

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

УТВЕРЖДЕНЫ

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

Протокол № 2 от 26 июня 2015 года

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



Лыков С.П.

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

г. Москва
2015 г.

СОДЕРЖАНИЕ

РАЗДЕЛ I. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ	4
Статья 1. Термины и определения	4
Статья 2. Общие положения	8
Статья 3. Особенности использования Аналога собственноручной подписи	10
Статья 4. Торговые и клиринговые счета	10
Статья 5. Клиринговые регистры	13
РАЗДЕЛ II. ТРЕБОВАНИЯ К УЧАСТНИКАМ КЛИРИНГА	17
Статья 6. Условия клирингового обслуживания. Порядок предоставления допуска к клиринговому обслуживанию	17
Статья 7. Особенности регистрации Участников клиринга, порядок регистрации Торгово-клиринговых счетов Участников клиринга и присвоения Участникам клиринга Клиринговых идентификаторов	17
Статья 8. Особенности регистрации Обособленных клиентов	21
Статья 9. Особенности приостановления допуска к клиринговому обслуживанию	21
Статья 10. Требования к клиентам Участника клиринга	21
Статья 11. Требования к Держателям. Порядок получения (лишения) статуса Держателя	21
Статья 12. Требования к Клиринговым банкам	23
РАЗДЕЛ III. МЕРЫ, НАПРАВЛЕННЫЕ НА УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ ПРИ ОСУЩЕСТВЛЕНИИ КЛИРИНГА	24
Статья 13. Перечень мер, направленных на управление рисками при осуществлении клиринга	24
Статья 14. Единый лимит по Расчетному коду и риск-параметры	25
РАЗДЕЛ IV. ПОРЯДОК И УСЛОВИЯ ДОПУСКА ОБЯЗАТЕЛЬСТВ К КЛИРИНГУ	28
Статья 15. Порядок взаимодействия с Биржей при подаче заявок и заключении сделок, допуске к клирингу обязательств по биржевым сделкам и обязательств по внесению компенсационных взносов	28
Статья 16. Процедура контроля обеспечения по биржевым сделкам с ценными бумагами	31
Статья 17. Порядок допуска к клирингу обязательств по внебиржевым сделкам с ценными бумагами	35
РАЗДЕЛ V. ПОРЯДОК ПРОВЕДЕНИЯ КЛИРИНГА	37
ПОДРАЗДЕЛ V-I. ПОРЯДОК ВНЕСЕНИЯ И ВОЗВРАТА ОБЕСПЕЧЕНИЯ	37
Статья 18. Порядок внесения Обеспечения	37
Статья 19. Порядок возврата Обеспечения	40
ПОДРАЗДЕЛ V-II. КЛИРИНГОВЫЕ СЕССИИ	44
Статья 20. Порядок проведения клиринговых сессий. Порядок возникновения и исполнения Маржинальных требований	44
ПОДРАЗДЕЛ V-III. ПОРЯДОК ВКЛЮЧЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ В КЛИРИНГОВЫЙ ПУЛ	46

Статья 21. Общие требования к порядку исполнения обязательств по сделкам и обязательств по внесению компенсационных взносов	46
Статья 22. Порядок подачи и регистрации Отчетов на исполнение.....	48
Статья 23. Порядок подачи и регистрации поручений на внесение компенсационных взносов и поручений на отказ от компенсационных взносов	51
Статья 24. Порядок подачи и исполнения Поручений на отказ от исполнения сделки РЕПО / Поручений на отказ от исполнения сделки купли-продажи ценных бумаг	52
Статья 25. Порядок подачи и регистрации Специальных и Срочных отчетов на исполнение	54
Статья 26. Порядок включения в клиринговый пул обязательств Участников клиринга по уплате Возмещения.....	57
Статья 27. Порядок включения в клиринговый пул обязательств по Сделкам Т+ ..	59
ПОДРАЗДЕЛ V-IV. ПОРЯДОК ДЕЙСТВИЙ В СЛУЧАЯХ НЕИСПОЛНЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ	62
Статья 28. Порядок действий в случаях неисполнения обязательств по Сделкам Т+	62
ПОДРАЗДЕЛ V-V. ПОРЯДОК ИСПОЛНЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ, ВКЛЮЧЕННЫХ В КЛИРИНГОВЫЙ ПУЛ	74
Статья 29. Порядок исполнения обязательств и требований Участников клиринга и Клирингового центра, включенных в клиринговый пул	74
ПОДРАЗДЕЛ V-VI. ОСОБЕННОСТИ ВЗАИМОДЕЙСТВИЯ С РАСЧЕТНОЙ ОРГАНИЗАЦИЕЙ И РАСЧЕТНЫМ ДЕПОЗИТАРИЕМ.....	80
Статья 30. Особенности взаимодействия с Расчетной организацией	80
Статья 31. Особенности взаимодействия с Расчетным депозитарием и иными депозитариями.....	81
ПОДРАЗДЕЛ V-VII. СДЕЛКИ РЕПО КЛИРИНГОВОГО ЦЕНТРА.....	84
Статья 32. Условия Сделок РЕПО Клирингового центра, порядок их заключения и исполнения	84
ПОДРАЗДЕЛ V-VIII. ПОРЯДОК ПЕРЕДАЧИ ДОХОДА	87
Статья 33. Порядок передачи Доходов по сделкам РЕПО и сделкам купли-продажи ценных бумаг, заключенным с Клиринговым центром	87
РАЗДЕЛ VI. ПОРЯДОК ОПЛАТЫ УСЛУГ. ОТЧЕТЫ ПО ИТОГАМ КЛИРИНГА	90
Статья 34. Порядок оплаты услуг Клирингового центра, Биржи и Технического центра	90
Статья 35. Порядок представления отчетов по итогам клиринга	95
РАЗДЕЛ VII. ПРОЧИЕ УСЛОВИЯ	98
Статья 36. Особенности перевода обязательств и Обеспечения одного Участника клиринга другому Участнику клиринга	98
Приложение № 1 Документы, предоставляемые юридическим лицом для получения статуса Держателя.....	99
Приложение № 2 Временной регламент на фондовом рынке	102
Приложение № 3 Порядок изменения позиций	105

РАЗДЕЛ I. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ

Настоящие «Правила клиринга Банка «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество). Часть III. Правила клиринга на фондовом рынке» (далее – Правила клиринга на фондовом рынке) являются неотъемлемой частью Правил клиринга Банка «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество) и совместно с «Правилами клиринга Банка «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество). Часть I. Общая часть» (далее – общая часть Правил клиринга) и «Правилами клиринга Банка «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество). Часть II. Тарифы» (далее – Тарифы Клирингового центра) регулируют отношения, связанные с исполнением сделок купли-продажи ценных бумаг и сделок РЕПО, заключаемых в Секторе рынка Основной рынок Закрытого акционерного общества «Фондовая биржа ММВБ», а также исполнением внебиржевых сделок купли-продажи ценных бумаг и сделок РЕПО.

Статья 1. Термины и определения

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

Клиринговый банк -	Участник клиринга, являющийся Кредитной организацией или Банком-нерезидентом.
Биржевая сделка с ценными бумагами / Биржевая сделка –	сделка купли-продажи ценных бумаг или сделка РЕПО, заключенная на Бирже, и информация о которой передана Биржей Клиринговому центру в порядке, предусмотренном Правилами клиринга на фондовом рынке.
Внебиржевая сделка с ценными бумагами / Внебиржевая сделка -	сделка купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов B0-B30 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. Значения кодов расчетов, используемых при заключении внебиржевых сделок, соответствуют значениям кодов расчетов, определенных Правилами торгов на фондовом рынке. Термины «Дата внесения компенсационного взноса», «Дата прекращения исполнения» для внебиржевых сделок используются в значениях, определенных Правилами торгов на фондовом рынке, с учетом особенностей внебиржевых сделок.
Возмещение –	Переменное возмещение или Фиксированное возмещение, определенные Правилами торгов на фондовом рынке.
Держатель -	организация, получившая статус Держателя в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке с целью использования ценных бумаг, учитываемых на Торговых счетах депо номинального держателя Держателя, для проведения Клиринговым центром Процедуры контроля обеспечения по сделкам и расчетов по итогам клиринга сделок Участников клиринга, депозитарное обслуживание которых и/или их клиентов осуществляется Держателем.

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.
Заявление на регистрацию ТКС -	Заявление Участника клиринга на регистрацию торгового-клирингового счета.
Клиринговый идентификатор Участника клиринга (Клиринговый идентификатор) -	уникальный буквенно-цифровой код, присваиваемый Участнику клиринга Клиринговым центром в целях совершения операций в Клиринговой системе.
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 с ценными бумагами и обязательств, возникших по итогам клиринга, подлежащих исполнению в определенный Правилами клиринга на фондовом рынке 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 момент времени в дату формирования клирингового пула обязательств по сделкам с ценными бумагами, 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 момент времени в дату формирования клирингового пула.
Код ценной бумаги -	код, позволяющий однозначно идентифицировать ценную бумагу в Клиринговой системе.
Методика определения риск-параметров рынка -	внутренний документ Клирингового центра, устанавливающий порядок определения риск-параметров Фондового и Денежного рынков ЗАО «ФБ ММВБ». Методика определения риск-

<i>ценных бумаг</i>	параметров рынка ценных бумаг раскрывается на Сайте Клирингового центра.
<i>Нетто-обязательство по денежным средствам / ценным бумагам по сделкам клирингового пула -</i>	обязательства Участника клиринга или Клирингового центра по оплате / передаче ценных бумаг по всем сделкам клирингового пула, обязательства по которым не прекращены в результате неттинга в ходе клиринга в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке, определяемые в отношении позиции Участника клиринга (Клирингового центра) по денежным средствам / ценным бумагам.
<i>Нетто-обязательство по денежным средствам / ценным бумагам по Сделкам Т+ -</i>	сумма денежных средств в российских рублях / иностранной валюте или количество ценных бумаг, представляющие собой превышение обязательств Участника клиринга по Сделкам Т+ над его требованиями к Клиринговому центру по Сделкам Т+ в российских рублях / иностранной валюте или ценных бумагах, определяемые по каждой Дате исполнения.
<i>Нетто-требование по денежным средствам / ценным бумагам по сделкам клирингового пула -</i>	требования Участника клиринга или Клирингового центра по оплате / передаче ценных бумаг по всем сделкам клирингового пула, обязательства по которым не прекращены в результате неттинга в ходе клиринга в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке, определяемые в отношении позиции Участника клиринга (Клирингового центра) по денежным средствам / ценным бумагам.
<i>Нетто-требование по денежным средствам / ценным бумагам по Сделкам Т+ -</i>	сумма денежных средств в российских рублях / иностранной валюте или количество ценных бумаг, представляющие собой превышение требований Участника клиринга по Сделкам Т+ над его обязательствами перед Клиринговым центром по Сделкам Т+ в российских рублях / иностранной валюте или ценных бумагах, определяемые по каждой Дате исполнения.
<i>Ограничительный лимит -</i>	клиринговый регистр, предназначенный для учета неисполненных обязательств Участника клиринга в случаях, установленных Правилами клиринга на фондовом рынке.
<i>Отчет на исполнение -</i>	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.
<i>Отчет на исполнение специальный / Специальный отчет на исполнение -</i>	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 иницирующее 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, 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 иницирующее 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.
Расчетная цена -	цена, используемая для установления значений Верхней и Нижней границы ценового коридора, а также Верхней и Нижней границы диапазона оценки рыночных рисков.
Регламент клиринга на фондовом рынке / Регламент клиринга -	внутренний документ Клирингового центра, устанавливающий порядок кодификации и регистрации в Клиринговой системе Торгово-клиринговых счетов, особенности проведения операций, осуществляемых в Клиринговой системе в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке. Регламент клиринга раскрывается на Сайте Клирингового центра.
Сделка с ценными бумагами / Сделка -	биржевая сделка, внебиржевая сделка.

Сделка T+ -	сделка РЕПО с кодом расчетов T0/Yn, Y0/Yn, Y1/Yn, Ym/Yn или сделка купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов Yn, заключенная с Центральным контрагентом в соответствии с Правилами торгов на фондовом рынке или Правилами клиринга на фондовом рынке, сделка своп с иностранной валютой или сделка купли-продажи иностранной валюты, заключенная с Центральным контрагентом в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке, 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 с целью исполнения обязательств Клирингового центра по Сделкам T+.
Торгово-клиринговый счет / ТКС -	учетный регистр в Клиринговой системе, устанавливающий однозначное соответствие между Разделом и Расчетным кодом.

Статья 2. Общие положения

- 2.1. Клиринговый центр осуществляет клиринг, выполняя функции центрального контрагента по:
- сделкам купли-продажи с кодом расчетов T0 (за исключением сделок размещения и выкупа), K0, Yn;
 - сделкам РЕПО с кодом расчетов T0/Yn, Y0/Yn, Y1/Yn, Ym/Yn.
- 2.2. Клиринговый центр осуществляет клиринг без выполнения функций центрального контрагента по:
- сделкам купли-продажи 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:
- сделкам купли-продажи с кодом расчетов Yn;
 - сделкам РЕПО с кодом расчетов Y0/Yn, Y1/Yn, Ym/Yn;
 - вторым частям сделок РЕПО с кодом расчетов T0/Yn.
- 2.5. Клиринговый центр осуществляет клиринг с полным обеспечением по:
- сделкам купли-продажи с кодом расчетов T0, Z0, X0, K0;
 - первым частям сделок РЕПО с кодом расчетов T0/Yn, Rb, Z0.
- 2.6. Клиринговый центр осуществляет клиринг без предварительного обеспечения по:
- сделкам купли-продажи с кодом расчетов B0-B30;
 - сделкам РЕПО с кодом расчетов Sn;

- вторым частям сделок РЕПО с кодом расчетов Rb, Z0.
- 2.7. Клиринговый центр осуществляет клиринг по сделкам, 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.
- 2.9. Расчеты по результатам клиринга осуществляются в ходе торгов и по итогам торгов.
- 2.10. По Сделкам Т+ с ценными бумагами Клиринговый центр осуществляет клиринг с частичным обеспечением по денежным средствам и ценным бумагам.
- 2.10.1. Клиринговый центр вправе установить признак «запрет коротких продаж» по ценной бумаге.
Признак «запрет коротких продаж» по ценной бумаге означает, что по Сделкам Т+ с такой ценной бумагой осуществляется клиринг с полным обеспечением по ценным бумагам, а Нижняя граница диапазона оценки рыночных рисков по такой ценной бумаге равна нулю.
- 2.11. Перечень видов используемых в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке торговых и клиринговых счетов, предназначенных для внесения ценных бумаг / денежных средств в качестве Обеспечения, приведен в статье 4 Правил клиринга на фондовом рынке.
- 2.12. Формы и форматы документов, предоставляемых Участниками клиринга Клиринговому центру в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке и способ их предоставления установлены документом «Формы и форматы документов, предоставляемых Участниками клиринга, клиентами Участников клиринга и Держателями на фондовом рынке», если иное не установлено Правилами клиринга на фондовом рынке.
- 2.13. Сроки исполнения обязательств, определенных Правилами клиринга на фондовом рынке, время проведения клиринговых сессий, а также сроки проведения клиринговых операций, сроки предоставления документов Клиринговому центру / Клиринговым центром в процессе взаимодействия с Участниками клиринга при проведении клиринга и расчетов по сделкам в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке, установлены Временным регламентом на фондовом рынке, являющимся приложением № 2 к Правилам клиринга на фондовом рынке.
- 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 является ПАО Московская Биржа.

Статья 3. Особенности использования Аналога собственноручной подписи

3.1. 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 / Клирингового центра, которому присвоен данный Клиринговый идентификатор.

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

Порядок присвоения Клирингового идентификатора Участнику клиринга определен пунктом 7.7 Правил клиринга на фондовом рынке.

Включение информации о Клиринговом идентификаторе Участника клиринга в состав ежедневного Отчета о Клиринговых идентификаторах, считается уведомлением о присвоении Клирингового идентификатора Участнику клиринга.

Сведения о присвоенных Клиринговых идентификаторах относятся к конфиденциальным. Участник клиринга и Клиринговый центр обеспечивают соблюдение требований о конфиденциальности и несут риск последствий, связанных с нарушением таких требований.

Статья 4. Торговые и клиринговые счета

4.1. При осуществлении клиринга в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке 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, Клирингового центра, клиента Участника клиринга;
- торговый счет для учета денежных средств клиентов;
- торговый счет для учета денежных средств, находящихся в доверительном управлении Участника клиринга.

4.2. Торговый счет – торговый банковский счет в российских рублях или иностранной валюте Участника клиринга, в том числе специальный брокерский счет или счет доверительного управляющего, Клирингового центра или клиента Участника клиринга, предназначенный для внесения индивидуального клирингового обеспечения в российских рублях или иностранной валюте соответственно.

- 4.2.1. Торговый счет Участника клиринга – Клирингового банка используется для внесения денежных средств, предназначенных для обеспечения исполнения и исполнения обязательств Клирингового банка по сделкам, заключенным за его счет, или для учета денежных средств, предназначенных для обеспечения исполнения и исполнения обязательств Клирингового банка по сделкам, заключенным за счет его клиентов, либо для обеспечения исполнения и исполнения обязательств другого Участника клиринга по сделкам (в случае открытия Клиринговым банком для Участника клиринга дополнительной позиции по денежным средствам, определяемой в отношении этого Торгового счета).

Торговый счет Клирингового банка в российских рублях также используется для исполнения обязательств Клирингового банка по уплате комиссионного вознаграждения и Возмещения, а в случае открытия Клиринговым банком для Участника клиринга дополнительной позиции по денежным средствам, определяемой в отношении этого Торгового счета, - для исполнения обязательств такого Участника клиринга по уплате комиссионного вознаграждения.

- 4.2.2. Торговый счет Участника клиринга - Некредитной организации используется для внесения денежных средств, предназначенных для обеспечения исполнения и исполнения обязательств по сделкам, заключенным за счет Участника клиринга или за счет его клиентов.

Торговый счет Участника клиринга, не являющегося кредитной организацией, в российских рублях также используется для исполнения обязательств Участника клиринга по уплате Комиссионного вознаграждения и Возмещения.

- 4.2.3. Торговый счет клиента Участника клиринга открывается такому клиенту Участника клиринга и используется для внесения денежных средств, предназначенных для обеспечения исполнения и исполнения обязательств по сделкам, заключенным за счет такого клиента.

Торговый счет клиента Участника клиринга в российских рублях также используется для исполнения обязательств Участника клиринга по уплате Комиссионного вознаграждения по указанным сделкам.

- 4.3. Торговый счет для учета денежных средств клиентов используется для внесения денежных средств, предназначенных для обеспечения исполнения и исполнения обязательств по сделкам, заключенным за счет клиентов Участника клиринга.

Торговым счетом, предназначенным для учета денежных средств клиентов, является специальный брокерский счет, открытый Участником клиринга – некредитной организацией, или отдельный Торговый счет Участника клиринга – кредитной организации.

- 4.4. Торговый счет для учета денежных средств, находящихся в доверительном управлении этого Участника клиринга, используется для внесения денежных средств, предназначенных для обеспечения исполнения и исполнения обязательств по сделкам, заключенным за счет денежных средств, находящихся в доверительном управлении Участника клиринга.

- 4.5. При осуществлении клиринга в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке 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 депозитории:

- 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;
- торговый счет депо брокера Участника клиринга;
- эмиссионный счет эмитента;
- торговый казначейский счет депо эмитента;
- счет депо владельца Участника клиринга или клиента Участника клиринга;
- счет депо номинального держателя Участника клиринга или Держателя.

4.6. При осуществлении клиринга в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке Клиринговый центр использует торговые разделы, блокированные для клиринга НКЦ, торговых счетов депо, а также торговые разделы, блокированные для торгов по реализации ценных бумаг, заложенных под ломбардные кредиты и по кредитам овернайт Банка России, счетов депо, открытых в Расчетном депозитории.

4.7. **Торговый раздел** – торговый раздел (за исключением торгового раздела типа «Блокировано для клиринга в НКЦ. Обеспечение») торгового счета депо владельца Участника клиринга или Клирингового центра и/или торгового счета депо номинального держателя Участника клиринга и/или торгового счета депо доверительного управляющего и/или эмиссионного счета и/или торгового счета депо владельца клиента Участника клиринга и/или торгового казначейского счета депо эмитента и/или эмиссионного счета и/или торгового счета депо брокера и/или счета депо владельца Участника клиринга и/или счета депо владельца клиента Участника клиринга, предназначенный для обеспечения исполнения и исполнения обязательств по сделкам.

4.8. **Дополнительный торговый раздел** – торговый раздел (за исключением торгового раздела типа «Блокировано для клиринга в НКЦ. Обеспечение») торгового счета депо номинального держателя Держателя и/или торгового счета депо иностранного номинального держателя Держателя и/или счета депо номинального держателя Держателя, предназначенный для обеспечения исполнения и исполнения обязательств по сделкам.

Существуют следующие типы дополнительных торговых разделов:

- **Тип «А»** - для учета ценных бумаг, принадлежащих на праве собственности или ином вещном праве Участнику клиринга, депозитарное обслуживание которого осуществляется Держателем;
- **Тип «В»** - для учета ценных бумаг клиента Участника клиринга, депозитарное обслуживание которых осуществляется Держателем;

- **Тип «С»** - для учета ценных бумаг, находящихся в доверительном управлении Участника клиринга, депозитарное обслуживание которого осуществляется Держателем.
- 4.9. **Торговый раздел обеспечения** - торговый раздел типа «Блокировано для клиринга в НКЦ. Обеспечение» торгового счета депо владельца Участника клиринга и/или торгового счета депо номинального держателя Участника клиринга и/или торгового счета депо доверительного управляющего и/или торгового счета депо владельца клиента Участника клиринга, предназначенный для учета Обеспечения в ценных бумагах.
- 4.10. **Дополнительный торговый раздел обеспечения** - торговый раздел типа «Блокировано для клиринга в НКЦ. Обеспечение» торгового счета депо номинального держателя Держателя, предназначенный для учета Обеспечения в ценных бумагах.
- 4.11. Торговые разделы всех типов, перечисленные в пунктах 4.6-4.10 Правил клиринга на фондовом рынке далее совместно именуются Разделы.
Торговые разделы, перечисленные в пунктах 4.7-4.8 Правил клиринга на фондовом рынке далее совместно именуются Разделы T0.
Торговые разделы обеспечения и Дополнительные торговые разделы обеспечения далее совместно именуются Разделы T+.
Разделы T0 и T+, открытые в рамках одного торгового счета депо, являются связанными, если коды таких разделов, за исключением первых двух символов, совпадают.

Статья 5. Клиринговые регистры

- 5.1. При осуществлении клиринга на фондовом рынке Клиринговый центр открывает и ведет клиринговые регистры, предусмотренные общей частью Правил клиринга, а также:
- 5.2. **Счет обеспечения T0** – клиринговый регистр, соответствующий лицевому счету, открытому Участнику клиринга в Клиринговом центре на балансовом счете № 30420 (30421) «Средства для исполнения обязательств, допущенных к клирингу, и индивидуального клирингового обеспечения» для учета денежных средств, предназначенных для обеспечения исполнения и исполнения обязательств по сделкам.
 - 5.2.1. При получении от Расчетной организации информации о новом Торговом счете в российских рублях Клиринговый центр открывает Участнику клиринга Расчетный код и связанные с ним Счет обеспечения T0 в российских рублях, а также Счет обеспечения в российских рублях и по одному Счету обеспечения в каждой иностранной валюте, в которой проводятся расчеты по сделкам с частичным обеспечением и/или денежные средства в которой принимаются Клиринговым центром в качестве Обеспечения.
 - 5.2.2. Тип Расчетного кода (собственный, клиентский или ДУ) устанавливается на основании информации о типе Торгового счета, полученной от Расчетной организации.

- Участник клиринга – Банк вправе изменить тип Расчетного кода, установленный Клиринговым центром, предоставив Клиринговому центру Заявление об изменении реквизитов Расчетного кода, указанное в общей части Правил клиринга.
- 5.2.3. Счет обеспечения T0 в иностранной валюте открывается к Торговому счету Участника клиринга или его клиента при получении от Расчетной организации информации о новом Торговом счете в соответствующей иностранной валюте.
- 5.2.4. Счет обеспечения T0 в иностранной валюте связывается с Расчетным кодом на основании Заявления Участника клиринга на регистрацию ТКС, предоставляемого Клиринговому центру в соответствии с пунктом 7.2 Правил клиринга на фондовом рынке.
- 5.2.5. С одним Расчетным кодом может быть связано не более одного Счета обеспечения T0 в каждой валюте.
- 5.2.6. Торговый счет, к которому открыт Счет обеспечения T0, является Счетом для возврата для Расчетного кода, связанного с таким Счетом обеспечения T0.
- 5.3. При осуществлении клиринга на фондовом рынке на клиринговых регистрах Клиринговый центр учитывает:
- позиции по денежным средствам в разрезе Счетов обеспечения и Счетов обеспечения T0;
 - позиции по ценным бумагам в разрезе Разделов T0 / Разделов T+;
 - Единый лимит по Расчетным кодам;
 - обязанности и требования Участника клиринга по каждому допущенному к клирингу обязательству по Сделке T+;
 - Нетто-обязательство / Нетто-требование Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам по сделкам клирингового пула в разрезе Счетов обеспечения и Разделов, валют / кодов ценных бумаг;
 - Нетто-обязательство / Нетто-требование Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам по Сделкам T+ в разрезе Счетов обеспечения / Разделов T+, Дат исполнения, валют / кодов ценных бумаг;
 - Итоговое нетто-обязательство / Итоговое нетто-требование Участника клиринга в разрезе Счетов обеспечения / Разделов T+, валют / кодов ценных бумаг;
 - Маржинальное требование Участника клиринга в разрезе Расчетных кодов (в случае наличия).
- 5.4. При осуществлении клиринга на фондовом рынке используются следующие разделы клирингового регистра «Позиция по денежным средствам»:
- Денежная позиция Участника клиринга / Клирингового центра** – позиция по денежным средствам, определяемая в отношении Счета обеспечения T0, открытого к Торговому счету Участника клиринга или Клирингового центра, или в отношении Счета обеспечения, связанного с собственным Расчетным кодом Участника клиринга или Клирингового центра.
- Клиентская денежная позиция** – позиция по денежным средствам, определяемая в отношении Счета обеспечения T0, открытого к Торговому счету Участника клиринга, являющемуся специальным брокерским счетом, или к Торговому счету

клиента Участника клиринга, или в отношении Счета обеспечения, связанного с клиентским Расчетным кодом Участника клиринга.

Денежная позиция ДУ – позиция по денежным средствам, определяемая в отношении Счета обеспечения Т0, открытого к Торговому счету Участника клиринга, или в отношении Счета обеспечения, связанного с Расчетным кодом ДУ Участника клиринга.

Денежные позиции, клиентские денежные позиции, денежные позиции ДУ далее совместно именуются основными позициями по денежным средствам.

Дополнительная собственная денежная позиция – позиция по денежным средствам, определяемая в отношении Счета обеспечения Т0, открытого к торговому счету Клирингового банка, осуществляющего расчетное обслуживание Участника клиринга.

Дополнительная клиентская денежная позиция – позиция по денежным средствам, определяемая в отношении Счета обеспечения Т0, открытого к торговому счету Клирингового банка, осуществляющего расчетное обслуживание клиентов Участника клиринга.

Дополнительная денежная позиция ДУ – позиция по денежным средствам, определяемая в отношении Счета обеспечения Т0, открытого к торговому счету Клирингового банка, осуществляющего расчетное обслуживание Участника клиринга при выполнении им функций доверительного управляющего, и предназначенному для учета денежных средств, находящихся в доверительном управлении Участника клиринга.

Дополнительные собственные денежные позиции, дополнительные клиентские денежные позиции и дополнительные денежные позиции ДУ далее совместно именуются дополнительными позициями по денежным средствам.

- 5.5. При осуществлении клиринга на фондовом рынке используются следующие разделы клирингового регистра «Позиция по ценным бумагам»:

Позиция «Депозит-1» Участника клиринга / Клирингового центра — позиция депозит, определяемая в отношении Торгового раздела или Торгового раздела обеспечения Торгового счета депозит владельца Участника клиринга или Клирингового центра в Расчетном депозитарии и/или Дополнительного торгового раздела - тип А / Дополнительного торгового раздела обеспечения, открытого для Участника клиринга на торговых счетах депозит номинального держателя Держателей в Расчетном депозитарии.

Позиция «Депозит-2» Участника клиринга — позиция депозит, определяемая в отношении Торгового раздела или Торгового раздела обеспечения Торгового счета депозит номинального держателя Участника клиринга в Расчетном депозитарии и/или Торгового раздела Торгового счета депозит клиента Участника клиринга в Депозитарии и/или Дополнительного торгового раздела - тип В / Дополнительного торгового раздела обеспечения, открытого для Участника клиринга на торговых счетах депозит номинального держателя Держателей в Расчетном депозитарии.

Позиция «Депозит-3» Участника клиринга – позиция депозит, определяемая в отношении открытого для Участника клиринга Торгового раздела эмиссионного счета, открытого для Участника клиринга.

Позиция «Депозит-4» Участника клиринга — позиция депозит, определяемая в отношении Торгового раздела или Торгового раздела обеспечения торгового счета депозит доверительного управляющего Участника клиринга в Расчетном депозитарии и/или Дополнительного торгового раздела - тип С / Дополнительного торгового раздела обеспечения, открытого для Участника клиринга на торговых счетах депозит номинального держателя / торговых счетах депозит иностранного номинального держателя Держателей в Расчетном депозитарии.

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

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

- 5.6. В Клиринговой системе устанавливаются начальные и плановые значения позиций по денежным средствам и позиций депозит Участников клиринга, указанные в пунктах 5.4-5.5 Правил клиринга на фондовом рынке.

Порядок и случаи изменения значений позиций по денежным средствам и позиций депозит приведен в приложении № 3 к Правилам клиринга на фондовом рынке.

- 5.7. Порядок ведения клиринговых регистров определен в соответствующих статьях разделов IV и V Правил клиринга на фондовом рынке.

РАЗДЕЛ II. ТРЕБОВАНИЯ К УЧАСТНИКАМ КЛИРИНГА

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

- 6.1. В соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке Участникам клиринга могут быть присвоены следующие категории Участников клиринга:
- Участники клиринга категории «А»;
 - Участники клиринга категории «Б»;
 - Участники клиринга категории «В».
- 6.1.1. По Сделкам Т+, стороной по которым является Участник клиринга категории «Б», осуществляется клиринг с частичным обеспечением.
По Сделкам Т+, стороной по которым является Участник клиринга категории «В», осуществляется клиринг с полным обеспечением.
- 6.1.2. К клирингу без предварительного обеспечения допускаются Участники клиринга всех категорий.
- 6.1.3. Участники клиринга категории «А» имеют допуск к клирингу с частичным обеспечением, к клирингу с полным обеспечением, к клирингу без предварительного обеспечения.
- 6.2. Допуск к клиринговому обслуживанию на фондовом рынке предоставляется Участнику клиринга, соответствующему требованиям, установленным для соответствующей категории Участников клиринга в общей части Правил клиринга, а также требованиям, указанным в пункте 6.3 Правил клиринга на фондовом рынке.
- 6.3. Для допуска к клиринговому обслуживанию Участник клиринга категории «В» должен дополнительно соответствовать следующим требованиям:
- 6.3.1. иметь хотя бы один зарегистрированный в Клиринговом центре Торгово-клиринговый счет;
- 6.3.2. предоставить Клиринговому центру Заявление о ТКС для внебиржевых сделок (данное требование относится только к клиринговому обслуживанию Участников клиринга при осуществлении клиринга по внебиржевым сделкам прямого РЕПО с Банком России).

Статья 7. Особенности регистрации Участников клиринга, порядок регистрации Торгово-клиринговых счетов Участников клиринга и присвоения Участникам клиринга Клиринговых идентификаторов

- 7.1. Процедура регистрации Участника клиринга Клиринговым центром предусматривает присвоение Участнику клиринга следующих кодов и идентификаторов, 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;

- специальный код Участника клиринга, являющегося управляющим (присваивается Участником клиринга самостоятельно).
- 7.1.1. Клиринговым центром Участнику клиринга может быть присвоено более одного идентификатора Участника клиринга. При этом для каждого Участника клиринга устанавливается однозначное соответствие всех идентификаторов коду Участника клиринга, присвоенному в соответствии с общей частью Правил клиринга.
- 7.1.2. Участник клиринга - управляющий также указывает Клиринговому центру специальный код Участника клиринга. Специальный код должен соответствовать формату (набору символов), используемому в Клиринговой системе, и является уникальным для данного Участника клиринга. При этом для каждого Участника клиринга Клиринговый центр устанавливает однозначное соответствие специального кода коду Участника клиринга.
- 7.2. Для регистрации Торгово-клирингового счета Участника клиринга, устанавливающего однозначное соответствие между Разделом и Расчетным кодом, а также в случае необходимости изменения такого соответствия Участник клиринга обязан предоставить Клиринговому центру Заявление на регистрацию ТКС.
- Один Раздел может входить в состав только одного Торгово-клирингового счета.
- Один Расчетный код может входить в состав нескольких Торгово-клиринговых счетов.
- 7.2.1. 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.
- 7.3. Для заключения Сделок Т+ у Участника клиринга должен быть зарегистрирован Торгово-клиринговый счет, в состав которого входит Раздел Т+ и Расчетный код, к которому привязан Счет обеспечения.
- 7.3.1. Для заключения иных сделок Участник клиринга может использовать Торгово-клиринговый счет, в состав которого входят:
- Раздел Т+, и Расчетный код, к которому привязан Счет обеспечения;
 - Раздел Т0, и Расчетный код, к которому привязан Счет обеспечения;
 - Раздел Т0, и Расчетный код, к которому привязан Счет обеспечения Т0.
- 7.3.2. Разделы Т+, зарегистрированные в составе Торгово-клиринговых счетов совместно с одним Расчетным кодом, далее именуются Разделами Т+, относящимися к такому Расчетному коду.
- 7.3.3. В случае наличия зарегистрированного Торгово-клирингового счета, в состав которого входит Раздел Т0, регистрация Торгово-клирингового счета, в состав которого входит Раздел Т+, связанный с Разделом Т0, осуществляется Клиринговым центром без предоставления Участником клиринга Заявления на регистрацию ТКС.

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

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

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

7.4.1. Для Торгово-клирингового счета, предназначенного для заключения Сделок 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.

7.5. Удержание Клиринговым центром с Участника клиринга:

- комиссионного вознаграждения по сделкам с расчетами в иностранной валюте;
- 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;
- комиссионного вознаграждения по тарифному плану «Размещения-фиксированный»;
- дополнительного вознаграждения в случае, предусмотренном пунктом 34.12 Правил клиринга на фондовом рынке;
- 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 Счета обеспечения 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 Счета обеспечения в российских рублях, соответствующего основному Расчетному коду.

7.5.1. В Заявлении о счете для возмещения и комиссии Участником клиринга может быть указан признак, означающий, что со Счета обеспечения, соответствующего Расчетному коду, указанному в таком заявлении, необходимо также удерживать

оборотную часть Комиссионного вознаграждения по сделкам с расчетами в российских рублях.

В случае, если такой признак не указан, обратная часть Комиссионного вознаграждения по сделкам с расчетами в российских рублях, а также неустойки, установленные Правилами торгов на фондовом рынке, удерживаются со Счета обеспечения Т0 или Счета обеспечения, по которому должны исполняться обязательства по сделке.

- 7.5.2. Счет обеспечения, определенный в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга на фондовом рынке, далее именуется Счетом для возмещения и комиссии.
- 7.6. В случае получения от Расчетной организации информации о закрытии и/или невозможности проведения операций по Торговому счету, к которому открыт Счет обеспечения Т0, являвшийся 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 Счет обеспечения, соответствующий собственному Расчетному коду.
- 7.7. Участнику клиринга, получившему допуск к клиринговому обслуживанию, Клиринговым центром присваиваются Клиринговые идентификаторы на основании Заявления о присвоении Клирингового идентификатора, предоставленного Участником клиринга Клиринговому центру.
- 7.7.1. Клиринговый идентификатор соответствует одному идентификатору Участника клиринга. Одному идентификатору Участника клиринга может соответствовать более одного Клирингового идентификатора.
- 7.7.2. Присвоение Участнику клиринга Клирингового идентификатора осуществляется Клиринговым центром в течение 5 (пяти) рабочих дней после получения Заявления о присвоении Клирингового идентификатора при условии отсутствия замечаний по представленному заявлению.
- 7.7.3. Клиринговый центр информирует Участника клиринга о присвоенном ему Клиринговом идентификаторе не позднее рабочего дня, следующего за днем присвоения Клирингового идентификатора, путем включения информации о Клиринговом идентификаторе Участника клиринга в состав Отчета о Клиринговых идентификаторах.
- 7.7.4. Аннулирование присвоенного Участнику клиринга Клирингового идентификатора по инициативе Участника клиринга осуществляется на основании Заявления об аннулировании Клирингового идентификатора, предоставленного Участником клиринга Клиринговому центру.
Аннулирование всех Клиринговых идентификаторов, соответствующих идентификатору Участника клиринга, осуществляется на основании полученного от Биржи уведомления о прекращении допуска к торгам Участника клиринга, являющегося Участником торгов, по такому идентификатору.

Статья 8. Особенности регистрации Обособленных клиентов

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

Статья 9. Особенности приостановления допуска к клиринговому обслуживанию

- 9.1. Клиринговый центр вправе приостановить допуск 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 любому из следующих оснований:
 - 9.1.1. при отсутствии хотя бы одного зарегистрированного Торгово-клирингового счета;
 - 9.1.2. при невозможности осуществления операций с использованием Торгово-клирингового счета, указанного в Заявлении о ТКС для внебиржевых сделок (в части осуществления клирингового обслуживания по внебиржевым сделкам прямого РЕПО с Банком России);

Статья 10. Требования к клиентам Участника клиринга

- 10.1. При открытии Расчетной организацией Торгового счета клиента Участника клиринга Участник клиринга обязан предоставить Клиринговому центру Уведомление об использовании торгового счета клиента Участника клиринга от соответствующего клиента.

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, предоставляют Клиринговому центру:

- юридические лица - Резиденты - документы, указанные в разделе I приложения № 1 к Правилам клиринга на фондовом рынке;
- юридические лица - Нерезиденты - документы, указанные в разделе II приложения № 1 к Правилам клиринга на фондовом рынке.

Юридические лица - Резиденты, 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) организации 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;
- 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 подпункте 11.5 Правил клиринга на фондовом рынке,
- 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;
- 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 требований;
- 11.4.10. 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 представленных Клиринговому центру документах, Держатель обязан в течение 5 (пяти) рабочих дней после таких изменений предоставить Клиринговому центру Анкету Участника клиринга (клиента) (Регистрационную карточку) с обновленной информацией в форме электронного документа и соответствующие документы, подтверждающие такие изменения.

- 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. Требования к Клиринговым банкам

- 12.1. Для открытия в Клиринговой системе дополнительной денежной позиции Участника клиринга – Клиринговый банк обязан предоставить Клиринговому центру Уведомление об использовании дополнительной позиции по денежным средствам.

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, а также, для дополнительной рублевой денежной позиции, - 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.

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

Статья 13. Перечень мер, направленных на управление рисками при осуществлении клиринга

- 13.1. В целях снижения рисков, связанных с осуществлением клиринга на фондовом рынке, Клиринговый центр применяет меры, предусмотренные общей частью Правил клиринга.
- 13.2. Предельная доля ценных бумаг, принимаемых в качестве обеспечения исполнения обязательств по Сделкам T+, составляет 100%.
Предельная доля иностранной валюты, принимаемой в качестве обеспечения исполнения обязательств по Сделкам T+, составляет 100%.
- 13.2.1. Клиринговый центр вправе установить ограничение на предельную сумму иностранной валюты / предельное количество ценных бумаг, принимаемых в качестве обеспечения исполнения обязательств по Сделкам T+ Участника клиринга, путем установления равной нулю любой из Нижних границ диапазона оценки рыночных рисков по такой иностранной валюте / ценной бумаге для отдельного Участника клиринга или для всех Участников клиринга.
- 13.3. Гарантийный фонд формируется Клиринговым центром за счет взносов всех Участников клиринга категории «Б».
Размер взноса в Гарантийный фонд каждого Участника клиринга категории «Б» составляет 10 000 000 (десять миллионов) рублей.
- 13.4. Обеспечение под стресс обязаны вносить Участники клиринга категории «Б».
Порядок определения размера Обеспечения под стресс Участника клиринга установлен Методикой определения размера Обеспечения под стресс.
- 13.5. При неисполнении Участником клиринга Маржинального требования по фондам и/или Маржинального требования по обеспечению под стресс, порядок выставления и исполнения которых определен общей частью Правил клиринга, Участнику клиринга категории «Б» устанавливается категория «В».
- 13.6. При использовании взноса Участника клиринга в Гарантийный фонд фондового рынка и/или Обеспечения под стресс на фондовом рынке Участнику клиринга категории «Б» устанавливается категория «В».
- 13.7. При возмещении Недобросовестным участником клиринга средств Гарантийного фонда фондового рынка и Обеспечения под стресс на фондовом рынке в течение 1 (одного) Расчетного дня после направления Клиринговым центром Маржинального требования по фонду и/или Маржинального требования по Обеспечению, Участнику клиринга категории «В» устанавливается категория «Б».
- 13.8. Выделенный капитал Клирингового центра на фондовом рынке составляет 2 000 000 000 (два миллиарда) российских рублей.

Статья 14. Единый лимит по Расчетному коду и риск-параметры

- 14.1. Единый лимит Участника клиринга 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.
- 14.2. Единый лимит Участника клиринга 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. Указанная проверка осуществляется, исходя из анализа изменения значения Единого лимита Участника клиринга до и после проведения операции.
- 14.3. Единый лимит Участника клиринга по Расчетному коду рассчитывается с учетом:
- Обеспечения Участника клиринга в российских рублях и иностранной валюте, учитываемого по Счетам обеспечения, относящимся к Расчетному коду;
 - Обеспечения Участника клиринга в ценных бумагах, учитываемого по всем Разделам T+, относящимся к Расчетному коду;
 - Нетто-обязательств / Нетто-требований Участника клиринга по Сделкам с T+ в российских рублях / иностранной валюте и ценных бумагах, учитываемых по Счету обеспечения / всем Разделам T+, относящимся к Расчетному коду, по всем Датам исполнения;
 - обязательств по уплате Комиссионных вознаграждений по Сделкам T+, учитываемых по Расчетному коду;
 - Задолженности Участника клиринга перед Клиринговым центром в российских рублях, учитываемой по Счету обеспечения, относящемуся к Расчетному коду;
 - обязательств по передаче / требований по получению Дохода, учитываемых по Расчетному коду и/или по Разделам T+, относящимся к Расчетному коду;
 - иных обязательств / требований Участника клиринга, если это установлено Правилами клиринга.
- 14.4. Обязательства по передаче / требования по получению Дохода, определенные Клиринговым центром в соответствии со статьей 33 Правил клиринга на фондовом рынке, учитываются при расчете Единого лимита 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.
- 14.5. Базовыми риск-параметрами, используемыми Клиринговым центром для контроля и управления рисками, являются:

- Расчетная цена;
- Верхняя и Нижняя границы ценового коридора;
- Верхняя и Нижняя границы диапазона оценки рыночных рисков;
- дисконт;
- Расчетная ставка РЕПО;
- Верхняя и Нижняя границы коридора ставок РЕПО;
- Верхняя и Нижняя границы диапазона оценки процентных рисков.

Помимо базовых риск-параметров Клиринговым центром используются дополнительные риск-параметры, приведенные в Методике определения риск-параметров рынка ценных бумаг.

- 14.6. Верхняя и Нижняя границы диапазона оценки рыночных и процентных рисков, используемые при расчете Единого лимита Участника клиринга, зависят от объема обязательств Участника клиринга по Сделкам T+.
- 14.7. Клиринговый центр вправе установить индивидуальные Верхние и Нижние границы диапазона оценки рыночных рисков и Верхние и Нижние границы диапазона оценки процентных рисков, расширяющие указанные диапазоны, для определенных Участников клиринга.
- 14.8. Участник клиринга категории «Б» вправе с использованием Клиринговой системы установить индивидуальные Верхние и Нижние границы диапазона оценки рыночных рисков и Верхние и Нижние границы диапазона оценки процентных рисков, расширяющие указанные диапазоны, для определенных Торгово-клиринговых счетов Участника клиринга по определенной ценной бумаге / иностранной валюте.
- 14.9. 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.
- 14.10. Расчет и изменение риск-параметров осуществляется Клиринговым центром по состоянию на 19:00 по московскому времени.
Клиринговый центр может принять решение об изменении риск-параметров до начала и в ходе торгов.
Изменения риск-параметров в ходе торгов, проводимых после 19:00 по московскому времени, не производится.
Порядок расчета и изменения риск-параметров установлен Методикой определения риск-параметров рынка ценных бумаг и Методикой определения риск-параметров валютного рынка и рынка драгоценных металлов.
- 14.11. Единый лимит Участника клиринга рассчитывается Клиринговым центром исходя из оценки в российских рублях максимально возможного уменьшения в течение срока, необходимого для прекращения обязательств по Сделкам T+ в случае неисполнения Участником клиринга Маржинального требования, общей стоимости активов и обязательств, указанных в пункте 14.3 Правил клиринга на фондовом рынке, в связи с изменением Расчетных цен ценных бумаг, являющихся предметом

Сделок T+, изменением Ставок по сделкам РЕПО, являющимся Сделками T+, Центральных курсов иностранных валют и/или изменением процентных ставок по сделкам своп.

При расчете Единого лимита Участника клиринга обязательства по Сделкам T+, которые могут быть заключены на основании зарегистрированных в Системе торгов заявок, Нетто-обязательства Участника клиринга по Сделкам T+ в российских рублях / иностранной валюте и ценных бумагах, иные обязательства и Задолженность учитываются со знаком «минус», требования по Сделкам T+, которые могут быть заключены на основании зарегистрированных в Системе торгов заявок, Нетто-требования Участника клиринга по Сделкам T+ в российских рублях / иностранной валюте и ценных бумагах, иные требования и Обеспечение Участника клиринга в российских рублях, иностранной валюте и ценных бумагах – со знаком «плюс».

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

Указанная оценка проводится с использованием Верхних и Нижних границ диапазона оценки рыночных и процентных рисков.

Рассчитанный в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга на фондовом рынке Единый лимит корректируется (складывается с учетом знака) с итоговой корректировкой Единого лимита с учетом Расчетных ставок РЕПО, рассчитанной как сумма с учетом знака корректировок Единого лимита с учетом Расчетных ставок РЕПО по каждой Дате исполнения, отстоящей от текущей даты более, чем на 1 (один) Расчетный день, и с итоговой корректировкой Единого лимита с учетом Индикативных курсов сделок своп, рассчитанной как сумма с учетом знака корректировок Единого лимита с учетом Индикативных курсов сделок своп по каждой валюте и каждой Дате исполнения, отстоящей от текущей даты более, чем на 1 (один) Расчетный день.

РАЗДЕЛ IV. ПОРЯДОК И УСЛОВИЯ ДОПУСКА ОБЯЗАТЕЛЬСТВ К КЛИРИНГУ

Статья 15. Порядок взаимодействия с Биржей при подаче заявок и заключении сделок, допуске к клирингу обязательств по биржевым сделкам и обязательств по внесению компенсационных взносов

- 15.1. При подаче Участником торгов заявки, Биржа с использованием Системы торгов направляет Клиринговому центру информацию о поданной заявке.
- 15.2. 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 Y_n , 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 T_0/Y_n , Y_0/Y_n , Y_1/Y_n , Y_m/Y_n , 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 16 Правил клиринга на фондовом рынке, за исключением заявок на заключение сделок с кодом расчетов K_0 .
- 15.3. Процедура контроля обеспечения осуществляется в отношении Разделов и/или Счетов обеспечения, по которым должны исполняться обязательства по сделке.
- 15.3.1. Обязательства по сделке с кодом расчетов T_0 , Z_0 , R_b , X_0 , B_0 - B_{30} , S_n , K_0 исполняются по Разделу T_0 или Разделу T^+ и Счету обеспечения T_0 или Счету обеспечения, входящим в состав Торгово-клирингового счета, указанного в заявке на заключение сделки.
- 15.3.2. Обязательства по сделке с кодом расчетом Y_n , T_0/Y_n , Y_0/Y_n , Y_1/Y_n , Y_m/Y_n всегда исполняются по Разделу T^+ и Счету обеспечения. Этими Разделом и Счетом обеспечения являются:
- в случае если в заявке на заключение сделки указан Торгово-клиринговый счет, в состав которого входят Раздел T^+ и Счет обеспечения, то Раздел T^+ и Счет обеспечения, входящие в состав Торгово-клирингового счета, указанного в заявке;

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

- в случае если в заявке на заключение сделки указан Торгово-клиринговый счет, в состав которого входят Раздел Т0 и/или Счет обеспечения Т0, то Раздел Т+, связанный с Разделом Т0, входящим в состав Торгово-клирингового счета, указанного в заявке, и Счет обеспечения, входящий в состав Торгово-клирингового счета совместно с таким Разделом Т+.
- 15.4. При выполнении условий, указанных в пункте 15.2 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 15.2 настоящей статьи, - Отчет о невозможности регистрации заявки.
- 15.5. 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.
- 15.5.1. После получения Уведомления о снятии заявки на заключение сделки с кодом расчетов Yn, T0/Yn, Y0/Yn, Y1/Yn, Ym/Yn, поданной Участником торгов, стороной которой будет являться Участник клиринга Клиринговый центр рассчитывает Единый лимит Участника клиринга по Расчетному коду, соответствующему Счету обеспечения, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в отозванной заявке, без учета отозванной заявки.
- 15.6. При регистрации в Системе торгов заявки, являющейся в соответствии с Правилами торгов на фондовом рынке 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 сделки (за исключением заявок на заключение сделок с кодом расчетов К0).
- 15.7. 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.
- 15.8. После того, как информация о регистрации сделки стала доступной Клиринговому центру посредством Системы торгов, Клиринговый центр допускает к клирингу обязательства по заключенной сделке.
- 15.8.1. После того, как информация о регистрации сделки купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов Т0, К0, Т0/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 Т0, К0 / первой части заключенной сделки РЕПО с кодом расчетов Т0/Yn;
 - рассчитывает соответствующий Единый лимит Участника клиринга 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, в состав которого входят Счета обеспечения и/или Разделы T+).

15.8.2. 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.

15.8.3. После того, как информация о регистрации сделки с кодом расчетов Yn, T0/Yn, Y0/Yn, Y1/Yn, Ym/Yn стала доступной Клиринговому центру посредством Системы торгов, Клиринговый центр также:

- рассчитывает соответствующий Единый лимит Участника клиринга без учета заявки (части заявки), на основании которой была заключена указанная сделка, и с учетом указанной заключенной сделки;
- изменяет с учетом заключенной сделки Нетто-обязательство и/или Нетто-требование Участника клиринга по Сделкам T+ в российских рублях / иностранной валюте и ценных бумагах с Датами исполнения, соответствующими Дате (Датам) исполнения обязательств по заключенной сделке с кодом расчетов Yn, Y0/Yn, Y1/Yn, Ym/Yn, по второй части заключенной сделки РЕПО с кодом расчетов T0/Yn, по Счету обеспечения (для денежных средств) и/или по Разделу T+ (для ценных бумаг), по которым должны исполняться обязательства по сделке.

15.9. 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 соответствующий Единый лимит Участника клиринга 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, в состав которого входят Счета обеспечения и/или Разделы T+);
- 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 31.6.1 Правил клиринга на фондовом рынке.

15.10. 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.

- 15.10.1. После получения посредством Системы торгов информации об обязательствах по внесению / требованиям по получению Участниками клиринга компенсационных взносов Клиринговый центр допускает указанные обязательства / требования к клирингу.
- 15.10.2. 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 16. Процедура контроля обеспечения по биржевым сделкам с ценными бумагами

- 16.1. Процедура контроля обеспечения, осуществляемая при подаче заявок на заключение биржевых сделок, за исключением заявок, дата активации которых не наступила, считается пройденной в следующих случаях:
- 16.1.1. Для заявки на покупку ценных бумаг с кодом расчетов T0, Z0, Rb, X0 в случае, если сумма сделки, которая может быть заключена на основании поданной заявки, включая НКД, не превышает планового значения позиции по денежным средствам по Счету обеспечения T0 или Счету обеспечения, по которому должны исполняться обязательства по сделке.
- Для заявок на заключение сделок РЕПО, проверка, указанная в настоящем подпункте Правил клиринга на фондовом рынке, осуществляется для первой части сделки РЕПО.
- 16.1.2. Для заявки на продажу ценных бумаг с кодом расчетов T0, Rb в случае, если количество ценных бумаг, указанное в заявке, не превышает планового значения позиции по ценным бумагам по Разделу T0 или T+, по которому должны исполняться обязательства по сделке.
- Для заявок на заключение сделок РЕПО, проверка, указанная в настоящем подпункте Правил клиринга на фондовом рынке, осуществляется для первой части сделки РЕПО.
- 16.1.3. Для заявки на продажу ценных бумаг с кодом расчетов Z0, X0 в случае, если количество ценных бумаг, указанное в заявке, не превышает начального и планового значения позиции по ценным бумагам по Разделу T0 или T+, по которому должны исполняться обязательства по сделке.
- 16.1.4. Для заявок на покупку или продажу ценных бумаг с кодом расчетов T0, Rb, Z0, X0 на заключение сделки, обязательства по которой должны исполняться по Разделу T+ и/или Счету обеспечения, дополнительно к условиям, указанным в подпунктах 16.1.1-16.1.3 Правил клиринга на фондовом рынке, проверяется достаточность Единого лимита Участника клиринга по Расчетному коду, соответствующему Разделу T+ и/или Счету обеспечения, по которым должны исполняться обязательства по сделке, в соответствии с подпунктом 16.1.7 Правил клиринга на фондовом рынке. При этом сумма операции, в отношении которой осуществляется указанная проверка, определяется в соответствии с подпунктами 16.1.1-16.1.3 Правил клиринга на фондовом рынке.
- 16.1.5. Для заявки на покупку или на продажу с кодом расчетов Yn, Y0/Yn, Y1/Yn, Ym/Yn, в случае достаточности Единого лимита Участника клиринга по Расчетному коду, соответствующему Счету обеспечения, по которому должны исполняться

обязательства по сделке, в соответствии с подпунктом 16.1.7 Правил клиринга на фондовом рынке.

- 16.1.6. Для заявки на покупку или продажу ценных бумаг с кодом расчетов T0/Yn в случае прохождения проверки в соответствии с подпунктом 16.1.1 или 16.1.2 Правил клиринга на фондовом рынке и проверки в соответствии с подпунктом 16.1.5 Правил клиринга на фондовом рынке.
- 16.1.7. Единый лимит Участника клиринга по Расчетному коду является достаточным для подачи заявки при условии, что значение Единого лимита с учетом поданной заявки не станет отрицательным, или, если Единый лимит Участника клиринга по такому Расчетному коду был отрицательным до момента подачи заявки, при условии, что Единый лимит Участника клиринга по такому Расчетному коду, рассчитанный с учетом поданной заявки, не станет меньше, чем Единый лимит Участника клиринга по этому Расчетному коду, рассчитанный до момента подачи заявки.
- 16.1.8. Для заявки на покупку ценных бумаг с кодом расчетов Yn, Y0/Yn, Y1/Yn, T0/Yn, Ym/Yn на заключение Сделки T+, по которой должен осуществляться клиринг с полным обеспечением по денежным средствам, дополнительным необходимым условием, кроме условий, указанных в подпункте 16.1.5 или подпункте 16.1.6 Правил клиринга на фондовом рынке, и для заявки на покупку ценных бумаг с кодом расчетов T0, Rb, Z0, X0 на заключение сделки, обязательства по которой должны исполняться по Счету обеспечения, дополнительным необходимым условием, кроме условий, указанных в подпунктах 16.1.1 и 16.1.4 Правил клиринга на фондовом рынке, является следующее:
- сумма сделки, которая может быть заключена на основании поданной заявки, включая НКД, не превышает планового значения позиции по денежным средствам, рассчитанного по каждой Дате исполнения, по Счету обеспечения, по которому должны исполняться обязательства по сделке.

Для заявок на заключение сделок РЕПО, проверки, указанные в настоящем подпункте Правил клиринга на фондовом рынке, осуществляются для первой и второй части сделки РЕПО.

- 16.1.9. Для заявки на продажу ценных бумаг с кодом расчетов Yn, Y0/Yn, Y1/Yn, T0/Yn, Ym/Yn на заключение Сделки T+, по которой должен осуществляться клиринг с полным обеспечением по ценным бумагам, дополнительным необходимым условием, кроме условий, указанных в подпункте 16.1.5 или подпункте 16.1.6 Правил клиринга на фондовом рынке, и для заявки на продажу ценных бумаг с кодом расчетов T0, Rb, Z0, X0 на заключение сделки, обязательства по которой должны исполняться по Разделу T+, дополнительным необходимым условием, кроме условий, указанных в подпунктах 16.1.2-16.1.3 и подпункте 16.1.4 Правил клиринга на фондовом рынке, является следующее:
- количество ценных бумаг, указанное в заявке, не превышает планового значения позиции по ценным бумагам, рассчитанного по каждой Дате исполнения, по Разделу T+, по которому должны исполняться обязательства по сделке.

Для заявок на заключение сделок РЕПО, проверки, указанные в настоящем подпункте Правил клиринга на фондовом рынке, осуществляются для первой и второй части сделки РЕПО.

16.1.10. Для заявки на покупку ценных бумаг с кодом расчетов T0, Z0, Rb, X0, заявки на продажу ценных бумаг с кодом расчетов T0, Rb, Z0, X0 на заключение сделок с расчетами в иностранной валюте, для заявки на покупку или на продажу с кодом расчетов Yn, Y0/Yn, Y1/Yn, T0/Yn, Ym/Yn дополнительно к условиям, указанным в подпунктах 16.1.1-16.1.6 Правил клиринга на фондовом рынке, а также для заявки на покупку или на продажу с кодом расчетов B0-B30 или Sn 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, обязательства по которой должны исполняться по Счету обеспечения T0 - в плановой позиции по денежным средствам по Счету обеспечения T0;
- для заявки на заключение сделки, обязательства по которой должны исполняться по Счету обеспечения, или обязательства по уплате комиссионных вознаграждений по которой должны исполняться по Счету обеспечения, - в Едином лимите.

16.1.11. Для заявок с кодом расчетов T0, Z0, Rb, X0, B0-B30 или Sn на заключение сделок, обязательства по которым должны исполняться по Счету обеспечения T0, проверки, указанные в подпунктах 16.1.1-16.1.4, 16.1.10 Правил клиринга на фондовом рынке осуществляются с учетом Ограничительного лимита, установленного по Счету обеспечения T0.

16.1.12. Проверки, указанные в подпунктах 16.1.1-16.1.11 Правил клиринга на фондовом рынке, 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 той же позиции, что и проверяемая заявка.

16.1.13. Для заявок на покупку ценных бумаг, поданных Участником клиринга категории «А», проверки, указанные в подпунктах 16.1.1, 16.1.4-16.1.6, 16.1.10, 16.1.11 Правил клиринга на фондовом рынке, не осуществляются.

Для заявок на продажу ценных бумаг, поданных Участником клиринга категории «А», проверка, указанная в подпункте 16.1.2 Правил клиринга на фондовом рынке, осуществляется только в случае принятия Участником клиринга категории «А» на себя обязательств по внесению индивидуального клирингового обеспечения в ценных бумагах.

16.2. В случае прохождения заявки на покупку или на продажу Процедуры контроля обеспечения, в ходе которой осуществлялась проверка достаточности Единого лимита, Клиринговый центр начинает учитывать значение Единого лимита Участника клиринга по Расчетному коду, соответствующему Счету обеспечения, по которому должны исполняться обязательства по сделке, рассчитанное в соответствии с подпунктом 16.1.7 Правил клиринга на фондовом рынке, в качестве нового значения Единого лимита Участника клиринга, в случае непрохождения - Клиринговый центр не изменяет учитываемое по такому Расчетному коду значение Единого лимита Участника клиринга.

- 16.3. Для заявок с отложенной датой активации Процедура контроля обеспечения в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на фондовом рынке осуществляется в дату активации во время, установленное Временным регламентом на фондовом рынке (далее – основная Процедура контроля обеспечения).
- 16.4. Для заявок с отложенной датой активации с реквизитом «Частичное обеспечение/отступное» осуществляется дополнительная Процедура контроля обеспечения при подаче такой заявки. Указанная процедура считается пройденной при соблюдении следующих условий:
- если сумма денежных средств, необходимая для исполнения в полном объеме обязательства по передаче отступного за отказ от исполнения обязательств по заключению сделки на основании заявки с отложенной датой активации с реквизитом «Частичное обеспечение/отступное», величина которого определяется в соответствии с Правилами торгов на фондовом рынке (далее – отступное за отказ от заключения сделки), не превышает планового значения позиции по денежным средствам по Счету обеспечения, по которому должны исполняться обязательства по сделке;
 - в случае достаточности Единого лимита Участника клиринга по Расчетному коду, соответствующему Счету обеспечения, по которому должны исполняться обязательства по сделке, для исполнения в полном объеме указанного обязательства по передаче отступного, в соответствии с подпунктом 16.1.7 Правил клиринга на фондовом рынке;
 - выполнении условия, указанного в подпункте 16.1.8 Правил клиринга на фондовом рынке, для исполнения в полном объеме указанного обязательства по передаче отступного.
- 16.4.1. В случае непрохождения заявки с отложенной датой активации с реквизитом «Частичное обеспечение/отступное» основной Процедуры контроля обеспечения Клиринговый центр включает в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов с ближайшим временем исполнения обязательство по передаче отступного за отказ от заключения сделки.
- 16.5. Процедура контроля обеспечения, осуществляемая при заключении биржевых сделок с ценными бумагами с кодом расчетов КО, считается пройденной в следующих случаях:
- 16.5.1. Для сделки, заключенной на основании заявки на покупку, в случае если сумма сделки, включая НКД, не превышает планового значения позиции по денежным средствам по Счету обеспечения, по которому должны исполняться обязательства по сделке, а также в случае прохождения соответствующих проверок, указанных в подпунктах 16.1.4, 16.1.8, 16.1.10, 16.1.11 Правил клиринга на фондовом рынке.
- 16.5.2. Для сделки, заключенной на основании заявки на продажу, в случае если количество ценных бумаг в сделке не превышает планового значения позиции депо по Разделу, по которому должны исполняться обязательства по сделке, а также в случае прохождения соответствующих проверок, указанных в подпунктах 16.1.4, 16.1.9, 16.1.10, 16.1.11 Правил клиринга на фондовом рынке.

Статья 17. Порядок допуска к клирингу обязательств по внебиржевым сделкам с ценными бумагами

17.1. 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.

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

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

17.2. 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.

17.3. 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.

17.4. 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.

- 17.5. 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 21 Правил клиринга на фондовом рынке.

РАЗДЕЛ V. ПОРЯДОК ПРОВЕДЕНИЯ КЛИРИНГА

ПОДРАЗДЕЛ V-I. ПОРЯДОК ВНЕСЕНИЯ И ВОЗВРАТА ОБЕСПЕЧЕНИЯ

Статья 18. Порядок внесения Обеспечения

18.1. Внесение Обеспечения в российских рублях и иностранной валюте возможно двумя способами:

- 1) путем зачисления денежных средств на соответствующий клиринговый банковский счет Клирингового центра, открытый в Расчетной организации и предназначенный для внесения индивидуального клирингового обеспечения;
- 2) путем перевода денежных средств со Счетов обеспечения Т0 на Счета обеспечения на основании распоряжения на внесение денежных средств в Обеспечение, поданного Участником клиринга с использованием Клиринговой системы.

18.2. Внесение Обеспечения в ценных бумагах возможно двумя способами:

- 1) путем зачисления ценных бумаг на Раздел Т+ на основании поручения, поданного владельцем торгового счета депо в Расчетный депозитарий
- 2) путем зачисления ценных бумаг с Раздела Т0 на Раздел Т+ на основании распоряжения на внесение ценных бумаг в Обеспечение, поданного Участником клиринга с использованием Клиринговой системы.

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

18.4. Зачисление денежных средств на клиринговый банковский счет Клирингового центра, открытый в Расчетной организации и предназначенный для учета индивидуального клирингового обеспечения, с целью их учета в качестве Обеспечения должно осуществляться с обязательным указанием в назначении платежа соответствующего Расчетного кода Участника клиринга.

18.4.1. Клиринговый центр учитывает в Клиринговой системе денежные средства, зачисленные на клиринговый банковский счет Клирингового центра, открытый в Расчетной организации и предназначенный для учета индивидуального клирингового обеспечения, в качестве Обеспечения Участника клиринга по Счету обеспечения, соответствующему Расчетному коду, указанному в назначении платежа, и увеличивает Единый лимит Участника клиринга по Расчетному коду, указанному в назначении платежа, с учетом зачисленной суммы денежных средств.

18.5. Распоряжение на внесение денежных средств / ценных бумаг в Обеспечение, подаваемое Участником клиринга с использованием Клиринговой системы, содержит указание на Торгово-клиринговые счета, по которым должна быть исполнена данная операция, и сумму денежных средств / количество ценных бумаг, которые необходимо внести в Обеспечение.

18.5.1. Распоряжение на внесение денежных средств в Обеспечение, поданное Участником клиринга, исполняется за счет денежных средств, учитываемых по Счету обеспечения Т0, в случае достаточности планового значения позиции по денежным

- средствам по Счету обеспечения T0, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в распоряжении, за вычетом соответствующего Ограничительного лимита.
- 18.5.2. Распоряжение на внесение ценных бумаг в Обеспечение, поданное Участником клиринга, исполняется за счет ценных бумаг, учитываемых на Разделе T0, в случае достаточности планового значения позиции по ценным бумагам по Разделу T0, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в распоряжении.
- 18.5.3. Частичное исполнение распоряжения на внесение денежных средств / ценных бумаг в Обеспечение невозможно.
- 18.5.4. Внесение денежных средств в Обеспечение осуществляется на Счет обеспечения, входящий в состав Торгово-клирингового счета, указанного в распоряжении.
- 18.5.5. Внесение ценных бумаг в Обеспечение осуществляется на Раздел T+, связанный с Разделом T0, входящим в состав Торгово-клирингового счета, указанного в распоряжении.
- 18.5.6. В случае положительного результата проверки возможности исполнения распоряжения на внесение денежных средств / ценных бумаг в Обеспечение, в Клиринговой системе незамедлительно уменьшается плановое значение позиции по денежным средствам / ценным бумагам по Счету обеспечения T0 / Разделу T0 и увеличивается плановое значение позиции по денежным средствам / ценным бумагам по Счету обеспечения / Разделу T+ Участника клиринга.
- 18.5.7. Обязательства по перечислению денежных средств со Счетов обеспечения T0 на Счета обеспечения и/или по перечислению ценных бумаг с Разделов T0 на Разделы T+ по распоряжениям на внесение денежных средств / ценных бумаг в Обеспечение, прошедшим проверку возможности их исполнения в соответствии с подпунктами 18.5.1, 18.5.2 Правил клиринга на фондовом рынке, 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 29 Правил клиринга на фондовом рынке.
- 18.6. Участник клиринга может перевести денежные средства, учитываемые в качестве Обеспечения, между своими Счетами обеспечения, подав в Клиринговый центр Заявление о переводе денежных средств.
- Данное заявление не принимается Клиринговым центром к исполнению, если сумма денежных средств в соответствующей валюте, указанная Участником клиринга в заявлении, превышает плановое значение позиции по денежным средствам в этой же валюте по Счету обеспечения, с которого денежные средства должны быть списаны, за вычетом соответствующего Ограничительного лимита или если Единый лимит Участника клиринга по Расчетному коду, соответствующему Счету обеспечения, с которого денежные средства, учитываемые в качестве Обеспечения Участника клиринга, должны быть списаны, в результате такого списания станет отрицательным, или отрицательный Единый лимит Участника клиринга по Расчетному коду, соответствующему Счету обеспечения, в результате такого списания уменьшится.
- В случае если в соответствии с поданным Заявлением о переводе денежных средств, списание денежных средств осуществляется со Счета обеспечения, входящего в состав Торгово-клирингового счета с признаком «запрет

необеспеченных покупок», и/или со Счета обеспечения Участника клиринга категории «В», дополнительным условием исполнения такого заявления является не превышение суммы денежных средств, подлежащей списанию, планового значения позиции по денежным средствам, рассчитанного по всем Датам исполнения, по Счету обеспечения за вычетом соответствующего Ограничительного лимита.

При исполнении Заявления о переводе денежных средств плановое значение позиции по денежным средствам Участника клиринга по Счету обеспечения, с которого списываются денежные средства, уменьшается, а по Счету обеспечения, на который зачисляются денежные средства, - увеличивается на сумму переводимых денежных средств.

- 18.7. Обеспечение в российских рублях используется в следующей очередности:
- 1) для погашения Задолженности Участника клиринга перед Клиринговым центром;
 - 2) для исполнения обязательств, включенных в клиринговый пул;
 - 3) для обеспечения исполнения обязательств Участника клиринга по Сделкам T+;
 - 4) для исполнения обязательств по уплате Комиссионного вознаграждения;
 - 5) для исполнения обязательств по уплате Возмещений;
 - 6) для уплаты пеней за наличие непогашенной Задолженности.
- 18.8. Обеспечение в иностранной валюте используется в следующей очередности:
- 1) для исполнения обязательств в соответствующей иностранной валюте, включенных в клиринговый пул;
 - 2) для обеспечения исполнения обязательств Участника клиринга по Сделкам T+.
- 18.9. Обеспечение в ценных бумагах используется в следующей очередности:
- 1) для исполнения обязательств в соответствующих ценных бумагах, включенных в клиринговый пул;
 - 2) для обеспечения исполнения обязательств Участника клиринга по Сделкам T+.
- 18.10. После перечисления Участником клиринга денежных средств на счет Клирингового центра, открытый в Расчетной организации, и учета их в качестве Обеспечения по Счету обеспечения, у Клирингового центра возникает обязательство вернуть денежные средства Участнику клиринга в размере, определяемом в соответствии с пунктами 19.4, 19.5 Правил клиринга на фондовом рынке.
- 18.11. Клиринговый центр вправе осуществить в любое время зачет денежных требований Участника клиринга по возврату ему денежных средств, учитываемых в качестве Обеспечения по Расчетному коду, с денежными требованиями Клирингового центра к этому Участнику клиринга, учитываемыми по тому же Расчетному коду.

Статья 19. Порядок возврата Обеспечения

19.1. Возврат Клиринговым центром Участнику клиринга денежных средств, учитываемых в качестве Обеспечения, осуществляется на основании Запроса о возврате денежных средств из Обеспечения, Постоянного поручения на возврат денежных средств из Обеспечения или на основании Заявления о порядке использования денежных средств и ценных бумаг.

Возврат Клиринговым центром Участнику клиринга ценных бумаг, учитываемых в качестве Обеспечения, осуществляется на основании Запроса о возврате ценных бумаг из Обеспечения, или на основании Заявления о порядке использования денежных средств и ценных бумаг, или на основании поручения на списание ценных бумаг с Раздела T+, поданного в Расчетный депозитарий. Исполнение указанного поручения будет осуществляться в порядке, установленном статьей 31 Правил клиринга на фондовом рынке.

19.1.1. Возврат денежных средств на основании Запроса о возврате денежных средств из Обеспечения или Постоянного поручения на возврат денежных средств из Обеспечения осуществляется на Счет для возврата, зарегистрированный в Клиринговом центре в порядке, установленном общей частью Правил клиринга.

19.1.2. Возврат денежных средств на основании Заявления о порядке использования денежных средств и ценных бумаг осуществляется на Счет обеспечения T0, соответствующий Счету обеспечения.

19.1.3. 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 Раздел T0, связанный с Разделом T+.

19.1.4. Возврат ценных бумаг на основании поручения на списание ценных бумаг с Раздела T+, поданного в Расчетный депозитарий, осуществляется на раздел торгового счета депо, указанный в поручении.

19.2. Запрос о возврате денежных средств из Обеспечения содержит указание на Счет обеспечения / Расчетный код Участника клиринга, валюту и сумму денежных средств.

19.2.1. Запрос о возврате ценных бумаг из Обеспечения содержит указание на Раздел T+, код и количество ценных бумаг.

19.2.2. В случае если между Участником клиринга и Клиринговым центром предусмотрен обмен сообщениями по системе S.W.I.F.T., Участник клиринга вправе направить Запрос о возврате денежных средств из Обеспечения в форме сообщения по системе S.W.I.F.T.

19.2.3. Постоянное поручение на возврат денежных средств из Обеспечения исполняется Клиринговым центром каждый Расчетный день, начиная с первого Расчетного дня, следующего за датой предоставления указанного поручения, после прекращения обязательств по Сделкам T+, включенных в последний в течение Расчетного дня Клиринговый пул по Сделкам T+ в соответствии со статьей 27 Правил клиринга на фондовом рынке, в размере плановой позиции по денежным средствам, учитываемой по Счету обеспечения.

Постоянное поручение на возврат денежных средств из Обеспечения действует до его отмены Участником клиринга.

- 19.2.4. Сроки предоставления Запросов о возврате денежных средств / ценных бумаг из Обеспечения установлены Временным регламентом на фондовом рынке.
- 19.2.5. При предоставлении Запроса о возврате денежных средств / ценных бумаг из Обеспечения позднее времени, указанного во Временном регламенте на фондовом рынке, Запрос о возврате денежных средств / ценных бумаг из Обеспечения не исполняется.
- 19.2.6. Запрос о возврате денежных средств / ценных бумаг из Обеспечения действует в день его предоставления.
- 19.2.7. Запрос о возврате денежных средств / ценных бумаг из Обеспечения, полученный в сроки, установленные Временным регламентом на фондовом рынке, исполняется в день его получения при соблюдении условия, указанного в пункте 19.4 Правил клиринга на фондовом рынке.
- 19.3. 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 Счета обеспечения / с Разделов T0 на Разделы 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 Счета обеспечения / с Разделов T0 на Разделы 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 со Счетов обеспечения / с Разделов 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 со Счетов обеспечения / с Разделов T+ после прекращения обязательств по Сделкам T+ не возвращаются.
- 19.3.1. Заявление о порядке использования денежных средств и ценных бумаг исполняется Клиринговым центром, начиная с Расчетного дня, следующего за датой предоставления указанного заявления.
- 19.4. Возврат Клиринговым центром Участнику клиринга денежных средств / ценных бумаг в соответствии с Запросом о возврате денежных средств / ценных бумаг из

Обеспечения исполняется в случае, если количество ценных бумаг / сумма денежных средств, подлежащая возврату, не превышает планового значения позиции по денежным средствам / ценным бумагам Участника клиринга по Счету обеспечения / Разделу T+ за вычетом соответствующего Ограничительного лимита (для Счета обеспечения), и Единый лимит по Расчетному коду Участника клиринга, указанному в запросе, или Единый лимит по Расчетному коду, к которому относится Раздел T+, указанный в запросе, рассчитанный без учета возвращаемой суммы денежных средств / количества ценных бумаг соответственно, не станет отрицательным.

В случае возврата денежных средств / ценных бумаг со Счета обеспечения / Раздела T+, входящего в состав Торгово-клирингового счета с признаком «запрет необеспеченных покупок» / «запрет коротких продаж», и/или Участника клиринга категории «B», и/или ценных бумаг с признаком «запрет коротких продаж», дополнительным условием исполнения такого возврата является не превышение суммы денежных средств / количества ценных бумаг, подлежащего списанию, планового значения позиции по денежным средствам / ценным бумагам, рассчитанного по всем Датам исполнения, по Счету обеспечения / Разделу T+ за вычетом соответствующего Ограничительного лимита (для Счета обеспечения).

- 19.5. 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 27 Правил клиринга на фондовом рынке, в размере прекращенного Итогового нетто-требования Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам, учитываемого по Счету обеспечения / Разделу T+, но не превышающем планового значения позиции по денежным средствам / ценным бумагам по тому же Счету обеспечения / Разделу T+ за вычетом соответствующего Ограничительного лимита (для Счета обеспечения), 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 Расчетному коду, соответствующему Счету обеспечения / Разделу T+, либо на максимально возможную сумму, не превышающую планового значения позиции по денежным средствам / ценным бумагам по Счету обеспечения / Разделу T+ за вычетом соответствующего Ограничительного лимита (для Счета обеспечения), возврат которой из Обеспечения не приведет к возникновению у Участника клиринга отрицательного Единого лимита по Расчетному коду, соответствующему Счету обеспечения.
- 19.6. Сразу после проверки возможности возврата денежных средств / ценных бумаг из Обеспечения, проведенной в соответствии с пунктом 19.4 или пунктом 19.5 Правил клиринга на фондовом рынке, плановое значение позиции по денежным средствам / ценным бумагам по Счету обеспечения / Разделу T+ уменьшается, а плановое значение позиции по денежным средствам / ценным бумагам по Счету обеспечения T0 / Разделу T0 увеличивается на возвращаемую сумму денежных средств / количество ценных бумаг (при возврате денежных средств / ценных бумаг на Счета обеспечения T0 / Разделы T0).
- 19.6.1. Обязательства по списанию денежных средств / ценных бумаг со Счетов обеспечения / Разделов T+ и/или обязательства по зачислению денежных средств /

ценных бумаг на Счета обеспечения T0 / Разделы T0, возникшие на основании Запросов о возврате денежных средств / ценных бумаг из Обеспечения или Заявлений о порядке использования денежных средств и ценных бумаг, прошедших проверку возможности их исполнения в соответствии с пунктом 19.4 или пунктом 19.5 Правил клиринга на фондовом рынке соответственно, 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 29 Правил клиринга на фондовом рынке.

- 19.7. Информация о размере Обеспечения и об изменении размера Обеспечения передается Участнику клиринга в составе Отчета об Обеспечении.
Отчет об обеспечении направляется Участнику клиринга в форме электронного документа в срок, установленный Временным регламентом на фондовом рынке.

ПОДРАЗДЕЛ V-II. КЛИРИНГОВЫЕ СЕССИИ

Статья 20. Порядок проведения клиринговых сессий. Порядок возникновения и исполнения Маржинальных требований

- 20.1. До начала торгов в установленное Временным регламентом на фондовом рынке время Клиринговый центр проводит клиринговую сессию, в ходе которой Клиринговый центр:
- устанавливает риск-параметры в соответствии с Методикой определения риск-параметров рынка ценных бумаг;
 - для каждого Участника клиринга рассчитывает и устанавливает новые значения Единых лимитов Участника клиринга по Расчетному коду;
 - формирует и направляет Участникам клиринга, у которых возникли Задолженности, Отчет «Требование о погашении задолженности»;
 - определяет Участников клиринга, у которых возникли Маржинальные требования и суммы указанных Маржинальных требований;
 - формирует и направляет Участникам клиринга, у которых возникли Маржинальные требования, Отчет о Маржинальном требовании, содержащий информацию о его сумме.
- 20.2. Клиринговый центр с использованием Системы торгов передает Бирже информацию об установленных риск-параметрах.
- 20.3. Маржинальное требование возникает у Участника клиринга, Единый лимит по Расчетному коду которого по итогам клиринговой сессии стал отрицательным. Сумма Маржинального требования равна абсолютному значению Единого лимита Участника клиринга по Расчетному коду, определенного по итогам клиринговой сессии.
- 20.4. Маржинальное требование, возникшее у Участника клиринга по итогам клиринговой сессии, должно быть исполнено Участником клиринга не позднее установленного Временным регламентом на фондовом рынке времени текущего Расчетного дня.
- 20.5. 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 18 Правил клиринга на фондовом рынке.
- Маржинальное требование может быть также прекращено полностью или в части в случаях:
- исполнения обязательств по Сделкам T+ с наступившей Датой исполнения;
 - заключения Сделок T+, приводящих к увеличению Единого лимита Участника клиринга.
- 20.6. Маржинальное требование по Расчетному коду, возникшее у Участника клиринга, считается прекращенным в момент времени, когда Единый лимит Участника клиринга по такому Расчетному коду станет неотрицательным.

20.7. В случае неисполнения Участником клиринга Маржинального требования по Расчетному коду в срок, установленный Временным регламентом на фондовом рынке между Клиринговым центром и Участником клиринга, не исполнившим Маржинальное требование, без подачи заявок заключаются закрывающие сделки купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов Y_n и/или сделки РЕПО с кодом расчетов Y_0/Y_n , Y_1/Y_n , Y_m/Y_n , приводящие к увеличению Единого лимита данного Участника клиринга по Расчетному коду.

Условия указанных сделок соответствуют условиям, определенным Правилами торгов на фондовом рынке для сделок с кодом расчетов Y_0/Y_n , Y_1/Y_n , Y_m/Y_n , а цены – ценам балансирующих сделок, порядок заключения которых определен общей частью Правил клиринга.

Указанные сделки заключаются до момента исполнения Маржинального требования Участника клиринга 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.

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

ПОДРАЗДЕЛ V-III. ПОРЯДОК ВКЛЮЧЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ В КЛИРИНГОВЫЙ ПУЛ

Статья 21. Общие требования к порядку исполнения обязательств по сделкам и обязательств по внесению компенсационных взносов

21.1. Для исполнения обязательств по сделкам Участники клиринга категории «Б» и «В» обязаны обеспечивать наличие денежных средств на Счетах обеспечения в Клиринговом центре и/или ценных бумаг на Разделах в Расчетном депозитарии, по которым должны исполняться обязательства по сделке.

21.2. 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 счет Клирингового центра, открытый в Расчетной организации и предназначенный для учета индивидуального клирингового обеспечения, и/или ценные бумаги на Разделы Т+ до установленного Временным регламентом на фондовом рынке времени исполнения Участниками клиринга Итоговых нетто-обязательств перед Клиринговым центром (для Сделок Т+).

Денежные средства, перечисленные Участником клиринга категории «А» на клиринговый банковский счет Клирингового центра, учитываются на Счетах обеспечения, открытых Клиринговым центром Участнику клиринга категории «А» на основании его Заявления о присвоении Расчетных кодов, предоставленного Клиринговому центру.

Для исполнения обязательств по денежным средствам по сделкам, за исключением Сделок Т+, Участник клиринга категории «А» обязан внести денежные средства на Счета обеспечения до установленного Временным регламентом на фондовом рынке момента окончания Процедуры контроля обеспечения по сделкам с расчетами в соответствующей валюте.

21.3. Исполнение обязательств по сделкам купли-продажи с кодом расчетов Т0, К0, первым частям сделок РЕПО с кодом расчетов Rb, а также по Сделкам Т+ осуществляется в моменты времени, установленные Временным регламентом на фондовом рынке.

21.3.1. Порядок включения в клиринговый пул обязательств по Сделкам Т+ определен статьей 27 Правил клиринга на фондовом рынке.

21.4. Участник клиринга вправе в Дату исполнения обязательств по сделкам купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов Yn, первой или второй части сделок РЕПО с кодом расчетов Y0/Yn, Y1/Yn, Ym/Yn, второй части сделок РЕПО с кодом расчетов T0/Yn, 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 22.11, 25.9, 25.10 Правил клиринга на фондовом рынке соответственно.

- 21.5. Порядок подачи и регистрации в Клиринговой системе Отчета на исполнение определен в статье 22 Правил клиринга на фондовом рынке, Специального и Срочного отчета на исполнение - в статье 25 Правил клиринга на фондовом рынке.
- 21.6. Исполнение обязательств по сделкам купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов В0-В30, 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.
- 21.7. 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 23 Правил клиринга на фондовом рынке.
- Участник клиринга вправе для исполнения обязательств по внесению компенсационного взноса (компенсационных взносов) включить их в Специальный или Срочный отчет на исполнение.
- 21.8. Участник клиринга, имеющий обязательства по внесению компенсационных взносов и/или по сделкам купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов В0-В30, 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.
- 21.9. По сделкам, за исключением Сделок Т+, 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.
- 21.10. 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.

- 21.11. 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 24 Правил клиринга на фондовом рынке.

- 21.12. 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 24 Правил клиринга на фондовом рынке.

- 21.13. 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:

- 21.13.1. об изменении в одностороннем порядке предмета (объекта) Сделок T+, обязательства по которым не исполнены, и/или порядка исполнения обязательств по Сделкам T+, с учетом условий реорганизации эмитента ценных бумаг или условий иного действия, установленных эмитентом ценных бумаг;

- 21.13.2. о том, что Дата исполнения обязательств по Сделкам T+ 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 22. Порядок подачи и регистрации Отчетов на исполнение

- 22.1. Отчет на исполнение может быть подан по 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, а также по сделке купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов Yn, первой или второй части сделки РЕПО с кодом расчетов Y0/Yn, Y1/Yn, Ym/Yn, второй части сделки РЕПО с кодом расчетов T0/Yn, заключенным на основании адресных заявок.

- 22.2. 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 B0 - с даты заключения до Даты прекращения исполнения;
- по внебиржевой сделке с кодом расчетов B0 - 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 Y0/Yn, Y1/Yn, Ym/Yn, второй части сделки РЕПО с кодом расчетов T0/Yn, заключенным на основании адресных заявок, - в Дату исполнения.
- 22.3. 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 того, что первая часть сделки РЕПО является обеспеченной средствами под исполнение.
- Отчет на исполнение по второй части сделки РЕПО с кодом расчетов Y0/Yn, Y1/Yn, T0/Yn, Ym/Yn, заключенной на основании адресных заявок, может быть подан Участником клиринга в Клиринговую систему при условии исполнения первой части сделки РЕПО.
- 22.4. Отчет на исполнение, поданный Участником клиринга - покупателем, регистрируется в Клиринговой системе только при условии превышения (равенства) планового значения позиции по денежным средствам по Счету обеспечения, по которому должны исполняться обязательства по сделке, в момент подачи Отчета на исполнение, за вычетом соответствующего Ограничительного лимита, величины(е) обязательства данного Участника клиринга по денежным средствам, возникшего по данной сделке (первой или второй части сделки РЕПО) (с учетом НКД).
- 22.5. Отчет на исполнение, поданный Участником клиринга - продавцом, регистрируется в Клиринговой системе только при условии превышения (равенства) планового значения позиции депо по Разделу, по которому должны исполняться обязательства по сделке, в момент подачи Отчета на исполнение величины(е) обязательства данного Участника клиринга по ценным бумагам, возникшего по данной сделке (первой или второй части сделки РЕПО).
- 22.6. Дополнительным условием регистрации в Клиринговой системе Отчета на исполнение по сделке купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов В0-В30, первой и второй части сделки РЕПО с кодом расчетов Sn, второй части сделки РЕПО с кодом расчетов Z0 и Rb, обязательства по которой должны исполняться по Разделу T+ и/или Счету обеспечения, а также Отчета на исполнение по сделке купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов Yn, первой или второй части сделки РЕПО с кодом расчетов Y0/Yn, Y1/Yn, Ym/Yn, второй части сделки РЕПО с кодом расчетов T0/Yn является проверка, что значение Единого лимита Участника клиринга по Расчетному коду, соответствующему такому Разделу T+ и/или Счету обеспечения, с учетом обязательств по сделке не стало отрицательным, или, если

- Единый лимит Участника клиринга по такому Расчетному коду был отрицательным до момента проверки, - проверку того, что Единый лимит Участника клиринга по такому Расчетному коду, рассчитанный с учетом обязательств по сделке, не стал меньше, чем Единый лимит Участника клиринга по этому Расчетному коду, рассчитанный до момента проверки.
- 22.7. Проверки, указанные в пунктах 22.4-22.6 Правил клиринга на фондовом рынке, осуществляются с учетом положений подпунктов РАЗДЕЛ IV.16.1.8, РАЗДЕЛ IV.16.1.9, 16.1.12 Правил клиринга на фондовом рынке.
- 22.8. 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.
- 22.9. 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.
- 22.10. 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 22.11 настоящей статьи Правил клиринга на фондовом рынке.
- 22.11. 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.
- 22.12. 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.
- 22.13. Отчет на исполнение по Сделке T+, не обеспеченной средствами под исполнение на установленное Временным регламентом на фондовом рынке 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, путем включения их в Клиринговый пул по Сделкам T+ в порядке, определенном статьей 27 Правил клиринга на фондовом рынке.

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

Статья 23. Порядок подачи и регистрации поручений на внесение компенсационных взносов и поручений на отказ от компенсационных взносов

23.1. 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.

23.2. Поручение на внесение компенсационного взноса может быть подано в Клиринговую систему в ходе периода регистрации поручений в Дату внесения компенсационного взноса.

23.2.1. Поручение на внесение компенсационного взноса в виде денежных средств, поданное Участником клиринга, регистрируется в Клиринговой системе только при условии превышения (равенства) планового значения позиции по денежным средствам по Счету обеспечения, по которому должны исполняться обязательства по сделке, в момент подачи Поручения, за вычетом соответствующего Ограничительного лимита, величины(е) обязательства данного Участника клиринга по внесению компенсационного взноса.

Поручение на внесение компенсационного взноса в виде ценных бумаг, поданное Участником клиринга, регистрируется в Клиринговой системе только при условии превышения (равенства) планового значения позиции депо по Разделу, по которому должны исполняться обязательства по сделке, в момент подачи Поручения величины(е) обязательства данного Участника клиринга по внесению компенсационного взноса.

Дополнительным условием регистрации в Клиринговой системе Поручения на внесение компенсационного взноса по сделке, обязательства по которой должны исполняться по Разделу T+ и/или Счету обеспечения, является проверка, что значение Единого лимита Участника клиринга по Расчетному коду, соответствующему такому Разделу T+ и/или Счету обеспечения, с учетом обязательства по внесению данного компенсационного взноса не стало отрицательным, или, если Единый лимит Участника клиринга по такому Расчетному коду был отрицательным до момента проверки, - проверку того, что Единый лимит Участника клиринга по такому Расчетному коду, рассчитанный с учетом обязательства по внесению данного компенсационного взноса, не стал меньше, чем Единый лимит Участника клиринга по этому Расчетному коду, рассчитанный до момента проверки.

Проверки, указанные в настоящем пункте Правил клиринга на фондовом рынке, осуществляются с учетом положений подпункта 16.1.12 Правил клиринга на фондовом рынке.

23.3. 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.

- 23.4. Участнику клиринга в Клиринговой системе раскрывается информация о регистрации Поручения на внесение компенсационного взноса, поданного в Клиринговую систему его контрагентом по соответствующей сделке.
- 23.5. 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 23.3 Правил клиринга на фондовом рынке.

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.

- 23.6. Участнику клиринга в Клиринговой системе раскрывается информация о регистрации Поручения на отказ от компенсационного взноса, поданного в Клиринговую систему его контрагентом.
- 23.7. 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 24. Порядок подачи и исполнения Поручений на отказ от исполнения сделки РЕПО / Поручений на отказ от исполнения сделки купли-продажи ценных бумаг

- 24.1. 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.
- 24.2. 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.

- 24.3. 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).
- 24.4. 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.
- 24.4.1. 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.
- 24.4.2. 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.
- 24.5. 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 только при условии превышения (равенства) планового значения позиции по денежным средствам по Счету обеспечения, по которому должны исполняться обязательства по сделке, в момент подачи Поручения, за вычетом соответствующего Ограничительного лимита, величины(е) обязательства данного Участника клиринга по уплате отступного.
- 24.5.1. Дополнительным условием регистрации в Клиринговой системе Поручения на отказ от исполнения сделки РЕПО / Поручения на отказ от исполнения сделки купли-продажи ценных бумаг, обязательства по которой должны исполняться по Разделу Т+ и/или Счету обеспечения, поданного Участником клиринга, обязанным уплатить отступное, является проверка, что значение Единого лимита Участника клиринга по Расчетному коду, соответствующему такому Разделу Т+ и/или Счету обеспечения, с учетом обязательства по уплате отступного не стало отрицательным, или, если Единый лимит Участника клиринга по такому Расчетному коду был отрицательным до момента проверки, - проверку того, что Единый лимит Участника клиринга по такому Расчетному коду, рассчитанный с учетом обязательства по уплате отступного, не стал меньше, чем Единый лимит Участника клиринга по этому Расчетному коду, рассчитанный до момента проверки.
- 24.5.2. Проверки, указанные в настоящем пункте Правил клиринга на фондовом рынке, осуществляются с учетом положений подпунктов РАЗДЕЛ IV.16.1.8, РАЗДЕЛ IV.16.1.9, 16.1.12 Правил клиринга на фондовом рынке.

- 24.6. 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.
- 24.7. 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 25. Порядок подачи и регистрации Специальных и Срочных отчетов на исполнение

- 25.1. Участник клиринга вправе включить в Специальный или Срочный отчет на исполнение:
- сделки купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов B0-B30;
 - 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;
 - первые и вторые части сделок РЕПО с кодом расчетов Y0/Yn, Y1/Yn, Ym/Yn, заключенных на основании адресных заявок;
 - вторые части сделок РЕПО с кодом расчетов T0/Yn, заключенных на основании адресных заявок.
- 25.2. Специальный или Срочный отчет на исполнение может быть подан в Клиринговую систему в ходе периода регистрации поручений до установленного Временным регламентом на фондовом рынке момента окончания периода получения Клиринговым центром от Участников клиринга Специальных и Срочных отчетов на исполнение.
- 25.3. 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.
- 25.4. По всем сделкам и/или обязательствам, указанным в пункте 25.1 Правил клиринга на фондовом рынке и включенным в Специальный или Срочный отчет на исполнение, Клиринговый центр для каждой позиции по Счету обеспечения и/или Разделу, по которым должны исполняться обязательства по сделкам, включенным в Специальный или Срочный отчет на исполнение, рассчитывает нетто-

обязательство (нетто-требование) Участника клиринга по денежным средствам или ценным бумагам.

- 25.4.1. 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 сделок 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 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).

- 25.4.2. 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 сделок 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 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).

- 25.5. Специальный или Срочный отчет на исполнение Участника клиринга, имеющего нетто-обязательство по денежным средствам, регистрируется в Клиринговой системе только при условии превышения (равенства) планового значения позиции по денежным средствам по Счету обеспечения, по которому должны исполняться обязательства по сделке, в момент подачи Специального или Срочного отчета на исполнение, за вычетом соответствующего Ограничительного лимита, величины(е) нетто-обязательства данного Участника клиринга по денежным средствам.

Специальный отчет на исполнение Участника клиринга, имеющего нетто-обязательство по ценным бумагам, регистрируется в Клиринговой системе только при условии превышения (равенства) планового значения позиции депо по Разделу, по которому должны исполняться обязательства по сделке, в момент подачи Специального отчета на исполнение величины(е) нетто-обязательства данного Участника клиринга по ценным бумагам.

Срочный отчет на исполнение Участника клиринга, имеющего нетто-обязательство по ценным бумагам, регистрируется в Клиринговой системе только при условии непревышения в момент подачи Срочного отчета на исполнение данного нетто-обязательства по ценным бумагам меньшей из двух величин: планового или начального значения позиции по ценным бумагам по Разделу, по которому должны исполняться обязательства по сделке.

- 25.5.1. Дополнительным условием регистрации в Клиринговой системе Специального или Срочного отчета на исполнение, в который включены сделки, обязательства по которым должны исполняться по Разделам T+ и/или Счетам обеспечения, является проверка, что значение Единого лимита Участника клиринга по всем Расчетным кодам, соответствующим такому Разделу T+ и/или Счету обеспечения, с учетом величин соответствующих нетто-обязательств данного Участника клиринга не стало отрицательным, или, если Единый лимит Участника клиринга по хотя бы одному Расчетному коду был отрицательным до момента проверки, - проверку того, что Единый лимит Участника клиринга по такому Расчетному коду, рассчитанный с учетом величины соответствующего нетто-обязательства, не стал меньше, чем Единый лимит Участника клиринга по этому Расчетному коду, рассчитанный до момента проверки.

Проверки, указанные в настоящем пункте Правил клиринга на фондовом рынке, осуществляются с учетом положений подпунктов 16.1.8, 16.1.9, 16.1.12 Правил клиринга на фондовом рынке.

- 25.6. Участнику клиринга в Клиринговой системе раскрывается информация о регистрации Специального или Срочного отчета на исполнение, поданного в Клиринговую систему его контрагентом / конечным контрагентом.
- 25.7. 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 25.9 / 25.10 Правил клиринга на фондовом рынке.
- 25.8. Специальные и Срочные отчеты на исполнение, содержащие Сделки T+ и не обеспеченные средствами под исполнение на установленное Временным регламентом на фондовом рынке 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, путем включения их в Клиринговый пул по Сделкам T+ в порядке, определенном статьей 27 Правил клиринга на фондовом рынке.

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.

- 25.9. 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.
- 25.10. 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 26. Порядок включения в клиринговый пул обязательств Участников клиринга по уплате Возмещения

- 26.1. 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.
- 26.2. 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, 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.
- 26.3. 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 включается в Клиринговой системе в Ограничительный лимит по счету, определенному в соответствии с пунктом 7.5 Правил клиринга на фондовом рынке.

- В случае неисполнения обязательств по уплате Возмещения, значение Ограничительного лимита устанавливается в Клиринговой системе в размере совокупных неисполненных обязательств Участника клиринга по уплате Возмещения ежедневно до тех пор, пока обязательства по уплате Возмещения учитываются в Клиринговой системе.
- 26.4. 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.
- 26.5. Обязательства Участника клиринга по уплате Возмещения исполняются после исполнения всех обязательств Участника клиринга по уплате комиссионных вознаграждений, определенных в соответствии со статьей 34 Правил клиринга на фондовом рынке.
- 26.5.1. Возмещение по биржевым сделкам с ценными бумагами удерживается с Участников клиринга в порядке возрастания номеров сделок.
- 26.5.2. Возмещение по биржевой сделке с ценными бумагами может быть удержано только в полном объеме, частичное удержание Возмещения по биржевой сделке не допускается.
- 26.6. Обязательство по уплате Возмещения считается обеспеченным средствами под исполнение при условиях:
- 1) превышения (равенства) планового значения позиции по денежным средствам по Счету обеспечения, по которому должны исполняться обязательства по уплате Возмещения, в момент формирования Клирингового пула для расчетов по итогам торгов после включения в него всех иных обязательств, за вычетом соответствующего Ограничительного лимита, величины(е) данного обязательства Участника клиринга по уплате Возмещения (за исключением Ограничительного лимита в размере обязательств по уплате Возмещений);
 - 2) значение Единого лимита Участника клиринга по Расчетному коду, соответствующему Счету обеспечения, по которому должны исполняться обязательства по уплате Возмещения, с учетом данного обязательства по уплате Возмещения не стало отрицательным, или, если Единый лимит Участника клиринга по такому Расчетному коду был отрицательным до момента проверки, - проверку того, что Единый лимит Участника клиринга по такому Расчетному коду, рассчитанный с учетом данного обязательства по уплате Возмещения, не стал меньше, чем Единый лимит Участника клиринга по этому Расчетному коду, рассчитанный до момента проверки.
- 26.7. Обязательства по уплате Возмещения, обеспеченные средствами под исполнение, включаются в последний в течение Расчетного дня Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов и исполняются в порядке, определенном статьей 29 Правил клиринга на фондовом рынке.
- 26.8. Неисполненные обязательства по уплате Возмещения по сделкам РЕПО 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.

- 26.8.1. 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.

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 27. Порядок включения в клиринговый пул обязательств по Сделкам T+

- 27.1. В срок, установленный Временным регламентом на фондовом рынке как время начала формирования соответствующего Клирингового пула по Сделкам T+, Клиринговый центр:

- 27.1.1. включает в соответствующий Клиринговый пул по Сделкам T+:

- обязательства и требования Участника клиринга и Клирингового центра по денежным средствам и ценным бумагам по Сделкам T+ с наступившей Датой исполнения, не обеспеченных средствами под исполнение на момент формирования Клирингового пула;
- обязательства / требования Участника клиринга и Клирингового центра по Сделкам РЕПО Клирингового центра, заключенным в соответствии с пунктом 28.22 Правил клиринга на фондовом рынке;
- обязательства по передаче / требования по получению Дохода, определенные в соответствии со статьей 33 Правил клиринга на фондовом рынке (только для первого Клирингового пула по Сделкам T+);
- обязательства по уплате комиссионных вознаграждений, определенные в соответствии со статьей 34 Правил клиринга на фондовом рынке, которые должны исполняться по Счетам обеспечения T+ (только для последнего Клирингового пула по Сделкам T+).

- 27.1.2. 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 Счету обеспечения T+ / Разделу T+, 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 Счету обеспечения T+ / Разделу T+;

- 27.1.3. формирует и передает Участникам клиринга отчеты, содержащие информацию об Итоговых нетто-обязательствах / Итоговых нетто-требованиях по денежным средствам / ценным бумагам;

- 27.2. 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.
- 27.3. Клиринговый центр исполняет Итоговые нетто-требования Участника клиринга, учитываемые по Счету обеспечения T+ / Разделу T+, относящемуся к Расчетному коду, определенные в соответствующем Клиринговом пуле, при условии исполнения Участником клиринга своих Итоговых нетто-обязательств, учитываемых по тому же Счету обеспечения T+ / по всем Разделам T+, относящимся к тому же Расчетному коду, определенных в том же Клиринговом пуле.
- 27.4. Клиринговый центр вправе устанавливать Ограничительные лимиты по Счету обеспечения T+ / Разделу T+ в размере Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам, учитываемого по Счету обеспечения T+ / Разделу T+, с момента определения Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований до момента исполнения Клиринговым центром Итоговых нетто-требований Участника клиринга.
- 27.5. Для исполнения Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам, учитываемого по Счету обеспечения / Разделу T+, используется Обеспечение Участника клиринга в соответствующих денежных средствах / ценных бумагах, внесенное Участником клиринга в порядке, определенном статьей 18 Правил клиринга на фондовом рынке, учитываемое по тому же Счету обеспечения / Разделу T+. Обеспечение, учитываемое по другим Счетам обеспечения / Разделам T+ этого же Участника клиринга, не используется.
- Итоговое нетто-обязательство Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам, учитываемое по Счету обеспечения / Разделу T+, является обеспеченным средствами под исполнение, если плановое значение позиции по денежным средствам / ценным бумагам по Счету обеспечения / Разделу T+ больше или равно величине указанного обязательства, учитываемого по тому же Счету обеспечения / Разделу T+, и не обеспеченным – если меньше.
- 27.5.1. Если Итоговое нетто-обязательство Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам, учитываемое по Счету обеспечения / Разделу T+, не является обеспеченным средствами под исполнение, и у Участника клиринга зарегистрирован Счет обеспечения T0 / Раздел T0, соответствующий / связанный с указанным Счетом обеспечения / Разделом T+, 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 времени исполнения Участниками клиринга Итоговых нетто-обязательства по денежным средствам и ценным бумагам, сформировать в Клиринговой системе распоряжение на внесение денежных средств / ценных бумаг 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 19.3 Правил клиринга и содержащего соответствующее указание.

Указанное в настоящем подпункте Правил клиринга на фондовом рынке распоряжение Клирингового центра по денежным средствам / ценным бумагам исполняется при выполнении условий, указанных в подпункте 18.5.1 или подпункте 18.5.2 Правил клиринга на фондовом рынке соответственно.

Указанное в настоящем подпункте Правил клиринга на фондовом рынке распоряжение Клирингового центра не формируется, в случае предоставления Участником клиринга Заявления о порядке использования денежных средств и ценных бумаг, предусмотренного пунктом 19.3 Правил клиринга на фондовом рынке и содержащего указание не перечислять денежные средства / ценные бумаги со Счетов обеспечения T0 на Счета обеспечения / с Разделов T0 на Разделы T+ при исполнении обязательств по Сделкам T+.

- 27.5.2. Если в результате действий, определенных в подпункте 27.5.1 Правил клиринга на фондовом рынке, Итоговое нетто-обязательство Участника клиринга по денежным средствам и/или ценным бумагам остается не обеспеченным средствами под исполнение, данный Участник клиринга признается Недобросовестным участником клиринга, и Клиринговый центр выполняет действия, предусмотренные статьей 28 Правил клиринга на фондовом рынке.
- 27.6. По обеспеченным средствами под исполнение Итоговым нетто-обязательствам Участников клиринга по денежным средствам / ценным бумагам и соответствующих им Итоговым нетто-требованиям Участников клиринга по денежным средствам / ценным бумагам, в том числе определенным по итогам выполнения действий, предусмотренных статьей 28 Правил клиринга на фондовом рынке, Клиринговый центр изменяет плановые значения позиций по денежным средствам / ценным бумагам Участников клиринга по Счету обеспечения / Разделу T+.
- 27.6.1. 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 плановые значения позиций по денежным средствам / ценным бумагам Участника клиринга по Счету обеспечения / Разделу T+ и Счету обеспечения T0 / Разделу 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 18 Правил клиринга на фондовом рынке.
- 27.7. Итоговые нетто-обязательства / Итоговые нетто-требования Участников клиринга по денежным средствам / ценным бумагам, в том числе определенные по итогам выполнения действий, предусмотренных статьей 28 Правил клиринга на фондовом рынке, Клиринговый центр включает в ближайший Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов и исполняет их в порядке, определенном статьей 29 Правил клиринга на фондовом рынке.

ПОДРАЗДЕЛ V-IV. ПОРЯДОК ДЕЙСТВИЙ В СЛУЧАЯХ НЕИСПОЛНЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ

Статья 28. Порядок действий в случаях неисполнения обязательств по Сделкам T+

28.1. В случае непогашения Участником клиринга до времени, установленного Временным регламентом на фондовом рынке, Задолженности, учитываемой по Расчетному коду, Участник клиринга обязан уплатить Клиринговому центру пеню, 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 рынка ценных бумаг;

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, не облагается НДС.

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

28.2. Клиринговый центр зачитывает обязательство Участника клиринга по уплате пени, учитываемое по Расчетному коду, сумма которого рассчитана в соответствии с пунктом 28.1 Правил клиринга на фондовом рынке, с требованием Участника клиринга по возврату Обеспечения в российских рублях, учитываемого по Счету обеспечения, соответствующему 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.

28.3. В случаях:

28.3.1. если Итоговое нетто-обязательство Участника клиринга по денежным средствам в российских рублях и/или ценным бумагам, определенное в соответствующем Клиринговом пуле, не обеспечено средствами под исполнение (полностью или частично);

28.3.2. непогашения Участником клиринга до времени, установленного Временным регламентом на фондовом рынке, Задолженности и наличия Обеспечения Участника клиринга в ценных бумагах;

28.3.3. если Итоговое нетто-обязательство Участника клиринга по денежным средствам, учитываемое по Расчетному коду и определенное в соответствующем Клиринговом пуле, обеспечено средствами под исполнение, но при этом у Участника клиринга имеется Итоговое нетто-требование в ценных бумагах, не принимаемых в качестве

обеспечения исполнения обязательств по Сделкам T+, учитываемое по тому же Расчетному коду, и в результате исполнения (прекращения) указанных обязательств и требований Единый лимит Участника клиринга по такому Расчетному коду станет отрицательным;

в ходе формирования соответствующего Клирингового пула по Сделкам T+, проводимого в соответствии со статьей 27 Правил клиринга на фондовом рынке, между Клиринговым центром и Недобросовестным участником клиринга, без подачи заявок заключается сделка РЕПО с кодом расчетов Y0/Y1 (две сделки купли-продажи ценных бумаг с кодами расчетов Y0, Y1).

28.4. В случаях:

28.4.1. если Итоговые нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам в иностранной валюте, определенные в соответствующем Клиринговом пуле, не обеспечены средствами под исполнение (полностью или частично);

28.4.2. непогашения Участником клиринга до времени, установленного Временным регламентом на фондовом рынке, Задолженности и наличия Обеспечения Участника клиринга в иностранной валюте;

в ходе формирования соответствующего Клирингового пула по Сделкам T+, проводимого в соответствии со статьей 27 Правил клиринга на фондовом рынке, между Клиринговым центром и Недобросовестным участником клиринга, без подачи заявок заключается сделка своп с иностранной валютой / сделка купли-продажи иностранной валюты.

28.5. 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 без специального полномочия (доверенности), а также без согласия Участника клиринга.

28.6. Сделки РЕПО (сделки купли-продажи ценных бумаг), указанные в пункте 28.3 Правил клиринга на фондовом рынке, заключаются при соблюдении следующих условий:

28.6.1. 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;

28.6.2. 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;

28.6.3. 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;

28.6.4. количество Расчетных дней, в течение которых у Участника клиринга возникает Итоговое нетто-обязательство по денежным средствам по одному Счету

- обеспечения, не обеспеченное средствами под исполнение, не превышает 2 (двух) Расчетных дней подряд;
- 28.6.5. количество Расчетных дней, в течение которых у Участника клиринга возникает Итоговое нетто-обязательство по соответствующей ценной бумаге по Разделам Т+, относящимся к одному Расчетному коду, не обеспеченное средствами под исполнение, не превышает 4 (четырёх) Расчетных дней подряд;
- 28.6.6. у Клирингового центра отсутствует информация о прекращении проведения депозитарных операций с ценной бумагой со следующего Расчетного дня;
- 28.6.7. 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.
- 28.7. Условия, указанные в подпунктах 28.6.4, 28.15.4 Правил клиринга на фондовом рынке, не применяются, если причиной необеспеченности Итогового нетто-обязательства по денежным средствам средствами под исполнение является несвоевременное зачисление денежных средств на клиринговые счета Клирингового центра, вызванное проведением процедур комплаенс-контроля в банках-корреспондентах, сбоями в работе платежных систем, а также обстоятельствами непреодолимой силы, определенными в пункте 28.18 Правил клиринга на фондовом рынке.
- Участник клиринга обязан предоставить Клиринговому центру документы, подтверждающие действие причин, указанных в настоящем пункте Правил клиринга на фондовом рынке.
- 28.8. Сделки купли-продажи ценных бумаг, указанные в пункте 28.3 Правил клиринга на фондовом рынке, заключаются по Торгово-клиринговым счетам, предназначенным для учета ценных бумаг и денежных средств, находящихся в доверительном управлении Участника клиринга, а также в случае предоставления Участником клиринга Клиринговому центру Заявления о заключении сделок купли-продажи.
- 28.9. Условия сделок РЕПО (двух сделок купли-продажи ценных бумаг), заключаемых между Клиринговым центром и Недобросовестным участником клиринга в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на фондовом рынке, соответствуют определенным Правилами торгов на фондовом рынке условиям Сделок Т+, заключенных в Секторе рынка Основной рынок, с учетом следующих особенностей:
- 28.9.1. в случае наличия у Участника клиринга не обеспеченного полностью или частично средствами под исполнение Итогового нетто-обязательства по ценным бумагам, по первой части сделки РЕПО (по первой сделке купли-продажи ценных бумаг) у Участника клиринга возникают требования по соответствующим ценным бумагам в объеме, равном величине не обеспеченного средствами под исполнение Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по ценным бумагам (части указанного обязательства);
- 28.9.2. в случае наличия у Участника клиринга не обеспеченного полностью или частично средствами под исполнение Итогового нетто-обязательства по денежным средствам (в российских рублях), по первой части сделки РЕПО (по первой сделке купли-продажи ценных бумаг) у Участника клиринга возникают требования в

российских рублях и обязательства по ценным бумагам в объеме, равном количеству ценных бумаг, не превышающему суммы объема Итогового нетто-требования по ценным бумагам, соответствующего не обеспеченному полностью или частично средствами под исполнение Итоговому нетто-обязательству Участника клиринга по денежным средствам в российских рублях, и/или планового значения позиции Участника клиринга по соответствующим ценным бумагам, учитываемой по Разделу Т+ (за исключением ценных бумаг, не принимаемых в качестве обеспечения исполнения обязательств по Сделкам Т+);

- 28.9.3. в случае наличия у Участника клиринга Задолженности, по первой части сделки РЕПО (по первой сделке купли-продажи ценных бумаг) у Участника клиринга возникают требования в российских рублях и обязательства по ценным бумагам в объеме, не превышающем размера планового значения позиции Участника клиринга по ценным бумагам по Разделу Т+, соответствующем сумме Задолженности;
- 28.9.4. 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 Участника клиринга 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 Участника клиринга по Расчетному коду;
- 28.9.5. Датой исполнения обязательств по первой части сделки РЕПО (первой сделке купли-продажи ценных бумаг) является день ее заключения;
- 28.9.6. Датой исполнения обязательств по второй части сделки РЕПО (второй сделке купли-продажи ценных бумаг) является Расчетный день, следующий за днем ее заключения;
- 28.9.7. 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;
- 28.9.8. 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+, не обеспеченных средствами под исполнение, установленная Клиринговым центром в соответствии с Методикой определения риск-параметров рынка ценных бумаг;

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.

- 28.9.9. при наличии у Участника клиринга неисполненного Итогового нетто-обязательства по денежным средствам, учитываемого по Счету обеспечения, или Задолженности, учитываемой по Счету обеспечения, сделка РЕПО (сделки купли-продажи ценных бумаг) в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга на фондовом рынке заключаются в отношении ценных бумаг, учитываемых по Разделу T+, относящемуся к тому же Расчетному коду, что и Счет обеспечения, за исключением ценных бумаг, не принимаемых в качестве обеспечения исполнения обязательств по Сделкам T+. Выбор ценных бумаг, в отношении которых заключается сделка РЕПО (сделки купли-продажи ценных бумаг), осуществляется Клиринговым центром.
- 28.10. При наличии случаев, указанных в пункте 28.3 Правил клиринга на фондовом рынке, и несоблюдении любого из условий, указанных в подпунктах 28.6.3-28.6.6 Правил клиринга на фондовом рынке, в ходе формирования соответствующего Клирингового пула по Сделкам T+, проводимого в соответствии со статьей 27 Правил клиринга на фондовом рынке, между Клиринговым центром и Недобросовестным участником клиринга без подачи заявок заключается закрывающая сделка купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов Y0, условия которой соответствуют определенным Правилами торгов на фондовом рынке условиям Сделок T+, заключенных в Секторе рынка Основной рынок, с учетом следующих особенностей:
- 28.10.1. в случае наличия у Участника клиринга не обеспеченного полностью или частично средствами под исполнение Итогового нетто-обязательства по ценным бумагам, по сделке купли-продажи ценных бумаг у Участника клиринга возникают требования по соответствующим ценным бумагам в объеме, равном величине не обеспеченного средствами под исполнение Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по ценным бумагам (части указанного обязательства);
- 28.10.2. в случае наличия у Участника клиринга не обеспеченного полностью или частично средствами под исполнение Итогового нетто-обязательства по денежным средствам в российских рублях, по сделке купли-продажи ценных бумаг у Участника клиринга возникают требования в российских рублях и обязательства по ценным бумагам в объеме, равном количеству ценных бумаг, не превышающему суммы объема Итогового нетто-требования по ценным бумагам, соответствующего не обеспеченному полностью или частично средствами под исполнение Итогового нетто-обязательству Участника клиринга по денежным средствам в российских рублях, и/или планового значения позиции Участника клиринга по соответствующим ценным бумагам, учитываемым по Разделу T+;
- 28.10.3. в случае наличия у Участника клиринга Задолженности и наличия Обеспечения Участника клиринга в ценных бумагах, по сделке купли-продажи ценных бумаг у Участника клиринга возникают требования в российских рублях и обязательства по ценным бумагам в объеме, не превышающем размера планового значения позиции Участника клиринга по ценным бумагам по Разделу T+, соответствующем сумме Задолженности;

- 28.10.4. Датой исполнения обязательств по сделке купли-продажи ценных бумаг является день ее заключения;
- 28.10.5. 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;
- 28.10.6. при наличии у Участника клиринга неисполненного Итогового нетто-обязательства по денежным средствам в российских рублях, учитываемого по Счету обеспечения, или Задолженности, учитываемой по Счету обеспечения, сделка купли-продажи ценных бумаг в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга на фондовом рынке заключаются в отношении ценных бумаг, учитываемых по Разделу Т+, относящемуся к тому же Расчетному коду, что и Счет обеспечения. Выбор ценных бумаг, в отношении которых заключается сделка РЕПО (сделки купли-продажи), осуществляется Клиринговым центром.
- 28.11. При наличии случаев, указанных в пункте 28.3 Правил клиринга на фондовом рынке, и несоблюдении условия, указанного в подпункте 28.6.4 Правил клиринга на фондовом рынке, по Торгово-клиринговым счетам Участника клиринга, имеющего необеспеченное средствами под исполнение Итоговое нетто-обязательство по ценным бумагам / денежным средствам устанавливается признак «запрет коротких продаж» или «запрет необеспеченных покупок» соответственно, и с Участника клиринга взимается штраф, рассчитываемый по формуле:
- $$\text{Penalty} = \text{ROUND} (\text{VAL_OBL} \times \text{C} \times \text{K} \times \text{R} / 365; 2), \text{ где}$$
- Penalty – сумма штрафа, в российских рублях,
VAL_OBL – необеспеченное средствами под исполнение Итоговое нетто-обязательство по ценным бумагам / денежным средствам,
С – Центральный курс иностранной валюты, определенный в соответствии с Методикой риск-параметров валютного рынка и рынка драгоценных металлов / Расчетная цена ценной бумаги / С=1 для необеспеченного средствами под исполнение Итогового нетто-обязательства в российских рублях;
К – коэффициент, установленный решением Клирингового центра; по умолчанию К=5;
R – штрафная ставка, равная ставке РЕПО, применяемой для случаев урегулирования обязательств по Сделкам Т+, не обеспеченных средствами под исполнение, установленная Клиринговым центром в соответствии с Методикой определения риск-параметров рынка ценных бумаг, 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, не облагается НДС.
- Обязательство по уплате штрафа, рассчитанное в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга на фондовом рынке, учитывается по Счету для возмещения и комиссии, порядок определения которого установлен пунктом 7.5 Правил клиринга на фондовом рынке.
- 28.12. Клиринговый центр зачитывает обязательство Участника клиринга по уплате штрафа, учитываемое по Расчетному коду, соответствующему Счету для

возмещения и комиссии, сумма которого рассчитана в соответствии с пунктом 28.11 Правил клиринга на фондовом рынке, с требованием Участника клиринга по возврату Обеспечения в российских рублях, учитываемого по такому Расчетному коду, за исключением случаев отзыва (аннулирования) у Участника клиринга лицензии на осуществление 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.

- 28.13. Клиринговый центр вправе принять решение о заключении вместо сделок РЕПО, предусмотренных пунктом 28.3 Правил клиринга на фондовом рынке, сделки купли-продажи ценных бумаг, условия которой предусмотрены пунктом 28.10 Правил клиринга на фондовом рынке:
- при принятии Клиринговым центром решения об установлении по ценной бумаге, по которой учитывается Итоговое нетто-обязательство, не обеспеченное средствами под исполнение, признака «запрет коротких продаж»;
 - при наличии у Клирингового центра информации о планируемом приостановлении проведения депозитарных операций с ценной бумагой.
- 28.14. При наличии случаев, указанных в пункте 28.3 Правил клиринга на фондовом рынке, и при принятии Клиринговым центром решения в соответствии с подпунктом 21.13.2 Правил клиринга на фондовом рынке, в ходе формирования соответствующего Клирингового пула по Сделкам Т+, проводимого в соответствии со статьей 27 Правил клиринга на фондовом рынке, между Клиринговым центром и Недобросовестным участником клиринга без подачи заявок заключается закрывающая сделка купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов Y0, условия которой соответствуют условиям, определенным в пункте 28.10 Правил клиринга на фондовом рынке, за исключением суммы сделки купли-продажи, которая определяется как произведение количества ценных бумаг в сделке и цены, установленной решением Клирингового центра. Клиринговый центр устанавливает цену указанной сделки исходя из рыночной ситуации на дату ее заключения.
- 28.15. Сделки своп с иностранной валютой, указанные в пункте 28.4 Правил клиринга на фондовом рынке, заключаются при соблюдении следующих условий:
- 28.15.1. у Участника клиринга не отозвана (не аннулирована) лицензия Банка России на осуществление банковских операций со средствами в рублях и иностранной валюте;
- 28.15.2. 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;
- 28.15.3. 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;
- 28.15.4. количество Расчетных дней, в течение которых у Участника клиринга возникает Итоговое нетто-обязательство по денежным средствам в соответствующей

иностранной валюте по одному Счету обеспечения, не обеспеченное средствами под исполнение, не превышает 2 (двух) Расчетных дней подряд.

28.16. Условия сделок своп с иностранной валютой, заключаемых в соответствии с пунктом 28.4 Правил клиринга на фондовом рынке, соответствуют условиям сделок своп, установленным в Правилах торгов на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, с учетом следующих особенностей:

28.16.1. в случае наличия у Участника клиринга не обеспеченного полностью или частично средствами под исполнение Итогового нетто-обязательства по денежным средствам в иностранной валюте, по первой части сделки своп у Участника клиринга возникают требования в соответствующей иностранной валюте в объеме, равном не обеспеченному полностью или частично средствами под исполнение Итоговому нетто-обязательству Участника клиринга по денежным средствам в иностранной валюте;

28.16.2. в случае наличия у Участника клиринга Задолженности и наличия Обеспечения Участника клиринга в иностранной валюте, по первой части сделки своп у Участника клиринга возникают требования в российских рублях и обязательства в иностранной валюте в объеме, равном размеру Обеспечения Участника клиринга в иностранной валюте, соответствующему сумме Задолженности;

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

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

28.16.5. 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 Рабочего дня.

28.16.6. 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 Рабочего 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.

28.17. При наличии случаев, указанных в пункте 28.4 Правил клиринга на фондовом рынке, и несоблюдении любого из условий, указанных в подпунктах 28.15.3-28.15.4 Правил клиринга на фондовом рынке, между Клиринговым центром и

Участником клиринга без подачи заявок заключается закрывающая сделка купли-продажи иностранной валюты, условия которой соответствуют условиям первой части сделки своп, определенным в пункте 28.16 Правил клиринга на фондовом рынке, а цена сделки – цене балансирующей сделке, порядок заключения которой определен общей частью Правил клиринга.

- 28.18. В случае невозможности исполнения Участником клиринга своих Итоговых нетто-обязательств по денежным средствам / ценным бумагам вследствие непреодолимой силы или сбоя в платежной системе Банка России, сделки РЕПО (две сделки купли-продажи ценных бумаг) / сделки своп с иностранной валютой, заключаемые между Клиринговым центром и Участником клиринга в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на фондовом рынке, заключаются со ставкой РЕПО / 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 исполнение Участником клиринга своих Итоговых нетто-обязательств по денежным средствам / ценным бумагам невозможно, Участник клиринга обязан уведомить Клиринговый центр любыми доступными средствами связи до установленного Временным регламентом на фондовом рынке времени исполнения Итоговых нетто-обязательств по денежным средствам / ценным бумагам.

Участник клиринга обязан предоставить Клиринговому центру документы, подтверждающие обстоятельства непреодолимой силы в течение 7 (семи) дней. В случае непредоставления Участником клиринга Клиринговому центру таких документов в указанный срок с Участника клиринга по решению Клирингового центра взыскивается неустойка по ставке РЕПО / Цене сделки своп, определенной в соответствии с подпунктом 28.9.8 / 28.16.6 Правил клиринга на фондовом рынке, в расчете на количество календарных дней между датой исполнения первой части сделки РЕПО / первой части сделки своп и датой расчета неустойки (между датами исполнения первой и второй сделки купли-продажи).

- 28.19. В случае отзыва (аннулирования) или приостановления действия лицензии профессионального участника рынка ценных бумаг на осуществление депозитарной деятельности у Держателя, по Разделу Т+ торгового счета депо которого учитываются Нетто-обязательства / Нетто-требования по Сделкам Т+ Участника клиринга, Клиринговый центр вправе принять решение о том, что Дата исполнения обязательств по Сделкам Т+ Участника клиринга, исполнение обязательств по передаче ценных бумаг по которым должно исполняться по такому Разделу Т+, считается наступившей в текущий Расчетный день.

- 28.19.1. Обязательства по Сделкам T+, в отношении которых Клиринговым центром принято решение в соответствии с пунктом 28.19 Правил клиринга на фондовом рынке, включаются в Клиринговый пул по Сделкам T+ и участвуют в определении Итогового нетто-обязательства / Итогового нетто-требования Участника клиринга в соответствии со статьей 27 Правил клиринга на фондовом рынке, 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 28.10 Правил клиринга на фондовом рынке.
- 28.20. Итоговое нетто-обязательство Участника клиринга по денежным средствам в российских рублях, учитываемое по Счету обеспечения, не обеспеченное средствами под исполнение по итогам действий, выполненных в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на фондовом рынке, учитывается как Задолженность Участника клиринга перед Клиринговым центром по Счету обеспечения.
- Указанная Задолженность должна быть погашена Участником клиринга не позднее времени, установленного Временным регламентом на фондовом рынке.
- Информация о наличии у Участника клиринга Задолженности и ее размере передается Участнику клиринга в составе отчета «Требование о погашении задолженности», направляемом Участнику клиринга в соответствии с пунктом 20.1 Правил клиринга на фондовом рынке.
- 28.21. Если Задолженность Участника клиринга по Расчетному коду не погашена полностью в результате заключения сделок в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на фондовом рынке и/или Участником клиринга в срок, установленный Временным регламентом на фондовом рынке, 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.
- 28.22. При наличии Недобросовестных участников клиринга, имеющих не обеспеченные полностью или частично средствами под исполнение Итоговые нетто-обязательства по денежным средствам / ценным бумагам, для исполнения Итоговых нетто-требований по денежным средствам / ценным бумагам Добросовестных участников клиринга Клиринговый центр выполняет действия в следующей последовательности:
- использует свободные собственные денежные средства и/или собственные ценные бумаги;
 - в случае недостаточности свободных собственных ценных бумаг заключает Сделки РЕПО Клирингового центра в соответствии со статьей 32 Правил клиринга на фондовом рынке;
 - в случае недостаточности свободных собственных денежных средств и/или невозможности заключения Сделок РЕПО Клирингового центра в соответствии со статьей 32 Правил клиринга на фондовом рынке на необходимое недостающее количество ценных бумаг без подачи заявок заключает сделки РЕПО с кодом расчетов Y0/Y1 (две сделки купли-продажи ценных бумаг с кодами расчетов Y0, Y1), с Добросовестными участниками

клиринга.

28.22.1. Сделки купли-продажи в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга на фондовом рынке заключаются по Торгово-клиринговым счетам, предназначенным для учета ценных бумаг и денежных средств, находящихся в доверительном управлении Участника клиринга, а также в случае предоставления Участником клиринга Клиринговому центру Заявления о заключении сделок купли-продажи, предусмотренного пунктом 28.8 Правил клиринга на фондовом рынке.

28.22.2. Условия сделок РЕПО (двух сделок купли-продажи), заключаемых между Клиринговым центром и Добросовестным участником клиринга в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга на фондовом рынке, соответствуют условиям, определенным Правилами торгов на фондовом рынке для биржевых Сделок Т+, с учетом следующих особенностей:

- в случае недостаточности у Клирингового центра ценных бумаг для исполнения Итоговых нетто-требований Добросовестного участника клиринга по первой части сделки РЕПО (по первой сделке купли-продажи) у Участника клиринга возникают обязательства по соответствующим ценным бумагам, противоположные указанному Итоговому нетто-требованию Добросовестного участника клиринга по ценным бумагам в объеме, не превышающем Итогового нетто-требования Добросовестного участника клиринга по ценным бумагам;
- в случае недостаточности у Клирингового центра денежных средств для исполнения Итоговых нетто-требований Добросовестного участника клиринга, по первой части сделки РЕПО (по первой сделке купли-продажи) у Участника клиринга возникают обязательства в соответствующей валюте, противоположные указанному Итоговому нетто-требованию Добросовестного участника клиринга по денежным средствам, и требования по ценным бумагам в объеме, равном Итоговому нетто-обязательству Добросовестного участника клиринга по ценным бумагам, соответствующему Итоговому нетто-требованию Добросовестного участника клиринга по денежным средствам;
- иные условия заключаемых сделок соответствуют условиям сделок, определенных в пункте 28.9, при этом цена второй части сделки РЕПО (второй сделки купли-продажи) определяется таким образом, чтобы разница между суммой первой и второй частью сделки РЕПО (между суммой первой и второй сделки купли-продажи) была уплачена в пользу Добросовестного участника клиринга.

28.23. Сделки РЕПО (две сделки купли-продажи), указанные в пункте 28.22 Правил клиринга на фондовом рынке, 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.

28.23.1. В случае невозможности Клирингового центра исполнить Итоговые нетто-требования по ценной бумаге одного или нескольких Добросовестных участников клиринга в течение 4 (четырех) Расчетных дней подряд, Клиринговый центр:

- устанавливает по такой ценной бумаге признак «запрет коротких продаж»;
- заключает с Добросовестным участником клиринга без подачи заявок 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 подпункте 28.22.2 Правил клиринга на фондовом рынке, за исключением цены сделки купли-продажи ценных бумаг, которая устанавливается решением Клирингового центра исходя из рыночной ситуации на дату заключения указанной сделки.

28.24. После заключения сделок в соответствии с пунктами 28.3-28.23 Правил клиринга на фондовом рынке 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 29 Правил клиринга на фондовом рынке.

28.24.1. Обязательства и требования по вторым частям сделок РЕПО (вторым сделкам купли-продажи) / вторым частям сделок своп, вторым частям Сделок РЕПО Клирингового центра, заключенным в соответствии с пунктами 28.3-28.23 Правил клиринга на фондовом рынке, учитываются в составе Нетто-обязательств / Нетто-требований Участника клиринга по Сделкам T+ с Датой исполнения, соответствующей дате исполнения указанных обязательств и требований.

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

Статья 29. Порядок исполнения обязательств и требований Участников клиринга и Клирингового центра, включенных в клиринговый пул

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

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

29.2. 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.

29.2.1. 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.

29.2.2. 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 25.4.1 и 25.4.2 Правил клиринга на фондовом рынке.

29.3. 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 периоды времени, установленные Временным регламентом на фондовом рынке. Для каждого периода времени, установленного Временным регламентом на фондовом рынке в качестве времени исполнения указанных обязательств, формируется отдельный Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов и отдельный Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов по сделкам с центральным контрагентом.

29.4. По обязательствам по сделкам с ценными бумагами с кодами расчетов T0, K0 и обязательствам по первым частям сделок РЕПО с кодом расчетов T0/Уп, а также обязательствам по иным Сделкам T+, 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.

29.5. 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.

29.5.1. Нетто-обязательство (нетто-требование) Участника клиринга (Клирингового центра) по денежным средствам по сделкам клирингового пула по каждой его позиции по денежным средствам, определенной в отношении Счета обеспечения T0 или Счета обеспечения, 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 29.2 Правил клиринга на фондовом рынке;
- 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 передаче отступного за отказ от заключения сделки;
- требованиям по зачислению денежных средств на Счет обеспечения T0 / Счет обеспечения по исполненным в Клиринговой системе возвратам денежных средств из Обеспечения / распоряжениям на внесение денежных средств в Обеспечение;
- обязательствам по списанию денежных средств со Счета обеспечения T0 / Счет обеспечения по исполненным в Клиринговой системе распоряжениям на внесение денежных средств в Обеспечение / возвратам денежных средств из Обеспечения;
- Итоговым нетто-обязательствам / Итоговым нетто-требованиям Участников клиринга по денежным средствам, определенным по Сделкам T+, обязательства по которым были включены в Клиринговый пул по Сделкам T+, в соответствии с пунктом 27.6 Правил клиринга на фондовом рынке (только для Счетов обеспечения);
- обязательствам по уплате комиссионных вознаграждений и неустоек, определенным в соответствии со статьей 34 Правил клиринга на фондовом

рынке (только для последнего Клирингового пула для расчетов по итогам торгов и Счетов обеспечения T0);

- обязательствам по уплате / требованиям по получению Возмещения, определенных в соответствии со статьей 26 Правил клиринга на фондовом рынке (только для последнего Клирингового пула для расчетов по итогам торгов).

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.

- 29.5.2. Нетто-обязательство (Нетто-требование) Участника клиринга (Клирингового центра) по ценным бумагам по сделкам клирингового пула по каждой его позиции депо, определенной в отношении Раздела T0 / Раздела T+ 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 29.2 Правил клиринга на фондовом рынке;
- 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 Раздел T0 / Раздел T+ по исполненным в Клиринговой системе возвратам ценных бумаг из Обеспечения / распоряжениям на внесение ценных бумаг в Обеспечение;
- обязательствам по списанию ценных бумаг с Раздела T0 / Раздела T+ по исполненным в Клиринговой системе распоряжениям на внесение ценных бумаг в Обеспечение / возвратам ценных бумаг из Обеспечения;
- требованиям по зачислению ценных бумаг на Раздел T0 / Раздел T+ по исполненным в Клиринговой системе запросам о возврате ценных бумаг из гарантийных фондов / обеспечения под стресс;
- обязательствам по списанию ценных бумаг с Раздела T0 / Раздела T+ по исполненным в Клиринговой системе распоряжениям на перечисление ценных бумаг в гарантийные фонды / обеспечение под стресс;
- Итоговым нетто-обязательствам / Итоговым нетто-требованиям Участников клиринга по ценным бумагам, определенным по Сделкам T+, обязательства

по которым были включены в Клиринговый пул по Сделкам T+, в соответствии с пунктом 27.6 Правил клиринга на фондовом рынке (только для Разделов T+).

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.

29.5.3. Нетто-обязательство (Нетто-требование) Участника клиринга (Клирингового центра) по ценным бумагам по сделкам клирингового пула по каждой его позиции депо, определенной в отношении субсчета 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:

- обязательствам по списанию ценных бумаг с субсчета депо по исполненным в Клиринговой системе запросам о возврате ценных бумаг из гарантийных фондов / обеспечения под стресс;
- требованиям по зачислению ценных бумаг на субсчета депо по исполненным в Клиринговой системе распоряжениям на перечисление ценных бумаг в гарантийные фонды / обеспечение под стресс.

29.6. Нетто-обязательства (нетто-требования) Участников клиринга по ценным бумагам по сделкам клирингового пула, рассчитанные в соответствии с подпунктами 29.5.2-29.5.3 Правил клиринга на фондовом рынке, включаются в распоряжение на проведение операций по Разделам / субсчетам депо, направляемое Клиринговым центром Расчетному депозитарию в соответствии с пунктом 31.7 Правил клиринга на фондовом рынке.

29.7. 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 25.4.2 Правил клиринга на фондовом рынке 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 31.6 Правил клиринга на фондовом рынке.

29.8. 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 25.4.1 Правил клиринга на фондовом рынке по обязательствам, включенным в Срочный отчет на исполнение, или в соответствии с подпунктом 29.5.1 Правил клиринга на фондовом рынке в отношении Счета обеспечения T0 или Счета обеспечения, исполняются за

счет денежных средств, учитываемых по тому же Счету обеспечения Т0 / Счету обеспечения.

29.8.1. Обязательство по оплате ценных бумаг или Нетто-обязательство Участника клиринга по денежным средствам по сделкам клирингового пула, определенное в отношении Счета обеспечения Т0 / Счета обеспечения, считается исполненным, если значение начальной позиции по денежным средствам по тому же Счету обеспечения Т0 / Счету обеспечения не меньше, чем соответствующее обязательство / Нетто-обязательство Участника клиринга.

29.8.2. Если значение плановой позиции по денежным средствам по Счету обеспечения Т0 меньше, чем Обязательство по оплате ценных бумаг или Нетто-обязательство Участника клиринга по денежным средствам по сделкам клирингового пула, определенное в отношении Счета обеспечения Т0, соответствующее обязательство / Нетто-обязательство прекращается в части, соответствующей размеру указанной начальной позиции, а неисполненная часть соответствующего обязательства / Нетто-обязательства на следующий Расчетный день включается в Ограничительный лимит по Счету обеспечения Т0.

29.8.3. Если значение плановой позиции по денежным средствам по Счету обеспечения меньше, чем Обязательство по оплате ценных бумаг или Нетто-обязательство Участника клиринга по денежным средствам по сделкам клирингового пула, определенное в отношении Счета обеспечения, соответствующее обязательство / Нетто-обязательство прекращается в части, соответствующей размеру указанной начальной позиции, а неисполненная часть соответствующего обязательства / Нетто-обязательства учитывается как Задолженность.

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

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

Задолженность считается погашенной, если на момент времени, установленный Временным регламентом на фондовом рынке в качестве времени погашения соответствующей Задолженности, значение плановой позиции по денежным средствам по Счету обеспечения, по которому учитывалась Задолженность, является неотрицательным.

Порядок действий Клирингового центра при непогашении Участником клиринга Задолженности в установленный Временным регламентом на фондовом рынке срок, определен в статье 28 Правил клиринга на фондовом рынке.

29.8.4. 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 / Счета обеспечения, с требованием Участника клиринга по возврату денежных средств, учитываемых по тому же Счету обеспечения Т0 / Счету обеспечения, а значение начальной и плановой позиции по денежным средствам по тому же Счету обеспечения Т0 / Счету обеспечения уменьшается на сумму такого исполненного обязательства / Нетто-обязательства (или его части).

- 29.9. 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 25.4.1 Правил клиринга на фондовом рынке по обязательствам, включенным в Срочный отчет на исполнение, или в соответствии с подпунктом 29.5.1 Правил клиринга на фондовом рынке в отношении Счета обеспечения T0 / Счета обеспечения, прекращается возникновением обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга денежных средств, учитываемых по тому же Счету обеспечения T0 / Счету обеспечения, в размере соответствующего требования / Нетто-требования Участника клиринга.
- При этом значение начальной и плановой позиции по денежным средствам по Счету обеспечения T0 / Счету обеспечения увеличивается на сумму такого прекращенного требования / Нетто-требования.
- 29.10. После исполнения (прекращения) Нетто-обязательств (нетто-требований) Участников клиринга по денежным средствам по сделкам клирингового пула в соответствии с пунктами 29.8 или 29.9 Правил клиринга на фондовом рынке и направления в Расчетный депозитарий распоряжения на проведение операций по Разделам / субсчетам депо в соответствии с пунктом 31.6 или 31.7 Правил клиринга на фондовом рынке обязательства Участников клиринга и Клирингового центра по оплате и передаче ценных бумаг (по сделкам с ценными бумагами), 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 31.8 Правил клиринга на фондовом рынке расчеты по ценным бумагам по итогам клиринга считаются завершенными.
- 29.11. Не исполненные обязательства и требования Участников клиринга по сделкам, за исключением Сделок T+, 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.
- 29.12. 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.
- 29.13. 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-VI. ОСОБЕННОСТИ ВЗАИМОДЕЙСТВИЯ С РАСЧЕТНОЙ ОРГАНИЗАЦИЕЙ И РАСЧЕТНЫМ ДЕПОЗИТАРИЕМ

Статья 30. Особенности взаимодействия с Расчетной организацией

- 30.1. Каждый Расчетный день до начала Торгов, Клиринговый центр направляет Расчетной организации Запрос выписки по Торговым счетам, в ответ на который Расчетная организация передает Клиринговому центру выписку по Торговым счетам.
- 30.2. После получения от Расчетной организации выписки по Торговым 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 счетов в суммах, указанных в полученной от Расчетной организации выписки по торговым банковским счетам.
- После получения от Расчетной организации отчета об исполнении указанного распоряжения учитывает переведенные денежные средства на Счетах обеспечения Т0, открытых к соответствующим Торговым счетам, и устанавливает начальные и плановые значения основных и дополнительных позиций по денежным средствам, определяемых в отношении Счетов обеспечения Т0, равными суммам денежных средств, учитываемых на соответствующих Счетах обеспечения Т0.
- 30.3. При увеличении в ходе торгов суммы денежных средств, учитываемых на Торговом счете, Расчетная организация передает Клиринговому центру информацию о таком увеличении, а Клиринговый центр учитывает это увеличение в плановых значениях основных и дополнительных позиций по денежным средствам Участников клиринга и передает Расчетной организации распоряжение на перевод на клиринговый банковский счет Клирингового центра денежных средств с Торгового счета в сумме указанного увеличения.
- 30.4. В случае необходимости в ходе Торгов списания денежных средств с Торгового счета, Расчетная организация направляет Клиринговому центру запрос согласия Клирингового центра на списание денежных средств с Торговых счетов.
- Клиринговый центр дает согласие на списание денежных средств с Торговых счетов при условии, что сумма списания не превышает планового значения соответствующей позиции по денежным средствам Участника клиринга за вычетом соответствующего Ограничительного лимита, и направляет Расчетной организации распоряжение на перевод денежных средств с клирингового банковского счета на Торговые счета на сумму списания.
- 30.5. После окончания торгов Клиринговый центр направляет Расчетной организации распоряжение на проведение операций по Торговым счетам, содержащее распоряжения на перевод денежных средств с клирингового банковского счета на Торговые счета в суммах плановых значений позиций по денежным средствам по Счетам обеспечения Т0, учитываемых в Клиринговой системе 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.

- 30.6. После исполнения Расчетной организацией распоряжения на проведение операций по Торговым счетам, направленного Клиринговым центром в соответствии с пунктом 30.5 Правил клиринга на фондовом рынке, Клиринговый центр направляет Расчетной организации уведомление о согласии на проведение операций по Торговым 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 счетам.

- 30.7. 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 счетам такого Участника клиринга / клиента Участника клиринга с рабочего дня, следующего за днем получения от Расчетной организации указанного уведомления.

Статья 31. Особенности взаимодействия с Расчетным депозитарием и иными депозитариями

- 31.1. Каждый Расчетный день до начала Торгов Расчетный депозитарий передает Клиринговому центру список Разделов / субсчетов депо и выписку по Разделам / субсчетам депо.

- 31.2. После получения от Расчетного депозитария выписки по Разделам / субсчетам депо Клиринговый центр устанавливает в Клиринговой системе начальные и плановые значения позиций депо по Разделам / субсчетам депо Участников клиринга в соответствии с информацией о количестве ценных бумаг, учитываемых на Разделах / субсчетам депо, полученной от Расчетного депозитария в Выписке по Разделам / субсчетам депо.

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

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

- 31.4. 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 в начальных и плановых значениях позиций депо Участников клиринга по Разделам T0 / Разделам T+.

- 31.5. 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 планового и начального значения соответствующей позиции депо Участника клиринга.

Клиринговый центр дает согласие на списание ценных бумаг с Раздела T+ при условии, что количество ценных бумаг, подлежащих списанию, не превышает планового и начального значения соответствующей позиции депо Участника клиринга, и в результате такого списания Единый лимит Участника клиринга 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, планового значения позиции по ценным бумагам, рассчитанного по всем Датам исполнения, по Разделу T+.

При согласии Клирингового центра на списание ценных бумаг плановое и начальное значение позиции по ценным бумагам по Разделу уменьшается на количество ценных бумаг, указанное в запросе.

- 31.6. 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.

- 31.6.1. 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.

- 31.7. Проведение расчетов по ценным бумагам по итогам и 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 по итогам торгов или Клиринговый пул для расчетов в ходе торгов.

В случае необходимости использования ценных бумаг, учитываемых в качестве взносов Участников клиринга в Гарантийные фонды, Клиринговый центр включает в распоряжение на проведение операций по Разделам / субсчетам депо, направляемое Расчетному депозитарию в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга, распоряжение на списание ценных бумаг с субсчетов депо Участников клиринга.

Исполнение распоряжения на проведение операций по Разделам / субсчетам депо, полученного от Клирингового центра в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга на фондовом рынке, осуществляется Расчетным депозитарием в корреспонденции с субсчетом депо Клирингового центра, открытым в рамках клирингового счета депо Клирингового центра в Расчетном депозитарию.

- 31.8. 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.
- 31.9. После окончания установленного Временным регламентом на фондовом рынке времени передачи Участниками клиринга в Клиринговый центр Запросов о возврате ценных бумаг из Обеспечения, 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 Т0 до момента передачи Клиринговому центру Расчетным депозитарием выписки по Разделам / субсчетам депо.

ПОДРАЗДЕЛ V-VII. СДЕЛКИ РЕПО КЛИРИНГОВОГО ЦЕНТРА

Статья 32. Условия Сделок РЕПО Клирингового центра, порядок их заключения и исполнения

- 32.1. Сделки РЕПО Клирингового центра заключаются между Клиринговым центром и Участником клиринга в случае, установленном пунктом 28.22 Правил клиринга на фондовом рынке.
- 32.2. Предметом Сделок РЕПО Клирингового центра могут являться ценные бумаги, с которыми возможно заключение Сделок Т+ (далее в настоящей статье – Ценные бумаги).
- 32.3. Продавцом по первой части Сделки РЕПО Клирингового центра является Участник клиринга, покупателем - Клиринговый центр.
- 32.4. Клиринговый центр вправе заключить Сделку РЕПО Клирингового центра с любым Участником клиринга категории «Б» с использованием любого Раздела Т+, открытого на Торговом счете депо владельца Участника клиринга в Расчетном депозитарии.
- 32.4.1. 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.
- 32.5. Для предоставления Клиринговому центру возможности заключения Сделок РЕПО Клирингового центра с использованием иных Разделов Т+ Участников клиринга, указанных в пункте 32.4 Правил клиринга на фондовом рынке, или с иными Участниками клиринга, Участник клиринга предоставляет Клиринговому центру Заявление о Торгово-клиринговых счетах для заключения сделок с Клиринговым центром.
- 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+, указанном в заявлении.
- 32.6. Выбор Участника клиринга, с которым, в случае необходимости, заключается Сделка РЕПО Клирингового центра, и выбор Раздела 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.
- 32.7. Условия Сделки РЕПО Клирингового центра соответствуют условиям сделок РЕПО, заключаемых в Режиме торгов «РЕПО с ЦК – Адресные заявки», определенным Правилами торгов на фондовом рынке, 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 рынка ценных бумаг;
 - 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 33 Правил клиринга на фондовом рынке. Иной Доход Клиринговый центр передает Участнику клиринга в течение десяти Расчетных дней, следующих за днем получения Клиринговым центром такого Дохода.
- 32.8. 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 Разделов Т+, указанных в пункте 32.4 Правил клиринга на фондовом рынке, или с Участниками клиринга, предоставившими заявление, указанное в пункте 32.4.1 Правил клиринга на фондовом рынке, с использованием Разделов Т+, указанных в данном заявлении, при условии, что на таком Разделе Т+ учитываются недостающие у Клирингового центра ценные бумаги.
- 32.9. Сделки РЕПО Клирингового центра заключаются без подачи заявок.
- 32.10. 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 Т+ в Дату их исполнения в порядке, установленном статьей 27 Правил клиринга на фондовом рынке.
- 32.11. 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 35 Правил клиринга на фондовом рынке. Указанный отчет является

документом, удостоверяющим передачу Участником клиринга Клиринговому центру Ценных бумаг.

ПОДРАЗДЕЛ V-VIII. ПОРЯДОК ПЕРЕДАЧИ ДОХОДА

Статья 33. Порядок передачи Доходов по сделкам РЕПО и сделкам купли-продажи ценных бумаг, заключенным с Клиринговым центром

33.1. 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 28.3 Правил клиринга на фондовом рынке 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.

33.2. 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:

$Inc = ROUND (N \times d \times (1 - T \times (D1 - D2) / D1); 2)$, 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 33.1 Правил клиринга на фондовом рынке (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)

- 33.3. По сделке с акциями иностранных организаций, номинированными в иностранной валюте, размер обязательства по передаче / требования 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 / 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 33.1 Правил клиринга на фондовом рынке (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.

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

$Inc = N \times d$, где	
Inc	размер обязательства по передаче / требования по получению Дохода по сделке (в штуках);
N	размер обязательства / требования Участника клиринга по ценным бумагам по сделке, указанной в пункте 33.1 Правил клиринга на фондовом рынке (в штуках);
d	количество ценных бумаг передаваемых эмитентом на одну акцию, установленное эмитентом ценных бумаг (в штуках).

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

$Inc = ROUND(N \times (d + m); 2)$, 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 33.1 Правил клиринга на фондовом рынке (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);

- 33.6. По сделке с облигациями, номинированными в иностранной валюте, размер обязательства по передаче / требования 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 33.1 Правил клиринга на фондовом рынке (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);

- 33.7. Датой исполнения обязательств по передаче / требований по получению Дохода, определенных в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на фондовом рынке, является Расчетный день, следующий за датой выплаты / передачи Дохода эмитентом (полностью или частично).
- 33.8. Отчет об обязательствах по передаче / требованиях 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.
- 33.9. В Дату исполнения обязательств по передаче / требований по получению Дохода, определенных в соответствии с пунктами 33.2-33.5 Правил клиринга на фондовом рынке, Клиринговый центр зачитывает встречные однородные обязательства по передаче и требования по получению Дохода по сделке, определенные в отношении одного Раздела T+ Участника клиринга.
- Обязательства по передаче / требования по получению Дохода, определенные после проведения зачета в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга на фондовом рынке, учитываются в Клиринговой системе и являются обязательствами, подлежащими исполнению.
- 33.10. Клиринговый центр передает Доход Участнику клиринга, имеющему требование по получению Дохода в отношении одного или нескольких своих Разделов T+, 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 Разделов T+.
- 33.11. Обязательства по передаче / требования по получению Дохода включаются в Клиринговый пул по Сделкам T+ в порядке, установленном статьей 27 Правил клиринга на фондовом рынке.
- 33.12. Информация об исполненных обязательствах по передаче Дохода включается в Отчет об Обеспечении.

РАЗДЕЛ VI. ПОРЯДОК ОПЛАТЫ УСЛУГ. ОТЧЕТЫ ПО ИТОГАМ КЛИРИНГА

Статья 34. Порядок оплаты услуг Клирингового центра, Биржи и Технического центра

- 34.1. На фондовом рынке Клиринговый центр взимает:
- клиринговую комиссию в пользу Клирингового центра;
 - комиссионное вознаграждение в пользу Биржи за организацию торгов;
 - 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 в пользу Биржи, установленные Правилами торгов на фондовом рынке.
- 34.2. 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.
- 34.3. 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 рассчитывается с учетом выбранного Участником торгов / Участником клиринга тарифного плана.
- 34.3.1. 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.
- 34.3.2. Участником торгов / Участникам клиринга, не выбравшим ни один из тарифных планов, устанавливается тарифный план REPO_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.
- 34.4. 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 7.5 Правил клиринга на фондовом рынке.
- 34.5. 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 рассчитывается при подаче заявки на заключение сделки, на ее сумму уменьшается плановое значение позиции по денежным средствам, определяемая в отношении Счета обеспечения, порядок определения которого установлен подпунктом 7.5.1 Правил клиринга на фондовом рынке, по окончании Торгов в дату заключения сделки обязательства по уплате указанного комиссионного вознаграждения 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 указанному Счету обеспечения.
- 34.6. 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 7.5 Правил клиринга на фондовом рынке, не позднее третьего Расчетного дня месяца, следующего за месяцем оказания клиринговых услуг.
- 34.7. Комиссионное вознаграждение по внебиржевым сделкам рассчитывается по окончании Торгов в дату регистрации Поручения на клиринг внебиржевой сделки, и 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 обеспечения Т0, соответствующего Торговому счету, указанному в Поручении на клиринг внебиржевой сделки (за исключением внебиржевых сделок, заключаемых в иностранной валюте).

- 34.8. 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, 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 7.5 Правил клиринга на фондовом рынке.
- 34.9. Неустойка в пользу Биржи, установленная Правилами торгов на фондовом рынке, взимается Клиринговым центром в Расчетный день нарушения Участником торгов обязательства, за которое установлена соответствующая неустойка, 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 7.5 Правил клиринга на фондовом рынке.
- 34.10. Комиссионное вознаграждение за предоставление по запросам Участников клиринга дубликатов отчетов по итогам клиринга, предусмотренных Правилами клиринга на фондовом рынке, подлежат уплате Участником клиринга в день предоставления указанных дубликатов 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 обеспечения, указанному Участником клиринга в запросе на предоставление дубликатов отчетов по итогам клиринга.
- 34.11. 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, 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 7.5 Правил клиринга на фондовом рынке.

34.12. 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, 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 обеспечения T0 / Счету обеспечения, 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 7.5 Правил клиринга на фондовом рынке, 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.

34.13. Комиссионное вознаграждение Клирингового центра за учет клирингового обеспечения удерживается Клиринговым центром с Участника клиринга в первый Рабочий день календарного месяца, следующего за месяцем оказания услуг, со Счета для возмещения и комиссии, порядок определения которого установлен пунктом 7.5 Правил клиринга на фондовом рынке, за исключением случаев, предусмотренных Тарифами Клирингового центра.

Клиринговый центр ежемесячно направляет Участнику клиринга Отчет о комиссионном вознаграждении за учет клирингового обеспечения.

34.14. 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 плановое значение позиции по денежным средствам, определяемое в отношении Счета для возмещения и комиссии, порядок определения которого установлен пунктом 7.5 Правил клиринга на фондовом рынке, по окончании Торгов в дату заключения

сделки обязательства по уплате указанного комиссионного вознаграждения 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 указанному Счету обеспечения.

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.

34.15. Обязательства Участника торгов / Участника клиринга по уплате комиссионного вознаграждения и неустоек исполняются после исполнения иных обязательств Участника клиринга по денежным средствам, определенных в соответствии со статьей 29 Правил клиринга на фондовом рынке, за исключением обязательств по уплате Возмещения.

34.16. В случае недостаточности денежных средств на соответствующем Счете обеспечения Т0 / Счете обеспечения для исполнения обязательств Участника торгов / Участника клиринга по уплате комиссионного вознаграждения, указанные обязательства исполняются в следующей очередности:

- в первую очередь исполняются обязательства по уплате неустойки, установленные Правилами торгов на фондовом рынке;
- во вторую очередь – обязательства по уплате комиссионного вознаграждения, начисленного в предыдущие Расчетные дни;
- в третью очередь - обязательства по уплате комиссионного вознаграждения, начисленного в текущий Расчетный день.

В случае недостаточности денежных средств на соответствующем Счете обеспечения Т0 / Счете обеспечения 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) постоянная часть комиссионного вознаграждения по сделкам РЕПО;
- 3) постоянная часть комиссионного вознаграждения по сделкам купли-продажи акций;
- 4) постоянная часть комиссионного вознаграждения по сделкам купли-продажи облигаций;
- 5) комиссионное вознаграждение по тарифному плану «Размещения-фиксированный»;
- 6) комиссионное вознаграждение за учет клирингового обеспечения;
- 7) абонентская плата;
- 8) дополнительное вознаграждение;
- 9) комиссионное вознаграждение за предоставление дубликатов отчетов по итогам клиринга;
- 10) 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 / Счете обеспечения 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.

Статья 35. Порядок представления отчетов по итогам клиринга

35.1. 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 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 комиссионном вознаграждении за учет клирингового обеспечения.

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

- 35.2. 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.
- 35.3. 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.
- 35.4. 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.
- 35.5. Отчеты, указанные в пунктах 35.1 и 35.2 Правил клиринга на фондовом рынке, направляются Участнику клиринга (Держателю, Клиринговому банку) в форме электронных документов в соответствии с Порядком ЭДО.
- 35.6. Отчеты, направляемые в форме электронных документов, имеют категорию «В»² и составляются в текстовом формате (ASCII) в соответствии с Порядком ЭДО.
- 35.7. 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.

² Понятие категории электронного документа определяется в Правилах ЭДО

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.

- 35.8. 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 35.1 и 35.2 Правил клиринга на фондовом рынке (далее - нестандартные отчеты), в бумажной форме.
- 35.9. Для получения в бумажной форме отчетов, указанных в пункте 35.8 Правил клиринга на фондовом рынке, Участник клиринга обязан предоставить Клиринговому центру Доверенность на получение и предоставление документов.
- 35.10. Отчеты в бумажной форме или в форме электронных документов, указанные в пункте 35.8 Правил клиринга на фондовом рынке, 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.
- 35.11. В случае обнаружения ошибок Клиринговый центр имеет право сформировать и направить Участникам клиринга исправленные отчеты. При этом правильным отчетом считается отчет, имеющий более позднюю дату и время формирования отчета.
- 35.12. Формы и форматы отчетов, предоставляемых Клиринговым центром в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга на фондовом рынке, установлены документом «Формы и форматы отчетов, предоставляемых Участникам клиринга, клиентам Участников клиринга, Держателям и Клиринговым банкам на фондовом рынке», раскрываемом на Сайте Клирингового центра.

РАЗДЕЛ VII. ПРОЧИЕ УСЛОВИЯ

Статья 36. Особенности перевода обязательств и Обеспечения одного Участника клиринга другому Участнику клиринга

36.1. 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.

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

- регистрирует Торгово-клиринговый счет Участника клиринга – реципиента, в состав которого входят клиентский Расчетный код, открытый Участнику клиринга – реципиенту для такого Обособленного клиента, и 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;
- направляет Расчетному депозитарию распоряжение на перевод ценных бумаг с Раздела(-ов), входящего(-их) в состав Торгово-клирингового(-ых) счета(-ов) Базового Участника клиринга, открытого(-ых) для такого Обособленного клиента, на Раздел(-ы), входящий(-ие) в состав Торгово-клирингового(-ых) счета(-ов) Участника клиринга – реципиента.

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

Приложение № 1
к Правилам клиринга на фондовом рынке

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

I. Список документов, предоставляемых юридическим лицом – Резидентом

- 1) Копии учредительных документов юридического лица с изменениями и дополнениями с отметкой о регистрации федеральным органом исполнительной власти, уполномоченным на осуществление государственной регистрации юридических лиц. Указанные копии должны быть заверены федеральным органом исполнительной власти, уполномоченным на осуществление государственной регистрации юридических лиц, или нотариально.
- 2) Нотариально удостоверенные копии свидетельств о внесении записей в Единый государственный реестр юридических лиц (ЕГРЮЛ), выданных уполномоченным органом, осуществляющим государственную регистрацию юридических лиц, и подтверждающую факт внесения в ЕГРЮЛ записей о государственной регистрации юридического лица (либо о юридическом лице, зарегистрированном до 1 июля 2002 года).
- 3) Заверенная подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица копия свидетельства о постановке на учет в налоговом органе юридического лица.
- 4) Подлинник или нотариально удостоверенная копия решения уполномоченного органа юридического лица (также могут быть предоставлены нотариально удостоверенная выписка из решения или подлинник выписки, заверенный подписью лица, уполномоченного на подписание решения) об избрании (назначении) единоличного исполнительного органа.
- 5) Оригинал доверенности, или нотариально удостоверенная копия, или копия, заверенная лицом, выдавшим указанную доверенность на представителя юридического лица, уполномоченного подписывать необходимые документы во взаимоотношениях с Клиринговым центром.
- 6) Карточка с образцами подписей и оттиска печати юридического лица, оформленная в соответствии с требованиями нормативных актов Банка России (либо нотариально удостоверенная копия карточки).
- 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, 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).
- 1) Документ, подтверждающий постановку юридического лица на налоговый учет в Российской Федерации (копия, верность которой засвидетельствована нотариусом или самим юридическим лицом) (при наличии).
- 2) Документ уполномоченного органа юридического лица, подтверждающий избрание (назначение) лица, уполномоченного действовать от имени юридического лица в соответствии с учредительными документами.
- 3) Доверенности на представителей юридического лица, уполномоченных подписывать необходимые документы во взаимоотношениях с Клиринговым центром.
- 4) Нотариально удостоверенная карточка или иной документ с образцами подписей и оттиска печати юридического лица (оттиск печати проставляется при наличии).
- 5) 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).
- 6) Иные документы, которые могут быть запрошены Клиринговым центром в необходимых случаях, также Клиринговый центр вправе потребовать уточнения информации, содержащейся в ранее предоставленных документах.

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

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

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

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

Приложение № 2
к Правилам клиринга на фондовом рынке

Временной регламент на фондовом рынке

1. Время (сроки) осуществления документооборота (совершения операций) в процессе взаимодействия Клирингового центра с Участниками клиринга при проведении клиринга и расчетов по сделкам с ценными бумагами:

№ п/п	Наименование операции	Время (московское)
1.	Установление в Клиринговой системе начальных значений позиций по ценным бумагам и денежным средствам Участников клиринга.	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
3.	Направление Участникам клиринга отчетных документов по итогам клиринга (в соответствии со статьей 35 Правил клиринга на фондовом рынке) в форме электронных документов.	Не позднее времени, указанного в нормативных актах Банка России

2. Время (сроки) осуществления документооборота (совершения операций) в процессе взаимодействия Клирингового центра с Участниками клиринга при внесении / возврате Обеспечения и проведения клиринга по Сделкам T+:

№ п/п	Наименование операции	Время (московское)
1.	Проведение клиринговой сессии.	с 9:45 до 10:00
2.	Передача Клиринговым центром Участникам клиринга Отчетов о Маржинальном требовании, Требований о погашении задолженности, Отчетов об Обеспечении, Отчетов об обязательствах по Сделкам T.	до 10:15
3.	Исполнение Маржинальных требований.	до 17:30 дня возникновения Маржинального требования
4.	Погашение Задолженности.	до 16:00 Рабочего дня, следующего за днем возникновения Задолженности
5.	Начисление пени за наличие непогашенной Задолженности.	19:00 Рабочего дня, следующего за днем возникновения

		Задолженности
6.	Формирование первого Клирингового пула по Сделкам T+.	16:00
6.1.	Формирование первого Клирингового пула по Сделкам T+ в отношении Участников клиринга, которыми превышено количество Расчетных дней, в течение которых у Участника клиринга может возникать Итоговое нетто-обязательство по денежным средствам / ценным бумагам, не обеспеченное средствами под исполнение.	10:00
7.	Исполнение Участниками клиринга Итоговых нетто-обязательств, определенных в первом Клиринговом пуле по Сделкам T+.	17:00 Даты исполнения
7.1.	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 возникать Итоговое нетто-обязательство по денежным средствам / ценным бумагам, не обеспеченное средствами под исполнение.	10:00 Даты исполнения
8.	Исполнение Клиринговым центром Итоговых нетто-требований Участников клиринга, определенных в первом Клиринговом пуле по Сделкам T+.	с 17:30 до 18:00 Даты исполнения
9.	Формирование первого Клирингового пула для расчетов по итогам торгов и Клирингового пула для расчетов по итогам торгов по сделкам с центральным контрагентом.	17:30
10.	Исполнение обязательств, определенных в первом Клиринговом пуле для расчетов по итогам торгов / Клиринговом пуле для расчетов по итогам торгов по сделкам с центральным контрагентом, и расчеты по итогам клиринга.	с 17:30 до 18:00 Даты исполнения
11.	Формирование второго Клирингового пула по Сделкам T+, Клирингового пула для расчетов по итогам торгов и Клирингового пула для расчетов по итогам торгов по сделкам с центральным контрагентом.	19:00
12.	Исполнение Участниками клиринга Итоговых нетто-обязательств, определенных во втором Клиринговом пуле по Сделкам T+.	19:00 Даты исполнения
13.	Исполнение Клиринговым центром Итоговых нетто-требований Участников клиринга, определенных во втором Клиринговом пуле по Сделкам T+.	с 19:00 до 20:00 Даты исполнения
14.	Исполнение обязательств, определенных во втором Клиринговом пуле для расчетов по итогам торгов / Клиринговом пуле для расчетов по итогам торгов по сделкам с центральным контрагентом, и расчеты по итогам клиринга.	с 19:00 до 20:00 Даты исполнения
15.	Передача Участником клиринга Клиринговому центру распоряжений на внесение денежных средств в Обеспечение (с использованием Клиринговой системы).	с 09:30 до 20:00 Расчетного дня
16.	Передача Участником клиринга Клиринговому центру Запросов о возврате денежных средств из Обеспечения.	с 09:30 до 20:00 Расчетного дня, но не позднее, чем за 30 минут до окончания времени приема расчетных документов для перечисления денежных средств с банковского счета, установленного регламентом работы Расчетной организации по соответствующей

		валюте
17.	Передача Участником клиринга Клиринговому центру распоряжений на внесение ценных бумаг в Обеспечение (с использованием Клиринговой системы).	с 09:30 до 20:30 Расчетного дня
18.	Передача Участником клиринга Клиринговому центру Запросов о возврате ценных бумаг из Обеспечения (с использованием Клиринговой системы).	с 09:30 до 20:30 Расчетного дня
19.	Исполнение Участниками клиринга обязательств по уплате комиссионных вознаграждений по Сделкам T+, заключенным до 19:00.	до 19:00 дня заключения сделки
20.	Исполнение Участниками клиринга обязательств по уплате комиссионных вознаграждений по Сделкам T+, заключенным после 19:00.	до 19:00 Расчетного дня, следующего за днем заключения сделки

3. Все иные документы, не указанные в пунктах 1 и 2 настоящего приложения к Правилам клиринга на фондовом рынке, 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

Порядок изменения позиций

Обозначения, используемые в таблицах:

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

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

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

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

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

Позиция+ (или П+) - позиция по ценным бумагам по Разделу Т+, или позиция по денежным средствам по Счету обеспечения. Изменение планового значения Позиции+ на определенную дату влечет за собой аналогичное изменение плановых значений Позиции+ на все последующие даты.

Позиция0 (или П0) - позиция по ценным бумагам, соответствующая Разделу Т0, и позиция по денежным средствам, соответствующая Счетам обеспечения Т0.

↑ - увеличение.

↓ - уменьшение.

1. Порядок установления и изменения позиций по денежным средствам

№	Операция	Значение позиции по денежным средствам (в соответствующей валюте)	
		Начальное	Плановое
1.	Исполнение Расчетной организацией распоряжения на перевод денежных средств с Торговых счетов на клиринговый банковский счет после получения от Расчетной организации выписки по Торговым счетам (S – сумма денежных средств, учитываемых на Торговом счете)	= S (П0)	= S (П0)
2.	Зачисление / списание денежных средств		
2.1.	Зачисление денежных средств на клиринговый банковский счет после увеличения суммы денежных средств на Торговом счете на сумму S	↑ на S (П0)	↑ на S (П0)
2.2.	Зачисление денежных средств на клиринговый банковский счет на сумму S в качестве Обеспечения	↑ на S (П+)	↑ на S (П+)
2.3.	Исполнение распоряжения Участника клиринга или Клирингового центра на внесение денежных средств в Обеспечение со Счета обеспечения Т0 с использованием Клиринговой системы		↓ на S (П0) ↑ на S (П+)
2.4.	Исполнение Запроса о возврате денежных средств из Обеспечения на Счет обеспечения Т0, поданного с использованием Клиринговой системы		↓ на S (П+) ↑ на S (П0)
2.5.	Исполнение Запроса о возврате денежных средств из Обеспечения или Постоянного поручения на возврат денежных средств из Обеспечения на Счет для возврата денежных средств		↓ на S (П+)
2.6.	Списание в ходе Торгов денежных средств с Торгового счета на основании запроса Расчетной организации		↓ на S (П0)
2.7.	Возврат Обеспечения в размере Итогового нетто-требования Участника клиринга на основании Заявления о порядке	↓ на S (П+) ↑ на S (П0)	↓ на S (П+) ↑ на S (П0)

	использования денежных средств и ценных бумаг		
3.	Регистрация и снятие заявок на заключение сделок с кодом расчетов T0, Z0, X0, Rb, Sn (за счет П0 или П+)		
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.	Регистрация и снятие заявок на заключение сделок с		

	кодом расчетов T0/Yn , по которым осуществляется клиринг с частичным обеспечением по денежным средствам и ценным бумагам (изменение позиций по первой части сделки РЕПО осуществляется за счет П+)		
4.1.	Регистрация заявки на покупку на заключение сделки РЕПО с кодом расчетов T0/Yn в российских рублях		↓ на S (П+)
4.2.	Снятие заявки на покупку на заключение сделки РЕПО с кодом T0/Yn в российских рублях		↑ на S (П+)
5.	Регистрация и снятие заявок на заключение сделок с кодом расчетов T0/Yn , по которым осуществляется клиринг с полным обеспечением по денежным средствам и/или ценным бумагам (изменение позиций по первой части сделки РЕПО осуществляется за счет П+)		
5.1.	Регистрация заявки на покупку на заключение сделки РЕПО с кодом расчетов T0/Yn в российских рублях X – положительная разность сумм первой и второй части сделки РЕПО или 0		↓ на S (П+) ↓ на X (П+ дня T+n)
5.2.	Регистрация заявки на продажу на заключение сделки РЕПО с кодом расчетов T0/Yn в российских рублях X – положительная разность сумм второй и первой части сделки РЕПО или 0		↓ на X (П+ дня T+n)
5.3.	Снятие заявки на покупку на заключение сделки РЕПО с кодом T0/Yn в российских рублях X – положительная разность сумм первой и второй части сделки РЕПО или 0		↑ на S (П+) ↑ на X (П+ дня T+n)
5.4.	Снятие заявки на продажу на заключение сделки РЕПО с кодом T0/Yn в российских рублях X – положительная разность сумм второй и первой части сделки РЕПО или 0		↑ на X (П+ дня T+n)
6.	Регистрация и снятие заявок с кодом расчетов Yn, Y0/Yn, Y1/Yn, Ym/Yn , по которым осуществляется клиринг с полным обеспечением по денежным средствам и/или ценным бумагам		
6.1.	Регистрация заявки на покупку на заключение сделки с кодом расчетов Yn;		↓ на S (П+ дня T+n)
6.2.	Регистрация заявки на продажу на заключение сделки с кодом расчетов Y0/Yn, Y1/Yn, Ym/Yn; X – положительная разность сумм второй и первой части сделки РЕПО или 0		↓ на X (П+ дня T+n)
6.3.	Регистрация заявки на покупку на заключение сделки с кодом расчетов Y0/Yn, Y1/Yn, Ym/Yn; X – положительная разность сумм первой и второй части сделки РЕПО или 0		↓ на S (П+ дня T+0 или T+1 соответственно) ↓ на X (П+ дня T+n)
6.4.	Снятие заявки на покупку на заключение сделки с кодом расчетов Yn;		↑ на S (П+ дня T+n)
6.5.	Снятие заявки на продажу на заключение сделки с кодом расчетов Y0/Yn, Y1/Yn, Ym/Yn; X – положительная разность сумм второй и первой части сделки РЕПО или 0		↑ на X (П+ дня T+n)
6.6.	Снятие заявки на покупку на заключение сделки с кодом		↑ на S (П+ дня

	расчетов Y0/Yn, Y1/Yn, Ym/Yn; X – положительная разность сумм первой и второй части сделки РЕПО или 0		T+0 или T+1 соответственно) ↑ на X (Π+ дня T+n)
7.	Регистрация и снятие заявок на заключение сделок с кодом расчетов Yn, Y0/Yn, Y1/Yn, Ym/Yn , по которым осуществляется клиринг с частичным обеспечением по денежным средствам и ценным бумагам		
7.1.	Позиции не изменяются		
8.	Заключение сделок с кодом расчетов T0, Rb, K0 (за счет Π0 или Π+)		
8.1.	Заключение сделки по заявке на продажу с кодом расчетов T0, Rb, K0, в российских рублях; X=Сделки – Ксделки		↑ на X
8.2.	Заключение сделки по заявке на покупку с кодом расчетов T0, Rb, в российских рублях; X = S – Сделки + (K - Ксделки)		↑ на X
8.3.	Заключение сделки по заявке на покупку с кодом расчетов K0, в российских рублях; X=Сделки + Ксделки		↓ на X
8.4.	Заключение сделки по заявке на продажу с кодом расчетов T0, K0, Rb в иностранной валюте; S – в иностранной валюте		↑ на S
8.5.	Заключение сделки по заявке на покупку с кодом расчетов T0, Rb в иностранной валюте; X = S – Сделки (в иностранной валюте) Y = (K - Ксделки) (в российских рублях)		↑ на X ↑ на Y
8.6.	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
9.	Заключение сделок с кодом расчетов T0/Yn , по которым осуществляется клиринг с частичным обеспечением по денежным средствам и ценным бумагам (изменение позиций по первой части сделки РЕПО осуществляется за счет Π+)		
9.1.	Заключение сделки РЕПО с кодом расчетов T0/Yn в российских рублях, по первой части которой Участник клиринга является продавцом		↑ на S (Π+)
10.	Заключение сделки с кодом расчетов T0/Yn , по которой осуществляется клиринг с полным обеспечением по денежным средствам и/или ценным бумагам (изменение позиций по первой части сделки РЕПО осуществляется за счет Π+)		
10.1.	Заключение сделки РЕПО с кодом расчетов T0/Yn в российских рублях, по первой части которой Участник клиринга является покупателем X – положительная разность сумм второй и первой части сделки РЕПО или 0		↑ на X (Π+)
10.2.	Заключение сделки РЕПО с кодом расчетов T0/Yn в российских рублях, по первой части которой Участник клиринга является продавцом		↑ на S (Π+) ↑ на X (Π+)

	X – положительная разность сумм первой и второй части сделки РЕПО или 0		
11.	Заключение сделок с кодом расчетов Yn, Y0/Yn, Y1/Yn, Ym/Yn , по которым осуществляется клиринг с полным обеспечением по денежным средствам и/или ценным бумагам		
11.1.	Заключение сделки с кодом расчетов Yn, по которой Участник клиринга является продавцом		↑ на S (Π+ дня T+n)
11.2.	Заключение сделки РЕПО с кодом расчетов Y0/Yn, Y1/Yn, Ym/Yn, по первой части которой Участник клиринга является продавцом; X – положительная разность сумм первой и второй части сделки РЕПО или 0		↑ на S (Π+ дня T+0 или T+1 соответственно) ↑ на X(Π+ дня T+n)
11.3.	Заключение сделки РЕПО с кодом расчетов Y0/Yn, Y1/Yn, Ym/Yn, по первой части которой Участник клиринга является покупателем; X – положительная разность сумм второй и первой части сделки РЕПО или 0		↑ на X(Π+ дня T+n)
12.	Заключение сделок с кодом расчетов Yn, Y0/Yn, Y1/Yn, Ym/Yn , по которым осуществляется клиринг с частичным обеспечением по денежным средствам и ценным бумагам		
12.1.	Позиции не изменяются		
13.	Регистрация и отзыв Отчетов на исполнение (за счет Π0 или Π+)		
13.1.	Регистрация в Клиринговой системе Отчета на исполнение, содержащего обязательство по оплате ценных бумаг		↓ на S сделки
13.2.	Отзыв из Клиринговой системы Отчета на исполнение, содержащего обязательство по оплате ценных бумаг		↑ на S сделки
13.3.	Прохождение Отчетом на исполнение, содержащим требование по оплате ценных бумаг, Процедуры контроля обеспечения		↑ на S сделки
13.4.	Регистрация в Клиринговой системе Специального отчета на исполнение, содержащего условное двустороннее нетто-обязательство по денежным средствам (X, X<0)		↓ на (-X)
13.5.	Отзыв из Клиринговой системы Специального отчета на исполнение, содержащего условное двустороннее нетто-обязательство по денежным средствам (X, X<0)		↑ на (-X)
13.6.	Прохождение Специальным отчетом на исполнение, содержащим условное двустороннее нетто-требование по денежным средствам (X, X>0), Процедуры контроля обеспечения		↑ на X
13.7.	Регистрация в Клиринговой системе Срочного отчета на исполнение, содержащего нетто-обязательство по денежным средствам (X, X<0)		↓ на (-X)
13.8.	Отзыв из Клиринговой системы Срочного отчета на исполнение, содержащего нетто-обязательство по денежным средствам (X, X<0)		↑ на (-X)
13.9.	Регистрация в Клиринговой системе Поручения на внесение компенсационного взноса в виде денежных средств		↓ на S
13.10.	Регистрация в Клиринговой системе Поручения на внесение компенсационного взноса в виде денежных средств Участником клиринга – контрагентом по сделке		↑ на S

13.11.	Регистрация в Клиринговой системе Поручения на проведение расчетов по поставке (по поставочным контрактам срочного рынка):		
13.11.1	по обязательствам участника клиринга по оплате поставки базового актива		↓ на S
13.11.2	по требованиям участника клиринга по оплате поставки базового актива		↑ на S
14.	Уплата / получение Компенсационного взноса / отступного		↓ на S / ↑ на S
15.	Расчеты по итогам клиринга по сделкам с кодом расчетов Z0 и Срочным отчетам на исполнение (осуществляется за счет П0 или П+)		
15.1.	Исполнение обязательства по оплате ценных бумаг или нетто-обязательства по денежным средствам в размере X	↓ на X	↓ на X
15.2.	Исполнение требования по оплате ценных бумаг или нетто-требования по денежным средствам в размере X	↑ на X	↑ на X
16.	Изменение плановых позиций по денежным средствам обеспеченным средствами под исполнение Итоговыми нетто-обязательствам и соответствующим им Итоговыми нетто-требованиям (осуществляется за счет П+)		
16.1.	по Итоговому нетто-обязательству		↓ на X
16.2.	По Итоговому нетто-требованию		↑ на X
17.	Расчеты по итогам клиринга по сделкам, обязательства по которым включены в клиринговый пул для расчетов по итогам торгов (осуществляется за счет П0 или П+)		
17.1.	Исполнение Нетто-обязательства по денежным средствам по сделкам клирингового пула в размере X	↓ на X	
17.2.	Исполнение Нетто-требования по денежным средствам по сделкам клирингового пула в размере X	↑ на X	

2. Порядок установления и изменения позиций по ценным бумагам

№	Операция	Значение позиций депо (по каждому коду ценных бумаг)	
		Начальное	Плановое
1.	Получение от Расчетного депозитария выписки по Разделам (V0 – количество ценных бумаг, учитываемых на Разделах T0) (V+ – количество ценных бумаг, учитываемых на Разделах T+)	= V0 (П0) = V+ (П+)	= V0 (П0) = V+ (П+)
2.	Зачисление / списание ценных бумаг		
2.1.	Увеличение количества ценных бумаг, учитываемых на Разделах T0 или T+ на количество V в случаях зачисления ценных бумаг на соответствующий раздел Торгового счета депо.	↑ на V	↑ на V
2.2.	Исполнение распоряжения Участника клиринга или Клирингового центра на внесение ценных бумаг в Обеспечение с Раздела T0 с использованием Клиринговой системы		↓ на V (П0) ↑ на V (П+)
2.3.	Исполнение Запроса о возврате ценных бумаг из Обеспечения на Раздел T0, поданного с использованием Клиринговой системы		↓ на V (П+) ↑ на V (П0)

2.4.	Списание в ходе Торгов ценных бумаг с Разделов T0 или T+ на основании запроса Расчетного депозитария	↓ на V	↓ на V
2.5.	Возврат Обеспечения в размере Итогового нетто-требования Участника клиринга на основании Заявления о порядке использования денежных средств и ценных бумаг	↓ на V (Π+) ↑ на V (Π0)	↓ на V (Π+) ↑ на V (Π0)
3.	Регистрация и снятие заявок T0, Rb, T0/Yn, Z0, X0 (осуществляется за счет Π0 или Π+, в зависимости от того, какой Торгово-клиринговый счет указан в заявке)		
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.	Регистрация и снятие заявок с кодом расчетов Yn, Y0/Yn, Y1/Yn, Ym/Yn на заключение сделки, по которым осуществляется клиринг с полным обеспечением по денежным средствам и/или ценным бумагам		
4.1.	Регистрация заявки на продажу на заключение сделки с кодом расчетов Yn;		↓ на V (Π+ дня T+n)
4.2.	Снятие заявки на продажу на заключение сделки с кодом расчетов Yn;		↑ на V (Π+ дня T+n)
4.3.	Регистрация заявки на продажу на заключение сделки с кодом расчетов Y0/Yn, Y1/Yn, Ym/Yn;		↓ на V (Π+ дня T+0 или T+1 соответственно)
4.4.	Снятие заявки на продажу на заключение сделки с кодом расчетов Y0/Yn, Y1/Yn, Ym/Yn;		↑ на V (Π+ дня T+0 или T+1 соответственно)
5.	Заключение сделок T0, K0, Rb, T0/Yn, Z0, X0 (за счет Π0 или Π+)		
5.1.	Заключение сделки по заявке на покупку с кодом расчетов T0, K0, Rb, T0/Yn, X0		↑ на V
5.2.	Заключение сделки по заявке на продажу с кодом расчетов K0 в российских рублях и иностранной валюте		↓ на V
6.	Заключение сделок с кодом расчетов Yn, Y0/Yn, Y1/Yn, Ym/Yn, по которым осуществляется клиринг с полным обеспечением по денежным средствам и/или ценным бумагам.		
6.1.	Заключение сделки по заявке на покупку с кодом расчетов Yn		↑ на V (Π+ дня T+n)
6.2.	Заключение сделки по заявке на покупку (по 1-й части РЕПО) с кодом расчетов Y0/Yn, Y1/Yn, Ym/Yn		↑ на V (Π+ дня T+0 или T+1 соответственно)
7.	Регистрация и отзыв Отчетов на исполнение (за счет Π0 или Π+)		
7.1.	Регистрация в Клиринговой системе Отчета на исполнение,		↓ на V

	содержащего обязательство по передаче ценных бумаг		
7.2.	Отзыв из Клиринговой системы Отчета на исполнение, содержащего обязательство по передаче ценных бумаг		↑ на V
7.3.	Прохождение Отчетом на исполнение, содержащим требование по передаче ценных бумаг, Процедуры контроля обеспечения		↑ на V
7.4.	Регистрация в Клиринговой системе Специального отчета на исполнение, содержащего условное двустороннее нетто-обязательство по ценным бумагам ($X, X < 0$)		↓ на (-X)
7.5.	Отзыв из Клиринговой системы Специального отчета на исполнение, содержащего условное двустороннее нетто-обязательство по ценным бумагам ($X, X < 0$)		↑ на (-X)
7.6.	Прохождение Специальным отчетом на исполнение, содержащим условное двустороннее нетто-требование по ценным бумагам (X), Процедуры контроля обеспечения		↑ на X
7.7.	Регистрация в Клиринговой системе Срочного отчета на исполнение, содержащего нетто-обязательство по ценным бумагам ($X, X < 0$)		↓ на (-X)
7.8.	Отзыв из Клиринговой системы Срочного отчета на исполнение, содержащего нетто-обязательство по ценным бумагам ($X, X < 0$)		↑ на (-X)
7.9.	Регистрация в Клиринговой системе Поручения на внесение компенсационного взноса в виде ценных бумаг		↓ на V
7.10.	Регистрация в Клиринговой системе Поручения на внесение компенсационного взноса в виде ценных бумаг Участником клиринга – контрагентом по сделке		↑ на V
7.11.	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
8.	Уплата / получение Компенсационного взноса		↓ на V / ↑ на V
9.	Расчеты по итогам клиринга по сделкам с кодом расчетов Z0 и Срочным отчетам на исполнение (осуществляется за счет П0 или П+)		
9.1.	Исполнение обязательства по передаче ценных бумаг или нетто-обязательства по ценным бумагам в размере V	↓ на V	↓ на V
9.2.	Исполнение требования по передаче ценных бумаг или нетто-требования по ценным бумагам в размере V	↑ на V	↑ на V
10.	Изменение плановых позиций по ценным бумагам обеспеченным средствами под исполнение Итоговым нетто-обязательствам и соответствующим им Итоговым нетто-требованиям (осуществляется за счет П+)		
10.1.	по Итоговому нетто-обязательству		↓ на V
10.2.	По Итоговому нетто-требованию		↑ на V
11.	Расчеты по итогам клиринга по сделкам, обязательства по которым включены в клиринговый пул для расчетов по итогам торгов (осуществляется за счет П0 или П+)		
11.1.	Исполнение Нетто-обязательства по ценным бумагам по сделкам клирингового пула в размере V	↓ на V	

11.2.	Исполнение Нетто-требования по ценным бумагам по сделкам клирингового пула в размере V	↑ на V	
-------	--	--------	--