снятие заявки на продажу на заключение сделки с любым кодом расчетов в иностранной валюте; S – в иностранной валюте, K – в российских рублях	↑ на K
4.	Заключение сделок с кодом расчетов T0, Rb, K0	
4.1.	Заключение сделки по заявке на продажу с кодом расчетов T0, Rb, K0, в российских рублях; $X=Сделки - Ксделки$	↑ на X
4.2.	Заключение сделки по заявке на покупку с кодом расчетов T0, Rb, в российских рублях;	↑ на X

	$X = S - \text{Сделки} + (K - \text{Ксделки})$	
4.3.	Заключение сделки по заявке на покупку с кодом расчетов K0, в российских рублях; $X = \text{Сделки} + \text{Ксделки}$	↓ на X
4.4.	Заключение сделки по заявке на продажу с кодом расчетов T0, K0, Rb в иностранной валюте; S – в иностранной валюте	↑ на S
4.5.	Заключение сделки по заявке на покупку с кодом расчетов T0, Rb в иностранной валюте; $X = S - \text{Сделки}$ (в иностранной валюте) $Y = (K - \text{Ксделки})$ (в российских рублях)	↑ на X ↑ на Y
4.6.	Заключение сделки по заявке на покупку с кодом расчетов K0 в иностранной валюте; Сделки – в иностранной валюте, Ксделки – в российских рублях	↓ на Сделки ↓ на Ксделки
5.	Регистрация и отзыв Отчетов на исполнение	
5.1.	Регистрация в Клиринговой системе Отчета на исполнение, содержащего обязательство по оплате ценных бумаг	↓ на Сделки
5.2.	Отзыв из Клиринговой системы Отчета на исполнение, содержащего обязательство по оплате ценных бумаг	↑ на Сделки
5.3.	Прохождение Отчетом на исполнение, содержащим требование по оплате ценных бумаг, Процедуры контроля обеспечения	↑ на Сделки
5.4.	Регистрация в Клиринговой системе Специального отчета на исполнение, содержащего условное двустороннее нетто-обязательство по денежным средствам (X, X<0)	↓ на (-X)
5.5.	Отзыв из Клиринговой системы Специального отчета на исполнение, содержащего условное двустороннее нетто-обязательство по денежным средствам (X, X<0)	↑ на (-X)
5.6.	Прохождение Специальным отчетом на исполнение, содержащим условное двустороннее нетто-требование по денежным средствам (X, X>0), Процедуры контроля обеспечения	↑ на X
5.7.	Регистрация в Клиринговой системе Срочного отчета на исполнение, содержащего нетто-обязательство по денежным средствам (X, X<0)	↓ на (-X)
5.8.	Отзыв из Клиринговой системы Срочного отчета на исполнение, содержащего нетто-обязательство по денежным средствам (X, X<0)	↑ на (-X)
5.9.	Регистрация в Клиринговой системе Поручения на внесение компенсационного взноса в виде денежных средств	↓ на S
5.10.	Регистрация в Клиринговой системе Поручения на внесение компенсационного взноса в виде денежных средств Участником клиринга – контрагентом по сделке	↑ на S
5.11.	Регистрация в Клиринговой системе Поручения на проведение расчетов по поставке (по поставочным контрактам срочного рынка):	
15.11.1	по обязательствам участника клиринга по оплате поставки базового актива	↓ на S
15.11.2	по требованиям участника клиринга по оплате поставки базового актива	↑ на S
6.	Уплата / получение Компенсационного взноса / отступного	↓ на S / ↑ на S
7.	Расчеты по итогам клиринга по сделкам с кодом расчетов Z0 и Срочным отчетам на исполнение	
7.1.	Исполнение обязательства по оплате ценных бумаг или нетто-обязательства по денежным средствам в размере X	↓ на X

7.2.	Исполнение требования по оплате ценных бумаг или нетто-требования по денежным средствам в размере X	↑ на X
------	---	--------

2. Порядок изменения информации о ценных бумагах

№	Операция	Значение количества ценных бумаг, учитываемого по Торгово-клиринговому счету T0
1.	Получение от Расчетного депозитария выписки по Разделам / субсчетам депо	= V0
2.	Зачисление / списание ценных бумаг	
2.1.	Увеличение количества ценных бумаг, учитываемого по Торгово-клиринговому счету T0 на количество V в случаях зачисления ценных бумаг на Раздел T0.	↑ на V
2.2.	Исполнение распоряжения Участника клиринга или Клирингового центра на перевод ценных бумаг с Торгово-клирингового счета T0 с использованием Клиринговой системы	↓ на V
2.3.	Исполнение распоряжения Участника клиринга на перевод ценных бумаг на Торгово-клиринговый счет T0 с использованием Клиринговой системы	↑ на V
2.4.	Списание ценных бумаг с Торгово-клирингового счета T0 на основании Заявления о порядке использования денежных средств и ценных бумаг в количестве, недостающем для исполнения Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по ценным бумагам либо в размере Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по ценным бумагам.	↓ на V
2.5.	Списание в ходе Торгов ценных бумаг с Разделов T0 на основании запроса Расчетного депозитария	↓ на V
2.6.	Возврат ценных бумаг в размере Итогового нетто-требования Участника клиринга по ценным бумагам на основании Заявления о порядке использования денежных средств и ценных бумаг	↑ на V
2.7.	Исполнение Запроса на подбор ценных бумаг.	↑ на V
3.	Регистрация и снятие заявок T0, Rb, T0/Yn, Z0, X0	
3.1.	Регистрация заявки на продажу на заключение сделки с кодом расчетов T0, Rb, T0/Yn в российских рублях и/или иностранной валюте	↓ на V
3.2.	Регистрация заявки на продажу на заключение сделки купли-продажи с кодом расчетов Z0, X0 или сделки РЕПО с кодом расчетов Z0 в российских рублях и иностранной валюте	↓ на V
3.3.	Снятие заявки на продажу на заключение сделки с кодом расчетов T0, Rb, T0/Yn в российских рублях и/или иностранной валюте	↑ на V
3.4.	Снятие заявки на продажу на заключение сделки купли-продажи с кодом расчетов Z0, X0 или сделки РЕПО с кодом расчетов Z0 в российских рублях и иностранной валюте	↑ на V
4.	Заключение сделок T0, K0, Rb, T0/Yn, Z0, X0	
4.1.	Заключение сделки по заявке на покупку с кодом расчетов T0, K0, Rb, T0/Yn, X0	↑ на V
4.2.	Заключение сделки по заявке на продажу с кодом расчетов K0 в российских рублях и иностранной валюте	↓ на V

5.	Регистрация и отзыв Отчетов на исполнение	
5.1.	Регистрация в Клиринговой системе Отчета на исполнение, содержащего обязательство по передаче ценных бумаг	↓ на V
5.2.	Отзыв из Клиринговой системы Отчета на исполнение, содержащего обязательство по передаче ценных бумаг	↑ на V
5.3.	Прохождение Отчетом на исполнение, содержащим требование по передаче ценных бумаг, Процедуры контроля обеспечения	↑ на V
5.4.	Регистрация в Клиринговой системе Специального отчета на исполнение, содержащего условное двустороннее нетто-обязательство по ценным бумагам (X, X<0)	↓ на (-X)
5.5.	Отзыв из Клиринговой системы Специального отчета на исполнение, содержащего условное двустороннее нетто-обязательство по ценным бумагам (X, X<0)	↑ на (-X)
5.6.	Прохождение Специальным отчетом на исполнение, содержащим условное двустороннее нетто-требование по ценным бумагам (X), Процедуры контроля обеспечения	↑ на X
5.7.	Регистрация в Клиринговой системе Срочного отчета на исполнение, содержащего нетто-обязательство по ценным бумагам (X, X<0)	↓ на (-X)
5.8.	Отзыв из Клиринговой системы Срочного отчета на исполнение, содержащего нетто-обязательство по ценным бумагам (X, X<0)	↑ на (-X)
5.9.	Регистрация в Клиринговой системе Поручения на внесение компенсационного взноса в виде ценных бумаг	↓ на V
5.10.	Регистрация в Клиринговой системе Поручения на внесение компенсационного взноса в виде ценных бумаг Участником клиринга – контрагентом по сделке	↑ на V
5.11.	Регистрация в Клиринговой системе Поручения на проведение расчетов по поставке (по поставочным контрактам срочного рынка)	
7.11.1.	по обязательствам участника клиринга по поставке базового актива	↓ на V
7.11.2.	по требованиям участника клиринга по поставке базового актива	↑ на V
6.	Уплата / получение Компенсационного взноса	↓ на V / ↑ на V
7.	Расчеты по итогам клиринга по сделкам с кодом расчетов Z0 и Срочным отчетам на исполнение	
7.1.	Исполнение обязательства по передаче ценных бумаг или нетто-обязательства по ценным бумагам в размере V	↓ на V
7.2.	Исполнение требования по передаче ценных бумаг или нетто-требования по ценным бумагам в размере V	↑ на V