УТВЕРЖДЕНЫ

решением Наблюдательного совета
НКО НКЦ (АО)

от «19» ноября 2018 года (Протокол № 7)

# ПРАВИЛА КЛИРИНГА НЕБАНКОВСКОЙ КРЕДИТНОЙ ОРГАНИЗАЦИИ-ЦЕНТРАЛЬНОГО КОНТРАГЕНТА «НАЦИОНАЛЬНЫЙ КЛИРИНГОВЫЙ ЦЕНТР» (АКЦИОНЕРНОЕ ОБЩЕСТВО). ЧАСТЬ I. ОБЩАЯ ЧАСТЬ

**Москва, 2018 г.**

**СОДЕРЖАНИЕ**

РАЗДЕЛ I. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ ... 6
Статья 1. Структура, содержание и применение Правил клиринга ... 6
Статья 2. Термины и определения ... 8
Статья 3. Общие положения ... 21
Статья 4. Права и обязанности Участников клиринга и Клирингового центра ... 27
Статья 5. Договор о ведении клиринговых регистров ... 30
Статья 6. Конфиденциальность ... 33
Статья 7. Порядок использования Аналога собственноручной подписи ... 34
Статья 8. Торговые и клиринговые счета ... 36
Статья 9. Клиринговые регистры ... 38
РАЗДЕЛ II. ТРЕБОВАНИЯ К УЧАСТНИКАМ КЛИРИНГА ... 43
Статья 10. Требования к Участникам клиринга ... 43
Статья 11. Категории Участников клиринга ... 45
Статья 12. Условия клирингового обслуживания. Порядок предоставления допуска к клиринговому обслуживанию ... 47
Статья 13. Порядок приостановления и прекращения допуска к клиринговому обслуживанию ... 54
Статья 14. Порядок регистрации Участников клиринга, клиентов Участника клиринга, порядок открытия Расчетных кодов Участника клиринга ... 61
Статья 15. Общий порядок открытия и закрытия Торгово-клиринговых счетов Участников клиринга ... 65
Статья 16. Порядок предоставления информации об Участнике торгов, не совпадающем в одном лице с Участником клиринга ... 66
Статья 17. Порядок открытия Расчетных кодов 2-го уровня и Торгово-клиринговых счетов 2-го уровня ... 67
Статья 18. Порядок открытия Расчетных кодов 3-го уровня и Торгово-клиринговых счетов 3-го уровня ... 69
Статья 19. Порядок присвоения Расчетному коду признака «Единый пул» ... 71
Статья 20. Порядок присвоения Клиринговых идентификаторов ... 74
Статья 21. Порядок регистрации Обособленных клиентов Участников клиринга ... 75
РАЗДЕЛ III. МЕРЫ, НАПРАВЛЕННЫЕ НА УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ ПРИ ОСУЩЕСТВЛЕНИИ КЛИРИНГА ... 77
Статья 22. Перечень мер, направленных на управление рисками при осуществлении клиринга ... 77
Статья 23. Единый лимит по Расчетному коду и риск-параметры ... 79
Статья 24. Меры, направленные на ограничение размера ответственности центрального контрагента (уровни защиты центрального контрагента) ... 82
Статья 25. Ограничение размера ответственности Клирингового центра по Внебиржевым сделкам с иностранной валютой ... 84
Статья 26. Дисконтирование обязательств Клирингового центра по возврату Обеспечения ... 86

Статья 27. Порядок заключения закрывающих и/или балансирующих сделок ..... 91
РАЗДЕЛ IV. ПОРЯДОК ПРОВЕДЕНИЯ КЛИРИНГА ..... 94
ПОДРАЗДЕЛ IV-I. ПОРЯДОК ВНЕСЕНИЯ И ВОЗВРАТА ОБЕСПЕЧЕНИЯ ..... 94
Статья 28. Порядок внесения Обеспечения ..... 94
Статья 29. Порядок передачи Профилей активов..... 101
Статья 30. Порядок подачи и исполнения Запросов на подбор ценных бумаг ..... 103
Статья 31. Порядок возврата Обеспечения ..... 105
ПОДРАЗДЕЛ IV-II. ПОРЯДОК ВНЕСЕНИЯ И ВОЗВРАТА ОБЕСПЕЧЕНИЯ ПОД СТРЕСС И ВЗНОСОВ В ГАРАНТИЙНЫЕ ФОНДЫ ..... 116
Статья 32. Порядок внесения взносов в Гарантийные фонды и Обеспечения под стресс ..... 116
Статья 33. Порядок возврата взносов в Гарантийные фонды и Обеспечения под стресс ..... 120
ПОДРАЗДЕЛ IV-III. ПОРЯДОК ВОЗНИКНОВЕНИЯ И ИСПОЛНЕНИЯ МАРЖИНАЛЬНЫХ ТРЕБОВАНИЙ И МАРЖИНАЛЬНЫХ ТРЕБОВАНИЙ ПО ФОНДАМ / ОБЕСПЕЧЕНИЮ ПОД СТРЕСС..... 123
Статья 34. Порядок проведения клиринговых сессий mark-to-market. Порядок возникновения и исполнения Маржинальных требований ..... 123
Статья 35. Режим урегулирования (Режим принудительного закрытия позиций) 125
Статья 36. Порядок возникновения и исполнения Маржинальных требований по фондам / обеспечению под стресс..... 126
ПОДРАЗДЕЛ IV-IV. ПОРЯДОК ИСПОЛНЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ ПО ИТОГАМ КЛИРИНГА ..... 129
Статья 37. Общие требования к порядку включения обязательств в клиринговые пулы и к порядку исполнения обязательств ..... 129
Статья 38. Сроки включения обязательств в клиринговые пулы (ранние расчеты и раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром)..... 131
Статья 39. Порядок исполнения обязательств и требований по денежным средствам / драгоценным металлам Участников клиринга и Клирингового центра ..... 133
Статья 40. Порядок формирования Единого клирингового пула ..... 137
Статья 41. Порядок прекращения обязательств в Едином клиринговом пуле..... 140
ПОДРАЗДЕЛ IV-V. ПОРЯДОК ДЕЙСТВИЙ, НАПРАВЛЕННЫХ НА ИСПОЛНЕНИЕ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ ..... 147
Статья 42. Порядок действий, направленных на исполнение обязательств, в случае наличия Итоговых нетто-обязательств, для исполнения которых недостаточно денежных средств / драгоценных металлов / ценных бумаг ..... 147
Статья 43. Порядок заключения и условия сделок своп / сделки купли-продажи с иностранной валютой / драгоценным металлом, заключаемых с Недобросовестными участниками клиринга..... 151
Статья 44. Порядок заключения и условия сделок РЕПО и сделок / сделки купли-продажи ценных бумаг, заключаемых с Недобросовестным участником клиринга .. 156
Статья 45. Порядок заключения и условия сделок своп / сделки купли-продажи с иностранной валютой / драгоценным металлом, заключаемых с Добросовестным участником клиринга..... 163

Статья 46. Условия Сделок РЕПО Клирингового центра, порядок их заключения и исполнения ..... 164
Статья 47. Порядок заключения и условия сделок РЕПО и сделок / сделки купли-продажи ценных бумаг, заключаемых с Добросовестным участником клиринга ..... 166
Статья 48. Порядок использования и возмещения Гарантийных фондов и иных средств в целях погашения Задолженностей Участников клиринга (процедура кросс-дефолта) ..... 167
Статья 49. Порядок действий, направленных на исполнение обязательств Участника торгов перед Участником клиринга ..... 177
ПОДРАЗДЕЛ IV-VI. ПОРЯДОК ВЗАИМОДЕЙСТВИЯ С РАСЧЕТНОЙ ОРГАНИЗАЦИЕЙ И РАСЧЕТНЫМ ДЕПОЗИТАРИЕМ. ПОРЯДОК ДЕЙСТВИЙ В СЛУЧАЕ ОБРАЩЕНИЯ ВЗЫСКАНИЯ ИЛИ НАЛОЖЕНИЯ АРЕСТА НА ИМУЩЕСТВО УЧАСТНИКА КЛИРИНГА, НАХОДЯЩЕЕСЯ НА ТОРГОВОМ ИЛИ КЛИРИНГОВОМ СЧЕТЕ ..... 179
Статья 50. Порядок взаимодействия с Расчетной организацией, в которой открыты торговые или клиринговые банковские счета для учета денежных средств ..... 179
Статья 51. Порядок действий в случае обращения взыскания или наложения ареста на имущество Участника клиринга, находящееся на торговом банковском счете в драгоценном металле ..... 180
Статья 52. Порядок взаимодействия с Расчетным депозитарием и иными депозитариями ..... 181
РАЗДЕЛ V. ОБЩИЙ ПОРЯДОК ОПЛАТЫ УСЛУГ ..... 185
Статья 53. Общий порядок оплаты услуг Клирингового центра, Биржи и Технического центра, а также порядок начисления и выплаты процентов на денежные средства, составляющие индивидуальное или коллективное клиринговое обеспечение ..... 185
Статья 54. Общий порядок представления отчетов по итогам клиринга ..... 193
РАЗДЕЛ VI. ПРОЧИЕ УСЛОВИЯ ..... 195
Статья 55. Перевод обязательств и Обеспечения одного Участника клиринга другому Участнику клиринга ..... 195
Статья 56. Порядок действий в случае включения Участника клиринга в перечень организаций, в отношении которых имеются сведения об их причастности к экстремистской деятельности или терроризму, или в перечень организаций, в отношении которых имеются сведения об их причастности к распространению оружия массового уничтожения ..... 200
Статья 57. Порядок урегулирования обязательств в случае прекращения допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию (ликвидационный неттинг в отношении Участника клиринга) ..... 202
Статья 58. Порядок урегулирования обязательств в случае банкротства клиента Участника клиринга (ликвидационный неттинг в отношении клиента Участника клиринга) ..... 225
Статья 59. Порядок урегулирования обязательств в случае отзыва (аннулирования) лицензии на осуществление банковских операций у Клирингового центра (ликвидационный неттинг в отношении Клирингового центра) ..... 240

Статья 60. Взаимодействие с Биржей при возникновении обстоятельств, которые могут повлиять на возможность проведения Торгов ..... 249
Статья 61. Чрезвычайные ситуации ..... 249
Статья 62. Порядок разрешения споров ..... 252
Приложение № 1. Договор об оказании клиринговых услуг №_____ ..... 253
Приложение № 2. Договор о ведении клиринговых регистров №_____ ..... 254
Приложение № 3. Порядок проведения технической экспертизы ..... 256
Приложение № 4. Документы, предоставляемые юридическим лицом для заключения Договора об оказании клиринговых услуг ..... 259
Приложение № 5. Отчетность, представляемая Участниками клиринга Клиринговому центру ..... 270
Приложение № 6. Временной регламент ..... 278

# РАЗДЕЛ I. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ

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

1.1. Правила клиринга Небанковской кредитной организации-центрального контрагента «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество) включают:

1) настоящие «Правила клиринга Небанковской кредитной организации-центрального контрагента «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество). Часть I. Общая часть», регулирующие / содержащие:

- способы обеспечения исполнения обязательств, допущенных к клирингу;
- права и обязанности Участников клиринга и Клирингового центра;
- порядок использования аналога собственноручной подписи;
- общие требования к Участникам клиринга;
- перечень общих мер, направленных на управление рисками при осуществлении клиринга;
- положения об ограничении размера ответственности Клирингового центра;
- порядок внесения и возврата Обеспечения;
- порядок внесения и возврата Обеспечения под стресс и взносов в Гарантийные фонды;
- общий порядок возникновения и исполнения Маржинальных требований;
- общие требования к порядку включения обязательств в клиринговые пулы и к порядку исполнения обязательств;
- порядок исполнения обязательств и требований по денежным средствам / драгоценным металлам;
- общий порядок действий в случае неисполнения обязательств;
- порядок заключения и условия сделок своп / сделок купли-продажи с иностранной валютой / драгоценным металлом, сделок РЕПО и сделок купли-продажи ценных бумаг, заключаемых в целях урегулирования неисполненных обязательств;
- порядок использования и возмещения Гарантийных фондов и иных средств в целях погашения Задолженностей Участников клиринга (процедура кросс-дефолта);
- основания и порядок перевода обязательств и Обеспечения одного Участника клиринга другому Участнику клиринга;
- порядок урегулирования обязательств в случае прекращения допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию (ликвидационный неттинг в отношении Участника клиринга);
- условия договора Клирингового центра с Участником торгов, не

совпадающим в одном лице с Участником клиринга, о ведении клиринговых регистров;

- иные общие положения,

далее – «общая часть Правил клиринга»;

2) «Правила клиринга Небанковской кредитной организации-центрального контрагента «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество). Часть II. Правила клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов», содержащие особенности исполнения сделок купли-продажи ценных бумаг, заключаемых в Секции Фондового рынка ПАО Московская Биржа, сделок РЕПО, заключаемых в Секции рынка РЕПО ПАО Московская Биржа, заключением и исполнением депозитных договоров на Рынке депозитов ПАО Московская Биржа, исполнением Внебиржевых сделок купли-продажи ценных бумаг, и определяющие условия договора об имущественном пуле (далее – «Правила клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов»);
3) «Правила клиринга Небанковской кредитной организации-центрального контрагента «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество). Часть III. Правила клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов», содержащие особенности исполнения сделок с иностранной валютой и драгоценными металлами, заключенных на торгах, организуемых ПАО Московская Биржа или не на организованных торгах в соответствии с Правилами клиринга, а также порядок заключения Внебиржевых сделок с иностранной валютой с Участниками клиринга и Провайдерами ликвидности (далее – «Правила клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов»);
4) «Правила клиринга Небанковской кредитной организации-центрального контрагента «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество). Часть IV. Правила клиринга на срочном рынке», содержащие особенности исполнения договоров, являющихся производными финансовыми инструментами, заключаемых на срочном рынке ПАО Московская Биржа (далее – «Правила клиринга на срочном рынке»);
5) «Правила клиринга Небанковской кредитной организации-центрального контрагента «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество). Часть V. Правила клиринга на товарном рынке», содержащие особенности исполнения договоров, являющихся производными финансовыми инструментами, базисным активом которых является товар, заключаемых на торгах, организуемых АО НТБ (далее – «Правила клиринга на товарном рынке»);
6) «Правила клиринга Небанковской кредитной организации-центрального контрагента «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество). Часть VI. Правила клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ», содержащие особенности заключения и исполнения договоров, являющихся производными финансовыми инструментами, заключаемых на организованных торгах ПАО Московская Биржа на рынке Стандартизированных ПФИ или не на организованных торгах в соответствии с Правилами клиринга (далее – «Правила клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ»).

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

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

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

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

**Статья 2. Термины и определения**

| | |
|---|---|
| ***Аналог собственноручной подписи / АСП -*** | реквизит Предложения или иного электронного сообщения, направляемого с использованием Клиринговой системы, подтверждающий идентификацию направившего Предложение или иное электронное сообщение лица, целостность и неизменность Предложений и иных электронных сообщений за счет использования специализированных программно-технических средств и организационных мероприятий. |
| ***Анкета для целей выявления иностранных налогоплательщиков -*** | Анкета в соответствии с нормами и положениями закона FATCA и требованиями российского законодательства по реализации международного автоматического обмена финансовой информацией в налоговых целях. |
| ***Аутентификация -*** | процедура подтверждения принадлежности АСП Участнику клиринга / Участнику торгов / Клиринговому центру. |
| ***Банк ЕврАзЭс/ЕАЭС -*** | Банк-нерезидент, зарегистрированный на территории государства, являющегося стороной Соглашения о сотрудничестве в области организации интегрированного валютного рынка государств - членов Евразийского экономического сообщества от 25.01.2006 (далее – Соглашение о сотрудничестве) и/или государства – стороны по Договору о Евразийском экономическом союзе от 29.05.2014 (далее – Договор ЕАЭС). |
| ***Банк-нерезидент -*** | юридическое лицо, являющееся Нерезидентом, которое на основании специального разрешения (лицензии или иного основания) компетентного органа государства учреждения имеет право осуществлять банковские операции, |

| | |
|---|---|
| | предусмотренные личным законом Банка-нерезидента. |
| ***Биржа -*** | биржа, заключившая договор о взаимодействии с Клиринговым центром. |
| ***Биржевой рынок -*** | одна из торговых (биржевых) секций ПАО Московская Биржа, на которой ПАО Московская Биржа является организатором торговли, организованные торги на товарном рынке АО НТБ и заключение договоров, являющихся производными финансовыми инструментами, не на организованных торгах в соответствии с Правилами клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ, осуществление клиринга по которым регулируется Правилами клиринга, включая клиринг по соответствующим Внебиржевым сделкам. В Правилах клиринга биржевыми рынками называются: фондовый рынок и рынок депозитов, валютный рынок и рынок драгоценных металлов, срочный рынок, товарный рынок, рынок Стандартизированных ПФИ. |
| ***Внебиржевая сделка -*** | заключаемая не на организованных торгах Внебиржевая сделка с ценными бумагами, или Внебиржевая сделка с иностранной валютой, или Внебиржевой Договор СПФИ. |
| ***Выделенный капитал центрального контрагента -*** | часть собственных средств Клирингового центра, предназначенная для покрытия возможных потерь Клирингового центра, вызванных ненадлежащим исполнением или неисполнением Недобросовестными участниками клиринга своих обязательств, допущенных к клирингу, и используемая Клиринговым центром до использования средств, внесенных Добросовестными участниками клиринга в Гарантийные фонды. |
| ***Гарантийный фонд -*** | коллективное клиринговое обеспечение, сформированное Клиринговым центром за счет взносов, определенных Правилами клиринга, Участников клиринга и иных лиц в целях обеспечения исполнения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением на соответствующем биржевом рынке. |
| ***Дата исполнения -*** | дата, в которую Участник клиринга и/или Клиринговый центр обязан исполнить свои обязательства в соответствии с условиями заключенной Сделки или иные обязательства в порядке, определенном Правилами клиринга. В случаях, установленных Правилами клиринга под Датой исполнения может пониматься дата, в которую Участник клиринга и/или Клиринговый центр будет обязан исполнить свои обязательства, которые возникнут при соблюдении условий, определенных Правилами торгов и/или Правилами клиринга. |
| ***Добросовестный участник клиринга -*** | Участник клиринга, не имеющий неисполненных обязательств перед Клиринговым центром. |
| ***Договор о взаимодействии -*** | Договор о взаимодействии при проведении организованных торгов и осуществлении клиринга сделок с иностранной валютой и драгоценными металлами, заключенный между |

| | |
|---|---|
| | Банком России, Биржей и Клиринговым центром. |
| ***Единый клиринговый пул -*** | клиринговый пул, формируемый в Клиринговой системе фондового рынка и рынка депозитов, состоящий из всех следующих обязательств с одной, наступившей Датой исполнения: (1) обязательств по Сделкам Т+; (2) иных определенных Правилами клиринга обязательств между Участниками клиринга и Клиринговым центром; (3) обязательств, учитываемых по Расчетным кодам Единого пула, переданных на исполнение в Клиринговую систему фондового рынка и рынка депозитов из Клиринговых систем других биржевых рынков. |
| ***Единый лимит по Расчетному коду -*** | величина, рассчитываемая Клиринговым центром в российских рублях по каждому Расчетному коду Участника клиринга, ограничивающая риски по Сделкам с частичным обеспечением (за исключением Срочных контрактов), заключаемым между Клиринговым центром и Участником клиринга, для которого рассчитан Единый лимит по Расчетному коду. |
| ***Единый лимит по Гарантийным фондам -*** | величина, рассчитываемая Клиринговым центром в российских рублях для каждого Участника клиринга в целях проверки исполнения Участником клиринга обязательств по внесению взносов в Гарантийные фонды. |
| ***Единый лимит по Обеспечению под стресс -*** | величина, рассчитываемая Клиринговым центром в российских рублях для каждого Участника клиринга в целях проверки исполнения Участником клиринга обязательств по внесению Обеспечения под стресс. |
| ***Задолженность -*** | обязательство Участника клиринга, возникшее в связи с прекращением не исполненных им обязательств, в том числе, обязательств по Сделкам, обязательств по уплате комиссионных вознаграждений и/или иных обязательств, указанных в Правилах клиринга. |
| ***Закон о клиринге -*** | Федеральный закон от 07.02.2011 № 7-ФЗ «О клиринге, клиринговой деятельности и центральном контрагенте». |
| ***Закон FATCA -*** | Федеральный закон от 28.06.2014 № 173-ФЗ «Об особенностях осуществления финансовых операций с иностранными гражданами и юридическими лицами, о внесении изменений в Кодекс Российской Федерации об административных правонарушениях и признании утратившими силу отдельных положений законодательных актов Российской Федерации». |
| ***Идентификатор (Идентификатор Участника клиринга) -*** | уникальный буквенно-цифровой код, присваиваемый Клиринговым центром Участнику клиринга и однозначно определяющий Участника клиринга. |
| ***Индивидуальный Участник клиринга -*** | Участник клиринга, имеющий право становиться стороной по Сделкам (в т.ч. действуя в качестве Клирингового брокера), заключаемым на торгах не более, чем двумя Участниками торгов (включая такого Участника клиринга в случае, если он является Участником торгов). |

| | |
|---|---|
| ***Итоговое нетто-обязательство Участника клиринга -*** | обязательство Участника клиринга перед Клиринговым центром по передаче российских рублей / соответствующей иностранной валюты / соответствующего драгоценного металла / соответствующих ценных бумаг, возникшее в связи с прекращением обязательств с наступившей Датой исполнения по Сделкам с центральным контрагентом и иных обязательств, указанных в соответствующей части Правил клиринга, по итогам клиринга, порядок проведения которого установлен соответствующей частью Правил клиринга. |
| ***Итоговое нетто-требование Участника клиринга -*** | требование Участника клиринга к Клиринговому центру по получению российских рублей / соответствующей иностранной валюты / соответствующего драгоценного металла / соответствующих ценных бумаг, возникшее в связи с прекращением обязательств с наступившей Датой исполнения по Сделкам с центральным контрагентом и иных обязательств, указанных в соответствующей части Правил клиринга, по итогам клиринга, порядок проведения которого установлен соответствующей частью Правил клиринга. |
| ***Клиринг без предварительного обеспечения -*** | клиринг по Сделке, при заключении которой не проверяется наличие Обеспечения Участника клиринга. |
| ***Клиринг с полным обеспечением -*** | клиринг по Сделке, условием заключения которой является наличие ценных бумаг / денежных средств / драгоценного металла / товара Участника клиринга и/или требования Участника клиринга по получению ценных бумаг / денежных средств / драгоценного металла / товара с Датой исполнения не позднее, чем Дата исполнения обязательств по заключаемой Сделке, в размере, необходимом для исполнения обязательств по такой Сделке в полном объеме. |
| ***Клиринг с частичным обеспечением -*** | клиринг по Сделке, условием заключения которой является достаточность Обеспечения Участника клиринга, контролируемая Клиринговым центром в порядке, установленном Правилами клиринга. |
| ***Клиринговая система -*** | совокупность программно-технических средств, баз данных, телекоммуникационных средств, иного оборудования и программного обеспечения Клирингового центра, предназначенных для осуществления клиринговой деятельности в соответствии с Правилами клиринга. |
| ***Клиринговый брокер -*** | Участник клиринга, исполняющий функции клирингового брокера в соответствии с Законом о клиринге и Правилами клиринга. |
| ***Клиринговый идентификатор -*** | уникальный буквенно-цифровой код, присваиваемый Техническим центром Участнику клиринга / Участнику торгов в целях совершения операций в Клиринговой системе, если это предусмотрено соответствующей специальной частью Правил клиринга. |

| | |
|---|---|
| ***Клиринговый терминал -*** | web-сервис, предназначенный для осуществления электронного документооборота между Участником клиринга и Клиринговым центром. |
| ***Клиринговый центр -*** | Небанковская кредитная организация-центральный контрагент «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество), действующий на основании лицензии на осуществление клиринговой деятельности и в соответствии с Законом о клиринге. |
| ***Конечный контрагент -*** | Участник клиринга, являющийся стороной по парной Сделке с центральным контрагентом. |
| ***Кредитная организация -*** | кредитная организация, являющаяся Резидентом. |
| ***Маржинальное требование -*** | требование Клирингового центра к Участнику клиринга об обеспечении обязательств по Сделкам с частичным обеспечением, заключенным Клиринговым центром с Участником клиринга, предъявляемое в порядке и случае, определенных Правилами клиринга. |
| ***Маржинальное требование по обеспечению под стресс -*** | требование о приведении размера средств, внесенных Участником клиринга в качестве Обеспечения под стресс, в соответствие установленному Клиринговым центром для Участника клиринга размеру Обеспечения под стресс. |
| ***Маржинальное требование по фондам -*** | требование о приведении взносов Участника клиринга в Гарантийные фонды в соответствие установленным Клиринговым центром размерам взносов в Гарантийные фонды. |
| ***Международная организация -*** | юридическое лицо, учрежденное в соответствии с международным договором Российской Федерации и имеющее право осуществлять банковские операции, в том числе валютные операции, и/или право размещать средства в депозиты на территории Российской Федерации в соответствии с международными договорами Российской Федерации и законодательством Российской Федерации. |
| ***Методика определения размера Обеспечения под стресс -*** | внутренний документ Клирингового центра, устанавливающий порядок определения минимального размера Обеспечения под стресс Участников клиринга на соответствующих биржевых рынках. Методика определения размера Обеспечения под стресс раскрывается на Сайте Клирингового центра. |
| ***Методика определения риск-параметров валютного рынка и рынка драгоценных металлов -*** | внутренний документ Клирингового центра, устанавливающий порядок определения риск-параметров валютного рынка и рынка драгоценных металлов ПАО Московская Биржа. |
| ***Методика определения выделенного капитала*** | внутренний документ Клирингового центра, устанавливающий порядок определения размера выделенного капитала Клирингового центра для всех биржевых рынков и размера |

| | |
|---|---|
| ***центрального контрагента -*** | выделенного капитала центрального контрагента для каждого биржевого рынка. Методика определения выделенного капитала центрального контрагента раскрывается на Сайте Клирингового центра. |
| ***Недобросовестный участник клиринга -*** | Участник клиринга, не исполнивший или ненадлежащим образом исполнивший свои обязательства перед Клиринговым центром, в том числе, Маржинальное требование, и/или имеющий Задолженность перед Клиринговым центром. |
| ***Некредитная организация -*** | юридическое лицо, являющееся Резидентом и не являющееся кредитной организацией. |
| ***Некредитная организация – нерезидент -*** | юридическое лицо, являющееся Нерезидентом и не имеющее права осуществлять банковские операции. |
| ***Нерезидент -*** | лицо, являющееся нерезидентом в соответствии с законодательством Российской Федерации о валютном регулировании и валютном контроле. |
| ***Нетто-обязательство Участника клиринга -*** | сумма денежных средств в российских рублях / соответствующей иностранной валюте / количество соответствующего драгоценного металла / соответствующих ценных бумаг / соответствующего товара, представляющие собой превышение обязательств Участника клиринга над его требованиями к Клиринговому центру в российских рублях / такой иностранной валюте / таком драгоценном металле / таких ценных бумагах / таком товаре по Сделкам с центральным контрагентом и иным обязательствам, указанным в соответствующей части Правил клиринга, определяемая по каждой Дате исполнения в порядке, установленном соответствующей частью Правил клиринга. |
| ***Нетто-требование Участника клиринга -*** | сумма денежных средств в российских рублях / соответствующей иностранной валюте / количество соответствующего драгоценного металла / соответствующих ценных бумаг / соответствующего товара, представляющие собой превышение требований Участника клиринга над его обязательствами перед Клиринговым центром в российских рублях / такой иностранной валюте / таком драгоценном металле / таких ценных бумагах / таком товаре по Сделкам с центральным контрагентом и иным обязательствам, указанным в соответствующей части Правил клиринга, определяемая по каждой Дате исполнения в порядке, установленном соответствующей частью Правил клиринга. |
| ***Обеспечение -*** | индивидуальное клиринговое обеспечение Участника клиринга в ценных бумагах, и/или товарах, и/или денежных средствах (российских рублях и/или иностранной валюте) и/или драгоценных металлах, и/или иное обеспечение Участника клиринга в иностранной валюте и/или драгоценных металлах, |

| | |
|---|---|
| | которое используется для обеспечения исполнения обязательств Участника клиринга по Сделкам с центральным контрагентом. Обеспечение используется для исполнения обязательств Участника клиринга по Сделкам, а также иных обязательств Участника клиринга, указанных в Правилах клиринга. Имущество, внесенное в имущественный пул, не является Обеспечением. Порядок использования имущества, внесенного в имущественный пул, для обеспечения исполнения обязательств по договору об имущественном пуле и по Сделкам, определен Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов. |
| ***Обеспечение под стресс -*** | индивидуальное клиринговое обеспечение определенных Правилами клиринга Участников клиринга в российских рублях и/или иностранной валюте и/или ценных бумагах, которое используется для обеспечения исполнения обязательств Участника клиринга по Сделкам с частичным обеспечением на соответствующем биржевом рынке. |
| ***Обособленный клиент -*** | клиент Участника клиринга, в том числе Участник торгов или клиент Участника торгов, зарегистрированный Участником клиринга в качестве Обособленного клиента в порядке, предусмотренном статьей 21 общей части Правил клиринга, для получения возможности воспользоваться Переводом обязательств и Обеспечения на условиях, определенных в статье 55 общей части Правил клиринга. |
| ***Общий Участник клиринга -*** | Участник клиринга, имеющий право становиться стороной по Сделкам (в т.ч. действуя в качестве Клирингового брокера), заключаемым на торгах более, чем двумя Участниками торгов. |
| ***Ограничительный лимит -*** | ограничение (положительное значение), которое Клиринговый центр устанавливает в отношении значения, учитываемого на клиринговом регистре, в порядке и случаях, установленных Правилами клиринга, не позволяющее совершать операции, в результате которых значение такого клирингового регистра станет меньше значения такого Ограничительного лимита. |
| ***Оператор товарных поставок -*** | НКО НКЦ (АО), осуществляющая функции оператора товарных поставок, выполняющего операции, связанные с исполнением обязательств по передаче товаров по итогам клиринга, осуществленного Клиринговым центром. |
| ***Парная сделка (Парный договор) -*** | каждая из двух Сделок, заключенных с центральным контрагентом на основании двух допустимых встречных заявок / Предложений / Предложений «Стратегия», в порядке и на условиях, определенных правилами торгов на соответствующем биржевом рынке или специальной частью Правил клиринга. |
| ***Пароль -*** | последовательность символов, используемая для аутентификации Участника клиринга, Участника торгов или Клирингового центра в Клиринговой системе. |
| ***Порядок предоставления*** | внутренний документ Клирингового центра, устанавливающий |

| | |
|---|---|
| ***информации и отчетности -*** | состав, сроки и форматы предоставления информации и отчетности Участниками клиринга Клиринговому центру. Порядок предоставления информации и отчетности раскрывается на Сайте Клирингового центра. |
| ***Порядок ЭДО -*** | Порядок организации электронного документооборота Небанковской кредитной организации-центрального контрагента «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество). |
| ***Правила торгов -*** | Правила торгов на валютном рынке и/или Правила торгов на рынке Стандартизированных ПФИ и/или Правила торгов на срочном рынке и/или Правила торгов на товарном рынке и/или Правила торгов на фондовом рынке и рынке депозитов. |
| ***Правила торгов на валютном рынке -*** | правила организованных торгов ПАО Московская Биржа, регламентирующие проведение организованных торгов на валютном рынке и рынке драгоценных металлов. |
| ***Правила торгов на рынке Стандартизированных ПФИ -*** | правила организованных торгов ПАО Московская Биржа, регламентирующие проведение организованных торгов на рынке Стандартизированных ПФИ. |
| ***Правила торгов на срочном рынке -*** | правила организованных торгов на Срочном рынке ПАО Московская Биржа. |
| ***Правила торгов на товарном рынке -*** | правила организованных торгов Акционерного общества «Национальная товарная биржа». |
| ***Правила торгов на фондовом рынке и рынке депозитов -*** | правила организованных торгов ПАО Московская Биржа, регламентирующие проведение организованных торгов, на которых заключаются Сделки с ценными бумагами и депозитные договоры. |
| ***Предложение -*** | 1) направляемое Участником клиринга или Клиринговым центром электронное сообщение, содержащее предложение (оферту) заключить Внебиржевую сделку, или 2) направляемое Участником клиринга или Клиринговым центром электронное сообщение, содержащее принятие предложения (акцепт оферты) заключить Внебиржевую сделку. Требования к содержанию Предложения устанавливаются в соответствующей специальной части Правил клиринга. |
| ***Профиль актива -*** | информация об Обеспечении, учитываемая по Расчетному коду / Торгово-клиринговому счету с признаком «Единый пул» в Клиринговой системе соответствующего биржевого рынка, переданная в Клиринговую систему другого биржевого рынка / полученная из Клиринговой системы другого биржевого рынка. |
| ***Рабочее место Участника клиринга -*** | совокупность программно-технических средств, предназначенных для использования Участником клиринга в целях получения технического доступа к Клиринговой системе. Существуют следующие виды Рабочих мест Участника |

| | |
|---|---|
| | клиринга:<br>• Рабочее место УРМ - Рабочее место Участника клиринга, получающего технический доступ к Клиринговой системе с использованием удаленного рабочего места;<br>• Рабочее место ВПТС - Рабочее место Участника клиринга, получающего технический доступ к Клиринговой системе с использованием внешних программно-технических средств, интегрированных с Клиринговой системой посредством универсального программно-аппаратного шлюза;<br>• Рабочее место Блумберг - Рабочее место Участника клиринга, получающего технический доступ к Клиринговой системе с использованием Системы Блумберг;<br>• Рабочее место Рейтер - Рабочее место Участника клиринга, получающего технический доступ к Клиринговой системе с использованием Системы Рейтер. |
| ***Раздел -*** | торговый раздел торгового счета депо, открытого в Расчетном депозитарии с указанием Клирингового центра в качестве клиринговой организации, которая вправе давать распоряжения по этому торговому счету, а также торговые разделы счетов депо, открытых в Расчетном депозитарии и указанных в Правилах клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов. |
| ***Расчетная организация -*** | НКО АО НРД, и/или Банк России, и/или иная кредитная организация, являющаяся Резидентом, в которой (-ом) Клиринговым центром открыт клиринговый банковский счет для учета индивидуального и/или коллективного клирингового обеспечения. |
| ***Расчетный банк -*** | банк или небанковская кредитная организация, в том числе иностранная кредитная организация, в которой Клиринговым центром открыт корреспондентский счет для учета Обеспечения в иностранной валюте / драгоценных металлах. |
| ***Расчетный день -*** | день, в том числе выходной или праздничный нерабочий день по законодательству Российской Федерации, в который Расчетная организация осуществляет платежи в российских рублях (далее также - Расчетный день по российским рублям).<br>Не является Расчетным днем по соответствующей иностранной валюте день, не являющийся рабочим днем в банковской системе страны / группы стран - эмитентов иностранной валюты.<br>Расчетным днем по драгоценным металлам является Расчетный день по российским рублям.<br>Расчетным днем для целей определения Даты исполнения обязательств по уплате вариационной маржи в российских рублях является Расчетный день по российским рублям.<br>Расчетным днем для целей определения Даты исполнения обязательств по уплате вариационной маржи в иностранной валюте является Расчетный день по такой иностранной валюте.<br>Не является Расчетным днем для целей определения Даты |

| | |
|---|---|
| | исполнения обязательств по уплате вариационной маржи / депозитной маржи день, в который Клиринговый центр не проводит клиринговую сессию.<br>Расчетным днем для целей определения Даты исполнения обязательств по Сделкам с иностранной валютой / драгоценным металлом является Расчетный день по такой иностранной валюте / такому драгоценному металлу, в который на Бирже допускается заключение сделок с такой иностранной валютой / драгоценным металлом с Датой исполнения обязательств в день проведения торгов.<br>Расчетным днем для целей определения Даты исполнения обязательств по Сделкам с ценной бумагой с расчетами в российских рублях является Расчетный день, в который на Бирже допускается заключение сделок с такой ценной бумагой с Датой исполнения обязательств в день проведения торгов.<br>Расчетным днем для целей определения Даты исполнения обязательств по Сделкам с ценной бумагой с расчетами в иностранной валюте является Расчетный день, в который на Бирже допускается заключение сделок с такой иностранной валютой и сделок с такой ценной бумагой с Датой исполнения обязательств в день проведения торгов.<br>Особенности определения Расчетного (Рабочего) дня для целей определения Даты исполнения иных обязательств могут быть установлены Спецификацией соответствующего Договора СПФИ. |
| ***Расчетный депозитарий -*** | расчетный депозитарий, осуществляющий операции, связанные с исполнением обязательств по передаче ценных бумаг по итогам клиринга, осуществленного Клиринговым центром. |
| ***Расчетный код -*** | Расчетный код Участника клиринга, или Расчетный код 1-го уровня, или Расчетный код для учета взносов в Гарантийные фонды, или Расчетный код для учета Обеспечения под стресс, или Расчетный код имущественного пула. |
| ***Расчетный код Участника клиринга / Расчетный код 1-го уровня -*** | клиринговый регистр 1-го уровня, предназначенный для учета информации об Обеспечении Участника клиринга в денежных средствах / драгоценных металлах и/или обязательств по Сделкам, стороной по которым является Участник клиринга. |
| ***Расчетный код 2-го уровня -*** | клиринговый регистр 2-го уровня, предназначенный для учета информации об Обеспечении в денежных средствах / драгоценных металлах, внесенном с указанием данного Расчетного кода 2-го уровня и/или информации об обязательствах по Сделкам, заключенным с указанием Торгово-клирингового счета 2-го уровня. |
| ***Расчетный код 3-го уровня -*** | клиринговый регистр 3-го уровня, предназначенный для учета информации об Обеспечении в денежных средствах / драгоценных металлах, внесенном с указанием данного Расчетного кода 3-го уровня и/или информации об |

| | |
|---|---|
| | обязательствах по Сделкам, заключенным с указанием Торгово-клирингового счета 3-го уровня. |
| ***Расчетный код для учета взносов в Гарантийные фонды -*** | клиринговый регистр, предназначенный для учета информации о денежных средствах, внесенных Участником клиринга в качестве взносов в Гарантийные фонды. |
| ***Расчетный код для учета Обеспечения под стресс -*** | клиринговый регистр, предназначенный для учета информации о денежных средствах, внесенных Участником клиринга в качестве Обеспечения под стресс. |
| ***Расчетный код имущественного пула -*** | клиринговый регистр, предназначенный для учета иностранной валюты и российских рублей, внесенных в имущественный пул. |
| ***Режим урегулирования (Режим принудительного закрытия позиций) -*** | установленные Правилами клиринга ограничения, действующие для Расчетного кода / Торгово-клирингового счета. Режим урегулирования устанавливается и снимается Клиринговым центром в порядке и случаях, определенных Правилами клиринга. |
| ***Резидент -*** | юридическое лицо, являющееся резидентом в соответствии с законодательством Российской Федерации о валютном регулировании и валютном контроле. |
| ***Сайт Клирингового центра -*** | сайт в сети Интернет по адресу www.nationalclearingcentre.com, на котором Клиринговым центром осуществляется раскрытие информации как клиринговой организацией и центральным контрагентом. |
| ***Сделка -*** | сделка купли-продажи ценных бумаг / сделка РЕПО / депозитный договор / сделка с иностранной валютой / драгоценным металлом / товаром, Срочный контракт / Договор СПФИ, в том числе Внебиржевая сделка, по которой / по которому Клиринговый центр осуществляет клиринг. |
| ***Сделка РЕПО Клирингового центра -*** | сделка РЕПО, заключаемая Клиринговым центром с Участником клиринга в соответствии с Правилами клиринга с целью исполнения обязательств Клирингового центра по Сделкам перед Добросовестными участниками клиринга. |
| ***Сделка с частичным обеспечением -*** | Сделка, по которой Клиринговый центр осуществляет клиринг с частичным обеспечением, в том числе Срочная сделка и Договор СПФИ. |
| ***Сделка Т+ -*** | сделка РЕПО с кодом расчетов T0/Yn, Ym/Yn, или сделка купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов Yn, Nn, или депозитный договор, заключенная (-ый) с центральным контрагентом в соответствии с Правилами торгов на фондовом рынке и рынке депозитов и/или Правилами клиринга, а также Сделка РЕПО Клирингового центра. |
| ***Система Блумберг (Блумберг) -*** | программно-аппаратный комплекс, предоставляемый компанией «Блумберг», используемый для передачи / получения информационных сообщений в Клиринговую |

| | |
|---|---|
| | систему / из Клиринговой системы. |
| ***Система Рейтер (Рейтер) -*** | программно-аппаратный комплекс, предоставляемый компанией «Томсон Рейтер», используемый для передачи / получения информационных сообщений в Клиринговую систему / из Клиринговой системы. |
| ***Спецификация -*** | в случаях, предусмотренных Правилами торгов или Правилами клиринга, документ, совместно с Правилами торгов и/или Правилами клиринга определяющий стандартные условия Сделки и порядок её исполнения. |
| ***Счет для возврата обеспечения -*** | зарегистрированный в Клиринговом центре счет, предназначенный для перечисления на него денежных средств / ценных бумаг / драгоценных металлов с целью исполнения обязательств Клирингового центра по возврату Обеспечения / Обеспечения под стресс / взносов в Гарантийные фонды.<br>В качестве Счета для возврата обеспечения в денежных средствах может выступать счет Участника клиринга / клиента Участника клиринга, открытый в кредитной организации на территории Российской Федерации, в том числе, в Клиринговом центре, или в банке за пределами территории Российской Федерации.<br>В качестве Счета для возврата обеспечения в драгоценных металлах может выступать открытый в Клиринговом центре обезличенный металлический счет Участника клиринга - кредитной организации, имеющей лицензию на привлечение во вклады и размещение драгоценных металлов, или обезличенный металлический счет Участника клиринга в банке, открывшем в Клиринговом центре обезличенный металлический счет и имеющем лицензию на привлечение во вклады и размещение драгоценных металлов, или открытый в Клиринговом центре банковский счет в драгоценных металлах Участника клиринга - кредитной организации, имеющей лицензию на привлечение во вклады и размещение драгоценных металлов, или банковский счет в драгоценных металлах Участника клиринга в кредитной организации, открывшей в Клиринговом центре банковский счет в драгоценных металлах и имеющей лицензию на привлечение во вклады и размещение драгоценных металлов. |
| ***СЭД ПАО Московская Биржа -*** | Система электронного документооборота ПАО Московская Биржа. |
| ***Тарифы Клирингового центра -*** | документ Клирингового центра, устанавливающий размер оплаты клиринговых услуг, оказываемых Клиринговым центром Участникам клиринга и иным лицам в соответствии с Правилами клиринга. |
| ***Технический центр -*** | организация, указанная в специальной части Правил клиринга, обеспечивающая Участникам клиринга технический доступ к Клиринговой системе на соответствующем биржевом рынке на |

| | |
|---|---|
| | основании соответствующего договора. |
| ***Торгово-клиринговый счет -*** | Торгово-клиринговый счет Участника клиринга, или Торгово-клиринговый счет 1-го уровня, или Торгово-клиринговый счет Гарантийных фондов, или Торгово-клиринговый счет Обеспечения под стресс, или Торгово-клирингового счета имущественного пула, или Торгово-клиринговый для заключения депозитных договоров. |
| ***Торгово-клиринговый счет Участника клиринга / Торгово-клиринговый счет 1-го уровня -*** | клиринговый регистр 1-го уровня, определяющий набор счетов, по которым должны исполняться обязательства по Сделке, если это предусмотрено соответствующей специальной частью Правил клиринга, и/или предназначенный для учета информации об Обеспечении Участника клиринга в ценных бумагах или товарах. В состав Торгово-клирингового счета Участника клиринга могут входить Расчетный код Участника клиринга или Счет обеспечения Т0, Раздел, торговый раздел торгового товарного счета. |
| ***Торгово-клиринговый счет 2-го уровня -*** | клиринговый регистр 2-го уровня, открываемый по требованию Участника клиринга, связанный с Торгово-клиринговым счетом Участника клиринга. В состав Торгово-клирингового счета 2-го уровня входит Расчетный код 2-го уровня. |
| ***Торгово-клиринговый счет 3-го уровня -*** | клиринговый регистр 3-го уровня, открываемый по требованию Участника торгов, не совпадающего в одном лице с Участником клиринга, или по требованию Участника клиринга, совпадающего в одном лице с Участником торгов, связанный с Торгово-клиринговым счетом 2-го уровня. В состав Торгово-клирингового счета 3-го уровня входит Расчетный код 3-го уровня. |
| ***Торгово-клиринговый счет Гарантийных фондов -*** | клиринговый регистр, определяющий набор счетов, на которых учитываются денежные средства / ценные бумаги, внесенные Участником клиринга в качестве взносов в Гарантийные фонды, и/или предназначенный для учета информации о ценных бумагах, внесенных Участником клиринга в качестве взносов в Гарантийные фонды. |
| ***Торгово-клиринговый счет Обеспечения под стресс -*** | клиринговый регистр, определяющий набор счетов, на которых учитываются денежные средства / ценные бумаги, внесенные Участником клиринга в качестве Обеспечения под стресс, и/или предназначенный для учета информации о ценных бумагах, внесенных Участником клиринга в качестве Обеспечения под стресс. |
| ***Уполномоченный участник клиринга -*** | Участник клиринга, предоставляющий Клиринговому центру денежные средства путем заключения между ним и Клиринговым центром сделок своп в соответствии с Правилами клиринга с целью исполнения Клиринговым центром своих обязательств по Сделкам перед Добросовестными участниками клиринга на биржевых рынках, на которых Клиринговый центр осуществляет функции клиринговой организации и центрального контрагента. |

| | |
|---|---|
| ***Участник клиринга -*** | юридическое лицо, которому Клиринговый центр оказывает клиринговые услуги на основании заключенного с ним Договора об оказании клиринговых услуг. |
| ***Участник торгов, совпадающий в одном лице с Участником клиринга -*** | Участник торгов, являющийся стороной по Сделке, заключенной им на торгах. |
| ***Участник торгов, не совпадающий в одном лице с Участником клиринга -*** | Участник торгов, не являющийся стороной по Сделке, заключенной им на торгах. |
| ***Ценные бумаги -*** | акции / облигации / инвестиционные паи / депозитарные расписки / клиринговые сертификаты участия как они определены законодательством Российской Федерации. |
| ***ЭДО -*** | электронный документооборот, организуемый ПАО Московская Биржа и Клиринговым центром, используемый Клиринговым центром для взаимодействия с участниками СЭД ПАО Московская Биржа и Организатором СЭД. |

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

### Статья 3. Общие положения

3.1. Клиринговый центр осуществляет клиринг, выполняя функции центрального контрагента и без выполнения функций центрального контрагента.

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

3.3. Клиринговый центр осуществляет клиринг с расчетами в российских рублях и с расчетами в иностранной валюте.

3.4. Особенности порядка осуществления клиринга на каждом из биржевых рынков определены в соответствующей специальной части Правил клиринга.

3.5. В качестве способов обеспечения исполнения обязательств, допущенных к клирингу, Клиринговый центр использует Обеспечение Участников клиринга, Обеспечение под стресс Участников клиринга, Гарантийные фонды. Условия формирования Обеспечения, Обеспечения под стресс и Гарантийных фондов устанавливаются Правилами клиринга.

3.5.1. Обеспечение в российских рублях, ценных бумагах и товарах является индивидуальным клиринговым обеспечением.

3.5.2. Обеспечение в драгоценных металлах, учитываемое на торговых банковских счетах в драгоценных металлах, является индивидуальным клиринговым обеспечением.

3.5.3. Обеспечение в драгоценных металлах, учитываемое на обезличенных металлических счетах, является иным обеспечением.

3.5.4. Обеспечение в иностранной валюте может являться индивидуальным клиринговым обеспечением или иным обеспечением.

3.5.5. Клиринговый центр вправе своим решением, раскрываемым на Сайте Клирингового центра, установить перечень иностранных валют, которые являются только индивидуальным клиринговым обеспечением.

3.5.6. Статус Обеспечения в иностранной валюте определяется счетами, предназначенными для внесения Обеспечения в иностранной валюте на соответствующем биржевом рынке: Обеспечение в иностранной валюте, являющееся индивидуальным клиринговым обеспечением, вносится на клиринговые банковские счета Клирингового центра или на торговые банковские счета, открытые в Расчетной организации, Обеспечение в иностранной валюте, являющееся иным обеспечением, - на корреспондентские счета Клирингового центра, открытые в Расчетном банке.

3.5.7. Обеспечение Участника клиринга на одном биржевом рынке во всех иностранных валютах, за исключением иностранных валют, указанных в решении Клирингового центра, принятом в соответствии с подпунктом 3.5.5 общей части Правил клиринга, и иностранных валют, учитываемых по Расчетному коду Единого пула, определенному в статье 19 общей части Правил клиринга, может являться либо индивидуальным клиринговым обеспечением, либо иным обеспечением.

Правилами клиринга установлен порядок перехода с использования Обеспечения в иностранной валюте, являющегося индивидуальным клиринговым обеспечением, на Обеспечение в иностранной валюте, являющееся иным обеспечением, по заявлению Участника клиринга.

Указанный порядок не применяется для иностранных валют, для которых решением Клирингового центра, принятым в соответствии с подпунктом 3.5.5 общей части Правил клиринга, установлено, что они являются только индивидуальным клиринговым обеспечением.

3.5.8. Клиринговый центр вправе принимать обоснованные и доступные меры по определению источников происхождения денежных средств и (или) иного имущества, вносимого Участником клиринга в качестве Обеспечения, Обеспечения под стресс, взносов в Гарантийные фонды, имущественные пулы.

3.6. Клиринговый центр осуществляет учет Обеспечения в денежных средствах и драгоценных металлах и обязательств по Сделкам в денежных средствах и драгоценных металлах по каждому Расчетному коду Участника клиринга, порядок открытия которых определен статьей 14 общей части Правил клиринга.

Клиринговый центр осуществляет учет Обеспечения в ценных бумагах и товарах и обязательств по Сделкам в ценных бумагах и товарах по каждому Торгово-клиринговому счету Участника клиринга, порядок открытия которых определен

статьей 15 общей части Правил клиринга и соответствующими специальными частями Правил клиринга.

3.6.1. Клиринговый центр не осуществляет зачет (неттинг) обязательств, учитываемых по разным Расчетным кодам Участника клиринга / Торгово-клиринговым счетам Участника клиринга, за исключением случаев проведения ликвидационного неттинга в отношении Участника клиринга (в соответствии со статьей 57 общей части Правил клиринга).

3.6.2. Клиринговый центр не использует Обеспечение в денежных средствах и драгоценных металлах, учитываемое по клиентскому Расчетному коду и Расчетному коду ДУ, для исполнения / прекращения обязательств, учитываемых по другим Расчетным кодам Участника клиринга.

3.6.3. Клиринговый центр не использует Обеспечение в денежных средствах и драгоценных металлах, учитываемое по собственному Расчетному коду, для исполнения обязательств, учитываемых по другим Расчетным кодам, за исключением случаев проведения процедуры кросс-дефолта (в соответствии со статьей 48 общей части Правил клиринга) и ликвидационного неттинга в отношении Участника клиринга (в соответствии со статьей 57 общей части Правил клиринга).

3.6.4. В случае неисполнения Участником клиринга обязательства по денежным средствам или Маржинального требования, учитываемых по Расчетному коду Участника клиринга, для исполнения / прекращения обязательства по денежным средствам или Маржинального требования Клиринговый центр вправе использовать Обеспечение в ценных бумагах / товарах, учитываемое по любому Торгово-клиринговому счету Участника клиринга, в состав которого входит такой Расчетный код Участника клиринга.

3.6.5. Клиринговый центр не использует Обеспечение в ценных бумагах / товарах, учитываемое по Торгово-клиринговому счету Участника клиринга, в состав которого входит клиентский Расчетный код или Расчетный код ДУ, для исполнения обязательств, учитываемых по другим Торгово-клиринговым счетам Участника клиринга, в состав которых входит другой Расчетный код Участника клиринга.

3.6.6. Клиринговый центр не использует Обеспечение в ценных бумагах / товарах, учитываемое по Торгово-клиринговому счету Участника клиринга, в состав которого входит собственный Расчетный код, для исполнения обязательств, учитываемых по другим Торгово-клиринговым счетам Участника клиринга, в состав которых входит другой Расчетный код Участника клиринга, за исключением случаев проведения процедуры кросс-дефолта (в соответствии со статьей 48 общей части Правил клиринга) и ликвидационного неттинга в отношении Участника клиринга (в соответствии со статьей 57 общей части Правил клиринга).

3.7. Участник клиринга обязан информировать своих клиентов о предусмотренном Правилами клиринга порядке ведения Клиринговым центром учета обязательств по Сделкам, заключенным в интересах и (или) за счет клиентов Участников клиринга, и Обеспечения указанных обязательств, в том числе о типах Расчетных кодов Участника клиринга, а также о возможности и порядке регистрации Обособленных клиентов, для которых существует возможность Перевода обязательств и

Обеспечения, по основаниям и в порядке, установленным в статье 55 общей части Правил клиринга.

3.8. Перечень видов используемых торговых и клиринговых счетов приведен в статье 8 общей части Правил клиринга.

3.9. Информация о реквизитах клиринговых счетов Клирингового центра, предназначенных для внесения индивидуального и/или коллективного клирингового обеспечения и/или имущества в имущественный пул, и/или реквизитах корреспондентских счетов Клирингового центра, открытых в Расчетных банках и предназначенных для внесения Обеспечения в иностранной валюте, являющегося иным обеспечением, раскрывается Клиринговым центром путем размещения на Сайте Клирингового центра.

Об изменениях реквизитов указанных счетов Клиринговый центр извещает Участников клиринга путем направления им новых реквизитов в форме электронного документа и путем размещения соответствующей информации на Сайте Клирингового центра не позднее, чем за 3 (три) рабочих дня до введения этих изменений в действие, если решением Клирингового центра не установлен иной срок изменения реквизитов указанных счетов.

3.10. Учет Клиринговым центром индивидуального клирингового и иного обеспечения, внесенного Участниками клиринга, является услугой, оказываемой Клиринговым центром Участнику клиринга в рамках осуществления Клиринговым центром клиринговой деятельности.

3.10.1. Перечень видов индивидуального клирингового и иного обеспечения: Обеспечения, имущества, составляющего имущественный пул, Обеспечения под стресс и/или Гарантийного фонда, а также иностранных валют, в отношении которых Клиринговый центр взимает комиссионное вознаграждение за учет индивидуального клирингового и иного обеспечения, определяется решением Клирингового центра.

Указанным решением Клирингового центра также устанавливается перечень биржевых рынков, в отношении которых Клиринговый центр взимает комиссионное вознаграждение за учет Обеспечения.

3.11. Клиринговый центр вправе использовать в своих интересах денежные средства, составляющие индивидуальное и коллективное клиринговое обеспечение, зачисленное на клиринговые банковские счета Клирингового центра, а также Обеспечение Участников клиринга в иностранной валюте / драгоценных металлах, зачисленное на корреспондентские счета Клирингового центра в Расчетных банках, с учетом ограничений, установленных внутренним документом Клирингового центра, определяющим критерии размещения временно свободных денежных средств Клирингового центра.

3.11.1. Доходы от использования денежных средств, составляющих индивидуальное и/или коллективное клиринговое обеспечение, не включаются в состав индивидуального и коллективного клирингового обеспечения.

3.12. Если это предусмотрено решением Клирингового центра, раскрытым на Сайте Клирингового центра, Клиринговый центр начисляет и выплачивает Участникам

клиринга проценты на денежные средства, составляющие индивидуальное и/или коллективное клиринговое обеспечение, как плату за право использования указанных денежных средств в порядке, предусмотренном Правилами клиринга и/или решением Клирингового центра о начислении и выплате Участникам клиринга процентов на денежные средства, составляющие индивидуальное и/или коллективное клиринговое обеспечение.

3.12.1. Решение Клирингового центра о начислении и выплате Участникам клиринга процентов на денежные средства, составляющие индивидуальное и/или коллективное клиринговое обеспечение, должно содержать перечень видов индивидуального и/или коллективного клирингового обеспечения (Обеспечения, Обеспечения под стресс и Гарантийного фонда) и валют, в отношении которых действует указанное решение, а также размер ставки (размеры ставок), по которой (которым) начисляются указанные проценты, и/или порядок определения такой ставки (ставок).

3.12.2. Решение Клирингового центра о начислении и выплате Участникам клиринга процентов на денежные средства, составляющие Обеспечение, может быть принято в отношении отдельных биржевых рынков.

3.12.3. Проценты на денежные средства, составляющие индивидуальное и/или коллективное клиринговое обеспечение, включаются в состав соответствующего индивидуального или коллективного клирингового обеспечения Участника клиринга.

3.13. За исключением случаев, предусмотренных пунктом 3.12 общей части Правил клиринга и специальными частями Правил клиринга, Участники клиринга не имеют права на получение от Клирингового центра процентов за пользование денежными средствами, составляющими индивидуальное или коллективное клиринговое обеспечение или иное обеспечение, предусмотренное Правилами клиринга, переданное Участниками клиринга Клиринговому центру и учитываемое Клиринговым центром.

3.14. Обмен электронными документами между Участником клиринга и Клиринговым центром осуществляется посредством ЭДО, Клирингового терминала и/или системы S.W.I.F.T. (в случаях, установленных Правилами клиринга).

3.14.1. Порядок формирования и передачи электронных документов посредством ЭДО, Клирингового терминала предусмотрен Правилами электронного документооборота Московской Биржи и Порядком ЭДО.

3.14.2. Электронные документы, направляемые посредством ЭДО, формируются в форматах, предусмотренных внутренними документами Клирингового центра. Указанные документы раскрываются Клиринговым центром путем размещения на Сайте Клирингового центра.

3.14.3. Электронные документы, направляемые посредством Клирингового терминала, формируются средствами Клирингового терминала и/или в форматах, поддерживаемых программным обеспечением Клиринговый терминал. Внутренний документ, содержащий описание форматов, поддерживаемых программным обеспечением Клиринговый терминал, раскрывается Клиринговым центром путем размещения на Сайте Клирингового центра.

Клиринговый центр посредством Клирингового терминала направляет Участнику клиринга уведомления (квитанции) об исполнении / отказе в исполнении запросов, направленных Участником клиринга посредством Клирингового терминала.

3.14.4. Электронные документы, направляемые посредством Системы S.W.I.F.T., формируются в форматах, установленных стандартами S.W.I.F.T., с учетом особенностей, предусмотренных внутренним документом Клирингового центра. Указанный документ раскрывается Клиринговым центром путем размещения на Сайте Клирингового центра.

3.14.5. В случае несоответствия информации, содержащейся в электронном документе, направленном посредством Клирингового терминала, ЭДО или системы S.W.I.F.T., Участники клиринга и Клиринговый центр в первую очередь руководствуются информацией, содержащейся в электронном документе, направленном посредством Клирингового терминала, во вторую - посредством системы S.W.I.F.T., в третью – посредством ЭДО.

3.15. Документы, направляемые Участником клиринга Клиринговому центру с использованием Клиринговой системы, являются электронными сообщениями, подписанными АСП Участника клиринга.

Документы и информация, получаемые Участником клиринга из Клиринговой системы, являются электронными сообщениями, подписанными АСП Клирингового центра.

Порядок использования АСП определен в статье 7 общей части Правил клиринга.

3.16. Перечень документов, предоставляемых Клиринговому центру в соответствии с общей и специальными частями Правил клиринга Участниками клиринга, клиентами Участников клиринга и иными указанными в соответствующей части Правил клиринга лицами, способ их предоставления: посредством ЭДО, Клирингового терминала или в бумажной форме, а также формы и форматы предоставляемых документов, установлены соответствующими внутренними документами Клирингового центра (соответствующими частями внутренних документов Клирингового центра). Указанные документы раскрываются Клиринговым центром путем размещения на Сайте Клирингового центра.

Правилами клиринга могут быть установлены случаи предоставления Клиринговому центру документов с использованием Клиринговой системы или по системе S.W.I.F.T.

3.17. Сроки исполнения обязательств, определенных общей частью Правил клиринга, а также сроки предоставления документов Клиринговому центру / Клиринговым центром в процессе взаимодействия с Участниками клиринга, определенного общей частью Правил клиринга, установлены временным регламентом, являющимся приложением № 6 к общей части Правил клиринга (далее – Временной регламент).

Сроки исполнения обязательств, определенных специальными частями Правил клиринга, время проведения клиринговых сессий, а также сроки проведения клиринговых операций, сроки предоставления документов Клиринговому центру / Клиринговым центром в процессе взаимодействия с Участниками клиринга при проведении клиринга и расчетов по Сделкам, определенного специальными

частями Правил клиринга, установлены временными регламентами, являющимися приложениями к соответствующим специальным частям Правил клиринга.

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

3.18. Клиринговый центр вправе принять решение об ограничении проведения отдельных операций в определенный Расчетный день. О принятии указанного решения Клиринговый центр извещает Участников клиринга путем размещения соответствующей информации на Сайте Клирингового центра, и/или посредством ЭДО, и/или с использованием Клиринговой системы не менее, чем за 2 (два) Расчетных дня до Расчетного дня, для которого указанные ограничения будут действовать.

3.19. Клиринговый центр взаимодействует с Биржей в соответствии с заключенными договорами, определяющими порядок и условия взаимодействия при организации Биржей Торгов, а также при осуществлении Клиринговым центром клиринга и иных функций, связанных с осуществлением клиринга по Сделкам, заключенным на Торгах Биржи.

3.20. В целях исполнения обязательств по Сделкам, а также в иных целях, предусмотренных Правилами клиринга, Клиринговый центр вправе совершать Сделки на основании заявок, поданных в Систему торгов / Торговую систему Биржи Клиринговым центром, а также Предложений / Предложений «Стратегия», поданных в Клиринговую систему Клиринговым центром.

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

4.1. Права и обязанности Участников клиринга и Клирингового центра определяются Договором об оказании клиринговых услуг и Правилами клиринга.

4.2. Форма Договора об оказании клиринговых услуг установлена приложением № 1 к общей части Правил клиринга.

4.3. Заключение Договора об оказании клиринговых услуг осуществляется путем присоединения к договору, условия которого определены Правилами клиринга.

4.4. Заключая Договор об оказании клиринговых услуг, Участник клиринга соглашается с Порядком ЭДО.

4.5. Размер оплаты клиринговых услуг, оказываемых Клиринговым центром Участникам клиринга в соответствии с Правилами клиринга, определен Тарифами Клирингового центра.

4.6. Общий порядок оплаты клиринговых услуг Клирингового центра определен в статье 53 общей части Правил клиринга.

Особенности порядка оплаты клиринговых услуг Клирингового центра могут быть определены в соответствующих специальных частях Правил клиринга.

4.7. Клиринговые услуги Клирингового центра считаются оказанными надлежащим образом, если в течение 5 (пяти) рабочих дней после окончания месяца, в течение которого оказывались услуги, Участник клиринга письменно не заявит об обратном.

4.8. Участник клиринга вправе отказаться от исполнения Договора об оказании клиринговых услуг только при отсутствии у него имущественных обязательств по указанному договору, а также неисполненных им обязательств, допущенных к клирингу, письменно уведомив об этом Клиринговый центр не позднее, чем за 5 (пять) дней до даты прекращения действия Договора об оказании клиринговых услуг.

4.9. Клиринговый центр вправе отказаться от исполнения Договора об оказании клиринговых услуг с Участником клиринга в случае нарушения Участником клиринга требований, предъявляемых к нему Правилами клиринга.

4.10. Клиринговый центр вправе отказаться от исполнения Договора об оказании клиринговых услуг с Участником клиринга в случае, если в течение 6 (шести) месяцев с момента заключения указанного Договора Участник клиринга не получил допуска к клиринговому обслуживанию ни на одном из биржевых рынков и на основании ни одних правил клиринга, либо в течение 6 (шести) месяцев подряд Участник клиринга не имел допуска к клиринговому обслуживанию ни на одном из биржевых рынков в связи с приостановлением / прекращением допуска к клиринговому обслуживанию.

4.11. Действие Договора об оказании клиринговых услуг прекращается в следующих случаях:

1) прекращения допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию на всех биржевых рынках, на которых Участник клиринга был допущен к клиринговому обслуживанию, и в соответствии со всеми правилами клиринга, на основании которых Участник клиринга был допущен к клиринговому обслуживанию;
2) ликвидации Участника клиринга, а также в случае реорганизации Участника клиринга при условии, что деятельность Участника клиринга в результате реорганизации прекращается;
3) отзыва (аннулирования) лицензии на осуществление банковских операций у Участника клиринга (для Кредитных организаций);
4) аннулирования специального разрешения (лицензии или иного основания), выданного центральным (национальным) банком или иным компетентным органом страны Банка-нерезидента, который в соответствии с законодательством страны Банка-нерезидента осуществляет валютное регулирование и банковский надзор (далее – компетентный орган), на основании которого Банк-нерезидент имеет право осуществлять банковские

операции, предусмотренные личным законом Банка–нерезидента (для Банков-нерезидентов, в т.ч. Банков ЕврАзЭс/ЕАЭС).

4.12. В случае прекращения Договора об оказании клиринговых услуг с Участником клиринга, Клиринговый центр возвращает Участнику клиринга денежные средства, драгоценные металлы и ценные бумаги, учитываемые в качестве Обеспечения Участника клиринга / взносов Участника клиринга в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс Участника клиринга на дату прекращения Договора об оказании клиринговых услуг, не позднее 3 (трех) рабочих дней с даты прекращения Договора об оказании клиринговых услуг, российские рубли - на корреспондентский счет Участника клиринга – Кредитной организации, открытый в Банке России, российские рубли Участникам клиринга, не являющимся Кредитной организацией, и иностранную валюту, драгоценные металлы - по реквизитам любого Счета для возврата обеспечения в соответствующей валюте / драгоценном металле, владельцем которого является Участник клиринга, зарегистрированного Участником клиринга в соответствии с Правилами клиринга, или по реквизитам соответствующего торгового банковского счета Участника клиринга, открытого в НКО АО НРД с указанием Клирингового центра в качестве клиринговой организации, которая вправе давать распоряжения по этим счетам, ценные бумаги – на торговый счет депо владельца Участника клиринга.

4.12.1. Возврат Участнику клиринга денежных средств, учитываемых в качестве Обеспечения по Счетам обеспечения, соответствующим Расчетным кодам, открытым для Обособленного клиента, зарегистрированного с указанием на необходимость защиты денежных средств Обособленного клиента, осуществляется по реквизитам Счетов для возврата обеспечения для Расчетного кода, открытого для такого Обособленного клиента (в случае наличия таких зарегистрированных реквизитов).

4.12.2. Возврат Участнику клиринга денежных средств и/или ценных бумаг в соответствии с настоящим пунктом общей части Правил клиринга осуществляется с учетом положений статьи 57 общей части Правил клиринга.

4.13. Участник клиринга обязан возместить Клиринговому центру определенную на момент использования стоимость в российских рублях средств Гарантийных фондов из взносов Добросовестных участников клиринга, использованных при прекращении обязательств такого Участника клиринга в соответствии со статьей 57 общей части Правил клиринга.

4.14. Прекращение действия Договора об оказании клиринговых услуг не освобождает Участника клиринга и Клиринговый центр от исполнения обязательств, возникших до прекращения действия Договора об оказании клиринговых услуг.

4.15. Клиринговый центр вправе на своем Сайте раскрывать информацию о нарушениях Участниками клиринга требований Правил клиринга, в том числе, о фактах неисполнения ими обязательств в порядке, предусмотренном Правилами клиринга.

4.16. Для Участника клиринга, в том числе Участника клиринга - Банка-нерезидента, Международной организации или для отдельной категории юридических лиц, применимым правом, регулирующим Договор об оказании клиринговых услуг и

связанные с ним отношения Участника клиринга и Клирингового центра, является законодательство Российской Федерации.

4.17. В соответствии со статьей 431.2 Гражданского кодекса РФ лицо, обращающееся за допуском к клиринговому обслуживанию / Участник клиринга / Участник торгов, заключивший договор о ведении клиринговых регистров, заверяет Клиринговый центр, что для получения допуска к клиринговому обслуживанию и осуществлению действий в качестве Участника клиринга / Участника торгов, заключившего договор о ведении клиринговых регистров, им получены все необходимые решения органов управления / третьих лиц об одобрении, а также согласия, получение которых регламентировано законодательством, уставом, иными документами, регулирующими деятельность такого юридического лица / Участника клиринга / Участника торгов, заключившего договор о ведении клиринговых регистров.

В случае если указанные заверения были нарушены или на момент получения допуска и в течение предоставления допуска / совершения действий в качестве Участника клиринга / Участника торгов, заключившего договор о ведении клиринговых регистров, были недействительными и/или недостоверными, Клиринговый центр вправе прекратить допуск и/или взыскать свои убытки, возникшие вследствие такого нарушения или недействительности и/или недостоверности указанного заверения.

В случае если указанные заверения были нарушены или на момент получения допуска и в течение предоставления допуска / совершения действий в качестве Участника клиринга / Участника торгов, заключившего договор о ведении клиринговых регистров, были недействительными и/или недостоверными и повлекли за собой претензии третьих лиц и/или государственных органов, включая, но не ограничиваясь, предписаниями Банка России, лицо, обращающееся за допуском к клиринговому обслуживанию / Участник клиринга / Участник торгов, заключивший договор о ведении клиринговых регистров, нарушивший или предоставивший такие заверения, обязан возместить все убытки и расходы Клирингового центра, в том числе, связанные с возмещением Клиринговым центром убытков третьим лицам и/или выплатой штрафов в связи с урегулированием указанных претензий.

## Статья 5. Договор о ведении клиринговых регистров

5.1. Участник торгов, не совпадающий в одном лице с Участником клиринга, вправе заключить с Клиринговым центром договор о ведении клиринговых регистров, в соответствии с которым Клиринговый центр оказывает Участнику торгов следующие клиринговые услуги:

5.1.1. открывает Участнику торгов соответствующие клиринговые регистры 3-го уровня (порядок определен статьей 18 общей части Правил клиринга и/или в специальных частях Правил клиринга) и предоставляет информацию, предусмотренную Правилами клиринга (далее – клиринговые услуги по открытию клиринговых регистров 3-го уровня);

5.1.2. учитывает в Клиринговой системе и предоставляет Участнику торгов информацию об Обеспечении в денежных средствах и драгоценных металлах, внесенном с

указанием соответствующего клирингового регистра 3-го уровня, и об Обеспечении в ценных бумагах, информация о котором учитывается по соответствующему клиринговому регистру 3-го уровня, а также о возникновении и прекращении обязательств по Сделкам, заключенным Участником торгов за счет клиента Участника торгов с указанием соответствующего клирингового регистра 3-го уровня (порядок определен в статье 39 общей части Правил клиринга и/или в специальных частях Правил клиринга);

5.1.3. предоставляет Участнику торгов услуги по лимитированию в Клиринговой системе операций, проводимых Участником торгов за счет клиентов Участника торгов (порядок определен в статье 23 общей части и/или в специальных частях Правил клиринга);

5.1.4. предоставляет Участнику торгов отчеты, предусмотренные Правилами клиринга (порядок определен в специальных частях Правил клиринга);

5.1.5. оказывает Участнику торгов иные услуги, предусмотренные Правилами клиринга.

5.2. Клиринговые услуги, перечисленные в подпунктах 5.1.2-5.1.5 общей части Правил клиринга, далее именуются клиринговыми услугами по ведению клиринговых регистров 3-го уровня.

5.3. Права и обязанности Участника торгов и Клирингового центра определяются договором о ведении клиринговых регистров и Правилами клиринга.

5.4. Форма договора о ведении клиринговых регистров установлена приложением № 2 к общей части Правил клиринга.

5.4.1. Для заключения договора о ведении клиринговых регистров Участник торгов предоставляет Клиринговому центру комплект документов в соответствии с перечнем, приведенным в приложении № 4 к общей части Правил клиринга, за исключением Анкеты для целей выявления иностранных налогоплательщиков.

5.4.2. Оказание услуг по договору о ведении клиринговых регистров осуществляется при наличии у Участника торгов технического доступа к Клиринговой системе.

5.5. Заключение договора о ведении клиринговых регистров осуществляется путем присоединения к договору, условия которого определены Правилами клиринга.

5.6. Заключая договор о ведении клиринговых регистров, Участник торгов соглашается с Порядком ЭДО.

5.7. Клиринговые услуги по открытию клиринговых регистров 3-го уровня оказываются Клиринговым центром Участнику торгов.

5.8. В случае непредоставления Участником торгов Клиринговому центру запроса, предусмотренного подпунктом 16.3.2 общей части Правил клиринга, клиринговые услуги по ведению соответствующих клиринговых регистров 3-го уровня оказываются Клиринговым центром Участнику торгов.

В случае предоставления Участником торгов Клиринговому центру запроса, предусмотренного подпунктом 16.3.2 общей части Правил клиринга, клиринговые услуги по ведению соответствующих клиринговых регистров 3-го уровня

оказываются Клиринговым центром Участнику клиринга по Договору об оказании клиринговых услуг.

В случае отказа Участника клиринга от предоставления ему Клиринговым центром клиринговых услуг по ведению соответствующих клиринговых регистров 3-го уровня в соответствии с подпунктом 16.3.2 общей части Правил клиринга, услуги по ведению соответствующих клиринговых регистров 3-го уровня оказываются Клиринговым центром Участнику торгов.

5.9. Размер оплаты клиринговых услуг по открытию и/или ведению клиринговых регистров 3-го уровня по договору о ведении клиринговых регистров, оказываемых Клиринговым центром Участникам торгов в соответствии с Правилами клиринга, и размер оплаты клиринговых услуг по ведению клиринговых регистров 3-го уровня, оказываемых Клиринговым центром / Участникам клиринга в соответствии с Правилами клиринга, определен Тарифами Клирингового центра.

5.10. Общий порядок оплаты услуг Клирингового центра по договору о ведении клиринговых регистров определен в статье 53 общей части Правил клиринга.

Особенности порядка оплаты услуг Клирингового центра по договору о ведении клиринговых регистров могут быть определены в соответствующих специальных частях Правил клиринга.

5.11. Услуги Клирингового центра по договору о ведении клиринговых регистров считаются оказанными надлежащим образом, если в течение 5 (пяти) рабочих дней после окончания месяца, в течение которого оказывались услуги, Участник торгов письменно не заявит об обратном.

5.12. Участник торгов вправе отказаться от исполнения договора о ведении клиринговых регистров, письменно уведомив об этом Клиринговый центр не позднее, чем за 5 (пять) дней до даты прекращения договора.

5.13. Оказание услуг по договору о ведении клиринговых регистров приостанавливается в случае закрытия всех клиринговых регистров 3-го уровня, открытых Клиринговым центром по запросу Участника торгов, являющегося стороной по такому договору о ведении клиринговых регистров.

5.14. Действие договора о ведении клиринговых регистров, приостановленное на основании пункта 5.13 общей части Правил клиринга, возобновляется с даты открытия Клиринговым центром на основании запроса, предоставленного Участником торгов, являющимся стороной по такому договору о ведении клиринговых регистров, не менее одного клирингового регистра 3-го уровня.

5.15. Плата за предоставление услуг по договору о ведении клиринговых регистров в период приостановления действия указанного договора не взимается.

5.16. Действие договора о ведении клиринговых регистров прекращается в следующих случаях:

1) в случае прекращения допуска Участника торгов к торгам на всех биржевых рынках, на которых Участник торгов был допущен к торгам;

2) в случае, если действие договора о ведении клиринговых регистров, приостановленное на основании пункта 5.13 общей части Правил клиринга, не было возобновлено в течение 6 (шести) месяцев с момента приостановления.

5.17. Прекращение действия договора о ведении клиринговых регистров не освобождает Участника торгов и Клиринговый центр от исполнения обязательств, возникших до прекращения действия указанного договора.

5.18. Для Участника торгов применимым правом, регулирующим договор о ведении клиринговых регистров и связанные с ним отношения Участника торгов и Клирингового центра, является законодательство Российской Федерации.

## Статья 6. Конфиденциальность

6.1. Участник клиринга и Клиринговый центр обязуются рассматривать содержание Договора об оказании клиринговых услуг и условия заключенных Сделок как конфиденциальную информацию и не будут раскрывать ее третьим лицам (за исключением аудиторов Участника клиринга или Клирингового центра, уполномоченных государственных органов, Участников торгов, которыми заключены указанные Сделки, и их клиентов, в интересах которых заключены указанные Сделки, а также случаев раскрытия информации в соответствии с требованиями действующего законодательства Российской Федерации), если иное не будет специально согласовано между Участником клиринга и Клиринговым центром.

6.2. Участник торгов и Клиринговый центр обязуются рассматривать содержание договора о ведении клиринговых регистров как конфиденциальную информацию и не будут раскрывать ее третьим лицам (за исключением аудиторов Участника торгов или Клирингового центра, уполномоченных государственных органов, а также случаев раскрытия информации в соответствии с требованиями действующего законодательства Российской Федерации), если иное не будет специально согласовано между Участником торгов и Клиринговым центром.

6.3. Любые документы, предоставленные и подготовленные Участником клиринга, Участником торгов и/или Клиринговым центром для исполнения Договора об оказании клиринговых услуг / договора о ведении клиринговых регистров и/или Сделок, заключенных в рамках Договора об оказании клиринговых услуг, будут рассматриваться как конфиденциальные.

6.4. Участники клиринга / Участники торгов, заключившие с Клиринговым центром договор о ведении клиринговых регистров, соглашаются с тем, что Клиринговый центр на основании договора, заключенного с Банком России, передает Банку России по его запросу информацию о ходе и итогах клиринга.

6.5. Участник клиринга соглашается с тем, что Участнику торгов, с которым Клиринговый центр заключил договор о ведении клиринговых регистров, становится доступной, в том числе посредством передачи Клиринговым центром, информация об обязательствах и обеспечении Участника клиринга, являющегося стороной по Сделкам, заключаемым данным Участником торгов, а также иная

информация в отношении такого Участника клиринга в объеме, предусмотренном Правилами клиринга и необходимом для оказания Клиринговым центром Участнику торгов услуг по договору о ведении клиринговых регистров.

Участник клиринга соглашается, что вышеуказанная информация также становится доступной Бирже и может быть предоставлена ею Участнику торгов, заключающему Сделки, стороной по которым является данный Участник клиринга.

6.6. Особенности применения настоящей статьи общей части Правил клиринга могут быть установлены в соответствующей специальной части Правил клиринга.

## Статья 7. Порядок использования Аналога собственноручной подписи

7.1. Аналог собственноручной подписи (АСП) используется при подаче (направлении) с использованием Клиринговой системы Предложений и иных электронных сообщений, предусмотренных Правилами клиринга. Предложение или электронное сообщение, подписанное АСП, признается электронным документом, равнозначным документу на бумажном носителе, подписанному Участником клиринга / Участником торгов / Клиринговым центром.

7.2. Аналогом собственноручной подписи Участника клиринга, Участника торгов или Клирингового центра признается Клиринговый идентификатор, позволяющий однозначно идентифицировать Участника клиринга, Участника торгов или Клиринговый центр, направивших Предложение или электронное сообщение с использованием Клиринговой системы, и достоверно установить, что Предложение или электронное сообщение исходит от Участника клиринга, Участника торгов или Клирингового центра, которому присвоен данный Клиринговый идентификатор.

Порядок присвоения Клирингового идентификатора Участнику клиринга / Участнику торгов определен статьей 20 общей части Правил клиринга.

7.3. Клиринговый центр обеспечивает защищенность и целостность Предложений и иных электронных сообщений Участника клиринга, Участника торгов и Клирингового центра в результате применения комплекса организационных и технических мер.

7.4. Предложение или электронное сообщение считается подписанным АСП, с момента отправки Участником клиринга / Участником торгов / Клиринговым центром в Клиринговую систему такого Предложения или электронного сообщения при условии успешного прохождения Участником клиринга / Участником торгов / Клиринговым центром процедуры аутентификации в порядке, предусмотренном настоящей статьей.

7.5. Уникальный символьный код, закрепленный за Участником клиринга / Клиринговым центром в Системе Блумберг / Системе Рейтер, присваивается Системой Блумберг / Системой Рейтер; информация об указанном коде вносится в базу данных Клиринговой системы.

7.6. Процедура аутентификации в отношении электронных сообщений Участника клиринга, Участника торгов или Клирингового центра, использующего для технического доступа к Клиринговой системе Рабочее место УРМ или Рабочее

место ВПТС, осуществляется Техническим центром с использованием Клиринговой системы при осуществлении технического доступа Участника клиринга, Участника торгов или Клирингового центра в Клиринговую систему путем сопоставления введенного реквизита, являющегося АСП, пароля, а также IP-адреса удаленного рабочего места или ВПТС Участника клиринга, Участника торгов или Клирингового центра, с которого получено электронное сообщение, соответствующим реквизиту, являющемуся АСП, паролю и IP-адресу удаленного рабочего места / ВПТС Участника клиринга / Участника торгов / Клирингового центра, информация о которых содержится в базе данных Клиринговой системы.

7.7. Процедура аутентификации в отношении электронных сообщений Участника клиринга или Клирингового центра, использующего для технического доступа к Клиринговой системе Рабочее место Блумберг или Рабочее место Рейтер, осуществляется Техническим центром с использованием Клиринговой системы в момент получения Клиринговой системой электронного сообщения путем проверки соответствия Клирингового идентификатора, присвоенного Участнику клиринга или Клиринговому центру, уникальному символьному коду, закрепленному за Участником клиринга или Клиринговым центром в Системе Блумберг / Системе Рейтер, информация о котором хранится в базе данных Клиринговой системы, и соответствующему Идентификатору Участника клиринга / Клирингового центра, присвоенному Клиринговым центром в соответствии с Правилами клиринга.

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

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

Участник клиринга / Участник торгов соглашается с тем, что Клиринговым центром могут быть изготовлены (распечатаны) копии электронных сообщений (подписанных АСП) на бумажном носителе, которые удостоверяются подписью уполномоченного лица Клирингового центра и являются доказательством факта направления Предложения или иного электронного сообщения с использованием Клиринговой системы, а также подтверждают соответствие Предложения / электронного сообщения содержанию копии Предложения / электронного сообщения, изготовленного (распечатанного) на бумажном носителе.

7.10. По письменному запросу Участника клиринга / Участника торгов Клиринговый центр предоставляет Участнику клиринга / Участнику торгов копию направленного Участником (Участнику) клиринга / торгов Предложения или электронного сообщения, изготовленного (распечатанного) на бумажном носителе.

Запрос Участника клиринга / Участника торгов должен содержать дату, на которую, либо период времени, за который предоставляются Предложения или электронные сообщения.

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

7.12. В случае возникновения конфликтных ситуаций в связи с использованием АСП проводится техническая экспертиза в соответствии с приложением № 3 к общей части Правил клиринга.

7.13. В случае, если по результатам технической экспертизы, проведенной в соответствии с приложением № 3 к общей части Правил клиринга, конфликтная ситуация остается неурегулированной, то такая конфликтная ситуация подлежит рассмотрению в порядке, предусмотренном статьей 62 общей части Правил клиринга.

## Статья 8. Торговые и клиринговые счета

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

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

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

- клиринговый счет депо, предназначенный для исполнения операций по ценным бумагам по Разделам / субсчетам депо по итогам клиринга;
- клиринговый счет депо, предназначенный для внесения коллективного клирингового обеспечения (Гарантийных фондов);
- клиринговый счет депо, предназначенный для внесения Обеспечения под стресс;
- клиринговые счета депо, предназначенные для внесения имущества в имущественный пул.

На указанных в настоящем пункте общей части Правил клиринга клиринговых счетах депо, предназначенных для внесения коллективного клирингового обеспечения (Гарантийных фондов) / Обеспечения под стресс, для каждого Участника клиринга, обязанного вносить средства в Гарантийные фонды / Обеспечение под стресс и желающего вносить ценные бумаги в качестве взносов в Гарантийные фонды / Обеспечение под стресс, открываются субсчета депо гарантийных фондов / субсчета депо обеспечения под стресс.

На указанных в настоящем пункте общей части Правил клиринга клиринговых счетах депо, предназначенных для внесения имущества в имущественный пул, для каждого Участника пула открываются субсчета депо имущественного пула.

Субсчета депо гарантийных фондов, субсчета депо обеспечения под стресс, субсчета депо имущественного пула по тексту Правил клиринга совместно называются субсчетами депо.

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

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

8.4. При осуществлении клиринга в соответствии с Правилами клиринга Клиринговый центр может использовать торговые банковские счета в драгоценных металлах, открытые в Клиринговом центре.

Торговый банковский счет в драгоценных металлах может быть открыт Участнику клиринга.

Торговый банковский счет в драгоценных металлах открывается на основании договора торгового банковского счета в драгоценных металлах, заключенного Участником клиринга с Клиринговым центром, в порядке, установленном указанным договором.

Операции по торговому банковскому счету в драгоценных металлах, открытому в Клиринговом центре, осуществляются на основании распоряжений Клирингового центра без дополнительных распоряжений Участника клиринга в порядке, установленном Правилами клиринга, или на основании распоряжений Участника клиринга.

Исполнение Клиринговым центром распоряжений Участника клиринга является способом выражения согласия Клирингового центра на совершение операций по торговому банковскому счету в драгоценных металлах в соответствии с Законом о клиринге.

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

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

При осуществлении клиринга в соответствии с Правилами клиринга Клиринговый центр использует Разделы.

8.6. При осуществлении клиринга в соответствии с Правилами клиринга Клиринговый центр может использовать следующие виды торговых товарных счетов, открытых Оператором товарных поставок с указанием Клирингового центра в качестве клиринговой организации, которая вправе давать распоряжения по этим счетам:

- торговый товарный счет для учета товаров Участника клиринга;
- торговый товарный счет для учета товаров клиента Участника клиринга;
- торговый товарный счет Клирингового центра.

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

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

8.8. Порядок совершения операций по клиринговым счетам в связи с внесением и возвратом взносов в Гарантийные фонды и Обеспечения под стресс указан в статьях 32, 33 общей части Правил клиринга.

Порядок совершения операций по клиринговым и/или торговым счетам в связи с внесением и возвратом Обеспечения указан в статьях 28, 31 общей части Правил клиринга и/или в соответствующих специальных частях Правил клиринга.

Порядок совершения операций по клиринговым и/или торговым счетам в связи с исполнением обязательств по Сделкам указан в статье 38 общей части Правил клиринга и/или в соответствующих специальных частях Правил клиринга.

## Статья 9. Клиринговые регистры

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

9.2. На клиринговых регистрах 1-го уровня Клиринговый центр учитывает:

- информацию о сумме денежных средств / количестве драгоценных металлов, внесенных в качестве Обеспечения в разрезе кодов валют / драгоценных металлов, Расчетных кодов Участника клиринга;
- информацию о количестве ценных бумаг, внесенных в качестве Обеспечения в разрезе кодов ценных бумаг и Торгово-клиринговых счетов Участника клиринга;
- информацию о Маржинальных требованиях, учитываемых по Расчетным кодам Участника клиринга (в случае наличия);
- информацию о Задолженностях Участника клиринга перед Клиринговым центром (в каждой валюте), учитываемых по Расчетным кодам Участника клиринга (в случае наличия);

- Профили активов в разрезе Расчетных кодов / Торгово-клиринговых счетов Участников клиринга, кодов валют / драгоценных металлов / ценных бумаг, Клиринговых систем соответствующих биржевых рынков (со знаком «плюс» или «минус») (только по Расчетным кодам Единого пула / Торгово-клиринговым счетам, в состав которых входит Расчетный код Единого пула);
- Итоговые нетто-обязательства / Итоговые нетто-требования Участника клиринга в каждой валюте и каждом драгоценном металле по каждому Расчетному коду Участника клиринга, определенные в Клиринговой системе соответствующего биржевого рынка;
- Итоговые нетто-обязательства / Итоговые нетто-требования Участника клиринга по каждой ценной бумаге по каждому Торгово-клиринговому счету Участника клиринга, определенные в Клиринговой системе фондового рынка и рынка депозитов;
- Итоговые нетто-обязательства / Итоговые нетто-требования Участника клиринга в каждой валюте и каждом драгоценном металле по каждому Расчетному коду Участника клиринга, полученные из Клиринговой системы соответствующего биржевого рынка (только в Клиринговой системе фондового рынка и рынка депозитов, по Расчетным кодам Единого пула);
- иную информацию, предусмотренную специальными частями Правил клиринга.

9.3. На клиринговых регистрах, предназначенных для учета Обеспечения под стресс / взносов в Гарантийные фонды, Клиринговый центр учитывает:

- информацию о сумме денежных средств, внесенных в качестве Обеспечения под стресс / взносов в Гарантийные фонды в разрезе кодов валют, Расчетных кодов для учета Обеспечения под стресс / Расчетных кодов для учета взносов в Гарантийные фонды;
- информацию о количестве ценных бумаг, внесенных в качестве Обеспечения под стресс / взносов в Гарантийные фонды в разрезе кодов ценных бумаг и Торгово-клиринговых счетов Обеспечения под стресс / Торгово-клиринговых счетов Гарантийных фондов;
- информацию об обязательствах Участников клиринга по внесению взносов в Гарантийные фонды в разрезе Участников клиринга и биржевых рынков;
- информацию об обязательствах Участников клиринга по внесению Обеспечения под стресс в разрезе Участников клиринга и биржевых рынков;
- информацию о Маржинальных требованиях по фондам, учитываемых по Расчетным кодам для учета взносов в Гарантийные фонды (в случае наличия);
- информацию о Маржинальных требованиях по обеспечению под стресс, учитываемых по Расчетным кодам для учета Обеспечения под стресс (в случае наличия).

9.4. ***Счет обеспечения*** –лицевой счет, открытый в Клиринговом центре на балансовом счете № 30420 (30421) «Средства для исполнения обязательств, допущенных к клирингу, для индивидуального клирингового и иного обеспечения» («Средства нерезидентов для исполнения обязательств, допущенных к клирингу, для индивидуального клирингового и иного обеспечения»), и предназначенный для учета Обеспечения в денежных средствах, являющегося индивидуальным

клиринговым обеспечением, или денежных средств в имущественном пуле, или лицевой счет, открытый в Клиринговом центре на балансовом счете № 47405 «Расчеты с клиентами по покупке и продаже иностранной валюты», и предназначенный для учета Обеспечения в иностранной валюте, не являющегося индивидуальным клиринговым обеспечением, или открытый Участнику клиринга в Клиринговом центре обезличенный металлический счет на балансовом счете № 20309 «Счета клиентов (кроме кредитных организаций) в драгоценных металлах» или № 30116 «Корреспондентские счета кредитных организаций в драгоценных металлах», предназначенный для учета Обеспечения Участника клиринга в соответствующем драгоценном металле.

9.4.1. Счета обеспечения, предназначенные для учета Обеспечения в российских рублях и иностранной валюте, открываются при открытии Расчетного кода Участника клиринга в соответствии со статьей 14 общей части Правил клиринга.

9.4.2. Порядок открытия Счетов обеспечения, предназначенных для учета денежных средств в имущественном пуле, определен Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

9.4.3. Обеспечение Участника клиринга в российских рублях, иностранной валюте и драгоценном металле, учитываемое по Расчетному коду Участника клиринга, также учитывается на Счете обеспечения в соответствующей валюте / соответствующем драгоценном металле, соответствующем Расчетному коду Участника клиринга.

9.5. ***Счет гарантийных фондов*** – лицевой счет, открытый в Клиринговом центре на балансовом счете № 30422 (30423) «Средства для коллективного клирингового обеспечения (гарантийный фонд)» («Средства нерезидентов для коллективного клирингового обеспечения (гарантийный фонд)»), и предназначенный для учета взносов Участника клиринга в Гарантийные фонды в денежных средствах.

9.5.1. Счета гарантийных фондов открываются Клиринговым центром для Участника клиринга категории «Б» или «О» при открытии Расчетного кода для учета взносов в Гарантийные фонды в соответствии с пунктом 14.6 общей части Правил клиринга.

9.5.2. Для одного Расчетного кода для учета взносов в Гарантийные фонды открывается один Счет гарантийных фондов в российских рублях и по одному Счету гарантийных фондов в каждой иностранной валюте, денежные средства в которой принимаются Клиринговым центром в качестве взносов в Гарантийные фонды.

9.5.3. Взносы Участника клиринга в Гарантийные фонды в российских рублях или иностранной валюте, учитываемые по Расчетному коду для учета взносов в Гарантийные фонды, также учитываются на Счете гарантийных фондов в соответствующей валюте, соответствующем Расчетному коду для учета взносов в Гарантийные фонды.

9.6. ***Счет обеспечения под стресс*** – лицевой счет, открытый в Клиринговом центре на балансовом счете № 30420 (30421) «Средства для исполнения обязательств, допущенных к клирингу, для индивидуального клирингового и иного обеспечения» («Средства нерезидентов для исполнения обязательств, допущенных к клирингу, для индивидуального клирингового и иного обеспечения»), и предназначенный для учета Обеспечения под стресс Участника клиринга в денежных средствах.

9.6.1. Счета обеспечения под стресс открываются Клиринговым центром для Участника клиринга категории «Б» или «О» при открытии Расчетного кода для учета Обеспечения под стресс в соответствии с пунктом 14.7 общей части Правил клиринга.

9.6.2. Для одного Расчетного кода для учета Обеспечения под стресс открывается один Счет обеспечения под стресс в российских рублях и по одному Счету обеспечения под стресс в каждой иностранной валюте, денежные средства в которой принимаются Клиринговым центром в качестве Обеспечения под стресс.

9.6.3. Обеспечение под стресс Участника клиринга в российских рублях или иностранной валюте, учитываемое по Расчетному коду для учета Обеспечения под стресс, также учитывается на Счете обеспечения под стресс в соответствующей валюте, соответствующем Расчетному коду для учета Обеспечения под стресс.

9.7. При открытии Расчетного кода для учета взносов в Гарантийные фонды или Расчетного кода для учета Обеспечения под стресс в соответствующей валюте, значение такого клирингового регистра устанавливается равным нулю.

9.7.1. Порядок и случаи изменения значений клиринговых регистров в связи с внесением и возвратом взносов в Гарантийные фонды и Обеспечения под стресс указаны в статьях 32, 33 общей части Правил клиринга.

9.8. По требованию Участника клиринга, предъявленному Клиринговому центру путем предоставления Запроса на открытие Торгово-клирингового счета 2-го уровня в соответствии со статьей 17 общей части Правил клиринга или в соответствии со специальной частью Правил клиринга, на клиринговых регистрах 2-го уровня Клиринговый центр учитывает:

- информацию об Обеспечении в российских рублях, внесенном с указанием клирингового регистра 2-го уровня;
- информацию об Обеспечении в каждой иностранной валюте и каждом драгоценном металле, внесенном с указанием клирингового регистра 2-го уровня (если применимо);
- информацию об Обеспечении в ценных бумагах, учитываемую по клиринговому регистру 2-го уровня (если применимо);
- информацию о Нетто-обязательствах / Нетто-требованиях с каждой Датой исполнения в каждой валюте, каждом драгоценном металле и каждой ценной бумаге, рассчитанных по Сделкам, заключенным с указанием клирингового регистра 2-го уровня, и Сделкам, заключенным с указанием клирингового регистра 3-го уровня, связанного с клиринговым регистром 2-го уровня (если применимо);
- информацию об обязательствах по уплате вариационной маржи по Сделкам, заключенным с указанием клирингового регистра 2-го уровня, и Сделкам, заключенным с указанием клирингового регистра 3-го уровня, связанного с клиринговым регистром 2-го уровня (если применимо);
- информацию о прекращении обязательств по Сделкам, заключенным с указанием клирингового регистра 2-го уровня, и Сделкам, заключенным с указанием клирингового регистра 3-го уровня, связанного с клиринговым регистром 2-го уровня, включая информацию о прекращении обязательств по

уплате вариационной маржи по указанным Сделкам;

- информацию о Едином лимите по клиринговому регистру 2-го уровня (если применимо).

9.9. По требованию Участника торгов, не совпадающего в одном лице с Участником клиринга и заключившего с Клиринговым центром Договор о ведении клиринговых регистров в соответствии со статьей 5 общей части Правил клиринга, или по требованию Участника клиринга, совпадающего в одном лице с Участником торгов, предъявленному Клиринговому центру путем предоставления Запроса на открытие Торгово-клирингового счета 3-го уровня в соответствии со статьей 18 общей части Правил клиринга или в соответствии со специальной частью Правил клиринга, на клиринговых регистрах 3-го уровня Клиринговый центр учитывает:

- информацию об Обеспечении в российских рублях, внесенном с указанием клирингового регистра 3-го уровня;
- информацию об Обеспечении в каждой иностранной валюте и каждом драгоценном металле, внесенном с указанием клирингового регистра 3-го уровня (если применимо);
- информацию об Обеспечении в ценных бумагах, учитываемую по клиринговому регистру 3-го уровня (если применимо);
- информацию о Нетто-обязательствах / Нетто-требованиях с каждой Датой исполнения в каждой валюте, каждом драгоценном металле и каждой ценной бумаге, рассчитанных по Сделкам, заключенным с указанием клирингового регистра 3-го уровня (если применимо);
- информацию об обязательствах по уплате вариационной маржи по Сделкам, заключенным с указанием клирингового регистра 3-го уровня (если применимо);
- информацию о прекращении обязательств по Сделкам, заключенным с указанием клирингового регистра 3-го уровня, включая информацию о прекращении обязательств по уплате вариационной маржи по указанным Сделкам;
- информацию о Едином лимите по клиринговому регистру 3-го уровня (если применимо).

9.10. Перечень иных клиринговых регистров, используемых при осуществлении клиринга на соответствующих биржевых рынках, определен в соответствующих специальных частях Правил клиринга.

9.11. Порядок ведения клиринговых регистров, предусмотренных Правилами клиринга и используемых при осуществлении клиринга на соответствующих биржевых рынках, определен в общей части Правил клиринга и/или соответствующих специальных частях Правил клиринга.

## РАЗДЕЛ II. ТРЕБОВАНИЯ К УЧАСТНИКАМ КЛИРИНГА

### Статья 10. Требования к Участникам клиринга

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

- Договор об оказании клиринговых услуг по форме, предусмотренной приложением № 1 к общей части Правил клиринга, в 2 (двух) экземплярах, подписанный уполномоченным лицом юридического лица и скрепленный печатью юридического лица (при наличии);
- комплект документов в соответствии с перечнем, приведенным в приложении № 4 к общей части Правил клиринга.

В случае если какой-либо из документов, указанных в приложении № 4 к общей части Правил клиринга, ранее уже предоставлялся Клиринговому центру и имеется в наличии у Клирингового центра, то юридическое лицо по предварительному согласованию с Клиринговым центром может быть освобождено от обязанности повторного предоставления этого документа.

10.2. Юридическое лицо обязано обеспечивать актуальность, достоверность и полноту комплекта документов, предоставляемых Клиринговому центру согласно приложению № 4 к общей части Правил клиринга, а также своевременное предоставление изменений и дополнений в указанные документы.

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

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

10.5. Участник клиринга обязан не реже одного раза в год предоставлять Клиринговому центру Анкету Участника клиринга (клиента) (Анкету юридического лица) в форме электронного документа.

Форматы предоставления Участником клиринга Анкеты Участника клиринга (клиента) (Анкеты юридического лица) определены Порядком предоставления информации и отчетности.

10.6. В случае изменения сведений, содержащихся в Анкете Участника клиринга (клиента) (Анкеты юридического лица) или в иных предоставленных Клиринговому центру документах, Участник клиринга обязан в течение 5 (пяти) рабочих дней с даты вступления в силу указанных изменений предоставить Клиринговому центру Анкету Участника клиринга (клиента) (Анкеты юридического лица) с обновленной информацией и соответствующие документы, содержащие / подтверждающие такие изменения и дополнения, в форме электронного документа.

10.7. Одновременно с ежегодным предоставлением Клиринговому центру Анкеты Участника клиринга (клиента) (Анкеты юридического лица) Участник клиринга, за исключением Участника клиринга категории «А» или «К», обязан предоставлять Клиринговому центру Отзывы о деловой репутации.

Участник клиринга предоставляет Отзывы о деловой репутации от других клиентов Клирингового центра, имеющих с ним деловые отношения, и/или Отзывы о деловой репутации от кредитных организаций, в которых Участник клиринга находится или ранее находился на обслуживании, с информацией этих кредитных организаций об оценке деловой репутации данного Участника клиринга.

В случае невозможности получения вышеуказанных Отзывов о деловой репутации Клиринговый центр принимает Отзывы о деловой репутации от контрагентов, не являющихся клиентами Клирингового центра, и/или сведения о деловой репутации от самого Участника клиринга

10.8. Для подтверждения своего финансового состояния Участники клиринга, за исключением Участников клиринга категории «А» или «К», обязаны в течение всего срока действия Договора об оказании клиринговых услуг предоставлять Клиринговому центру отчетность в соответствии с приложением № 5 к общей части Правил клиринга.

В целях оценки финансового состояния Участника клиринга Клиринговый центр вправе затребовать от Участника клиринга дополнительную информацию и отчетность, не указанную в приложении № 5 к общей части Правил клиринга.

10.9. Участник клиринга, за исключением Участника клиринга категории «А», предоставляет Клиринговому центру Анкету для целей выявления иностранных налогоплательщиков в форме электронного документа, а также иные прилагаемые к Анкете для целей выявления иностранных налогоплательщиков документы и сведения, предоставляемые для целей Закона FATCA, необходимость предоставления которых следует из Анкеты для целей выявления иностранных налогоплательщиков и (или) действующего законодательства.

В случае, если Участник клиринга является субъектом, на которого не распространяются требования Закона FATCA, данный Участник клиринга вправе в Анкете для целей выявления иностранных налогоплательщиков не предоставлять Клиринговому центру информацию, относящуюся только к выполнению требования закона FATCA, а также не предоставлять иные прилагаемые к Анкете для целей выявления иностранных налогоплательщиков документы и сведения, предоставляемые для целей Закона FATCA.

В случае, если Участник клиринга является субъектом, на которого в соответствии с законодательством Российской Федерации не распространяются требования по представлению информации в федеральный орган исполнительной власти, уполномоченный по контролю и надзору в области налогов и сборов, в связи с автоматическим обменом финансовой информацией, данный Участник клиринга вправе в Анкете для целей выявления иностранных налогоплательщиков не предоставлять Клиринговому центру информацию, относящуюся только к выполнению требований международного автоматического обмена финансовой информацией в налоговых целях.

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

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

10.10. Обязанность по предоставлению Участником клиринга отчетности, указанной в приложении № 5 к общей части Правил клиринга, Анкеты Участника клиринга (клиента) (Анкеты юридического лица) и Анкеты для целей выявления иностранных налогоплательщиков считается выполненной при условии, что предоставленные Участником клиринга документы соответствуют требованиям к их составу, форме и форматам, установленным Правилами клиринга и (или) Порядком предоставления информации и отчетности.

10.11. Участник клиринга несет риск отрицательных последствий, вызванных непредоставлением или несвоевременным предоставлением Клиринговому центру информации (документов) в соответствии с требованиями Правил клиринга.

10.12. Клиринговый центр не несет ответственности за причиненные убытки в случае:

- наличия неполной либо недостоверной информации в документах, предоставленных в соответствии с требованиями настоящей статьи общей части Правил клиринга;
- непредоставления документов в соответствии с требованиями настоящей статьи общей части Правил клиринга.

## Статья 11. Категории Участников клиринга

11.1. Существуют следующие категории Участников клиринга:

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

11.2. Участниками клиринга категории «А» являются Банк России, а также иные лица, на которые в соответствии с Законом о клиринге не распространяется требование о передаче имущества в индивидуальное и коллективное клиринговое обеспечение и которые не относятся к Участникам клиринга категории «К».

Положения Правил клиринга распространяются на Участников клиринга категории «А», если иное не установлено Законом о клиринге или не предусмотрено договором, заключенным между соответствующим Участником клиринга категории «А» и Клиринговым центром.

Участник клиринга категории «А» может принять на себя обязательство по внесению индивидуального клирингового обеспечения в ценных бумагах и/или денежных средствах.

11.3. Участниками клиринга категории «К» являются Федеральное казначейство, а также иные федеральные органы исполнительной власти, осуществляющие в соответствии с законодательством Российской Федерации функции по обеспечению исполнения федерального бюджета, на которые в соответствии с Законом о клиринге не распространяется требование о передаче имущества в индивидуальное и коллективное клиринговое обеспечение.

Положения Правил клиринга распространяются на Участников клиринга категории «К», если иное не установлено действующим законодательством, в том числе Законом о клиринге, или если иное не указано в Правилах клиринга.

Клиринговые услуги Участникам клиринга категории «К» предоставляются без взимания платы в случае, если это предусмотрено действующим законодательством.

11.4. Участниками клиринга категории «О» являются Общие Участники клиринга.

11.4.1. Участник клиринга категории «О» может являться стороной по Сделкам, заключенным более, чем двумя Участниками торгов, информация о которых предоставлена Участником клиринга Клиринговому центру в соответствии с пунктом 16.1 и/или 16.2 общей части Правил клиринга, и стороной по Сделкам, заключенным им как Участником торгов от своего имени.

11.4.2. Участник клиринга категории «О» имеет допуск к клирингу с частичным обеспечением, за исключением случаев, установленных Правилами клиринга.

11.5. Участниками клиринга категории «Б» являются Индивидуальные Участники клиринга, имеющие допуск к клирингу с частичным обеспечением.

11.5.1. Участник клиринга категории «Б» может являться стороной по Сделкам, заключенным им как Участником торгов от своего имени и не более, чем одним Участником торгов, не совпадающим в одном лице с таким Участником клиринга, или стороной по Сделкам, заключенным не более, чем двумя Участниками торгов, не совпадающими в одном лице с таким Участником клиринга, информация о которых предоставлена Участником клиринга Клиринговому центру в соответствии с пунктом 16.1 и/или 16.2 общей части Правил клиринга, и/или стороной по Сделкам, заключенным им как Участником клиринга от своего имени не на организованных торгах в соответствии с Правилами клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ.

11.6. Участниками клиринга категории «В» являются Индивидуальные Участники клиринга, не имеющие допуска к клирингу с частичным обеспечением.

11.6.1. Участник клиринга категории «В» может являться стороной по Сделкам, заключенным им как Участником торгов от своего имени и не более, чем одним

Участником торгов, не совпадающим в одном лице с таким Участником клиринга, или стороной по Сделкам, заключенным не более, чем двумя Участниками торгов, не совпадающими в одном лице с таким Участником клиринга, информация о которых была предоставлена Участником клиринга Клиринговому центру в соответствии с пунктом 16.1 и/или 16.2 общей части Правил клиринга.

11.7. Правилами клиринга могут быть установлены ограничения в отношении видов сделок, сторонами по которым могут являться Участники клиринга определенной категории.

11.8. Специальной частью Правил клиринга устанавливается перечень категорий Участников клиринга для каждого биржевого рынка.

## Статья 12. Условия клирингового обслуживания. Порядок предоставления допуска к клиринговому обслуживанию

12.1. Допуск к клиринговому обслуживанию на каждом из биржевых рынков предоставляется Участнику клиринга, соответствующему требованиям, установленным пунктами 12.2, и/или 12.3, и/или 12.4 общей части Правил клиринга, на основании Заявления о предоставлении допуска к клиринговому обслуживанию на соответствующем биржевом рынке.

Специальной частью Правил клиринга могут быть установлены дополнительные требования для допуска к клиринговому обслуживанию на соответствующем биржевом рынке для Участников клиринга любой категории.

12.2. Для допуска к клиринговому обслуживанию на любом из биржевых рынков Участник клиринга категории «В» должен соответствовать следующим требованиям:

12.2.1. иметь действующий Договор об оказании клиринговых услуг, заключенный с Клиринговым центром;

12.2.2. иметь действующий договор / договоры, заключенный(-ые) с Техническим центром и обеспечивающий(-ие) технический доступ к Клиринговой системе, и установить необходимое для клирингового обслуживания программно-техническое обеспечение, соответствующее требованиям, установленным Техническим центром;

12.2.3. иметь действующую лицензию на осуществление банковских операций, выданную Банком России (для Кредитных организаций);

12.2.4. иметь действующую лицензию, выданную Банком России на осуществление вида(ов) деятельности некредитных финансовых организаций (для Некредитных организаций, осуществляющих лицензируемую деятельность на финансовом рынке);

12.2.5. иметь действующее специальное разрешение (лицензию или иное основание), выданное компетентным органом государства учреждения Банка-нерезидента, на основании которого Банк-нерезидент имеет право осуществлять банковские операции, предусмотренные личным законом Банка–нерезидента (для Банков-нерезидентов);

12.2.6. иметь действующее специальное разрешение на осуществление операций на финансовых рынках, выданное компетентным органом государства учреждения Участника клиринга (иметь право размещать средства в депозиты на территории Российской Федерации в соответствии с законодательством Российской Федерации и/или соответствующими международными договорами Российской Федерации), либо иметь собственные средства (капитал) не менее, чем 1 000 000 000 (один миллиард) российских рублей (для Участников клиринга, являющихся Некредитной организацией или Некредитной организацией – Нерезидентом);

12.2.7. являться участником СЭД ПАО Московская Биржа;

12.2.8. выполнять требования Клирингового центра по предоставлению информации и отчетности, предусмотренные пунктами 10.5-10.9 общей части Правил клиринга;

12.2.9. иметь открытый собственный Расчетный код или предоставить Клиринговому центру Запрос о выборе основного Расчетного кода для списания комиссионных вознаграждений.

12.3. Для допуска к клиринговому обслуживанию на любом из биржевых рынков Участник клиринга категории «Б», за исключением национальных (центральных) банков стран ЕврАзЭС/ЕАЭС, помимо требований, установленных пунктом 12.2 общей части Правил клиринга, должен соответствовать следующим требованиям:

12.3.1. внести взнос в Гарантийный фонд соответствующего биржевого рынка в размере, установленном в соответствующей специальной части Правил клиринга;

12.3.2. в деятельности Участника клиринга должны отсутствовать факты ухудшения его финансового состояния и/или должна отсутствовать информация, дающая основания считать возможными ухудшение финансового состояния Участника клиринга и/или неспособность Участника клиринга своевременно и в полном объеме исполнять свои обязательства по Сделкам с частичным обеспечением, Маржинальные требования и/или иные обязательства Участника клиринга, возникающие из Правил клиринга.

12.4. Для допуска к клиринговому обслуживанию на любом из биржевых рынков Участник клиринга категории «Б», являющийся национальным (центральным) банком стран ЕврАзЭС/ЕАЭС, помимо требований, установленных пунктом 12.2 общей части Правил клиринга, должен соответствовать следующим требованиям:

12.4.1. внести взнос в Гарантийный фонд соответствующего биржевого рынка в размере, установленном в соответствующей специальной части Правил клиринга.

12.5. Для допуска к клиринговому обслуживанию на любом из биржевых рынков Участник клиринга категории «О» помимо требований, установленных пунктами 12.2-12.3 общей части Правил клиринга, должен соответствовать следующим требованиям:

12.5.1. иметь собственные средства (капитал) не менее, чем 50 000 000 000 (пятьдесят миллиардов) российских рублей, либо

12.5.2. иметь собственные средства (капитал) не менее, чем 20 000 000 000 (двадцать миллиардов) российских рублей и

- рейтинг по международной шкале долгосрочной кредитоспособности по обязательствам в российских рублях или в иностранной валюте не ниже BB+

по классификации рейтинговых агентств "Standard & Poor's" или "Fitch Ratings" либо "Ba1" по классификации рейтингового агентства "Moody's Investors Service", либо

- кредитный рейтинг по национальной шкале не менее A- по классификации Аналитического Кредитного Рейтингового Агентства (АКРА) или рейтингового агентства «Эксперт РА»,

либо

12.5.3. иметь собственные средства (капитал) не менее, чем 20 000 000 000 (двадцать миллиардов) российских рублей при условии, что организация, имеющая право прямо или косвенно осуществлять контроль за деятельностью Участника клиринга, имеет:

- рейтинг по международной шкале долгосрочной кредитоспособности по обязательствам в российских рублях или в иностранной валюте не ниже BB+ по классификации рейтинговых агентств "Standard & Poor's" или "Fitch Ratings" либо "Ba1" по классификации рейтингового агентства "Moody's Investors Service", либо
- кредитный рейтинг по национальной шкале не менее A- по классификации Аналитического Кредитного Рейтингового Агентства (АКРА) или рейтингового агентства «Эксперт РА»;

12.5.4. иметь лицензию Банка России на осуществление банковских операций со средствами в рублях и иностранной валюте и/или лицензию на осуществление клиринговой деятельности (для Участников клиринга – Резидентов);

12.5.5. иметь действующее специальное разрешение на осуществление операций на финансовых рынках, выданное компетентным органом государства учреждения Участника клиринга (для Участников клиринга, являющихся Некредитной организацией – Нерезидентом).

12.6. Для допуска к клиринговому обслуживанию на любом из биржевых рынков Участник клиринга категории «А» или «К» должен соответствовать следующим требованиям:

12.6.1. иметь действующий Договор об оказании клиринговых услуг, заключенный с Клиринговым центром;

12.6.2. иметь действующий договор / договоры, заключенный(-ые) с Техническим центром и обеспечивающий(-ие) технический доступ к Клиринговой системе, и установить необходимое для клирингового обслуживания программно-техническое обеспечение, соответствующее требованиям, установленным Техническим центром;

12.6.3. являться участником СЭД ПАО Московская Биржа.

12.7. Для проверки соответствия собственных средств (капитала) Участника клиринга – Нерезидента требованиям, установленным подпунктами 12.2.6, 12.5.1-12.5.3 общей части Правил клиринга, а также специальными частями Правил клиринга, размер собственных средств (капитала) Участника клиринга – Нерезидента в иностранной валюте пересчитывается в российские рубли по курсу иностранной валюты к российскому рублю, установленному Банком России на первое число каждого календарного квартала.

12.8. В случае изменения суверенного рейтинга Российской Федерации, значения рейтингов по международной шкале долгосрочной кредитоспособности по обязательствам в российских рублях или в иностранной валюте, применяемые для предоставления допуска к клиринговому обслуживанию в соответствии с подпунктами 12.5.2-12.5.3 общей части Правил клиринга, а также специальными частями Правил клиринга, могут быть изменены решением Клирингового центра, раскрываемом на Сайте Клирингового центра.

12.9. Клиринговый центр вправе запросить у Участника клиринга, предоставившего Клиринговому центру Заявление о предоставлении допуска к клиринговому обслуживанию с категорией «О» или Заявление об изменении категории Участника клиринга на категорию «О»:

- информацию о структуре собственности Участника клиринга;
- внутренние документы, описывающие систему управления рисками, а также методику и результаты стресс-тестирования Участника клиринга.

12.10. Клиринговый центр вправе запросить у Участника клиринга, соответствующего требованиям подпункта 12.5.3 общей части Правил клиринга и предоставившего Клиринговому центру Заявление о предоставлении допуска к клиринговому обслуживанию с категорией «О» или Заявление об изменении категории Участника клиринга на категорию «О», письмо, выданное организацией, имеющей право прямо или косвенно осуществлять контроль за деятельностью Участника клиринга, содержащее:

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

Указанное в настоящем пункте общей части Правил клиринга письмо может быть предоставлено на русском или английском языке.

12.11. По результатам анализа информации и/или документов, полученных Клиринговым центром от Участника клиринга в соответствии с пунктами 12.9 и 12.10 общей части Правил клиринга, или в случае непредоставления указанной информации и/или документов, Клиринговый центр вправе отказать Участнику клиринга в исполнении Заявления о предоставлении допуска к клиринговому обслуживанию с категорией «О» или Заявления об изменении категории Участника клиринга на категорию «О».

12.12. Клиринговый центр не предоставляет Участнику клиринга категории «О», «Б» или «В» допуск к клиринговому обслуживанию по Сделкам с ценными бумагами с

источником дохода в США при наличии информации о том, что Участник клиринга не участвует в применении FATCA и/или не признан соблюдающим требования FATCA, и/или информации, дающей основания считать Участника клиринга лицом, не участвующем в применении FATCA и/или утратившим статус лица, признанного соблюдающим требования FATCA.

12.13. Участники клиринга должны соответствовать следующим требованиям к финансовой устойчивости:

12.13.1. Участники клиринга - Кредитные организации - соблюдать обязательные нормативы Банка России, установленные для кредитных организаций;

12.13.2. в деятельности Участников клиринга – Кредитных организаций должны отсутствовать основания для отзыва Банком России лицензии на осуществление банковских операций в соответствии с законодательством Российской Федерации о банковской деятельности;

12.13.3. в деятельности Участников клиринга должны отсутствовать основания для осуществления мер по предупреждению банкротства в соответствии с законодательством Российской Федерации о несостоятельности (банкротстве) или в соответствии с личным законом Участника клиринга;

12.13.4. соблюдать обязательные нормативы, установленные компетентным органом государства учреждения, в случае если в соответствии с национальным законодательством государства учреждения Участника клиринга такие обязательные нормативы устанавливаются;

12.13.5. в деятельности Участников клиринга – Банков-нерезидентов должны отсутствовать основания для отзыва в соответствии с национальным законодательством государства учреждения Банка-нерезидента специального разрешения (лицензии или иного основания), выданного компетентным органом государства учреждения Банка-нерезидента, на основании которого Банк-нерезидент имеет право осуществлять банковские операции.

12.14. Участники клиринга категории «Б» и «О» должны соответствовать требованиям к финансовой устойчивости, приведенным в пункте 12.12 общей части Правил клиринга, в течение всего времени допуска к клиринговому обслуживанию.

12.15. Участники клиринга обязаны незамедлительно уведомлять Клиринговый центр о своем несоответствии требованиям к финансовой устойчивости, приведенным в пункте 12.12 общей части Правил клиринга.

12.16. Клиринговый центр вправе не предоставлять допуск к клиринговому обслуживанию на одном или нескольких биржевых рынков Участникам клиринга категорий «О», «Б» и «В», в следующих случаях:

12.16.1. Кредитным организациям – в случае несоответствия требованию о наличии по балансу на последнюю отчетную дату положительного финансового результата текущего года, определяемого как разница между суммой остатков, числящихся на балансовых счетах по учету доходов текущего года, и суммой остатков, числящихся на балансовых счетах по учету расходов текущего года;

12.16.2. Государственным корпорациям, Международным организациям, Некредитным организациям – в случае наличия непокрытого убытка по балансу на последнюю отчетную дату;

12.16.3. Нерезидентам – в случае несоответствия требованию о наличии по финансовой отчетности на последнюю отчетную дату положительного финансового результата деятельности, определяемого как прибыль после налогообложения;

12.16.4. в случае невыполнения требований Клирингового центра к финансовой устойчивости Участника клиринга, предусмотренных пунктом 12.13 общей части Правил клиринга;

12.16.5. в случае наличия риска потери деловой репутации Клирингового центра в связи с осуществлением клирингового обслуживания Участника клиринга.

12.17. Клиринговый центр вправе определить особенности применения требований по допуску к клиринговому обслуживанию для отдельных категорий юридических лиц, в том числе для Банков-нерезидентов, с учетом положений соответствующего международного соглашения (договора), для Международных организаций - с учетом положений соответствующего международного договора.

12.18. В случае, если информация, полученная от Банка России, государственной корпорации «Агентство по страхованию вкладов» и/или инвестора, осуществляющего мероприятия по финансовому оздоровлению Кредитной организации, дает Клиринговому центру основания полагать, что обязательства Участника клиринга перед Клиринговым центром будут надлежащим образом исполнены, Клиринговый центр вправе предоставить допуск к клиринговому обслуживанию с категорией «Б» или «В» лицу, не соответствующему требованиям, предъявляемым к Участнику клиринга соответствующей категории для допуска к клиринговому обслуживанию.

12.19. Допуск к клиринговому обслуживанию на соответствующем биржевом рынке предоставляется Участнику клиринга Клиринговым центром в срок, не превышающий 5 (пяти) рабочих дней после выполнения Участником клиринга требований и условий, предусмотренных Правилами клиринга.

О факте предоставления Участнику клиринга допуска к клиринговому обслуживанию и о категории Участника клиринга Клиринговый центр извещает Участника клиринга и Биржу не позднее рабочего дня, следующего за днем предоставления допуска к клиринговому обслуживанию.

12.20. Участник клиринга вправе предоставить Клиринговому центру Заявление об изменении категории Участника клиринга.

12.20.1. Заявление об изменении категории Участника клиринга с категории «Б» на категорию «В» на соответствующем биржевом рынке исполняется при соблюдении следующих условий:

1) у Участника клиринга отсутствуют неисполненные Маржинальные требования по всем Расчетным кодам, открытым для такого рынка, и
2) у Участника клиринга отсутствуют непогашенные Задолженности по всем Расчетным кодам, учитываемые в соответствии с Правилами клиринга.

12.20.2. Изменение категории Участника клиринга с категории «О» на категорию «Б» или «В» на соответствующем биржевом рынке осуществляется при соблюдении условий, указанных в подпункте 12.20.1 общей части Правил клиринга, и выполнении одного из следующих условий:

1) отсутствие у Участника клиринга неисполненных обязательств по Сделкам, заключенным на соответствующем биржевом рынке Участниками торгов с указанием соответствующего Участника клиринга категории «О» в качестве Клирингового брокера, или

2) наличие у Участника клиринга неисполненных обязательств по Сделкам, заключенным на соответствующем биржевом рынке только одним Участником торгов, не совпадающим в одном лице с таким Участником клиринга, или обязательств по Сделкам, заключенным не более, чем двумя Участниками торгов, не совпадающими в одном лице с таким Участником клиринга.

12.20.3. Клиринговый центр вправе изменить категорию Участника клиринга с категории «В» на категорию «Б» на соответствующем биржевом рынке без подачи заявления при выполнении Участником клиринга требований, установленных для Участников клиринга категории «Б» на соответствующем биржевом рынке.

12.20.4. Клиринговый центр извещает Участника клиринга и Биржу об изменении категории Участника клиринга не позднее рабочего дня, следующего за днем установления Участнику клиринга новой категории.

12.21. При изменении категории Участника клиринга с категории «Б» или «О» на категорию «В» на соответствующем биржевом рынке или при прекращении допуска к клиринговому обслуживанию Участника клиринга с категорией «Б» или «О» на соответствующем биржевом рынке Клиринговый центр прекращает учет обязательств Участника клиринга по внесению взноса в Гарантийный фонд такого биржевого рынка и Обеспечения под стресс на таком биржевом рынке при соблюдении условии для возврата Участнику клиринга денежных средств и/или ценных бумаг, учитываемых в качестве взноса Участника клиринга в Гарантийный фонд / Обеспечения под стресс, установленных подпунктом 33.1.1 общей части Правил клиринга.

Возврат Участнику клиринга денежных средств и/или ценных бумаг, учитываемых в качестве взноса Участника клиринга в Гарантийный фонд / Обеспечения под стресс Участника клиринга, осуществляется в порядке, предусмотренном статьей 33 общей части Правил клиринга.

12.22. Участник клиринга или Клиринговый центр имеют возможность подавать Запросы на подбор ценных бумаг с использованием WEB-сервиса Расчетного депозитария в случаях, установленных Правилами клиринга, в случае если депонент Расчетного депозитария, которому открыт субсчет депо или торговый счет депо и который является Участником клиринга и/или клиентом Участника клиринга и/или Держателем, осуществляющим депозитарное обслуживание такого Участника клиринга и/или его клиентов:

- заключил с Расчетным депозитарием договор об оказании клиринговых услуг;
- заключил с Расчетным депозитарием договор об оказании услуг по

управлению обеспечением;

- предоставил Расчетному депозитарию поручение на маркирование ресурсов для подбора ценных бумаг, предусмотренное договором об оказании услуг по управлению обеспечением, заключенным с Расчетным депозитарием.

12.22.1. Депонент Расчетного депозитария, указанный в пункте 12.22 общей части Правил клиринга, вправе предоставить Расчетному депозитарию отдельное поручение на маркирование ресурсов для подбора ценных бумаг для клиринга НКО НКЦ (АО), предусмотренное договором об оказании услуг по управлению обеспечением, заключенным с Расчетным депозитарием.

12.23. Для предоставления Клиринговому центру права на безакцептное списание денежных средств с корреспондентского счета Участника клиринга – Кредитной организации, открытого в Банке России, в случаях, установленных Правилами клиринга, Участник клиринга обязан заключить с Банком России дополнительное соглашение к Договору корреспондентского счета, содержащее сведения о Клиринговом центре как о получателе средств, имеющем право направлять инкассовые поручения по корреспондентскому счету.

## Статья 13. Порядок приостановления и прекращения допуска к клиринговому обслуживанию

13.1. Клиринговый центр вправе приостановить допуск к клиринговому обслуживанию Участника клиринга категории «О», категории «Б» или категории «В» на одном или нескольких биржевых рынках по всем Сделкам или по отдельным видам Сделок, а также по отдельным Режимам торгов, по любому из следующих оснований:

13.1.1. на основании полученной от Биржи информации о приостановлении или прекращении допуска Участника клиринга к участию в торгах на Бирже на соответствующем биржевом рынке (для Участника клиринга, являющегося Участником торгов);

13.1.2. при возникновении обстоятельств, препятствующих, в соответствии с законодательством Российской Федерации, исполнению Участником клиринга сделок (за исключением чрезвычайных ситуаций), ставших известными Клиринговому центру;

13.1.3. при нарушении Участником клиринга установленных Правилами клиринга требований;

13.1.4. при применении Банком России к Участнику клиринга – Кредитной организации санкций за нарушение банковского законодательства, в том числе: введение запрета на осуществление Участником клиринга отдельных банковских операций, если это приведет к невозможности исполнения Участником клиринга сделок, и назначение временной администрации по управлению Участником клиринга - Кредитной организацией в рамках мер по предупреждению банкротства кредитной организации;

13.1.5. при применении к Участнику клиринга санкций уполномоченных органов за нарушение законодательства Российской Федерации, в том числе при применении административных наказаний;

13.1.6. при применении к Участнику клиринга – Нерезиденту санкций уполномоченных органов за нарушение национального законодательства государства учреждения Нерезидента;

13.1.7. при получении Клиринговым центром письменного сообщения от компетентного органа государства учреждения Нерезидента в отношении Нерезидента, из которого следует невозможность дальнейшего осуществления клирингового обслуживания Нерезидента, и/или размещении соответствующей информации на сайте вышеуказанного компетентного органа в сети Интернет;

13.1.8. в случае приостановления международного соглашения (договора) для Российской Федерации либо в случае приостановления международного соглашения (договора) для государства - стороны международного соглашения (договора), являющегося государством учреждения соответствующего Участника-клиринга;

13.1.9. в случае приостановления международного договора для Российской Федерации, в соответствии с которым Международная организация учреждена либо в случае принятия решения уполномоченными лицами сторон указанного международного договора о приостановлении деятельности Международной организации;

13.1.10. наличие в деятельности Участника клиринга оснований для осуществления мер по предупреждению банкротства в соответствии с законодательством Российской Федерации о несостоятельности (банкротстве), а также оснований для отзыва (аннулирования) уполномоченным органом / Банком России лицензии на осуществление соответствующего вида деятельности в соответствии с законодательством Российской Федерации;

13.1.11. наличие в деятельности Участника клиринга, являющегося Банком-Нерезидентом, оснований для отзыва (аннулирования) компетентным органом государства учреждения Участника клиринга разрешения (лицензии или иного основания), на основании которого Участник клиринга имеет право осуществлять банковские операции, предусмотренные личным законом Нерезидента;

13.1.12. наличие в деятельности Участника клиринга, являющегося Некредитной организацией – Нерезидентом, оснований для отзыва (аннулирования) компетентным органом государства учреждения Участника клиринга специального разрешения на осуществление операций на финансовых рынках;

13.1.13. по результатам рассмотрения Клиринговым центром предоставленных Участником клиринга в соответствии с пунктами 10.5-10.8 общей части Правил клиринга информации и документов, а также в случае их непредставления в надлежащий срок;

13.1.14. при наличии фактов ухудшения финансового состояния Участника клиринга и/или информации, дающей основания считать возможными ухудшение финансового состояния Участника клиринга и/или неспособность Участника клиринга своевременно и в полном объеме исполнять свои обязательства по Сделкам, Маржинальные требования и/или иные обязательства Участника клиринга, возникающие из Правил клиринга;

13.1.15. при наличии фактов неисполнения или ненадлежащего исполнения Участником клиринга обязательств перед Клиринговым центром, возникших из Договора об оказании клиринговых услуг;

13.1.16. в случае отсутствия в отчетности Участника клиринга положительного финансового результата, предусмотренного пунктом 12.16 общей части Правил клиринга, по состоянию на две и более последовательные отчетные даты;

13.1.17. в случае непредоставления Участником клиринга Анкеты для целей выявления иностранных налогоплательщиков в соответствии с пунктом 10.9 общей части Правил клиринга;

13.1.18. в случае получения от иностранного налогового органа уведомления о невыполнении Участником клиринга требований законодательства иностранного государства;

13.1.19. в случае наличия риска потери деловой репутации Клирингового центра в связи с продолжением клирингового обслуживания Участника клиринга;

13.1.20. в случае непредоставления Участником клиринга копии документа, удостоверяющего личность единоличного исполнительного органа Участника клиринга (далее по тексту – Руководитель), заверенной согласно требованиям Правил клиринга, в течение 30 дней после наступления обстоятельства, с которого документ, удостоверяющий личность Руководителя, копия которого была ранее предоставлена Клиринговому центру, подлежит замене.

13.2. Клиринговый центр приостанавливает допуск к клиринговому обслуживанию Участника клиринга категории «О», «Б» или «В» по сделкам с ценными бумагами с источником дохода в США при наличии информации о том, что Участник клиринга не участвует в применении FATCA и/или не признан соблюдающим требования FATCA, и/или информации, дающей основания считать Участника клиринга лицом, не участвующем в применении FATCA и/или утратившим статус лица, признанного соблюдающим требования FATCA.

Клиринговый центр возобновляет клиринговое обслуживание Участника клиринга, приостановленного на основании настоящего пункта общей части Правил клиринга, после получения информации о прекращении действия оснований для приостановления допуска к клиринговому обслуживанию. Клиринговый центр вправе принять решение о возобновлении допуска к клиринговому обслуживанию Участника клиринга на основании соответствующих документов и/или информации от Участника клиринга.

13.3. Клиринговый центр вправе установить Участнику клиринга категории «Б» категорию «В» на одном или нескольких биржевых рынках по основаниям, предусмотренным пунктом 13.1 общей части Правил клиринга, а также:

13.3.1. при несоответствии размера взноса Участника клиринга категории «Б» в Гарантийный фонд соответствующего биржевого рынка размеру, установленному в соответствующей специальной части Правил клиринга;

13.3.2. при несоответствии размера Обеспечения под стресс Участника клиринга на соответствующем биржевом рынке размеру, установленному в соответствии с Правилами клиринга;

13.3.3. при выполнении условия, указанного в подпункте 43.3.1, 44.5.2 или 44.5.3 общей части Правил клиринга.

13.4. Клиринговый центр вправе установить по всем Торгово-клиринговым счетам Участника клиринга категории «О» на одном или нескольких биржевых рынках признак «запрет коротких продаж» и признак «запрет необеспеченных покупок» или предпринять иные меры, предусмотренные соответствующей специальной частью Правил клиринга, по основаниям, предусмотренным пунктом 13.2 общей части Правил клиринга, а также:

13.4.1. при несоответствии Участника клиринга требованиям, установленным подпунктом 12.5.1, или подпунктом 12.5.2, или подпунктом 12.5.3 общей части Правил клиринга.

При этом в целях проверки соответствия собственных средств (капитала) Участника клиринга – Нерезидента требованиям, установленным подпунктами 12.5.1-12.5.3 общей части Правил клиринга, размер собственных средств (капитала) Участника клиринга – Нерезидента в иностранной валюте пересчитывается в российские рубли по курсу иностранной валюты к российскому рублю, установленному Банком России на первое число каждого календарного квартала.

13.5. В случае если действие указанных в подпункте 13.4.1 общей части Правил клиринга оснований для установления Участнику клиринга категории «О» признака «запрет коротких продаж» и признака «запрет необеспеченных покупок» или принятия иных мер, предусмотренных соответствующей специальной частью Правил клиринга, не прекращено в течение 3-х рабочих дней после установления указанного признака (принятия иных мер, предусмотренных соответствующей специальной частью Правил клиринга), Клиринговый центр вправе приостановить допуск к клиринговому обслуживанию Участника клиринга категории «О», начиная с 4-го рабочего дня с даты установления указанного признака (принятия указанных мер).

13.6. Клиринговый центр вправе установить Участнику клиринга категории «О» категорию «Б» в случае, если в течение 2-х (двух) лет с даты присвоения Участнику клиринга категории «О» такому Участнику клиринга не было зарегистрировано Клиринговым центром ни одного Торгово-клирингового счета 2-го уровня для Участника торгов или не было осуществлено иных действий, предусмотренных соответствующей специальной частью Правил клиринга, свидетельствующих о начале оказания услуг другим Участникам торгов.

13.7. При отсутствии на биржевом рынке категории «В» Клиринговый центр вправе приостановить допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию на таком биржевом рынке по основаниям, указанным в подпунктах 13.3.1, 13.3.2 общей части Правил клиринга.

13.8. При установлении Клиринговым центром Участнику клиринга категории «Б» категории «В» или Участнику клиринга категории «О» признака «запрет коротких продаж» и признака «запрет необеспеченных покупок» или при принятии в отношении Участника клиринга категории «О» иных мер, предусмотренных соответствующей специальной частью Правил клиринга, Клиринговый центр вправе осуществить перевод Профилей активов в целях выполнения условия неотрицательности значений, рассчитанных в соответствии с пунктом 31.13 общей части Правил клиринга для каждой Даты исполнения по всем Расчетным кодам

Участника клиринга, являющимся Расчетными кодами Единого пула / Торгово-клиринговым счетам, в состав которых входит Расчетный код Единого пула.

13.9. В случае, если информация, полученная от Банка России, государственной корпорации «Агентство по страхованию вкладов» и/или инвестора, осуществляющего мероприятия по финансовому оздоровлению Участника клиринга, дает Клиринговому центру основания полагать, что обязательства Участника клиринга перед Клиринговым центром будут надлежащим образом исполнены, Клиринговый центр вправе при наличии оснований, предусмотренных пунктом 13.1 общей части Правил клиринга для приостановления допуска к клиринговому обслуживанию, не приостанавливать допуск к клиринговому обслуживанию такого Участника клиринга.

13.10. В случае приостановления допуска к клиринговому обслуживанию на одном или нескольких биржевых рынках, в том числе по отдельным видам сделок или по отдельным Режимам торгов, Клиринговый центр продолжает осуществлять клиринг и иные функции, связанные с осуществлением на соответствующем биржевом рынке клиринга по Сделкам, стороной по которым является данный Участник клиринга, заключенным до момента приостановления допуска к клиринговому обслуживанию Участника клиринга или, соответственно, до момента приостановления допуска к клиринговому обслуживанию по отдельным видам сделок или по отдельным Режимам торгов, по Сделкам, направленным на урегулирование неисполненных обязательств такого Участника клиринга, которые Клиринговый центр вправе в порядке и случаях, установленных Правилами клиринга, заключать с таким Участником клиринга, а также по иным обязательствам Участника клиринга, возникшим после приостановления допуска к клиринговому обслуживанию, в том числе, обязательствам по уплате комиссионных вознаграждений и штрафов.

13.11. В случае приостановления допуска к клиринговому обслуживанию Клиринговый центр вправе:

13.11.1. установить по всем Торгово-клиринговым счетам Участника клиринга категории «О» или «Б» на одном или нескольких биржевых рынках признак «запрет коротких продаж» и признак «запрет необеспеченных покупок»;

13.11.2. принять решение о заключении от имени Участника клиринга закрывающих сделок, направленных на прекращение обязательств Участника клиринга по всем Расчетным кодам / Торгово-клиринговым счетам на биржевом рынке, допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию на котором приостановлен.

При принятии указанного решения Клиринговый центр также заключает балансирующие сделки.

Порядок заключения закрывающих и балансирующих сделок определен статьей 27 общей части Правил клиринга.

В случае принятия решения, указанного в настоящем подпункте общей части Правил клиринга, Участник клиринга, в отношении которого принято указанное решение, признается Недобросовестным участником клиринга.

13.12. После получения информации о прекращении действия оснований для приостановления допуска к клиринговому обслуживанию на одном или нескольких

биржевых рынках и на основании соответствующего письма Участника клиринга Клиринговый центр вправе принять решение о возобновлении допуска к клиринговому обслуживанию Участника клиринга.

13.12.1. Для возобновления допуска к клиринговому обслуживанию, приостановленного на основании подпункта 13.1.1 общей части Правил клиринга, предоставление соответствующего письма Участника клиринга не требуется.

13.12.2. Клиринговый центр вправе принять решение о возобновлении допуска к клиринговому обслуживанию, приостановленного на основании подпунктов 13.3.1, 13.3.2 общей части Правил клиринга, без предоставления соответствующего письма Участника клиринга.

13.13. Клиринговый центр прекращает допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию (независимо от его категории) на всех биржевых рынках по любому из следующих оснований:

13.13.1. прекращение действия Договора об оказании клиринговых услуг;

13.13.2. отзыв (аннулирование) Банком России лицензии на осуществление банковских операций у Участника клиринга – кредитной организации;

13.13.3. отзыв (аннулирование) специального разрешения (лицензии или иного основания) компетентного органа государства учреждения Нерезидента, в соответствии с которым Нерезидент имеет право осуществлять банковские операции и/или иные операции на финансовых рынках, предусмотренные личным законом Нерезидента;

13.13.4. прекращение международного соглашения (договора) для Российской Федерации либо прекращение международного соглашения (договора) для государства - стороны международного соглашения (договора), являющегося государством учреждения соответствующего Участника-клиринга;

13.13.5. прекращение международного договора, в соответствии с которым учреждена Международная организация, для Российской Федерации либо принятие решения уполномоченными лицами сторон указанного международного договора о прекращении деятельности Международной организации;

13.13.6. принятие федерального закона о ликвидации государственной корпорации;

13.13.7. назначение временной администрации в отношении Участника клиринга – Некредитной организации;

13.13.8. принятие арбитражным судом решения о введении в отношении Участника клиринга одной из процедур банкротства;

13.13.9. ликвидация Участника клиринга, а также реорганизация Участника клиринга при условии, что деятельность Участника клиринга в результате реорганизации прекращается;

13.13.10. размещение в сети Интернет на официальном сайте уполномоченного органа информации о включении Участника клиринга в перечень организаций, в отношении которых имеются сведения об их причастности к экстремистской деятельности или терроризму, или в перечень организаций, в отношении которых имеются сведения об их причастности к распространению оружия массового уничтожения, либо размещение в сети Интернет на официальном сайте уполномоченного органа решения о применении мер по замораживанию

(блокированию) денежных средств или иного имущества, принадлежащих Участнику клиринга, в отношении которого имеются достаточные основания подозревать его причастность к террористической деятельности (в том числе к финансированию терроризма) при отсутствии оснований для включения в указанный перечень (далее – включение в перечень);

13.13.11. предоставление Участником клиринга Заявления о прекращении допуска к клиринговому обслуживанию. Клиринговый центр прекращает допуск Участника клиринга на основании указанного заявления на биржевом рынке, указанном в заявлении, при выполнении условий для закрытия всех Расчетных кодов и Торгово-клиринговых счетов Участника клиринга, открытых Участнику клиринга на таком биржевом рынке, на дату получения Клиринговым центром такого заявления.

13.14. Клиринговый центр прекращает допуск Участника клиринга категории «О» к клиринговому обслуживанию по основаниям, предусмотренным пунктом 13.13 общей части Правил клиринга, а также:

13.14.1. в случае отзыва (аннулирования) Банком России лицензии на осуществление клиринговой деятельности у Участника клиринга - Резидента, не имеющего лицензии Банка России на осуществление банковских операций;

13.14.2. в случае отзыва (аннулирования) компетентным органом государства учреждения Участника клиринга, являющегося Некредитной организацией – Нерезидентом, специального разрешения на осуществление операций на финансовых рынках у такого Участника клиринга.

13.15. Клиринговый центр вправе прекратить допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию на одном или нескольких биржевых рынках:

13.15.1. при получении Клиринговым центром от Биржи информации о прекращении допуска Участника клиринга к участию в торгах на Бирже на соответствующем рынке (для Участника клиринга, являющегося Участником торгов);

13.15.2. неоднократного (два и более раза) в течение одного года неисполнения Участником клиринга своих обязательств, допущенных к клирингу, и/или иных денежных обязательств Участника клиринга, возникающих на основании Правил клиринга;

13.15.3. неоднократного (два и более раза) в течение одного года нарушения Участником клиринга установленных Правилами клиринга требований;

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

13.16. Клиринговый центр извещает Участника клиринга и Биржу о приостановлении / прекращении или возобновлении приостановленного допуска к клиринговому обслуживанию на одном или нескольких рынках (в том числе, по отдельным видам сделок или по отдельным Режимам торгов) или об изменении категории Участника клиринга не позднее Расчетного дня, следующего за днем приостановления / прекращения или возобновления приостановленного допуска к клиринговому обслуживанию / днем установления Участнику клиринга иной категории.

## Статья 14. Порядок регистрации Участников клиринга, клиентов Участника клиринга, порядок открытия Расчетных кодов Участника клиринга

14.1. Клиринговый центр осуществляет регистрацию Участников клиринга.

14.1.1. Процедура регистрации Участника клиринга предусматривает присвоение (открытие) Участнику клиринга следующих кодов / идентификаторов:

- кода Участника клиринга в соответствии с требованиями нормативных актов Банка России;
- Идентификатор (присваивается Клиринговым центром). Если Участник клиринга является Участником торгов, Идентификатор присваивается на основании данных, полученных от Биржи.

Код Участника клиринга присваивается при заключении Участником клиринга с Клиринговым центром Договора об оказании клиринговых услуг.

14.1.2. Изменение кода Участника клиринга осуществляется на основании информации, предоставляемой Участником клиринга в соответствии со статьей 10 общей части Правил клиринга и / или на основании сведений (информации) о юридическом лице из официальных источников, в том числе электронного сервиса Федеральной налоговой службы.

14.1.3. Клиринговый центр извещает Участника клиринга о присвоенном/измененном коде Участника клиринга путем направления уведомления в форме электронного документа.

14.1.4. Информация о коде Участника клиринга учитывается в реестре Участников клиринга и предоставляется по запросу Банка России, иных уполномоченных лиц и органов и содержит данные, соответствующие требованиям Банка России, предъявляемым к регистрации Участников клиринга (кодов Участников клиринга).

14.2. Клиринговый центр осуществляет регистрацию клиентов Участника клиринга по требованию Участника клиринга.

Регистрация Обособленных клиентов осуществляется в соответствии со статьей 21 общей части Правил клиринга.

14.3. Открытие Расчетного кода Участника клиринга осуществляется для каждого биржевого рынка или для всех биржевых рынков, включенных в единый пул обеспечения, определенных в пункте 19.1 общей части Правил клиринга, в порядке и случаях, установленных настоящей статьей общей части Правил клиринга.

14.3.1. Для одного Расчетного кода Участника клиринга открывается один Счет обеспечения в российских рублях и по одному Счету обеспечения в каждой иностранной валюте, в которой проводятся расчеты по Сделкам и/или денежные средства в которой принимаются Клиринговым центром в качестве Обеспечения.

14.3.2. Специальными частями Правил клиринга могут быть установлены особенности / иной порядок открытия Расчетных кодов / Счетов обеспечения Участника клиринга для соответствующего биржевого рынка.

14.4. Участнику клиринга могут быть открыты Расчетные коды Участника клиринга следующих типов:

- собственный – для учета денежных средств Участника клиринга;

- клиентский – для учета денежных средств клиента Участника клиринга / клиентов Участника клиринга;
- ДУ – для учета денежных средств, находящихся в доверительном управлении Участника клиринга.

14.4.1. Участнику клиринга может быть открыто неограниченное количество Расчетных кодов Участника клиринга каждого из типов.

14.5. Расчетный код Участника клиринга имеет один из следующих признаков:

- Расчетный код Участника клиринга, совпадающего в одном лице с Участником торгов (устанавливается по умолчанию);
- Расчетный код для заключения сделок от имени Участника клиринга на основании заявок Участника торгов, не совпадающего в одном лице с таким Участником клиринга (далее – Расчетный код для заключения сделок от имени Участника клиринга);
- Расчетный код для заключения сделок на основании заявок, в которых Участник клиринга будет указан в качестве Клирингового брокера (далее – Расчетный код Клирингового брокера).

Изменение указанного признака осуществляется на основании Запроса на изменение параметров Расчетного кода.

14.6. Участнику клиринга категории «Б» или «О» Клиринговый центр без заявления Участника клиринга открывает Расчетный код для учета взносов в Гарантийные фонды.

14.6.1. Одному Участнику клиринга категории «Б» или «О» открывается один Расчетный код для учета взносов в Гарантийные фонды.

14.7. Участнику клиринга категории «Б» или «О» при первом случае возникновения обязанности по внесению Обеспечения под стресс Клиринговый центр без заявления Участника клиринга открывает Расчетный код для учета Обеспечения под стресс.

14.7.1. Одному Участнику клиринга категории «Б» или «О» открывается один Расчетный код для учета Обеспечения под стресс.

14.8. Для заключения сделок за счет клиентов Участника клиринга и/или за счет денежных средств, находящихся в доверительном управлении Участника клиринга, Участник клиринга обязан совершить действия, необходимые для открытия Клиринговым центром Участнику клиринга отдельного клиентского Расчетного кода Участника клиринга (отдельных клиентских Расчетных кодов Участника клиринга) и/или отдельного Расчетного кода ДУ Участника клиринга (отдельных Расчетных кодов ДУ Участника клиринга).

14.9. Для заключения сделок за счет клиента Участника клиринга, в отношении которого в соответствии с нормативными актами Российской Федерации Участник клиринга обязан требовать от Клирингового центра ведения отдельного учета денежных средств и иного имущества этого клиента, переданных Клиринговому центру в качестве индивидуального клирингового обеспечения, Участник клиринга обязан совершить действия, необходимые для открытия Клиринговым центром Участнику

клиринга отдельного клиентского Расчетного кода Участника клиринга для такого клиента, а также действия, необходимые для открытия Клиринговым центром Участнику клиринга для такого клиента Участника клиринга отдельного Торгово-клирингового счета Участника клиринга, в состав которого входит клиентский Расчетный код Участника клиринга, открытый Участнику клиринга для такого клиента Участника клиринга (на тех биржевых рынках, условием допуска к клирингу на которых является открытие Торгово-клиринговых счетов Участника клиринга).

14.10. Открытие Расчетных кодов Участника клиринга осуществляется на основании Запроса на открытие Расчетного кода, предоставленного Участником клиринга Клиринговому центру, или Запроса на открытие Торгово-клирингового счета в случае, если это предусмотрено специальной частью Правил клиринга, а также без заявления Участника клиринга в случаях, установленных специальными частями Правил клиринга.

14.10.1. Запрос на открытие Расчетного кода может содержать идентификационные данные клиента Участника клиринга в соответствии с требованиями, предъявляемыми Биржей при регистрации клиентов Участников торгов.

14.11. На основании Запроса на открытие Расчетного кода или Запроса на изменение параметров Расчетного кода, содержащего идентификационные данные клиента Участника клиринга, Клиринговый центр устанавливает соответствие между Расчетным кодом Участника клиринга и идентификационными данными клиента Участника клиринга, указанными в запросе.

14.12. Участник клиринга вправе зарегистрировать в Клиринговом центре Счета для возврата обеспечения и установить соответствие между Расчетным кодом Участника клиринга и Счетом для возврата обеспечения.

14.12.1. Возврат Клиринговым центром Обеспечения в денежных средствах, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, осуществляется на зарегистрированные Счета для возврата обеспечения, соответствующие такому Расчетному коду Участника клиринга.

14.13. Регистрация Счетов для возврата обеспечения осуществляется на основании Запроса на регистрацию реквизитов Счета для возврата обеспечения.

14.13.1. В случае если владельцем Счета для возврата обеспечения является клиент Участника клиринга Участник клиринга обязан предоставить Клиринговому центру:

- Письмо об идентификации клиента (в случае, если Участник клиринга обязан осуществлять идентификацию клиента в соответствии с требованиями законодательства по противодействию легализации (отмыванию) доходов, полученных преступных путем и финансированию терроризма;
- копию договора об обслуживании / оказании услуг /договора комиссии / агентского договора, заключенного между Участником клиринга и клиентом Участника клиринга, заверенную нотариально или Участником клиринга;
- Анкету выгодоприобретателя (в случаях, когда Клиринговый центр осуществляет идентификацию выгодоприобретателя в соответствии с требованиями законодательства по противодействию легализации

(отмыванию) доходов, полученных преступных путем и финансированию терроризма);

- иные документы (по требованию Клирингового центра).

14.13.2. Клиринговый центр вправе отказать в регистрации Счета для возврата обеспечения, в случае, если Участник клиринга не предоставил документы, указанные в подпункте 14.13.1 общей части Правил клиринга в течение 30 дней с момента получения Клиринговым центром Запроса на регистрацию реквизитов Счета для возврата обеспечения или с момента предъявления Клиринговым центром требования о предоставлении иных документов (в случае предъявления такого требования).

14.13.3. Клиринговый центр вправе отказать в регистрации Счета для возврата обеспечения и (или) не удовлетворить требование Участника клиринга о возврате денежных средств, составляющих Обеспечение Участника клиринга, а также аннулировать регистрацию ранее зарегистрированного Счета для возврата обеспечения, в случае, если по заключению Клирингового центра регистрация Счета для возврата обеспечения или удовлетворение требования Участника клиринга может повлечь нарушение российского законодательства о валютном регулировании и валютном контроле, и/или увеличение принимаемых Клиринговым центром рисков, и/или нарушение правил и порядка внутреннего контроля, осуществляемого Клиринговым центром в соответствии с нормативными актами Банка России.

14.14. Установление соответствия между Расчетным кодом Участника клиринга и Счетом для возврата обеспечения осуществляется на основании Запроса на установление соответствия Счета для возврата обеспечения Расчетному коду.

14.15. В случае изменения реквизитов Счета для возврата обеспечения Участник клиринга обязан предоставить Клиринговому центру Запрос на изменение реквизитов Счета для возврата обеспечения, содержащее информацию о новых реквизитах Счета для возврата обеспечения.

14.15.1. Клиринговый центр вправе отказать в регистрации новых реквизитов Счета для возврата обеспечения по основанию, указанному в подпункте 14.13.3 общей части Правил клиринга.

14.15.2. Новые реквизиты Счета для возврата обеспечения в соответствующей валюте начинают действовать с момента направления Участнику клиринга уведомления об исполнении Запроса на изменение реквизитов Счета для возврата обеспечения.

14.16. Аннулирование регистрации Счетов для возврата обеспечения осуществляется Клиринговым центром на основании предоставленного Участником клиринга Запроса на аннулирование регистрации реквизитов Счета для возврата обеспечения.

Специальной частью Правил клиринга могут быть установлены особенности аннулирования Счетов для возврата обеспечения.

14.17. Участник клиринга несет риск последствий, вызванных непредоставлением (несвоевременным представлением) Клиринговому центру Запроса на регистрацию реквизитов Счета для возврата обеспечения, или Запроса на открытие Торгово-клирингового счета, или Запроса на изменение реквизитов Счета для возврата

обеспечения, или Запроса на аннулирование регистрации реквизитов Счета для возврата обеспечения.

14.18. В случае получения от Биржи информации о прекращении допуска к торгам Участника торгов, являющегося Участником клиринга, по Идентификатору, Клиринговый центр вправе закрыть все или отдельные Расчетные коды Участника клиринга, открытые Участнику клиринга.

14.19. Закрытие Расчетного кода Участника клиринга также осуществляется на основании Запроса на закрытие Расчетного кода.

14.20. Закрытие Расчетного кода Участника клиринга осуществляется при условии отсутствия у Участника клиринга неисполненных обязательств, учитываемых по такому Расчетному коду.

14.20.1. При закрытии Расчетного кода Участника клиринга также закрываются все Расчетные коды 2-го и 3-го уровней, соответствующие такому Расчетному коду Участника клиринга.

14.21. В случае закрытия Расчетного кода Участника клиринга, Клиринговый центр в течение 3 (трех) банковских дней после получения соответствующего уведомления от Биржи или Запроса на закрытие Расчетного кода от Участника клиринга, осуществляет возврат Обеспечения Участнику клиринга в соответствующей валюте / соответствующем драгоценном металле, учитываемого по данному Расчетному коду, на Счета для возврата обеспечения, соответствующие данному Расчетному коду.

14.22. Клиринговый центр информирует Участника клиринга об открытии, закрытии или изменении параметров Расчетного кода Участника клиринга не позднее рабочего дня, следующего за днем исполнения соответствующей операции.

## Статья 15. Общий порядок открытия и закрытия Торгово-клиринговых счетов Участников клиринга

15.1. В случае если в соответствии с Правилами торгов соответствующего биржевого рынка Торгово-клиринговый счет является одним из реквизитов заявки, Участнику клиринга должен быть открыт Торгово-клиринговый счет Участника клиринга, в состав которого входит Расчетный код Участника клиринга, и/или счета, определенные соответствующей специальной частью Правил клиринга.

15.1.1. Открытие Торгово-клирингового счета Участника клиринга осуществляется в порядке, установленном соответствующей специальной частью Правил клиринга.

15.2. В случае если в соответствии с Правилами торгов соответствующего биржевого рынка Торгово-клиринговый счет является одним из реквизитов заявки, Торгово-клиринговый счет Участника клиринга может указываться в качестве Торгово-клирингового счета в заявке на заключение Сделки Участником торгов, совпадающем в одном лице с Участником клиринга.

15.3. Участнику клиринга может быть открыто неограниченное количество Торгово-клиринговых счетов Участника клиринга.

15.4. Порядок закрытия Торгово-клиринговых счетов Участника клиринга установлен соответствующими специальными частями Правил клиринга.

15.4.1. При закрытии Торгово-клирингового счета Участника клиринга также закрываются все Торгово-клиринговые счета 2-го и 3-го уровней, соответствующие такому Торгово-клиринговому счету Участника клиринга.

15.5. Клиринговый центр информирует Участника клиринга об открытии / закрытии Торгово-клирингового счета Участника клиринга не позднее рабочего дня, следующего за днем исполнения соответствующей операции.

## Статья 16. Порядок предоставления информации об Участнике торгов, не совпадающем в одном лице с Участником клиринга

16.1. Для заключения сделок на основании заявок, в которых Участник клиринга будет указан в качестве Клирингового брокера, такой Участник клиринга категории «Б» или «О» предоставляет Клиринговому центру информацию об идентификаторе и наименовании Участника торгов, который будет подавать соответствующие заявки.

Указанная информация предоставляется в форме запроса на открытие соответствующего клирингового регистра 2-го уровня.

Порядок предоставления и исполнения указанного запроса определен в статье 17 общей части Правил клиринга или в соответствующей специальной части Правил клиринга.

Подача указанного запроса считается согласием Участника клиринга на указание его в качестве Клирингового брокера в заявках Участника торгов с соответствующим клиринговым регистром 2-го уровня и/или клиринговым регистром 3-го уровня, соответствующим клиринговому регистру 2-го уровня, открытому Участником клиринга для такого Участника торгов.

Открытие клирингового регистра 2-го уровня осуществляется к Расчетному коду Участника клиринга с признаком «Расчетный код Клирингового брокера».

16.2. Для заключения сделок от имени Участника клиринга на основании заявок Участника торгов, не совпадающего в одном лице с таким Участником клиринга, Участник клиринга категории «Б» или «О» предоставляет Клиринговому центру:

16.2.1. информацию об идентификаторе и наименовании Участника торгов, который будет подавать соответствующие заявки.

Указанная информация предоставляется в форме запроса на открытие соответствующего клирингового регистра 2-го уровня**.**

Порядок предоставления и исполнения указанного запроса определен в статье 17 общей части Правил клиринга или в соответствующей специальной части Правил клиринга.

Подача указанного запроса считается согласием Участника клиринга на указание его в качестве стороны по Сделке в заявках Участника торгов с соответствующим клиринговым регистром 2-го уровня и/или клиринговым регистром 3-го уровня, соответствующим клиринговому регистру 2-го уровня, открытому Участником клиринга для такого Участника торгов.

Открытие клирингового регистра 2-го уровня осуществляется к Расчетному коду Участника клиринга с признаком «Расчетный код для заключения сделок от имени Участника клиринга».

16.3. На клиринговом регистре 2-го уровня, открытом к Расчетному коду Клирингового брокера, учитывается признак, соответствующий порядку разделения полномочий Участника клиринга и Участника торгов по получению клиринговых услуг по клиринговым регистрам 3-го уровня, открытым к такому клиринговому регистру 2-го уровня.

16.3.1. Клиринговый центр оказывает клиринговые услуги по открытию и ведению клиринговых регистров 3-го уровня Участнику торгов (данный порядок используется по умолчанию).

По умолчанию при таком порядке Участнику клиринга не доступна информация, учитываемая по клиринговым регистрам 3-го уровня.

Участник торгов вправе направить Клиринговому центру запрос о предоставлении Участнику клиринга доступа к информации об идентификационных данных клиента Участника торгов в соответствии с требованиями, предъявляемыми Биржей при регистрации клиентов Участников торгов, которые содержались в Запросе на открытие клирингового регистра 3-го уровня. В случае предоставления такого запроса Участником торгов, Участник клиринга вправе предоставить Клиринговому центру запрос о запрете заключения Участником торгов сделок с указанием клиринговых регистров 3-го уровня, которым соответствуют идентификационные данные клиента Участника торгов, указанные Участником клиринга в таком запросе. Отмена указанного запрета осуществляется на основании запроса Участника клиринга.

16.3.2. По запросу Участника торгов на клиринговом регистре 2-го уровня, открытом к Расчетному коду Клирингового брокера, может быть установлен признак, означающий, что клиринговые услуги по ведению клиринговых регистров 3-го уровня Клиринговый центр оказывает Участнику клирингу.

Участник клиринга вправе отказаться от предоставления ему Клиринговым центром указанных клиринговых услуг путем предоставления соответствующего запроса Клиринговому центру.

## Статья 17. Порядок открытия Расчетных кодов 2-го уровня и Торгово-клиринговых счетов 2-го уровня

17.1. В случае если в соответствии с Правилами торгов соответствующего биржевого рынка Торгово-клиринговый счет является одним из реквизитов заявки, для заключения сделок Участником торгов, не совпадающим в одном лице с Участником клиринга, Участник клиринга обязан открыть Торгово-клиринговый счет 2-го уровня.

17.2. В случае если это предусмотрено соответствующей специальной частью Правил клиринга, Участник клиринга, совпадающий в одном лице с Участником торгов, вправе открыть Торгово-клиринговые счета 2-го уровня.

17.3. Открытие Торгово-клирингового счета 2-го уровня осуществляется на основании Запроса на открытие Торгово-клирингового счета 2-го уровня, предоставляемого Участником клиринга Клиринговому центру.

17.4. Запрос на открытие Торгово-клирингового счета 2-го уровня должен содержать указание на Расчетный код Участника клиринга.

17.4.1. Запрос на открытие Торгово-клирингового счета 2-го уровня может содержать идентификационные данные клиента Участника клиринга в соответствии с требованиями, предъявляемыми Биржей при регистрации клиентов Участников торгов.

17.4.2. Запрос на открытие Торгово-клирингового счета 2-го уровня может содержать иную информацию, состав которой установлен формой/форматом Запроса на открытие Торгово-клирингового счета 2-го уровня и/или специальной частью Правил клиринга.

17.5. На основании полученного от Участника клиринга Запроса на открытие Торгово-клирингового счета 2-го уровня Клиринговый центр:

- открывает отдельный Расчетный код 2-го уровня, связанный с Расчетным кодом Участника клиринга, указанным в запросе;
- открывает Торгово-клиринговый счет 2-го уровня, в состав которого входит открытый Расчетный код 2-го уровня;
- устанавливает соответствие между открытым Расчетным кодом 2-го уровня и Участником торгов, информация об идентификаторе и наименовании которого указана в запросе (при открытии Торгово-клирингового счета 2-го уровня для Участника торгов);
- устанавливает соответствие между Расчетным кодом 2-го уровня и идентификационными данными клиента Участника клиринга, указанными в запросе (если указаны).

Через указанный Расчетный код 2-го уровня устанавливается соответствие между Расчетным кодом Участника клиринга и Торгово-клиринговым счетом 2-го уровня, в состав которого входит такой Расчетный код 2-го уровня.

17.5.1. Специальной частью Правил клиринга могут быть установлены особенности открытия Торгово-клиринговых счетов 2-го уровня.

17.6. Если в соответствии с Правилами торгов соответствующего биржевого рынка Торгово-клиринговый счет является одним из реквизитов заявки, Торгово-клиринговый счет 2-го уровня может указываться в качестве Торгово-клирингового счета в заявке на заключение Сделки:

а) в случае подачи заявки Участником торгов с указанием Участника клиринга в качестве Клирингового брокера, или

б) в случае подачи заявки Участником торгов, не совпадающим в одном лице с Участником клиринга, от имени такого Участника клиринга, или

в) в случае подачи заявки Участником торгов, совпадающим в одном лице с Участником клиринга.

17.7. По запросу Участника клиринга может быть открыто неограниченное количество Расчетных кодов 2-го уровня.

17.7.1. Один Расчетный код 2-го уровня соответствует одному Расчетному коду 1-го уровня.

17.7.2. Одному Расчетному коду 1-го уровня могут соответствовать несколько Расчетных кодов 2-го уровня (в т.ч. открытых для одного или нескольких Участников торгов).

17.7.3. Разные Расчетные коды 2-го уровня, открытые для одного Участника торгов, могут соответствовать Расчетным кодам 1-го уровня разных Участников клиринга (один Участник торгов может обслуживаться у разных Участников клиринга).

17.8. Закрытие Расчетного кода 2-го уровня осуществляется на основании Запроса на закрытие Расчетного кода 2-го уровня.

17.8.1. При закрытии Расчетного кода 2-го уровня также закрываются все Расчетные коды 3-го уровня, соответствующие такому Расчетному коду 2-го уровня.

17.9. Закрытие Торгово-клирингового счета 2-го уровня осуществляется на основании Запроса на закрытие Торгово-клирингового счета 2-го уровня.

17.9.1. При закрытии Торгово-клирингового счета 2-го уровня также закрываются все Торгово-клиринговые счета 3-го уровня, соответствующие такому Торгово-клиринговому счету 2-го уровня.

17.10. Клиринговый центр информирует Участника клиринга об открытии / закрытии Расчетного кода 2-го уровня и Торгово-клирингового счета 2-го уровня не позднее рабочего дня, следующего за днем исполнения соответствующей операции.

## Статья 18. Порядок открытия Расчетных кодов 3-го уровня и Торгово-клиринговых счетов 3-го уровня

18.1. В случае если это предусмотрено соответствующей специальной частью Правил клиринга, Участник торгов, не совпадающий в одном лице с Участником клиринга и заключивший с Клиринговым центром договор о ведении клиринговых регистров, предусмотренный статьей 5 общей части Правил клиринга, или Участник клиринга, совпадающий в одном лице с Участником торгов, вправе потребовать у Клирингового центра открытия Торгово-клиринговых счетов 3-го уровня.

18.2. Открытие Торгово-клирингового счета 3-го уровня осуществляется на основании Запроса на открытие Торгово-клирингового счета 3-го уровня, предоставляемого Участником торгов / Участником клиринга Клиринговому центру.

18.3. За оказание клиринговых услуг по открытию и/или ведению Торгово-клиринговых счетов 3-го уровня с Участника торгов / Участника клиринга взимается плата в соответствии с Тарифами Клирингового центра.

18.4. Запрос на открытие Торгово-клирингового счета 3-го уровня должен содержать указание на Расчетный код 2-го уровня.

18.4.1. Запрос на открытие Торгово-клирингового счета 3-го уровня может содержать идентификационные данные клиента Участника торгов / клиента Участника клиринга в соответствии с требованиями, предъявляемыми Биржей при регистрации клиентов Участников торгов.

18.4.2. Запрос на открытие Торгово-клирингового счета 3-го уровня может содержать иную информацию, состав которой установлен формой / форматом Запроса на открытие Торгово-клирингового счета 3-го уровня и/или специальной частью Правил клиринга.

18.5. На основании полученного от Участника торгов / Участника клиринга Запроса на открытие Торгово-клирингового счета 3-го уровня Клиринговый центр:

- открывает отдельный Расчетный код 3-го уровня, связанный с Расчетным кодом 2-го уровня, указанным в запросе;
- открывает Торгово-клиринговый счет 3-го уровня, в состав которого входит открытый Расчетный код 3-го уровня;
- устанавливает соответствие между Расчетным кодом 3-го уровня и идентификационными данными клиента Участника торгов / клиента Участника клиринга, указанными в запросе (если указаны).

Через указанные Расчетный код 3-го уровня и Расчетный код 2-го уровня устанавливается соответствие между Расчетным кодом Участника клиринга и Торгово-клиринговым счетом 3-го уровня, в состав которого входит такой Расчетный код 3-го уровня.

18.5.1. Запрос на открытие Торгово-клирингового счета 3-го уровня, предоставленный Участником торгов, исполняется при условии, что указанный запрос предоставлен Участником торгов, соответствующим Расчетному коду 2-го уровня, с которым должен быть связан открываемый Расчетный код 3-го уровня.

18.5.2. Специальной частью Правил клиринга могут быть установлены особенности открытия Торгово-клиринговых счетов 3-го уровня.

18.6. В случае если в соответствии с Правилами торгов соответствующего биржевого рынка Торгово-клиринговый счет является одним из реквизитов заявки, Торгово-клиринговый счет 3-го уровня может указываться в качестве Торгово-клирингового счета в заявке на заключение Сделки.

18.7. По запросу Участника торгов / Участника клиринга может быть открыто неограниченное количество Расчетных кодов 3-го уровня.

18.7.1. Один Расчетный код 3-го уровня соответствует одному Расчетному коду 2-го уровня.

18.7.2. Одному Расчетному коду 2-го уровня могут соответствовать несколько Расчетных кодов 3-го уровня.

18.8. Закрытие Расчетного кода 3-го уровня осуществляется на основании Запроса на закрытие Расчетного кода 3-го уровня.

18.9. Закрытие Торгово-клирингового счета 3-го уровня осуществляется на основании Запроса на закрытие Торгово-клирингового счета 3-го уровня.

18.10. Клиринговый центр информирует Участника торгов / Участника клиринга об открытии / закрытии Расчетного кода 3-го уровня и Торгово-клирингового счета 3-го уровня не позднее рабочего дня, следующего за днем исполнения соответствующей операции.

## Статья 19. Порядок присвоения Расчетному коду признака «Единый пул»

19.1. Расчетному коду, открытому для фондового рынка и рынка депозитов, может быть присвоен признак «Единый пул», означающий, что Обеспечение Участника клиринга, учитываемое по данному Расчетному коду Участника клиринга, может быть использовано для:

- обеспечения исполнения обязательств Участника клиринга по Сделкам с частичным обеспечением, заключенным на фондовом рынке и рынке депозитов, и/или валютном рынке и рынке драгоценных металлов, и/или срочном рынке (далее – биржевые рынки, включенные в единый пул обеспечения);
- исполнения обязательств Участника клиринга по Сделкам, заключенным на биржевых рынках, включенных в единый пул обеспечения, а также иных обязательств Участника клиринга, указанных в соответствующих частях Правил клиринга.

19.2. Присвоение Расчетному коду признака «Единый пул» осуществляется на основании Запроса на присвоение Расчетному коду признака «Единый пул», предоставленного Участником клиринга Клиринговому центру.

19.3. В случае, если Обеспечение Участника клиринга в иностранной валюте, учитываемое по Расчетному коду Участника клиринга, открытому для фондового рынка и рынка депозитов, является индивидуальным клиринговым обеспечением, Запрос на присвоение Расчетному коду признака «Единый пул» одновременно является заявлением об изменении статуса Обеспечения в иностранной валюте, учитываемого по такому Расчетному коду, на иное обеспечение. Клиринговый центр осуществляет в отношении такого Расчетного кода действия, предусмотренные подпунктами 28.9.1-28.9.2 общей части Правил клиринга.

19.4. Для использования Расчетного кода, которому присвоен признак «Единый пул» (далее – Расчетный код Единого пула), на определенном биржевом рынке Участник клиринга обязан предоставить Клиринговому центру Запрос на изменение области действия Расчетного кода Единого пула.

19.4.1. Запрос на изменение области действия Расчетного кода Единого пула должен содержать указание на Расчетный код Единого пула.

19.4.2. Запрос на изменение области действия Расчетного кода Единого пула может содержать:

- указание на валютный рынок и рынок драгоценных металлов – в случае распространения области действия Расчетного кода Единого пула на указанный биржевой рынок без использования Расчетных кодов, ранее открытых для указанного биржевого рынка, или
- указание на Расчетный код Участника клиринга, открытый для валютного

рынка и рынка драгоценных металлов, или на Расчетный код Участника клиринга, открытый для срочного рынка, - в случае распространения области действия Расчетного кода Единого пула на указанный биржевой рынок с использованием Расчетного кода, ранее открытого для указанного биржевого рынка. При этом указанный Расчетный код, открытый для соответствующего биржевого рынка, должен иметь такой же тип (собственный, клиентский или ДУ), как и указанный в запросе Расчетный код Единого пула.

19.4.3. Расчетный код Единого пула имеет область действия фондовый рынок и рынок депозитов по умолчанию.

19.5. При исполнении Запроса на изменение области действия Расчетного кода Единого пула, Расчетный код Единого пула, указанный в таком запросе, становится доступным для использования в Клиринговой системе валютного рынка и рынка драгоценных металлов / срочного рынка, начиная со следующего Расчетного дня после получения такого запроса.

19.6. Для исполнения Запроса на изменение области действия Расчетного кода Единого пула, содержащего указание на Расчетный код Участника клиринга, открытый для валютного рынка и рынка драгоценных металлов, или на Расчетный код Участника клиринга, открытый для срочного рынка, Клиринговый центр после учета всех клиринговых и иных операций текущего Расчетного дня:

19.6.1. в случае наличия открытого Расчетного кода 2-го уровня, связанного с Расчетным кодом Участника клиринга, открытым для валютного рынка и рынка драгоценных металлов, указанным в Запросе на изменение области действия Расчетного кода Единого пула, Клиринговый центр осуществляет действия, указанные в пункте 17.5 общей части Правил клиринга, направленные на открытие Расчетного кода 2-го уровня, связанного с Расчетным кодом Единого пула, указанным в Запросе на изменение области действия Расчетного кода Единого пула, и открытие Торгово-клирингового счета 2-го уровня, в состав которого входит открытый Расчетный код 2-го уровня;

19.6.2. в случае наличия открытого Расчетного кода 3-го уровня, соответствующего Расчетному коду Участника клиринга, открытому для валютного рынка и рынка драгоценных металлов и указанному в Запросе на изменение области действия Расчетного кода Единого пула, Клиринговый центр осуществляет действия, указанные в пункте 18.5 общей части Правил клиринга, направленные на открытие Расчетного кода 3-го уровня, соответствующему Расчетному коду Единого пула, указанному в Запросе на изменение области действия Расчетного кода Единого пула, и открытие Торгово-клирингового счета 3-го уровня, в состав которого входит открытый Расчетный код 3-го уровня;

19.6.3. в случае указания в Запросе на изменение области действия Расчетного кода Единого пула на Расчетный код Участника клиринга, открытый для срочного рынка, Клиринговый центр связывает Брокерские фирмы, связанные с Расчетным кодом Участника клиринга, открытым для срочного рынка, с Расчетным кодом Единого пула, указанным в Запросе на изменение области действия Расчетного кода Единого пула;

19.6.4. прекращает учитывать соответствующую информацию:

- об обязательствах / требованиях и Обеспечении по Расчетному коду

Участника клиринга, открытому для соответствующего биржевого рынка и указанному в Запросе на изменение области действия Расчетного кода Единого пула;

- об обязательствах / требованиях и Обеспечении по Расчетным кодам 2-го уровня, связанным с Расчетным кодом Участника клиринга, открытым для соответствующего биржевого рынка и указанным в Запросе на изменение области действия Расчетного кода Единого пула;
- об обязательствах / требованиях и Обеспечении по Расчетным кодам 3-го уровня, соответствующим Расчетному коду Участника клиринга, открытому для соответствующего биржевого рынка и указанному в Запросе на изменение области действия Расчетного кода Единого пула;
- об Обеспечении по разделам клиринговых регистров, имеющих код Брокерской фирмы, связанной с указанным в запросе Расчетным кодом Участника клиринга, открытым для срочного рынка (в случае указания в Запросе на изменение области действия Расчетного кода Единого пула Расчетного кода Участника клиринга, открытого для срочного рынка).

19.6.5. начинает учитывать соответствующую информацию об обязательствах / требованиях и Обеспечении, указанную в подпункте 19.6.4 общей части Правил клиринга (за исключением Обеспечения в ценных бумагах, учитываемого на Счете FORTS):

- по Расчетному коду Единого пула, указанному в Запросе на изменение области действия Расчетного кода Единого пула;
- по Расчетным кодам 2-го уровня, открытым в соответствии с подпунктом 19.6.1 общей части Правил клиринга;
- по Расчетным кодам 3-го уровня, открытым в соответствии с подпунктом 19.6.2 общей части Правил клиринга;

19.6.6. начинает учитывать в Клиринговой системе фондового рынка и рынка депозитов по Расчетному коду Единого пула, указанному в Запросе на изменение области действия Расчетного кода Единого пула, Профили активов, переданные в Клиринговую систему соответствующего биржевого рынка, в сумме / количестве, равной / равном сумме / количеству Обеспечения, указанного в подпункте 19.6.5 общей части Правил клиринга (учитываются со знаком «минус»);

19.6.7. начинает учитывать в Клиринговой системе соответствующего биржевого рынка по Расчетному коду Единого пула, указанному в Запросе на изменение области действия Расчетного кода Единого пула, Профили активов, полученные Клиринговой системой соответствующего биржевого рынка, в сумме / количестве, равной / равном сумме / количеству Обеспечения, указанного в подпункте 19.6.5 общей части Правил клиринга (учитываются со знаком «плюс»);

19.6.8. начинает учитывать в Клиринговой системе срочного рынка по разделам клиринговых регистров, указанным в подпункте 19.6.4 общей части Правил клиринга, Профили активов по денежным средствам, полученные Клиринговой системой срочного рынка, в сумме, равной сумме Обеспечения, указанного в подпункте 19.6.5 общей части Правил клиринга (учитываются со знаком «плюс»);

19.6.9. прекращает учитывать информацию о Поручениях на управление риском по Расчетному коду Участника клиринга, открытому для валютного рынка и рынка

драгоценных металлов, указанному в Запросе на изменение области действия Расчетного кода Единого пула (в случае указания в Запросе на изменение области действия Расчетного кода Единого пула Расчетного кода Участника клиринга, открытого для валютного рынка и рынка драгоценных металлов);

19.6.10. начинает учитывать информацию о Поручениях на управление риском, указанную в подпункте 19.6.9 общей части Правил клиринга, по Расчетному коду Единого пула, указанному в Запросе на изменение области действия Расчетного кода Единого пула;

19.6.11. осуществляет закрытие Расчетных кодов 3-го уровня, связанных с Расчетным кодом 2-го уровня, указанным в подпункте 19.6.12 общей части Правил клиринга;

19.6.12. осуществляет закрытие Расчетных кодов 2-го уровня, связанных с Расчетным кодом Участника клиринга, указанным в подпункте 19.6.13 общей части Правил клиринга;

19.6.13. осуществляет закрытие Расчетного кода Участника клиринга, открытого для соответствующего биржевого рынка и указанного в Запросе на изменение области действия Расчетного кода Единого пула;

19.6.14. аннулирует закрепление торговых счетов за разделами клиринговых регистров, имеющих код Брокерской фирмы, связанной с указанным в запросе Расчетным кодом Участника клиринга, открытым для срочного рынка (в случае указания в запросе Расчетного кода, открытого для срочного рынка);

19.6.15. аннулирует соответствие Торгово-клирингового счета для поставки Брокерской фирме, установленное в соответствии с Правилами клиринга на срочном рынке (в случае указания в запросе Расчетного кода, открытого для срочного рынка).

19.7. Запрос на изменение области действия Расчетного кода Единого пула, содержащий указание на Расчетный код Участника клиринга, открытый для срочного рынка, не исполняется Клиринговым центром, если выполняется следующее условие:

- на разделах регистра учета позиций, имеющих код Брокерской фирмы, связанной с указанным в таком запросе Расчетным кодом Участника клиринга, открытым для срочного рынка, учитываются поставочные Срочные контракты режима Т+ с Датой исполнения указанных контрактов в Расчетный день, следующий за днем исполнения такого запроса.

## Статья 20. Порядок присвоения Клиринговых идентификаторов

20.1. Участнику клиринга, получившему допуск к клиринговому обслуживанию / Участнику торгов, заключившему с Клиринговым центром договор о ведении клиринговых регистров, Техническим центром присваиваются Клиринговые идентификаторы на основании Заявления о Клиринговых идентификаторах, предоставленного Участником клиринга / Участником торгов в адрес Клирингового центра и Технического центра, если использование Клиринговых идентификаторов предусмотрено соответствующей специальной частью Правил клиринга.

20.2. Технический центр информирует Клиринговый центр о присвоении Участнику клиринга / Участнику торгов / об аннулировании Клирингового идентификатора в день проведения соответствующей операции.

20.3. Клиринговый центр информирует Участника клиринга / Участника торгов о присвоенном ему Клиринговом идентификаторе не позднее рабочего дня, следующего за днем получения от Технического центра уведомления о присвоении Клирингового идентификатора в соответствии с пунктом 20.2 общей части Правил клиринга, путем включения информации о Клиринговом идентификаторе в состав ежедневного Отчета о Клиринговых идентификаторах.

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

Информация о Клиринговых идентификаторах может быть включена в состав отчета, установленного специальной частью Правил клиринга. В этом случае получение такого отчета считается уведомлением о присвоении Клирингового идентификатора Участнику клиринга / Участнику торгов.

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

### Статья 21. Порядок регистрации Обособленных клиентов Участников клиринга

21.1. Для регистрации Обособленного клиента Участник клиринга должен открыть для такого клиента Участника клиринга отдельный клиентский Расчетный код 1-го уровня (отдельные клиентские Расчетные коды 1-го уровня), а также выполнить иные действия, если это предусмотрено соответствующей специальной частью Правил клиринга, и предоставить Клиринговому центру Запрос на регистрацию Обособленного клиента, в котором указать:

1) Расчетные коды 1-го уровня, открытые Участником клиринга для Обособленного клиента, а также иную информацию, если это предусмотрено соответствующей специальной частью Правил клиринга;
2) наименование / фамилию, имя и отчество Обособленного клиента;
3) идентификационные данные Обособленного клиента, аналогичные идентификационным данным, указываемым в соответствии с требованиями, предъявляемыми Биржей при регистрации клиентов Участников торгов;
4) электронные адреса для направления Обособленному клиенту уведомлений Клирингового центра.

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

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

21.1.1. В Запросе на регистрацию Обособленного клиента Участник клиринга вправе указать на необходимость защиты денежных средств Обособленного клиента.

В этом случае:

1) в качестве реквизитов Счетов для возврата обеспечения для Расчетного кода 1-го уровня, открываемого для Обособленного клиента, Участником клиринга могут быть указаны только реквизиты счета, открытого Обособленному клиенту,
2) и Участник клиринга лишается права направлять Клиринговому центру Запросы на перевод обеспечения в денежных средствах / распоряжения на перевод денежных средств с Расчетного кода 1-го уровня, открытому для Обособленного клиента, на Расчетные коды, открытые для иных лиц.

21.2. Участник клиринга не вправе использовать Расчетный код 1-го уровня, открытый для Обособленного клиента, для заключения и исполнения сделок за счет иных клиентов Участников клиринга и/или за свой счет.

21.3. Участник клиринга вправе аннулировать регистрацию Обособленного клиента или указать на отсутствие необходимости защиты денежных средств Обособленного клиента при условии отсутствия Обеспечения, учитываемого по Расчетному коду, открытому Участником клиринга для такого Обособленного клиента.

21.4. Клиринговый центр уведомляет Обособленного клиента о его регистрации, аннулировании регистрации, указании Участником клиринга на необходимость защиты денежных средств Обособленного клиента, указании Участником клиринга на отсутствие необходимости защиты денежных средств Обособленного клиента в электронном виде по электронному адресу, указанному Участником клиринга в Запросе на регистрацию Обособленного клиента.

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

## Статья 22. Перечень мер, направленных на управление рисками при осуществлении клиринга

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

- предъявляет требования к финансовой устойчивости Участников клиринга;
- предъявляет к Участникам клиринга требование о внесении Обеспечения;
- определяет Верхние и Нижние границы диапазона оценки рыночных рисков (за исключением рынка Стандартизированных ПФИ);
- определяет Верхние и Нижние границы диапазона оценки процентных рисков (за исключением рынка Стандартизированных ПФИ);
- осуществляет предварительный контроль достаточности Обеспечения Участника клиринга при подаче заявок на заключение сделок;
- не реже, чем каждый Расчетный день, осуществляет переоценку стоимости Обеспечения, а также обязательств и требований Участника клиринга по Сделкам с частичным обеспечением на нетто-основе и иных обязательств и требований Участников клиринга, возникающих в соответствии с Правилами клиринга, и контроль достаточности Обеспечения, в случае недостаточности – предъявляет Участнику клиринга Маржинальное требование;
- осуществляет контроль достаточности Обеспечения при возврате Обеспечения;
- формирует Гарантийные фонды для обеспечения исполнения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением;
- не реже, чем каждый Расчетный день, осуществляет переоценку стоимости иностранной валюты и ценных бумаг, учитываемых в качестве взносов в Гарантийные фонды, и в случае недостаточности – предъявляет Участнику клиринга Маржинальное требование по фондам;
- предъявляет к Участникам клиринга категории «Б» и «О» требование о внесении Обеспечения под стресс;
- не реже, чем каждый Расчетный день, осуществляет переоценку стоимости иностранной валюты и ценных бумаг, учитываемых в качестве Обеспечения под стресс Участника клиринга, и в случае недостаточности – предъявляет Участнику клиринга Маржинальное требование по обеспечению под стресс;
- ограничивает размер своей ответственности в соответствии со статьей 24 общей части Правил клиринга.

22.2. Клиринговый центр вправе установить признак «запрет коротких продаж» по иностранной валюте / драгоценному металлу / ценной бумаге.

22.2.1. Признак «запрет коротких продаж» по иностранной валюте / драгоценному металлу означает, что по Сделкам с такой иностранной валютой / драгоценным металлом осуществляется клиринг с полным обеспечением по такой иностранной валюте / драгоценному металлу.

22.2.2. Признак «запрет коротких продаж» по ценной бумаге означает, что по Сделкам Т+ с такой ценной бумагой осуществляется клиринг с полным обеспечением по такой ценной бумаге.

22.2.3. По Сделкам с иностранной валютой / драгоценным металлом, по которой (которому) не установлен признак «запрет коротких продаж», а также по российским рублям осуществляется клиринг с частичным обеспечением.

22.2.4. При установлении признака «запрет коротких продаж» по иностранной валюте / драгоценному металлу / ценной бумаге, по Сделкам Т+ с которой до этого осуществлялся клиринг с частичным обеспечением, Клиринговый центр вправе осуществить перевод Профилей активов в целях выполнения условия неотрицательности значений, рассчитанных в соответствии с пунктом 31.13 общей части Правил клиринга для каждой Даты исполнения по всем Расчетным кодам Единого пула / Торгово-клиринговым счетам, в состав которых входит Расчетный код Единого пула.

22.3. Перечень ценных бумаг, перечень иностранных валют / драгоценных металлов и/или перечень товаров, принимаемых в качестве обеспечения исполнения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением, устанавливается решением Клирингового центра.

22.3.1. Российские рубли принимаются в качестве обеспечения исполнения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением.

22.3.2. Для отдельных биржевых рынков Клиринговым центром может быть установлен отдельный перечень ценных бумаг, иностранных валют и/или товаров, принимаемых в качестве обеспечения исполнения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением.

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

22.3.4. Ценные бумаги, эмитентом которых является Участник клиринга или связанное с ним лицо, учитываемые по Торгово-клиринговому счету, в состав которого входит Раздел на торговом счете депо владельца такого Участника клиринга, не учитываются в качестве обеспечения исполнения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением, заключенным таким Участником клиринга за его счет.

22.3.5. Облигации Банка России не учитываются в качестве Обеспечения Участника клиринга, не являющегося Кредитной организацией.

22.4. Гарантийный фонд каждого биржевого рынка формируется Клиринговым центром за счет взносов всех Участников клиринга категорий «Б» и «О».

Минимальный размер взноса в Гарантийный фонд соответствующего биржевого рынка каждого Участника клиринга категорий «Б» и/или «О» устанавливается соответствующей специальной частью Правил клиринга.

22.5. Обеспечение под стресс на каждом биржевом рынке обязаны вносить Участники клиринга категорий «Б» и «О».

22.6. Порядок определения минимального размера Обеспечения под стресс Участника клиринга на соответствующем биржевом рынке установлен Методикой определения размера Обеспечения под стресс.

22.7. В качестве взноса в Гарантийные фонды и/или Обеспечения под стресс Участники клиринга могут вносить денежные средства в российских рублях и иностранной валюте, а также ценные бумаги.

22.7.1. Перечень иностранных валют и ценных бумаг, принимаемых Клиринговым центром в качестве взносов в Гарантийные фонды и/или Обеспечения под стресс, устанавливается решением Клирингового центра.

22.7.2. Ценная бумага исключается из Перечня ценных бумаг, принимаемых Клиринговым центром в качестве взносов в Гарантийные фонды и/или Обеспечения под стресс, одновременно при исключении такой ценной бумаги из Перечня ценных бумаг, принимаемых в качестве обеспечения исполнения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением, в порядке, установленном пунктом 22.3 общей части Правил клиринга, без решения Клирингового центра.

При погашении ценной бумаги такая ценная бумага исключается из Перечня ценных бумаг, принимаемых Клиринговым центром в качестве взносов в Гарантийные фонды и/или Обеспечения под стресс, с даты погашения без решения Клирингового центра.

22.7.3. Ценные бумаги, эмитентом которых является Участник клиринга или связанное с ним лицо, не учитываются в качестве взносов в Гарантийный фонды и Обеспечения под стресс такого Участника клиринга.

22.7.4. Облигации Банка России не учитываются в качестве взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс Участника клиринга, не являющегося Кредитной организацией.

### Статья 23. Единый лимит по Расчетному коду и риск-параметры

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

23.2. Единый лимит по Расчетному коду используется для предварительного контроля достаточности Обеспечения Участника клиринга при подаче заявок на заключение сделок, стороной по которым будет являться Участник клиринга, для проверки возможности исполнения / прекращения обязательств по Сделкам, стороной по

которым является Участник клиринга, возврата Участнику клиринга Обеспечения, а также выполнения иных операций, предусмотренных Правилами клиринга, по Расчетным кодам Единого пула, а также по Расчетным кодам, открытым для биржевых рынков, на которых контроль достаточности Обеспечения осуществляется с использованием Единого лимита по Расчетному коду. Указанная проверка осуществляется, исходя из анализа изменения значения Единого лимита по Расчетному коду до и после проведения операции.

23.2.1. Если в соответствии с Правилами клиринга в отношении значения Единого лимита по Расчетному коду установлен Ограничительный лимит, то проверка достаточности Обеспечения в указанных случаях осуществляется с учетом Ограничительного лимита. При этом, если на момент установки Ограничительного лимита значение Единого лимита по Расчетному коду меньше установленного Ограничительного лимита, то до момента превышения значения Единого лимита по Расчетному коду установленного Ограничительного лимита значение Единого лимита по Расчетному коду не может становится меньше, чем значение Единого лимита по Расчетному коду, учитываемое до установки Ограничительного лимита.

23.3. Единый лимит по Расчетному коду рассчитывается с учетом:

- Обеспечения Участника клиринга в российских рублях, Обеспечения Участника клиринга в иностранной валюте и драгоценных металлах, за исключением иностранной валюты, по Сделкам с которой осуществляется только клиринг с полным обеспечением, учитываемого по Расчетному коду. При этом учитываемый при расчете Единого лимита по Расчетному коду размер Обеспечения Участника клиринга в российских рублях и иностранной валюте уменьшается на размер обязательства с отложенным исполнением в соответствующей валюте, определенного в статье 24 общей части Правил клиринга;
- Обеспечения Участника клиринга в ценных бумагах, учитываемого по всем Торгово-клиринговым счетам Т+, в состав которых входит Расчетный код;
- Нетто-обязательств / Нетто-требований Участника клиринга по Сделкам в российских рублях / иностранной валюте / драгоценных металлах, за исключением иностранной валюты, по Сделкам с которой осуществляется только клиринг с полным обеспечением, учитываемых по Расчетному коду, по всем Датам исполнения;
- Нетто-обязательств / Нетто-требований Участника клиринга по Сделкам в ценных бумагах, учитываемых по всем Торгово-клиринговым счетам Т+, в состав которых входит Расчетный код, по всем Датам исполнения;
- совокупности действующих Поручений на управление риском, учитываемых по Расчетному коду Участника клиринга;
- Задолженности Участника клиринга перед Клиринговым центром, учитываемой по Расчетному коду;
- обязательств по передаче / требований по получению Дохода, учитываемых по Расчетному коду, и/или по Торгово-клиринговым счетам Т+, относящимся к Расчетному коду;
- обязательств по уплате комиссионных вознаграждений;
- иных обязательств / требований Участника клиринга, если это установлено

Правилами клиринга;

- обязательств / требований, которые могут возникнуть в случае заключения на основании зарегистрированных заявок Сделок, стороной по которым будет являться Участник клиринга, в том числе обязательств по уплате комиссионных вознаграждений.

23.4. При расчете Единого лимита по Расчетному коду Единого пула кроме величин, указанных в пункте 23.3 общей части Правил клиринга, также учитываются:

23.4.1. в Клиринговой системе фондового рынка и рынка депозитов:

- Профиль актива с учетом знака (российских рублей, иностранной валюты, драгоценного металла), переданный в Клиринговую систему / полученный из Клиринговой системы валютного рынка и рынка драгоценных металлов;
- Профиль актива с учетом знака (российских рублей, иностранной валюты, ценных бумаг), переданный в Клиринговую систему / полученный из Клиринговой системы срочного рынка;
- Итоговые нетто-обязательства / Итоговые нетто-требования, полученные из Клиринговой системы валютного рынка и рынка драгоценных металлов;
- Итоговые нетто-обязательства / Итоговые нетто-требования, полученные из Клиринговой системы срочного рынка;

23.4.2. в Клиринговой системе валютного рынка и рынка драгоценных металлов:

- Профиль актива с учетом знака (российских рублей, иностранной валюты, драгоценного металла), полученный из Клиринговой системы / переданный в Клиринговую систему фондового рынка и рынка депозитов.

23.5. Значение Единого лимита по Расчетному коду Единого пула, рассчитанного в Клиринговой системе фондового рынка и рынка депозитов, уменьшается на сумму абсолютного значения отрицательного Единого лимита по Расчетному коду Единого пула, рассчитанного в Клиринговой системе валютного рынка и рынка драгоценных металлов, и абсолютного значения величины $SZ_{SC}$ (свободного Обеспечения), имеющей отрицательное значение, рассчитанное в Клиринговой системе срочного рынка.

23.6. Обязательства по передаче / требования по получению Дохода, определенные Клиринговым центром в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, учитываются при расчете Единого лимита по Расчетному коду в Дату исполнения обязательств по передаче Дохода, а обязательства по передаче Дохода в форме денежных средств – дополнительно учитываются с даты заключения Сделки до даты, предшествующей Дате исполнения обязательств по передаче такого Дохода (включительно), либо до даты, установленной решением Клирингового центра.

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

23.8. Перечень, порядок расчета и изменения риск-параметров, используемых Клиринговым центром для контроля и управления рисками, определены в методиках определения риск-параметров соответствующих биржевых рынков.

23.9. Участник клиринга категории «О» или «Б» / Участник торгов, заключивший с Клиринговым центром договор о ведении клиринговых регистров, предусмотренный общей частью Правил клиринга, вправе с использованием Клиринговой системы установить индивидуальные риск-параметры, указанные в методиках определения риск-параметров на соответствующих биржевых рынках.

23.10. Участник клиринга вправе с использованием Клиринговой системы:

- снять / установить признак, указывающий на необходимость контроля Единого лимита по Расчетному коду 2-го уровня, входящему в состав Торгово-клирингового счета 2-го уровня, и минимальное допустимое значение такого Единого лимита (по умолчанию указанный признак установлен, минимальное допустимое значение Единого лимита по Расчетному коду 2-го уровня равно нулю).

23.11. Участник торгов, заключивший с Клиринговым центром договор о ведении клиринговых регистров, предусмотренный общей частью Правил клиринга, вправе с использованием Клиринговой системы:

- снять / установить признак, указывающий на необходимость контроля Единого лимита по Расчетному коду 3-го уровня, входящему в состав Торгово-клирингового счета 3-го уровня, и минимальное допустимое значение такого Единого лимита (по умолчанию указанный признак установлен, минимальное допустимое значение Единого лимита по Расчетному коду 3-го уровня равно нулю).

## Статья 24. Меры, направленные на ограничение размера ответственности центрального контрагента (уровни защиты центрального контрагента)

24.1. В целях ограничения размера ответственности Клирингового центра за неисполнение или ненадлежащее исполнение обязательств перед Участниками клиринга, включенных в клиринговый пул на соответствующем биржевом рынке, в случае наличия Недобросовестных участников клиринга Клиринговый центр использует следующие средства и меры в следующей последовательности:

24.1.1. Обеспечение Недобросовестных участников клиринга (за исключением клиринговых сертификатов участия) на таком биржевом рынке и имущество Недобросовестных участников из имущественного пула на таком биржевом рынке (в случае если рынком, на котором возникла Задолженность, является фондовый рынок).

24.1.2. Обеспечение Недобросовестных участников клиринга (за исключением клиринговых сертификатов участия) на других биржевых рынках и имущество Недобросовестных участников из имущественного пула, используемое в рамках процедуры кросс-дефолта, проводимой в соответствии со статьей 48 общей части Правил клиринга.

24.1.3. Обеспечение под стресс Недобросовестных участников клиринга на таком биржевом рынке.

24.1.4. Взносы Недобросовестных участников клиринга в Гарантийный фонд такого биржевого рынка.

24.1.5. Обеспечение под стресс Недобросовестных участников клиринга на других биржевых рынках, используемое в рамках процедуры кросс-дефолта, проводимой в соответствии со статьей 48 общей части Правил клиринга.

24.1.6. Взносы Недобросовестных участников клиринга в Гарантийные фонды других биржевых рынков, используемые в рамках процедуры кросс-дефолта, проводимой в соответствии со статьей 48 общей части Правил клиринга.

24.1.7. Выделенный капитал центрального контрагента, установленный для такого биржевого рынка.

24.1.8. Дополнительный выделенный капитал центрального контрагента для всех биржевых рынков (используется по решению Клирингового центра).

24.1.9. Взносы Добросовестных участников клиринга в Гарантийный фонд такого биржевого рынка и взнос ПАО Московская Биржа в Гарантийный фонд валютного рынка и рынка драгоценных металлов (если таким биржевым рынком является валютный рынок и рынок драгоценных металлов).

24.1.10. Взнос ПАО Московская Биржа в Гарантийный фонд такого биржевого рынка, вносимый по требованию Клирингового центра.

24.1.11. Собственные средства Клирингового центра, не превышающие разности величины собственных средств (капитала) Клирингового центра и величины капитала, необходимого для поддержания норматива достаточности капитала Клирингового центра на минимально необходимом уровне, установленном решением Клирингового центра (далее – дополнительный капитал Клирингового центра).

24.1.12. Процедура дисконтирования обязательств Клирингового центра по возврату Обеспечения, предусмотренная статьей 26 общей части Правил клиринга.

24.2. Размер взноса ПАО Московская Биржа в Гарантийный фонд валютного рынка и рынка драгоценных металлов равен произведению количества Провайдеров ликвидности на минимальный размер взноса в Гарантийный фонд валютного рынка и рынка драгоценных металлов Участников клиринга категорий «Б» или «О», установленному Правилами клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.

24.3. Размер выделенного капитала центрального контрагента для всех биржевых рынков и размер выделенного капитала центрального контрагента для каждого биржевого рынка рассчитывается Клиринговым центром в соответствии с Методикой определения выделенного капитала центрального контрагента.

24.3.1. Выделенный капитал центрального контрагента для фондового рынка и рынка депозитов составляет 2 000 000 000 (два миллиарда) российских рублей.

24.3.2. Выделенный капитал центрального контрагента для валютного рынка и рынка драгоценных металлов составляет 2 500 000 000 (два миллиарда пятьсот миллионов) российских рублей.

24.3.3. Выделенный капитал центрального контрагента для срочного рынка составляет 1 500 000 000 (один миллиард пятьсот миллионов) российских рублей.

24.3.4. Выделенный капитал центрального контрагента для товарного рынка составляет 100 000 000 (сто миллионов) российских рублей;

24.3.5. Выделенный капитал центрального контрагента для рынка Стандартизированных ПФИ составляет 400 000 000 (четыреста миллионов) российских рублей.

24.4. Размер дополнительного выделенного капитала центрального контрагента для всех биржевых рынков составляет 3 000 000 000 (три миллиарда) российских рублей.

24.4.1. Дополнительный выделенный капитал центрального контрагента для всех биржевых рынков используется по решению Клирингового центра за исключением случая, установленного подпунктом 25.1.3 общей части Правил клиринга.

24.5. Совокупный размер денежных средств, которые ПАО Московская Биржа вносит в качестве взноса в Гарантийный фонд одного или нескольких биржевых рынков по требованию Клирингового центра, не может превышать 5 000 000 000 (пять миллиардов) российских рублей.

24.6. В случае использования выделенного капитала центрального контрагента, Клиринговый центр должен принять решение по вопросу о необходимости восполнения выделенного капитала центрального контрагента.

24.7. Дополнительный капитал Клирингового центра используется по решению Клирингового центра за исключением случая, установленного подпунктом 25.1.6 общей части Правил клиринга.

## Статья 25. Ограничение размера ответственности Клирингового центра по Внебиржевым сделкам с иностранной валютой

25.1. В соответствии с пунктом 1 статьи 15 Гражданского кодекса Российской Федерации, ответственность Клирингового центра перед Участниками клиринга по Внебиржевым сделкам с иностранной валютой в форме возмещения причиненных убытков в случае неисполнения / ненадлежащего исполнения Провайдером(-ами) ликвидности обязательств перед Клиринговым центром, ограничивается в порядке, предусмотренном статьей 24 общей части Правил клиринга, при этом используются следующие уровни защиты центрального контрагента:

25.1.1. Взнос ПАО Московская Биржа в Гарантийный фонд валютного рынка и рынка драгоценных металлов в размере, равном произведению минимального размера взноса в Гарантийный фонд валютного рынка и рынка драгоценных металлов Участников клиринга категорий «Б» и «О», установленному Правилами клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, и количества Провайдеров ликвидности, не исполнивших обязательства перед Клиринговым центром.

25.1.2. Выделенный капитал центрального контрагента для валютного рынка и рынка драгоценных металлов, установленный в соответствии с подпунктом 24.3.2 общей части Правил клиринга.

25.1.3. Дополнительный выделенный капитал центрального контрагента для всех биржевых рынков, установленный в соответствии с пунктом 24.4 общей части Правил клиринга.

25.1.4. Взносы Добросовестных участников клиринга в Гарантийный фонд валютного рынка и рынка драгоценных металлов и взнос ПАО Московская Биржа в Гарантийный фонд валютного рынка и рынка драгоценных металлов.

25.1.5. Взнос ПАО Московская Биржа в Гарантийный фонд валютного рынка и рынка драгоценных металлов, вносимый по требованию Клирингового центра и не превышающей размера, установленного пунктом 24.5 общей части Правил клиринга.

25.1.6. Дополнительный капитал Клирингового центра.

25.1.7. Процедура дисконтирования обязательств Клирингового центра по возврату Обеспечения, предусмотренная статьей 26 общей части Правил клиринга с учетом особенностей, установленных настоящей статьей общей части Правил клиринга.

25.2. Статья 26 общей части Правил клиринга применяется в случае неисполнения Провайдером(-ами) ликвидности обязательств перед Клиринговым центром, при этом под Задолженностью Участника клиринга понимается неисполненное(-ые) обязательство(-а) Провайдера(-ов) ликвидности в соответствующей валюте, под размером взноса Участника клиринга в Гарантийный фонд биржевого рынка – размер взноса ПАО Московская Биржа в Гарантийный фонд валютного рынка и рынка драгоценных металлов в размере, равном произведению минимального размера взноса в Гарантийный фонд валютного рынка и рынка драгоценных металлов Участников клиринга категорий «Б» или «О», установленному Правилами клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, и количества Провайдеров ликвидности, не исполнивших обязательства перед Клиринговым центром.

25.3. Общая сумма обязательств с отложенным исполнением по валютному рынку и рынку драгоценных металлов, определенная в соответствии с подпунктом 26.2.2 общей части Правил клиринга в связи с неисполнением Провайдером ликвидности обязательств перед Клиринговым центром, распределяется:

25.3.1. в первую очередь, между Участниками клиринга, заключавшими Внебиржевые сделки с иностранной валютой и имеющими по состоянию на Расчетный день, в который были определены обязательства с отложенным исполнением, Нетто-требование с наступившей Датой исполнения / Итоговое нетто-требование к Клиринговому центру по денежным средствам в соответствующей валюте на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, пропорционально размеру такого Нетто-требования / Итогового нетто-требования;

25.3.2. во вторую очередь, между Участниками клиринга, заключавшими Внебиржевые сделки с иностранной валютой и имеющими требования к Клиринговому центру по возврату Обеспечения в денежных средствах, учитываемое по Расчетному коду Участника клиринга, открытому для валютного рынка и рынка драгоценных металлов, или по Расчетному коду Единого пула, пропорционально размеру указанных требований;

25.3.3. в третью очередь, между всеми Участниками клиринга, допущенными к клиринговому обслуживанию на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, в соответствии с пунктом 26.4 общей части Правил клиринга.

25.4. В соответствии с пунктом 2 статьи 393 и статьей 15 Гражданского кодекса Российской Федерации, Клиринговый центр не несет ответственности перед Участниками клиринга по Внебиржевым сделкам с иностранной валютой в форме уплаты процентов на сумму денежных средств при просрочке их уплаты в случае неисполнения / ненадлежащего исполнения Провайдером ликвидности обязательств перед Клиринговым центром.

25.5. Положения, содержащиеся в пунктах 25.1-25.3 общей части Правил клиринга, являются соглашением между Участниками клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов и Клиринговым центром об ограничении ответственности Клирингового центра перед Участниками клиринга по Внебиржевым сделкам с иностранной валютой в случае неисполнения / ненадлежащего исполнения Провайдером ликвидности обязательств перед Клиринговым центром в силу пункта 1 статьи 15 и пункта 2 статьи 393 Гражданского кодекса Российской Федерации.

## Статья 26. Дисконтирование обязательств Клирингового центра по возврату Обеспечения

26.1. В целях ограничения размера ответственности Клирингового центра за неисполнение или ненадлежащее исполнение обязательств перед Участниками клиринга, включенных в клиринговый пул на соответствующем биржевом рынке, в случае наличия Недобросовестных участников клиринга, не исполнивших обязательства перед Клиринговым центром, и/или в случае проведения ликвидационного неттинга в отношении Участников клиринга / клиентов Участника клиринга в соответствии со статьями 57, 58 общей части Правил клиринга, Клиринговый центр применяет установленную настоящей статьей Правил клиринга процедуру дисконтирования обязательств Клирингового центра по возврату Обеспечения в денежных средствах Участникам клиринга / Доверенным владельцам счетов.

26.2. По итогам каждой клиринговой сессии mark-to-market на каждом биржевом рынке Клиринговый центр производит расчет сумм денежных средств, на которые могут быть погашены обязательства Клирингового центра по возврату Обеспечения в денежных средствах Участникам клиринга / Доверенным владельцам счетов (далее – обязательства с отложенным исполнением). Обязательства с отложенным исполнением могут быть погашены Клиринговым центром по истечении четвертого Расчетного дня с даты их определения в соответствии с условиями настоящей статьи общей части Правил клиринга.

26.2.1. Обязательства с отложенным исполнением на биржевом рынке возникают в случае, если сумма по всем Участникам клиринга на таком биржевом рынке Задолженности Участника клиринга, не обеспеченной Обеспечением, Обеспечением под стресс и взносом в Гарантийный фонд такого Участника клиринга (далее – необеспеченная Задолженность Участника клиринга) и абсолютных значений нетто-обязательств Участников клиринга, определенных по

итогам проведения ликвидационного неттинга в отношении Участника клиринга (клиента Участника клиринга), превысит величину доступных средств, порядок определения которой установлен пунктом 26.3 общей части Правил клиринга.

26.2.2. Обязательства с отложенным исполнением на биржевом рынке возникают при выполнении условия:

NCD + LN > DW, где

NCD – сумма необеспеченных Задолженностей Участников клиринга по биржевому рынку,

LN - сумма нетто-обязательств Участников клиринга, определенных по итогам проведения ликвидационного неттинга в отношении Участника клиринга (клиента Участника клиринга),

DW - величина доступных средств на биржевом рынке, порядок определения которой установлен пунктом 26.3 общей части Правил клиринга.

Общая сумма обязательств с отложенным исполнением по биржевому рынку рассчитывается по формуле:

$OwPF = |NCD + LN - DW|$, где

OwPF - общая сумма обязательств с отложенным исполнением по биржевому рынку.

26.2.3. Сумма необеспеченных Задолженностей Участников клиринга по биржевому рынку рассчитывается в следующем порядке:

$NCD = \sum_{cm} |D_{cm}|$, где

NCD – сумма необеспеченных Задолженностей Участников клиринга по биржевому рынку,

$D_{cm}$ - необеспеченная Задолженность Участника клиринга;

$\sum_{cm}$ - сумма по всем Участникам клиринга на биржевом рынке;

$D_{cm} = \min((\sum_{sa} \max(\min(D_{sa};0);\min(Sl_{sa};0)) + CfS_{cm} + DF_{cm});0)$, где

$D_{sa}$ – Задолженность, учитываемая по Расчетному коду Участника клиринга (учитывается со знаком «минус»). Задолженность в иностранной валюте пересчитывается в российские рубли по последнему установленному Клиринговым центром Центральному курсу иностранной валюты,

$\sum_{sa}$ – сумма по всем Расчетным кодам Участника клиринга на биржевом рынке,

$Sl_{sa}$ – Единый лимит по Расчетному коду Участника клиринга (для фондового рынка и рынка депозитов, для валютного рынка и рынка драгоценных металлов, для товарного рынка / величина $SZ_{sc}$ (для срочного рынка) / Уровень обеспеченности (для рынка Стандартизированных ПФИ),

$CfS_{cm}$ – оценка размера Обеспечения под стресс Участника клиринга на биржевом рынке,

$DF_{cm}$ – оценка размера взноса Участника клиринга в Гарантийный фонд биржевого рынка;

$CfS_{cm} = msCfS_m \times (1 + \min((Sl_{CfS} / \sum_{m} msCfS_m);0))$,

$DF_{cm} = msDF_m \times (1 + \min((Sl_{DF} / \sum_{m} msDF_m);0))$, где

$msCfS_m$, $msDF_m$ – минимальный размер Обеспечения под стресс / взноса в Гарантийный фонд соответствующего биржевого рынка;
$Sl_{CfS}$, $Sl_{DF}$ - Единый лимит Участника клиринга по Обеспечению под стресс / Единый лимит Участника клиринга по Гарантийным фондам (с учетом знака);
$\sum_m$ – сумма минимальных размеров Обеспечения под стресс / взносов в Гарантийные фонды по всем биржевым рынкам для данного Участника клиринга.

26.3. Величина доступных средств для биржевого рынка определяется как сумма средств, указанных в подпунктах 24.1.7-24.1.11 общей части Правил клиринга.

26.4. Общая сумма обязательств с отложенным исполнением по биржевому рынку, определенная в соответствии с подпунктом 26.2.2 общей части Правил клиринга, распределяется между Расчетными кодами Участников клиринга, имеющих по состоянию на Расчетный день, в который были определены обязательства с отложенным исполнением, Нетто-требование с наступившей Датой исполнения / Итоговое нетто-требование к Клиринговому центру по денежным средствам в соответствующей валюте, пропорционально размеру такого Нетто-требования / Итогового нетто-требования в соответствии с подпунктом 26.5.3 общей части Правил клиринга.

26.4.1. Если распределить общую сумму обязательств с отложенным исполнением по биржевому рынку среди Участников клиринга, имеющих Нетто-требование с наступившей Датой исполнения / Итоговое нетто-требование к Клиринговому центру в денежных средствах на таком биржевом рынке, невозможно, оставшаяся нераспределенная сумма обязательств с отложенным исполнением распределяется среди Участников клиринга, имеющих требования к Клиринговому центру по возврату Обеспечения в денежных средствах, пропорционально размеру указанных требований в соответствии с подпунктом 26.5.4 общей части Правил клиринга.

26.4.2. Информация о размере обязательства с отложенным исполнением раскрывается в Клиринговой системе соответствующего биржевого рынка по каждому Расчетному коду Участника клиринга.

26.5. Клиринговый центр осуществляет расчет размера обязательств с отложенным исполнением и проверяет возможность их прекращения не реже, чем каждый Расчетный день.

26.5.1. Если сумма всех необеспеченных Задолженностей Участников клиринга на биржевом рынке, рассчитанная в соответствии с пунктом 26.2 общей части Правил клиринга, и абсолютных значений нетто-обязательств Участников клиринга, определенных по итогам проведения ликвидационного неттинга в отношении Участника клиринга (клиента Участника клиринга), не превышает величину доступных средств, порядок определения которой установлен пунктом 26.3 общей части Правил клиринга, значения всех обязательств с отложенным исполнением устанавливаются равными нулю.

26.5.2. Если общая сумма обязательств с отложенным исполнением по биржевому рынку, определенная в соответствии с подпунктом 26.2.2 общей части Правил клиринга, меньше, чем указанная сумма, определенная при предыдущем расчете обязательств с отложенным исполнением, размер обязательств с отложенным исполнением,

учитываемых по Расчетным кодам Участников клиринга, уменьшается следующим образом:

$$OwPF_{sa} = round(OwPF_{sa}_old \times (1 - min((\Delta OwPF / \sum_{sa} OwPF_{sa}_old); 1)); 2),$$

где
$OwPF_{sa}$ – новое значение размера обязательства с отложенным исполнением, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга,
$OwPF_{sa}_old$ – предыдущее значение размера обязательства с отложенным исполнением, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга,
$\Delta OwPF$ – сумма, на которую уменьшилась общая сумма обязательств с отложенным исполнением по биржевому рынку,
$\sum_{sa}$ - сумма по всем Расчетным кодам Участников клиринга, по которым учитываются обязательства с отложенным исполнением.

26.5.3. Если общая сумма обязательств с отложенным исполнением по биржевому рынку, определенная в соответствии с подпунктом 26.2.2 общей части Правил клиринга, больше, чем указанная сумма, определенная при предыдущем расчете обязательств с отложенным исполнением, размер обязательств с отложенным исполнением, учитываемых по Расчетным кодам Участников клиринга, по которым учитывается Нетто-требование с наступившей Датой исполнения / Итоговое нетто-требование к Клиринговому центру в денежных средствах на таком биржевом рынке, увеличивается следующим образом:

$$OwPF_{sa} = OwPF_{sa}_old + min((\Delta OwPF / \sum_{sa} TO_{sa}); 1) \times TO_{sa},$$

где
$OwPF_{sa}$ – новое значение размера обязательства с отложенным исполнением, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга,
$OwPF_{sa}_old$ – предыдущее значение размера обязательства с отложенным исполнением, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга,
$\Delta OwPF$ – сумма, на которую увеличилась общая сумма обязательств с отложенным исполнением по биржевому рынку,
$TO_{sa}$ – Нетто-требование с наступившей Датой исполнения / Итоговое нетто-требование к Клиринговому центру в денежных средствах, учитываемое по Расчетному коду Участника клиринга, уменьшенное на размер Задолженность по такому Расчетному коду и требований, учтенных при предыдущем (в течение данного Расчетного дня) расчете обязательств с отложенным исполнением;
$\sum_{sa}$ - сумма по всем Расчетным кодам Участников клиринга, по которым учитываются Нетто-требования с наступившей Датой исполнения / Итоговые нетто-требования к Клиринговому центру в денежных средствах.

26.5.4. Если распределить общую сумму обязательств с отложенным исполнением по биржевому рынку среди Участников клиринга, имеющих Нетто-требование с наступившей Датой исполнения / Итоговое нетто-требование к Клиринговому центру в денежных средствах на таком биржевом рынке, невозможно, размер обязательств с отложенным исполнением, учитываемых по Расчетным кодам

Участников клиринга, по которым учитывается Обеспечение в денежных средствах на таком биржевом рынке, рассчитывается следующим образом:

$$OwPF_{sa} = OwPF_{sa}_old + \min((\Delta OwPF / \sum_{sa} Col_{sa}); 1) \times Col_{sa},$$

где

$OwPF_{sa}$ – новое значение размера обязательства с отложенным исполнением, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга,

$OwPF_{sa}_old$ – предыдущее значение размера обязательства с отложенным исполнением,

$\Delta OwPF$ – общая сумма обязательств с отложенным исполнением по биржевому рынку, не распределенная в соответствии с подпунктом 26.5.3 общей части Правил клиринга;

$Col_{sa}$ – требование к Клиринговому центру по возврату Обеспечения в денежных средствах на биржевом рынке без учета Нетто-требований с наступившей Датой исполнения / Итоговых нетто-требований каждого Участника клиринга, учтенных при расчете обязательств с отложенным исполнением в соответствии с подпунктом 26.5.3 общей части Правил клиринга. Для Расчетных кодов Единого пула требование к Клиринговому центру по возврату Обеспечения в денежных средствах на биржевом рынке определяется пропорционально сумме Нетто-обязательств по всем Датам исполнения, учитываемых по Расчетному коду на таком биржевом рынке. Нетто-обязательства по ценным бумагам, товарам, драгоценным металлам пересчитываются в российские рубли по Расчетной цене / Центральному курсу;

$\sum_{sa}$ - сумма по всем Расчетным кодам Участников клиринга, по которым учитываются требования к Клиринговому центру по возврату Обеспечения в денежных средствах.

26.5.5. Для целей определения размера обязательств с отложенным исполнением Нетто-требования / Итоговые нетто-требования по денежным средствам в иностранной валюте, требования по возврату Обеспечения в иностранной валюте пересчитываются в российские рубли по последнему установленному Клиринговым центром Центральному курсу иностранной валюты.

26.6. Обязательства с отложенным исполнением в размере, определенном по состоянию на четвертый Расчетный день с даты его первоначального расчета, по истечении такого четвертого Расчетного дня считаются погашенными. При этом общий размер обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга Обеспечения в соответствующей валюте уменьшится на сумму такого погашенного обязательства с отложенным исполнением.

26.7. В случае погашения Недобросовестными участниками клиринга Задолженностей или получения денежных средств в счет исполнения нетто-обязательств Участников клиринга, определенных по итогам проведения ликвидационного неттинга в отношении Участников клиринга (клиентов Участника клиринга), после погашения обязательств с отложенным исполнением в соответствии с пунктом 26.6 общей части Правил клиринга, Клиринговый центр распределяет полученные средства в полном объеме пропорционально (при недостаточности полученных

средств) среди Участников клиринга, в отношении которых обязательства с отложенным исполнением были погашены в соответствии с пунктом 26.6 общей части Правил клиринга. Указанное распределение осуществляется путем увеличения размера обязательств Клирингового центра по возврату Обеспечения Участникам клиринга.

## Статья 27. Порядок заключения закрывающих и/или балансирующих сделок

27.1. В случае необходимости заключения Клиринговым центром сделок с иностранной валютой / драгоценными металлами / ценными бумагами / Срочных контрактов / Договоров СПФИ / Договоров, базисным активом которых является товар, с Недобросовестным участником клиринга, имеющим неисполненное Маржинальное требование, и в иных предусмотренных Правилами клиринга случаях необходимости заключения Клиринговым центром сделок с иностранной валютой / драгоценными металлами / ценными бумагами / Срочных контрактов / Договоров СПФИ / Договоров, базисным активом которых является товар, с Недобросовестным участником клиринга, Клиринговый центр в порядке, определенном настоящей статьей общей части Правил клиринга, заключает одновременно две соответствующие Сделки с центральным контрагентом:

1) закрывающую сделку: от имени такого Недобросовестного участника клиринга в отношении себя лично;
2) балансирующую сделку: с Участником клиринга, указанным в качестве стороны по сделке в заявке, являющейся допустимой встречной по отношению к заявке, поданной Клиринговым центром от имени Недобросовестного участника клиринга, или с Участником клиринга, определенным в соответствии с пунктом 27.4 общей части Правил клиринга.

В случае проведения ликвидационного неттинга в отношении Участника клиринга / клиента Участника клиринга в соответствии со статьями 57, 58 общей части Правил клиринга или в случае неисполнения Провайдером(-ами) ликвидности обязательств перед Клиринговым центром, Клиринговый центр с целью минимизации рисков Клирингового центра по обязательствам и требованиям по Сделкам с центральным контрагентом в порядке, определенном настоящей статьей общей части Правил клиринга, заключает от своего имени балансирующие сделки: Сделки с иностранной валютой / драгоценными металлами / ценными бумагами / товарами / Срочные контракты / Договоры СПФИ, с Участниками клиринга, указанными в качестве стороны по сделке в заявках, являющихся допустимыми встречными по отношению к заявке, поданной Клиринговым центром от своего имени, или с Участниками клиринга, определенными в соответствии с пунктом 27.4 общей части Правил клиринга.

27.2. Закрывающие и/или балансирующие сделки заключаются на соответствующих биржевых рынках на основании пункта 3.20 общей части Правил клиринга на основании хотя бы одной безадресной заявки, в случае невозможности заключения балансирующих сделок на основании хотя бы одной безадресной заявки – на основании адресных заявок, условия закрывающих и/или балансирующих сделок соответствуют условиям сделок, определенным Правилами торгов на соответствующем биржевом рынке.

В случае невозможности заключения закрывающих и/или балансирующих сделок на соответствующих биржевых рынках, в том числе в соответствии с действующим законодательством, закрывающие и/или балансирующие сделки заключаются на внебиржевых рынках. Закрывающие и/или балансирующие сделки на внебиржевых рынках заключаются на условиях, аналогичных условиям сделок с иностранной валютой / драгоценными металлами / ценными бумагами / товарами / Срочных контрактов / Договоров СПФИ, заключаемых на соответствующих биржевых рынках.

27.3. Закрывающие и/или балансирующие сделки заключаются по текущим рыночным ценам.

27.4. Если заключение закрывающих и/или балансирующих сделок на соответствующих биржевых и внебиржевых рынках в соответствии с пунктом 27.3 общей части Правил клиринга невозможно, балансирующие сделки заключаются без подачи заявок между Клиринговым центром и Добросовестными участниками клиринга, имеющими Нетто-обязательства / Нетто-требования / позиции, учитываемые по соответствующим Расчетным кодам, противоположные Нетто-обязательствам / Нетто-требованиям / позициям Участников клиринга, в отношении обязательств которых проводится урегулирование, в объеме, пропорциональном объему Нетто-обязательств / Нетто-требований / открытых позиций Добросовестных участников клиринга, учитываемых по соответствующим Расчетным кодам, по справедливым рыночным ценам, порядок определения которых установлен методикой определения риск-параметров соответствующего биржевого рынка, закрывающие сделки – без подачи заявок между Клиринговым центром и Недобросовестными участниками клиринга по ценам, соответствующим ценам балансирующих сделок.

Настоящий пункт общей части Правил клиринга не применяется в случае заключения сделок по продаже Обеспечения / Обеспечения под стресс / взносов в Гарантийные фонды Участника клиринга в иностранной валюте / драгоценных металлах / ценных бумагах / товарах в соответствии с пунктами 57.11.5, 58.5.5 общей части Правил клиринга при проведении ликвидационного неттинга в отношении Участника клиринга / клиента Участника клилринга, а также в иных случаях, установленных Правилами клиринга.

27.4.1. Участник клиринга вправе заранее предоставить Клиринговому центру информацию о Расчетном коде Участника клиринга, по которому должны учитываться и исполняться обязательства по балансирующим сделкам, заключенным в соответствии с настоящим пунктом общей части Правил клиринга.

27.4.2. В случае необходимости заключения балансирующих сделок в соответствии с настоящим пунктом общей части Правил клиринга, Клиринговый центр с использованием Клиринговой системы предоставляет Участнику клиринга информацию об обязательствах по балансирующим сделкам, которые возникнут у Участника клиринга.

Указанные обязательства Участника клиринга по балансирующим сделкам будут учтены по Расчетному коду, информация о котором предоставлена Участником клиринга Клиринговому центру в соответствии с подпунктом 27.4.1 общей части Правил клиринга, при условии обеспечения Участником клиринга встречных обязательств, учитываемых по такому Расчетному коду, до 18:45 по московскому времени дня, в который возникла необходимость заключения указанных

балансирующих сделок, а в случае необеспечения Участником клиринга встречных обязательств, учитываемых по такому Расчетному коду, до указанного времени, - по Расчетным кодам, по которым учитывались Нетто-обязательства / Нетто-требования / позиции Добросовестного участника клиринга, пропорционально объему которых были заключены указанные балансирующие сделки.

27.4.3. Участник клиринга обязан исполнить обязательства по балансирующим сделкам, заключенным в соответствии с настоящим пунктом общей части Правил клиринга, по Расчетным кодам Участника клиринга, порядок определения которых установлен подпунктом 27.4.2 общей части Правил клиринга.

27.4.4. Временем заключения балансирующих сделок в соответствии с настоящим пунктом общей части Правил клиринга считается 18:45 по московскому времени дня, в который возникла необходимость заключения указанных балансирующих сделок.

27.5. Специальной частью Правил клиринга может быть установлен особый порядок заключения закрывающих и/или балансирующих сделок, отличный от порядка, определенного пунктом 27.4 общей части Правил клиринга.

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

27.7. Клиринговый центр допускает к клирингу обязательства по закрывающим и балансирующим сделкам, заключенным в соответствии с настоящей статьей общей части Правил клиринга.

# РАЗДЕЛ IV. ПОРЯДОК ПРОВЕДЕНИЯ КЛИРИНГА

## ПОДРАЗДЕЛ IV-I. ПОРЯДОК ВНЕСЕНИЯ И ВОЗВРАТА ОБЕСПЕЧЕНИЯ

### Статья 28. Порядок внесения Обеспечения

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

1) путем перечисления денежных средств на соответствующий клиринговый банковский или корреспондентский счет Клирингового центра по реквизитам, размещенным на Сайте Клирингового центра;

2) путем исполнения распоряжения на перевод денежных средств, поданного Участником клиринга с использованием Клиринговой системы (при наличии такой возможности);

3) путем исполнения Запроса на перевод обеспечения.

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

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

28.3. Денежные средства в соответствующей валюте, предоставляемые в качестве Обеспечения в российских рублях и/или Обеспечения в иностранной валюте, перечисляются на соответствующий клиринговый банковский или корреспондентский счет Клирингового центра с обязательным указанием в назначении платежа Расчетного кода Участника клиринга либо Расчетного кода 2-го или 3-го уровня.

Специальной частью Правил клиринга может быть предусмотрен иной порядок заполнения назначения платежа и учета денежных средств при внесении Обеспечения в российских рублях и иностранной валюте.

28.4. До открытия Участником клиринга торгового банковского счета в драгоценном металле внесение Обеспечения в драгоценных металлах осуществляется путем перечисления драгоценных металлов на Счет обеспечения в соответствующем драгоценном металле с обязательным указанием в назначении платежа Расчетного кода Участника клиринга либо Расчетного кода 2-го или 3-го уровня.

28.4.1. После открытия Участником клиринга торгового банковского счета в драгоценном металле внесение Обеспечения в драгоценных металлах осуществляется путем перечисления драгоценных металлов на торговый банковский счет в соответствующем драгоценном металле с обязательным указанием в назначении платежа Расчетного кода Участника клиринга либо Расчетного кода 2-го или 3-го уровня.

28.5. Внесение Обеспечения в ценных бумагах возможно следующими способами:

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

Специальной частью Правил клиринга может быть предусмотрен иной порядок внесения Обеспечения в ценных бумагах.

28.6. Клиринговый центр учитывает в Клиринговой системе денежные средства / драгоценные металлы, перечисленные на соответствующий клиринговый банковский счет или корреспондентский счет Клирингового центра / Счет обеспечения / торговый банковский счет в соответствующем драгоценном металле, в качестве Обеспечения Участника клиринга по Расчетному коду Участника клиринга, указанному в назначении платежа, и увеличивает Единый лимит по такому Расчетному коду с учетом перечисленной суммы денежных средств / перечисленного количества драгоценного металла.

Денежные средства / драгоценные металлы, перечисленные с указанием в назначении платежа Расчетного кода 2-го уровня, учитываются Клиринговым центром в качестве Обеспечения по Расчетному коду Участника клиринга, соответствующему Расчетному коду 2-го уровня, указанного в назначении платежа, информация о таком Обеспечении также учитывается по Расчетному коду 2-го уровня, указанному в назначении платежа.

Денежные средства / драгоценные металлы, перечисленные с указанием в назначении платежа Расчетного кода 3-го уровня, учитываются Клиринговым центром в качестве Обеспечения по Расчетному коду Участника клиринга, соответствующему Расчетному коду 3-го уровня, указанного в назначении платежа, информация о таком Обеспечении также учитывается по Расчетному коду 2-го уровня, соответствующему Расчетному коду 3-го уровня, указанному в назначении платежа, и по Расчетному коду 3-го уровня, указанному в назначении платежа.

28.6.1. Если Расчетный код 1-го, 2-го или 3-го уровня, указанный в назначении платежа, не найден среди зарегистрированных Клиринговым центром Расчетных кодов, Клиринговый центр вправе запросить у Участника клиринга уточнение назначения платежа. В случае получения от Участника клиринга или от банка плательщика уточнения назначения платежа, учет денежных средств / драгоценных металлов в качестве Обеспечения Участника клиринга в соответствии с пунктом 28.6 общей части Правил клиринга, осуществляется Клиринговым центром после получения от Участника клиринга / банка плательщика такого уточнения назначения платежа с правильно указанным Расчетным кодом соответствующего уровня.

28.6.2. Если в течение 5 (пяти) Расчетных дней по соответствующей валюте с даты, следующей за датой зачисления денежных средств в российских рублях / иностранной валюте на соответствующий клиринговый банковский / корреспондентский счет Клирингового центра с неуказанным / неправильно указанным Расчетным кодом соответствующего уровня в назначении платежа,

Участник клиринга / банк плательщика не предоставит Клиринговому центру уточнение назначения платежа с правильно указанным Расчетным кодом соответствующего уровня, Клиринговый центр возвращает указанные денежные средства по реквизитам плательщика.

28.6.3. Денежные средства, зачисленные на соответствующий клиринговый банковский или корреспондентский счет Клирингового центра позднее времени, установленного Временным регламентом, учитываются Клиринговым центром в следующем Расчетном дне.

28.7. Денежные средства / драгоценные металлы, перечисленные с указанием в назначении платежа Расчетного кода Единого пула, учитываются в качестве Обеспечения Участника клиринга по Расчетному коду Участника клиринга, указанному в назначении платежа, в Клиринговой системе фондового рынка и рынка депозитов.

28.7.1. При перечислении денежных средств / драгоценных металлов на соответствующий клиринговый банковский или корреспондентский счет Клирингового центра / на Счет обеспечения / торговый банковский счет в соответствующем драгоценном металле, с указанием в назначении платежа Расчетного кода Единого пула, Участник клиринга вправе в назначении платежа указать кодовое слово / код раздела клиринговых регистров, означающее, что в Клиринговую систему валютного рынка и рынка драгоценных металлов / в Клиринговую систему срочного рынка, необходимо передать Профиль актива в размере перечисляемой суммы денежных средств / количества драгоценного металла.

Информация о кодовых словах, указываемых в назначении платежа, раскрывается на Сайте Клирингового центра.

Перечень активов, передача Профилей которых возможна между Клиринговой системой фондового рынка и рынка депозитов и Клиринговой системой валютного рынка и рынка драгоценных металлов / Клиринговой системой срочного рынка, устанавливается соответствующей специальной частью Правил клиринга.

28.7.2. В случае указания в назначении платежа кодового слова / кода раздела клиринговых регистров в соответствии с подпунктом 28.7.1 общей части Правил клиринга, Клиринговый центр также:

- учитывает в Клиринговой системе фондового рынка и рынка депозитов изменение Профиля актива, переданного в Клиринговую систему соответствующего биржевого рынка, в размере перечисляемой суммы денежных средств / количества драгоценного металла (со знаком «минус»);
- учитывает в Клиринговой системе валютного рынка и рынка драгоценных металлов / Клиринговой системе срочного рынка, изменение Профиля актива, полученного из Клиринговой системы фондового рынка и рынка депозитов, в размере перечисляемой суммы денежных средств / количества драгоценного металла (со знаком «плюс»).

28.8. Денежные средства и драгоценные металлы, учитываемые в качестве Обеспечения Участника клиринга, используются для обеспечения исполнения и исполнения обязательств по Сделкам, учитываемых по Расчетному коду, по которому указанное Обеспечение учитывается. Денежные средства, учитываемые в качестве Обеспечения Участника клиринга, также используются для исполнения

обязательств по уплате комиссионных вознаграждений, учитываемых по такому Расчетному коду.

28.9. Участник клиринга вправе предоставить Клиринговому центру Заявление об изменении статуса Обеспечения на соответствующем биржевом рынке.

28.9.1. Для исполнения указанного заявления Клиринговый центр после учета всех клиринговых и иных операций текущего Расчетного дня:

- для каждого Расчетного кода Участника клиринга открывает Счета обеспечения в иностранных валютах на балансовом счете № 47405;
- переводит Обеспечение в иностранной валюте, учитываемое по каждому Расчетному коду, со Счета обеспечения, соответствующего такому Расчетному коду и открытого на балансовом счете № 30420 (30421), на Счет обеспечения, соответствующий такому Расчетному коду и открытый на балансовом счете № 47405;
- закрывает Счета обеспечения в иностранных валютах, открытые на балансовом счете № 30420 (30421);
- уведомляет Участника клиринга о выполненных переводах Обеспечения в иностранных валютах по Счетам обеспечения в Отчетах о движении денежных средств, предоставляемых по итогам Расчетного дня исполнения Заявления об изменении статуса Обеспечения на фондовом рынке и рынке депозитов.

28.9.2. Начиная с Расчетного дня по соответствующей валюте, следующего за днем исполнения указанного заявления, Участник клиринга обязан вносить Обеспечение в иностранной валюте в соответствии с подпунктом 28.2.1 общей части Правил клиринга.

28.10. Распоряжение на перевод денежных средств / драгоценных металлов / ценных бумаг, подаваемое Участником клиринга с использованием Клиринговой системы (при наличии такой возможности), содержит указание на Торгово-клиринговые счета, по которым должна быть исполнена данная операция, код валюты / драгоценных металлов / ценных бумаг, сумму денежных средств / количество драгоценных металлов / ценных бумаг, которые необходимо перевести. Распоряжение на перевод ценных бумаг, подаваемое Участником клиринга с использованием Клиринговой системы (при наличии такой возможности), также содержит указание на один из двух способов перевода ценных бумаг в Расчетном депозитарии: немедленный перевод ценных бумаг либо перевод ценных бумаг в ближайшую расчетную клиринговую сессию.

28.10.1. Распоряжение на перевод денежных средств / драгоценных металлов исполняется за счет денежных средств / драгоценных металлов, учитываемых по Расчетному коду / Счету обеспечения Т0, входящему в состав Торгово-клирингового счета / по Торгово-клиринговому счету, указанному в распоряжении в качестве Торгово-клирингового счета, по которому осуществляется уменьшение суммы денежных средств / количества драгоценных металлов, при выполнении условий для возврата денежных средств / драгоценных металлов, установленных пунктом 31.11 общей части Правил клиринга или соответствующей специальной частью Правил клиринга, в отношении такого Расчетного кода / Счета обеспечения Т0 / Торгово-

клирингового счета и суммы денежных средств / количества драгоценных металлов, указанной / указанного в распоряжении.

28.10.2. Распоряжение на перевод ценных бумаг исполняется за счет ценных бумаг, учитываемых по Торгово-клиринговому счету, указанному в распоряжении в качестве Торгово-клирингового счета, по которому осуществляется уменьшение количества ценных бумаг, при выполнении следующего условия / следующих условий:

- условий для возврата ценных бумаг, установленных пунктом 31.12 общей части Правил клиринга;
- количество ценных бумаг, указанное в распоряжении, не превышает количества ценных бумаг, учитываемого по Торгово-клиринговому счету, по которому осуществляется уменьшение количества ценных бумаг, и количества ценных бумаг, учитываемых на соответствующем Разделе Т0 или Разделе Т+ по информации, полученной от Расчетного депозитария (только для немедленного перевода ценных бумаг);
- совпадение лица, которому открыт субсчет депо / счет депо, эмиссионный счет, на котором открыт Раздел, входящий в состав Торгово-клирингового счета, по которому осуществляется уменьшение количества ценных бумаг, с лицом, которому открыт субсчет депо / счет депо, эмиссионный счет, на котором открыт Раздел, входящий в состав Торгово-клирингового счета, по которому осуществляется увеличение количества ценных бумаг.

28.10.3. Частичное исполнение распоряжения на перевод денежных средств / драгоценных металлов / ценных бумаг невозможно.

28.10.4. В случае положительного результата проверки возможности исполнения распоряжения на перевод денежных средств / драгоценных металлов / ценных бумаг, в Клиринговой системе незамедлительно уменьшается сумма денежных средств / драгоценных металлов / ценных бумаг, учитываемых по Расчетному коду / Счету обеспечения Т0 / Торгово-клиринговому счету, по которому осуществляется уменьшение суммы денежных средств / количества драгоценных металлов / ценных бумаг, и увеличивается сумма денежных средств / количество драгоценных металлов / ценных бумаг, учитываемых по Расчетному коду / Счету обеспечения Т0 / Торгово-клиринговому счету, по которому осуществляется увеличение суммы денежных средств / количества драгоценных металлов / ценных бумаг.

28.10.5. Обязательства по списанию / зачислению денежных средств / драгоценных металлов по распоряжениям на перевод денежных средств, прошедшим проверку возможности их исполнения в соответствии с подпунктом 28.10.1 общей части Правил клиринга, включаются в соответствующий клиринговый пул в порядке, предусмотренном соответствующей специальной частью Правил клиринга.

28.10.6. Обязательства по списанию / зачислению ценных бумаг по распоряжениям на перевод ценных бумаг в ближайшую расчетную клиринговую сессию, прошедшим проверку возможности их исполнения в соответствии с подпунктом 28.10.2 общей части Правил клиринга, включаются в соответствующий клиринговый пул в порядке, предусмотренном соответствующей специальной частью Правил клиринга.

Обязательства по списанию / зачислению ценных бумаг по распоряжениям на немедленный перевод ценных бумаг, прошедшим проверку возможности их исполнения в соответствии с подпунктом 28.10.2 общей части Правил клиринга, включаются в распоряжение на проведение операций по Разделам, направляемое Клиринговым центром Расчетному депозитарию в соответствии Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

28.11. Участник клиринга может перевести денежные средства / драгоценные металлы, учитываемые в качестве Обеспечения / Обеспечения под стресс / взносов в Гарантийные фонды, между своими Расчетными кодами, в том числе, Расчетными кодами, открытыми для разных биржевых рынков, и Расчетными кодами Единого пула, подав в Клиринговый центр Запрос на перевод обеспечения.

28.12. В Запросе на перевод обеспечения Участник клиринга указывает:

- первый Расчетный код, по которому осуществляется уменьшение суммы денежных средств / количества драгоценных металлов;
- второй Расчетный код, по которому осуществляется увеличение суммы денежных средств / количества драгоценных металлов;
- код валюты / драгоценных металлов;
- сумма денежных средств / количество драгоценных металлов, подлежащие переводу;
- Клиринговая система первого биржевого рынка;
- список изменений по клиринговым регистрам в Клиринговой системе первого биржевого рынка (указывается опционально):
  - код раздела клиринговых регистров (указывается для Клиринговой системы срочного рынка);
  - Расчетный код 2-го или 3-го уровня (указывается для Клиринговой системы фондового рынка и рынка депозитов / Клиринговой системы валютного рынка и рынка драгоценных металлов);
  - изменение (со знаком «плюс») суммы денежных средств / количества драгоценных металлов в Клиринговой системе первого биржевого рынка;
- Клиринговая система второго биржевого рынка;
- список изменений по клиринговым регистрам в Клиринговой системе второго биржевого рынка (указывается опционально):
  - код раздела клиринговых регистров (указывается для Клиринговой системы срочного рынка);
  - Расчетный код 2-го или 3-го уровня (указывается для Клиринговой системы фондового рынка и рынка депозитов / Клиринговой системы валютного рынка и рынка драгоценных металлов);
  - изменение (со знаком «плюс») суммы денежных средств / количества драгоценных металлов в Клиринговой системе второго биржевого рынка.

28.12.1. Общая сумма / общее количество изменений суммы денежных средств / количества драгоценных металлов по каждой валюте / каждому драгоценному металлу, рассчитанные по списку изменений по клиринговым регистрам в Клиринговой системе первого биржевого рынка, должны быть равны общей сумме / общему

количеству изменений по такой валюте / такому драгоценному металлу, рассчитанным по списку изменений по клиринговым регистрам в Клиринговой системе второго биржевого рынка; обе указанные суммы должны быть равны сумме денежных средств / количеству драгоценных металлов, подлежащих переводу.

28.12.2. Запросы на перевод обеспечения принимаются Клиринговым центром в Расчетные дни в период времени, установленный Временным регламентом.

28.12.3. Запрос на перевод обеспечения исполняется Клиринговым центром при выполнении условий для возврата денежных средств, установленных пунктом 31.9 общей части Правил клиринга или соответствующей специальной частью Правил клиринга, в отношении Расчетного кода, по которому осуществляется уменьшение суммы денежных средств / количества драгоценных металлов, и суммы денежных средств / количества драгоценных металлов, подлежащих переводу.

28.12.4. Для исполнения Запроса на перевод обеспечения Клиринговый центр:

- уменьшает сумму денежных средств / количество драгоценного металла Участника клиринга, учитываемых в качестве Обеспечения / Обеспечения под стресс / взноса в Гарантийные фонды по Расчетному коду, по которому осуществляется уменьшение суммы денежных средств / количества драгоценного металла, на сумму денежных средств / количество драгоценных металлов, подлежащих переводу;
- увеличивает сумму денежных средств / количество драгоценного металла Участника клиринга, учитываемых в качестве Обеспечения / Обеспечения под стресс / взноса в Гарантийные фонды по Расчетному коду, по которому осуществляется увеличение суммы денежных средств / количества драгоценного металла на сумму денежных средств / количество драгоценного металла, подлежащих переводу;
- в случае указания в Запросе на перевод обеспечения Расчетного кода 2-го или 3-го уровня изменяет информацию об Обеспечении, учитываемую по такому Расчетному коду 2-го или 3-го уровня, в соответствии с пунктами 28.14, 28.15 общей части Правил клиринга;
- в случае указания в Запросе на перевод обеспечения кода раздела клиринговых регистров изменяет информацию об Обеспечении, учитываемую по такому разделу клиринговых регистров в соответствии с Правилами клиринга на срочном рынке;
- если в Запросе на перевод обеспечения в качестве первого или второго Расчетного кода указан Расчетный код Единого пула и в качестве Клиринговой системы первого или второго биржевого рынка указана Клиринговая система валютного рынка и рынка драгоценных металлов или Клиринговая система срочного рынка, осуществляет передачу Профилей активов по денежным средствам / драгоценным металлам, аналогичную переводу денежных средств / драгоценных металлов, между Клиринговой системой фондового рынка и рынка депозитов и Клиринговой системой указанного биржевого рынка.

28.13. Порядок подачи и исполнения Запросов на подбор ценных бумаг определен статьей 30 общей части Правил клиринга.

28.14. Участник клиринга вправе с использованием Клиринговой системы изменить информацию об Обеспечении, учитываемую по Расчетному коду 2-го уровня.

28.14.1. Изменение информации об Обеспечении, учитываемой по Расчетному коду 2-го уровня, осуществляется безусловно, вне зависимости от наличия или отсутствия Обеспечения Участника клиринга, учитываемого по соответствующему Расчетному коду Участника клиринга.

28.14.2. После изменения информации об Обеспечении, учитываемой по Расчетному коду 2-го уровня, Клиринговый центр рассчитывает новое значение Единого лимита по такому Расчетному коду 2-го уровня.

28.15. Участник торгов, заключивший с Клиринговым центром договор о ведении клиринговых регистров, предусмотренный общей частью Правил клиринга, вправе с использованием Клиринговой системы изменить информацию об Обеспечении, учитываемую по Расчетному коду 3-го уровня.

28.15.1. Изменение информации об Обеспечении, учитываемой по Расчетному коду 3-го уровня, осуществляется безусловно, вне зависимости от наличия или отсутствия Обеспечения Участника клиринга, учитываемого по соответствующему Расчетному коду Участника клиринга / информации об Обеспечении, учитываемой по соответствующему Расчетному коду 2-го уровня.

28.15.2. После изменения информации об Обеспечении, учитываемой по Расчетному коду 3-го уровня, Клиринговый центр рассчитывает новое значение Единого лимита по такому Расчетному коду 3-го уровня.

28.16. После перечисления денежных средств на клиринговый банковский или корреспондентский счет Клирингового центра, открытый в Расчетной организации / Расчетном банке, и учета их в качестве Обеспечения по Расчетному коду Участника клиринга, у Клирингового центра возникает обязательство вернуть Обеспечение Участнику клиринга. Указанное обязательство по возврату Участнику клиринга Обеспечения исполняется с учетом условий, указанных в пункте 31.9 общей части Правил клиринга, или условий, установленных соответствующей специальной частью Правил клиринга.

## Статья 29. Порядок передачи Профилей активов

29.1. Участник клиринга вправе передать Профили активов по Расчетному коду Единого пула / Торгово-клиринговому счету, в состав которого входит Расчетный код Единого пула.

Передача Профилей активов осуществляется на основании Запроса на передачу Профилей активов.

29.2. В Запросе на передачу Профилей активов Участник клиринга указывает:

- Торгово-клиринговый счет Участника клиринга, в состав которого входит Расчетный код Единого пула, по которому осуществляется передача Профилей активов;
- Клиринговая система первого биржевого рынка;
- список изменений Профилей активов по клиринговым регистрам в Клиринговой системе первого биржевого рынка:

- код раздела клиринговых регистров (указывается в обязательном порядке для Клиринговой системы срочного рынка);
- Расчетный код 2-го или 3-го уровня (указывается опционально для Клиринговой системы фондового рынка и рынка депозитов / Клиринговой системы валютного рынка и рынка драгоценных металлов);
- код актива, Профиль которого передается;
- изменение (со знаком «плюс» или «минус») Профиля актива в Клиринговой системе первого биржевого рынка;
- Клиринговая система второго биржевого рынка;
- список изменений Профилей активов по клиринговым регистрам в Клиринговой системе второго биржевого рынка:
- код раздела клиринговых регистров (указывается в обязательном порядке для Клиринговой системы срочного рынка);
- Расчетный код 2-го или 3-го уровня (указывается опционально для Клиринговой системы фондового рынка и рынка депозитов / Клиринговой системы валютного рынка и рынка драгоценных металлов);
- код актива, Профиль которого передается;
- изменение (со знаком «плюс» или «минус») Профиля актива в Клиринговой системе второго биржевого рынка.

29.2.1. Общая сумма / общее количество изменений Профилей по каждому активу, рассчитанные по списку изменений Профилей активов по клиринговым регистрам в Клиринговой системе первого биржевого рынка, должны быть равны по абсолютной величине общей сумме / общему количеству изменений Профилей по такому активу, рассчитанным по списку изменений Профилей активов по клиринговым регистрам в Клиринговой системе второго биржевого рынка, и иметь противоположные знаки.

29.2.2. Не допускается указание в одном Запросе на передачу Профилей активов Клиринговой системы фондового рынка и рынка депозитов в качестве Клиринговой системы и первого, и второго биржевого рынка.

29.3. Запрос на передачу Профилей активов исполняется Клиринговым центром при одновременном выполнении следующих условий для всего списка изменений Профилей активов по клиринговым регистрам в Клиринговой системе первого и второго биржевого рынка:

- исполнение Запроса на передачу Профилей активов не приводит к возникновению у Участника клиринга отрицательного Единого лимита по Расчетному коду, рассчитанному в Клиринговой системе первого и/или второго биржевого рынка (для биржевых рынков, на которых для контроля достаточности Обеспечения Участника клиринга используется Единый лимит по Расчетному коду);
- исполнение Запроса на передачу Профилей активов не приводит к возникновению недостаточности Обеспечения по Расчетному коду в Клиринговой системе первого и/или второго биржевого рынка (для биржевых рынков, на которых для контроля достаточности Обеспечения не используется Единый лимит);

- при передаче Профилей активов по Торгово-клиринговому счету Т+ Участника клиринга с признаком «запрет коротких продаж» и/или по Торгово-клиринговому счету Т+ Участника клиринга категории «В», - значения, рассчитанные с учетом исполнения Запроса на передачу Профилей активов в соответствии с пунктом 31.13 общей части Правил клиринга для каждой Даты исполнения, не станут отрицательными.

29.4. Для исполнения Запроса на передачу Профилей активов Клиринговый центр:

- учитывает изменения Профилей активов в Клиринговой системе первого и второго биржевых рынков по Расчетному коду Единого пула / Торгово-клиринговому счету, в состав которого входит Расчетный код Единого пула;
- начинает учитывать новые значения Единого лимита по Расчетному коду Единого пула в Клиринговой системе первого и/или второго биржевого рынка, рассчитанные с учетом изменений Профилей активов в Клиринговой системе первого и второго биржевых рынков (для биржевых рынков, на которых для контроля достаточности Обеспечения Участника клиринга используется Единый лимит по Расчетному коду);
- в случае указания в Запросе на передачу Профилей активов Расчетного кода 2-го или 3-го уровня изменяет информацию об Обеспечении, учитываемую по такому Расчетному коду 2-го или 3-го уровня, в соответствии с пунктами 28.14, 28.15 общей части Правил клиринга;
- в случае указания в Запросе на передачу Профилей активов кода раздела клиринговых регистров изменяет информацию об Обеспечении, учитываемую по такому разделу клиринговых регистров в соответствии с Правилами клиринга на срочном рынке.

29.5. Специальной частью Правил клиринга могут быть установлены особенности исполнения Запроса на передачу Профилей активов в Клиринговой системе соответствующего биржевого рынка.

### Статья 30. Порядок подачи и исполнения Запросов на подбор ценных бумаг

30.1. Участник клиринга, соответствующий требованиям, установленным пунктом 12.22 общей части Правил клиринга, вправе с использованием WEB-сервиса Расчетного депозитария подавать Запросы на подбор ценных бумаг.

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

- внесения ценных бумаг в имущественные пулы;
- внесения ценных бумаг в качестве взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс;
- внесения ценных бумаг в Обеспечение;
- исполнения обязательств по Сделкам.

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

- Торгово-клиринговый счет, в состав которого входит Раздел / субсчет депо, на который должен быть осуществлен подбор ценных бумаг;

- сумму (в российских рублях), в размере которой должен быть осуществлен подбор ценных бумаг, и/или
- код и количество ценных бумаг, которые необходимо подобрать.

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

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

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

30.5. В случаях, установленных Правилами клиринга, Клиринговый центр вправе с использованием WEB-сервиса Расчетного депозитария направить Расчетному депозитарию Запрос на подбор ценных бумаг в отношении Участника клиринга, соответствующего требованиям, установленным пунктом 12.22 общей части Правил клиринга.

30.6. На основании полученного от Клирингового центра / Участника клиринга Запроса на подбор ценных бумаг Расчетный депозитарий в соответствии с условиями договора об оказании услуг по управлению обеспечением, заключенным с депонентом Расчетного депозитария, осуществляет подбор ценных бумаг, используя в первую очередь, приоритеты подбора, указанные депонентом Расчетного депозитария в поручении на маркирование ресурсов для подбора ценных бумаг для клиринга НКО НКЦ (АО), во вторую – приоритеты подбора, указанные в Запросе на подбор ценных бумаг (при наличии).

30.6.1. Если в Запросе на подбор ценных бумаг указана сумма, в размере которой должен быть осуществлен подбор ценных бумаг, Расчетный депозитарий осуществляет подбор ценных бумаг на указанную сумму с учетом цен ценных бумаг, а также ограничений на подбор, полученных от Клирингового центра в соответствии с пунктом 52.5 общей части Правил клиринга.

30.7. По итогам исполнения полученного от Клирингового центра / Участника клиринга Запроса на подбор ценных бумаг Расчетный депозитарий с использованием WEB-сервиса Расчетного депозитария направляет Клиринговому центру / Участнику клиринга Ответ на запрос на подбор ценных бумаг, а также зачисляет ценные бумаги на Раздел / субсчет депо, указанный в Запросе на подбор ценных бумаг, и направляет Клиринговому центру информацию об увеличении количества ценных бумаг, учитываемых на Разделе / субсчете депо, в соответствии с пунктом 52.8 общей части Правил клиринга.

## Статья 31. Порядок возврата Обеспечения

31.1. Возврат Клиринговым центром Участнику клиринга денежных средств / драгоценных металлов, учитываемых в качестве Обеспечения, осуществляется на основании:

1) Запроса на возврат обеспечения;
2) Постоянного поручения на возврат обеспечения;
3) Запроса на перевод обеспечения;
4) распоряжения на перевод денежных средств, поданного Участником клиринга с использованием Клиринговой системы;
5) Запроса на получение денежных средств, поданного НКО АО НРД.

31.2. Возврат Клиринговым центром Участнику клиринга ценных бумаг, учитываемых в качестве Обеспечения, осуществляется на основании:

1) распоряжения на перевод ценных бумаг (за исключением клиринговых сертификатов участия), поданного Участником клиринга с использованием Клиринговой системы;
2) Запроса на изменение параметров Торгово-клирингового счета;
3) поручения на списание ценных бумаг с Раздела Т+, поданного в Расчетный депозитарий.

31.3. Возврат денежных средств / драгоценных металлов на основании Запроса на возврат обеспечения или Постоянного поручения на возврат обеспечения осуществляется на Счет для возврата обеспечения, предварительно зарегистрированный в Клиринговом центре в порядке, установленном пунктом 14.13 общей части Правил клиринга.

31.4. Запрос на возврат обеспечения / Постоянное поручение на возврат обеспечения должны содержать:

а) Расчетный код Участника клиринга;

б) реквизиты Счета для возврата обеспечения.

31.5. Запрос на возврат обеспечения / Постоянное поручение на возврат обеспечения могут содержать указание на Расчетный код 2-го или 3-го уровня.

31.5.1. Запрос на возврат обеспечения / Постоянное поручение на возврат обеспечения, содержащие указание на Расчетный код 2-го или 3-го уровня, не соответствующий Расчетному коду Участника клиринга, указанному в таком Запросе на возврат обеспечения / Постоянном поручении на возврат обеспечения, не исполняется Клиринговым центром.

31.6. Запрос на возврат обеспечения может содержать:

а) сумму денежных средств / количество драгоценного металла, или

б) признак, указывающий на необходимость возврата всей доступной суммы денежных средств / всего доступного количества драгоценного металла;

в) код Клиринговой системы валютного рынка и рынка драгоценных металлов / Клиринговой системы срочного рынка и код раздела клиринговых регистров,

означающие, что одновременно с возвратом Обеспечения необходимо осуществить передачу Профиля актива (только для Запроса на возврат обеспечения, содержащего сумму денежных средств / количество драгоценного металла).

31.6.1. Запросы на возврат обеспечения в соответствующей валюте / соответствующем драгоценном металле принимаются Клиринговым центром в Расчетные дни по соответствующей валюте / соответствующему драгоценному металлу в период времени, установленный Временным регламентом.

31.6.2. При предоставлении Запроса на возврат обеспечения позднее времени, указанного во Временном регламенте, Клиринговый центр вправе не исполнять Запрос на возврат обеспечения.

31.6.3. Запрос на возврат обеспечения действует в день его предоставления.

31.6.4. Запрос на возврат обеспечения исполняется после его получения при соблюдении условий его исполнения.

31.6.5. Запрос на возврат обеспечения, содержащий сумму денежных средств / количество драгоценного металла, исполняется при соблюдении условий, указанных в пункте 31.11 общей части Правил клиринга, при этом проверка указанных условий осуществляется в отношении суммы денежных средств / количества драгоценного металла, указанных(-го) в Запросе на возврат обеспечения.

31.6.6. Исполнение Клиринговым центром Запроса на возврат обеспечения, содержащего признак, указывающий на необходимость возврата всей доступной суммы денежных средств / всего доступного количества драгоценного металла, осуществляется в максимально возможной сумме денежных средств / максимально возможном количестве драгоценного металла, уменьшенной(-ом) на сумму денежных средств / количество драгоценного металла, указанную(-ое) в Запросе на депонирование и/или Постоянном поручении на депонирование (в случае предоставления Участником клиринга Клиринговому центру Запроса на депонирование и/или Постоянного поручения на депонирование в соответствии с пунктом 31.8 общей части Правил клиринга), для которой(-ого) условия, указанные в пункте 31.11 общей части Правил клиринга, будут выполняться.

31.6.7. Запрос на возврат обеспечения, содержащий сумму денежных средств, не исполненный сразу после его получения по причине несоблюдения условий, указанных в пункте 31.11 общей части Правил клиринга, может быть исполнен Клиринговым центром позднее, в период до установленного Временным регламентом времени исполнения Постоянных поручений на возврат обеспечения в соответствующей валюте / соответствующем драгоценном металле, содержащих признак, указывающий на необходимость возврата всей доступной суммы денежных средств / всего доступного количества драгоценного металла, если будут соблюдены условия, указанные в пункте 31.11 общей части Правил клиринга.

31.6.8. Запрос на возврат обеспечения, содержащий признак, указывающий на необходимость возврата всей доступной суммы денежных средств / всего доступного количества драгоценного металла, не исполненный сразу после его получения по причине, что условия, указанные в пункте 31.11 общей части Правил клиринга, не выполняются ни для какой суммы денежных средств / количества драгоценного металла, аннулируется.

31.6.9. В случае если между Участником клиринга и Клиринговым центром предусмотрен обмен сообщениями по системе S.W.I.F.T., Участник клиринга вправе направить Запрос на возврат обеспечения в форме сообщения по системе S.W.I.F.T.

31.7. Постоянное поручение на возврат обеспечения может содержать:

а) признак, указывающий на необходимость возврата всей доступной суммы денежных средств / всего доступного количества драгоценного металла, или

б) признак, указывающий на необходимость возврата денежных средств / драгоценного металла в размере Итогового нетто-требования, или;

в) признак, указывающий на необходимость возврата денежных средств в российских рублях в размере Итогового нетто-требования Участника клиринга без учета обязательств по уплате комиссионных вознаграждений.

31.7.1. Постоянное поручение на возврат обеспечения исполняется Клиринговым центром каждый Расчетный день по соответствующей валюте / соответствующему драгоценному металлу, начиная с первого Расчетного дня по соответствующей валюте / соответствующему драгоценному металлу, следующего за датой предоставления указанного поручения, при соблюдении условий его исполнения.

31.7.2. Исполнение Клиринговым центром Постоянного поручения на возврат обеспечения, содержащего признак, указывающий на необходимость возврата всей доступной суммы денежных средств / всего доступного количества драгоценного металла, осуществляется в срок, установленный Временным регламентом, в максимально возможной сумме денежных средств / максимально возможном количестве драгоценного металла, уменьшенной(-ом) на сумму денежных средств / количество драгоценного металла, указанную(-ое) в Запросе на депонирование и/или Постоянном поручении на депонирование (в случае предоставления Участником клиринга Клиринговому центру Запроса на депонирование и/или Постоянного поручения на депонирование в соответствии с пунктом 31.8 общей части Правил клиринга), для которой(-ого) условия, указанные в пункте 31.11 общей части Правил клиринга, будут выполняться.

31.7.3. Исполнение Клиринговым центром Постоянного поручения на возврат обеспечения, содержащего признак, указывающий на необходимость возврата денежных средств в иностранной валюте / драгоценного металла в размере Итогового нетто-требования / Постоянного поручения на возврат обеспечения, содержащего признак, указывающий на необходимость возврата денежных средств в российских рублях в размере Итогового нетто-требования Участника клиринга без учета обязательств по уплате комиссионных вознаграждений, осуществляется после определения Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований Участника клиринга в соответствующей валюте / драгоценном металле, специально указанных во Временном регламенте, в размере такого Итогового нетто-требования Участника клиринга в соответствующей валюте при соблюдении условий, указанных в пункте 31.11 общей части Правил клиринга, при этом проверка указанных условий осуществляется в отношении указанного Итогового нетто-требования.

Для Постоянного поручения на возврат обеспечения, содержащего признак, указывающий на необходимость возврата денежных средств в российских рублях в размере Итогового нетто-требования Участника клиринга без учета обязательств по уплате комиссионных вознаграждений, проверка и возврат Обеспечения,

указанные в настоящем подпункте общей части Правил клиринга, осуществляются в указанном размере.

Исполнение Клиринговым центром Постоянного поручения на возврат обеспечения, содержащего признак, указывающий на необходимость возврата денежных средств в российских рублях в размере Итогового нетто-требования, осуществляется после определения обязательств по уплате оборотных частей комиссионных вознаграждений.

31.7.4. Постоянное поручение на возврат обеспечения, содержащее признак, указывающий на необходимость возврата денежных средств / драгоценного металла в размере Итогового нетто-требования, не исполненное сразу после определения Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований Участника клиринга в соответствующей валюте / драгоценном металле, специально указанных во Временном регламенте, по причине несоблюдения условий, указанных в пункте 31.11 общей части Правил клиринга, может быть исполнено Клиринговым центром позднее, в период до установленного Временным регламентом времени исполнения Постоянных поручений на возврат обеспечения в соответствующей валюте / драгоценном металле, содержащих признак, указывающий на необходимость возврата всей доступной суммы денежных средств / всего доступного количества драгоценного металла, если будут соблюдены условия, указанные в пункте 31.11 общей части Правил клиринга.

31.7.5. Постоянное поручение на возврат обеспечения, содержащее признак, указывающий на необходимость возврата денежных средств / драгоценного металла в размере Итогового нетто-требования, не исполненное до установленного Временным регламентом времени исполнения Постоянных поручений на возврат обеспечения в соответствующей валюте / драгоценном металле, содержащих признак, указывающий на необходимость возврата всей доступной суммы денежных средств, по причине несоблюдения условий, указанных в пункте 31.11 общей части Правил клиринга, исполняется Клиринговым центром непосредственно в указанный срок в таком же порядке, как Постоянное поручение на возврат обеспечения, содержащее признак, указывающий на необходимость возврата всей доступной суммы денежных средств / всего доступного количества драгоценного металла.

31.7.6. Клиринговый центр вправе принять решение об аннулировании действующих Постоянных поручений на возврат обеспечения не ранее, чем начиная с Расчетного дня, следующего за днем принятия такого решения, в случае, если у Клирингового центра возникнут основания полагать, что существует необходимость в уточнении информации, указанной в Постоянном поручении на возврат обеспечения. Клиринговый центр уведомляет Участника клиринга о принятом решении об аннулировании Постоянного поручения на возврат обеспечения не позднее рабочего дня, следующего за днем принятия такого решения.

31.7.7. Постоянное поручение на возврат обеспечения действует до его отмены Участником клиринга или до даты принятия Клиринговым центром решения об аннулировании Постоянных поручений на возврат обеспечения.

31.8. Участник клиринга вправе предоставить Клиринговому центру Запрос на депонирование или Постоянное поручение на депонирование, содержащие указание на сумму денежных средств в определенной валюте / количество

драгоценного металла, которую(-ый) необходимо оставить в составе Обеспечения Участника клиринга в такой валюте / таком драгоценном металле при возврате денежных средств / драгоценных металлов.

Запрос на депонирование или Постоянное поручение на депонирование не применяются при исполнении Запроса на возврат обеспечения, содержащего сумму денежных средств / количество драгоценного металла, и Постоянного поручения на возврат обеспечения, содержащего признак, указывающий на необходимость возврата денежных средств / драгоценного металла в размере Итогового нетто-требования.

31.8.1. Запрос на депонирование или Постоянное поручение на депонирование должны содержать:

а) Расчетный код Участника клиринга;

б) код валюты / код драгоценного металла;

в) сумму денежных средств / количество драгоценного металла.

31.8.2. Запросы на депонирование в соответствующей валюте / драгоценном металле принимаются Клиринговым центром в Расчетные дни по соответствующей валюте / драгоценном металле в период времени, установленный Временным регламентом.

31.8.3. Запрос на депонирование действует в день его предоставления.

31.8.4. Постоянное поручение на депонирование исполняется Клиринговым центром каждый Расчетный день по соответствующей валюте / драгоценному металлу, начиная с первого Расчетного дня по соответствующей валюте / драгоценному металлу, следующего за датой предоставления указанного поручения.

31.8.5. Постоянное поручение на депонирование действует до его отмены Участником клиринга.

31.8.6. При наличии действующего Постоянного поручения на депонирование в соответствующей валюте / драгоценном металле и подачи Запроса на депонирование в такой валюте / драгоценном металле суммы денежных средств в такой валюте / количества драгоценного металла, указанные в таких документах складываются при определении суммы денежных средств / количества драгоценного металла, подлежащей / подлежащего возврату Участнику клиринга в соответствии с подпунктами 31.6.6, 31.7.2 общей части Правил клиринга.

31.9. Возврат Клиринговым центром Участнику клиринга денежных средств, учитываемых в качестве Обеспечения, осуществляется на основании Запроса на получение денежных средств, поданного НКО АО НРД в случае, если Участник клиринга предоставил Клиринговому центру Запрос на изменение параметров Расчетного кода, содержащий указание установить для Расчетного кода Участника клиринга признак «Единый счет с НРД», и зарегистрировал для Расчетного кода Участника клиринга в качестве Счета для возврата обеспечения в денежных средствах торговый банковский счет, открытый в НКО АО НРД

31.9.1. Участник клиринга путем предоставления Запроса на изменение параметров Расчетного кода, содержащего указание установить для Расчетного кода Участника клиринга признак «Единый счет с НРД» и регистрации для Расчетного кода Участника клиринга в качестве Счета для возврата обеспечения в денежных средствах торгового банковского счета, открытого в НКО АО НРД, подтверждает

полномочия НКО АО НРД на подачу Запроса на получение денежных средств по такому Расчетному коду и на возврат Обеспечения в денежных средствах в соответствии с полученным от НКО АО НРД Запросом на получение денежных средств по такому Расчетному коду.

31.9.2. Участник клиринга обязан уведомить Клиринговый центр о прекращении указанных полномочий клиринговой организации НКО АО НРД путем предоставления Клиринговому центру Запроса на изменение параметров Расчетного кода, содержащего указание снять для Расчетного кода Участника клиринга признак «Единый счет с НРД».

31.10. Запрос на получение денежных средств, подаваемый НКО АО НРД, должен содержать:

а) Расчетный код Участника клиринга;

б) код валюты;

в) сумму денежных средств;

г) номер Счета для возврата обеспечения;

д) признак допустимости частичного исполнения.

31.10.1. Запросы на получение денежных средств в соответствующей валюте принимаются Клиринговым центром в Расчетные дни по соответствующей валюте в период времени, установленный Временным регламентом.

31.10.2. При предоставлении Запроса на получение денежных средств позднее времени, установленного Временным регламентом, Клиринговый центр не исполняет Запрос на получение денежных средств.

31.10.3. Запрос на получение денежных средств действует в день его предоставления.

31.10.4. Запрос на получение денежных средств исполняется после его получения при соблюдении условий его исполнения.

31.10.5. Запрос на получение денежных средств исполняется для Расчетного кода Участника клиринга с признаком «Единый счет с НРД» при соблюдении условий, указанных в пункте 31.11 общей части Правил клиринга, при этом проверка указанных условий осуществляется в отношении Расчетного кода Участника клиринга и суммы денежных средств, указанных в Запросе на получение денежных средств.

31.10.6. Запрос на получение денежных средств, не исполненный сразу после его получения по причине несоблюдения условий, указанных в подпункте 31.10.5 общей части Правил клиринга, не исполняется.

31.11. Возврат Клиринговым центром Участнику клиринга Обеспечения в денежных средствах / драгоценных металлах, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, осуществляется при соблюдении следующих условий:

- Единый лимит по Расчетному коду, рассчитанный без учета возвращаемой суммы денежных средств / количества драгоценного металла, не станет отрицательным;
- возвращаемая сумма денежных средств / количество драгоценного металла не превышает максимального из двух значений: (1) значения

Обеспечения в соответствующей валюте / драгоценном металле, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, уменьшенного на сумму обязательства с отложенным исполнением в такой валюте, определенного в соответствии со статьей 24 общей части Правил клиринга; (2) суммы (с учетом знака) значения Обеспечения, уменьшенного на сумму обязательства с отложенным исполнением в такой валюте, определенного в соответствии со статьей 25 общей части Правил клиринга, и Нетто-обязательства / Нетто-требования в соответствующей валюте / драгоценном металле с текущей Датой исполнения, учитываемых по Расчетному коду;

- в случае возврата денежных средств с Расчетного кода Участника клиринга с признаком «запрет необеспеченных покупок» и/или при возврате иностранной валюты / драгоценного металла, по которому установлен признак «запрет коротких продаж» и/или с Расчетного кода Участника клиринга категории «В», - значения, рассчитанные без учета возвращаемой суммы денежных средств / количества драгоценного металла в соответствии с пунктом 31.13 общей части Правил клиринга для каждой Даты исполнения, не станут отрицательными;
- в случае возврата денежных средств с собственного Расчетного кода - в отношении Участника клиринга не проводится процедура кросс-дефолта.

Специальной частью Правил клиринга могут быть установлены иные условия возврата Обеспечения в денежных средствах.

31.11.1. Возврат Клиринговым центром денежных средств, учитываемых по Счету обеспечения Т0, осуществляется при условии, что возвращаемая сумма денежных средств не превышает суммы денежных средств, учитываемой по такому Счету обеспечения Т0, за вычетом соответствующего Ограничительного лимита.

31.12. Возврат Клиринговым центром Участнику клиринга Обеспечения в ценных бумагах, учитываемого по Торгово-клиринговому счету Т+ Участника клиринга, осуществляется при соблюдении следующих условий:

- Единый лимит по Расчетному коду, рассчитанный без учета возвращаемого количества ценных бумаг, не станет отрицательным;
- возвращаемое количество ценных бумаг не превышает минимального из двух значений: (1) значения Обеспечения в соответствующих ценных бумагах, учитываемого по Торгово-клиринговому счету Т+ Участника клиринга; (2) количества ценных бумаг, учитываемых на Разделе Т+, входящем в состав такого Торгово-клирингового счета Т+, по информации, полученной от Расчетного депозитария;
- в случае возврата ценных бумаг с Торгово-клирингового счета Т+, в состав которого входит Расчетный код Единого пула, – неотрицательное значение Единого лимита по такому Расчетному коду Единого пула (или иное условие достаточности Обеспечения по такому Расчетному коду Единого пула, предусмотренное соответствующей специальной частью Правил клиринга) в Клиринговых системах всех биржевых рынков, включенных в единый пул обеспечения;
- в случае возврата ценных бумаг с Торгово-клирингового счета Т+ Участника клиринга с признаком «запрет коротких продаж» и/или ценных бумаг с

признаком «запрет коротких продаж» и/или с Торгово-клирингового счета Т+ Участника клиринга категории «В», - значения, рассчитанные без учета возвращаемого количества ценных бумаг в соответствии с пунктом 31.13 общей части Правил клиринга для каждой Даты исполнения, не станут отрицательными;

- в случае возврата ценных бумаг с Торгово-клирингового счета, в состав которых входит собственный Расчетный код - в отношении Участника клиринга не проводится процедура кросс-дефолта.

Специальной частью Правил клиринга могут быть установлены иные условия возврата Обеспечения в ценных бумагах.

31.12.1. Возврат Клиринговым центром ценных бумаг, учитываемых по Разделу Т0, осуществляется при условии, что количество ценных бумаг, подлежащих списанию, не превышает количества ценных бумаг, учитываемого по Торгово-клиринговому счету Т0, и количества ценных бумаг, учитываемых на Разделе Т0 по информации, полученной от Расчетного депозитария.

31.13. Сумма денежных средств / количество драгоценных металлов / ценных бумаг, в отношении которой (которого) осуществляется дополнительная проверка возможности исполнения операции, проводимой по Торгово-клиринговому счету / Расчетному коду, при наличии признака «запрет необеспеченных покупок» / «запрет коротких продаж», и/или Участника клиринга категории «В», и/или по ценным бумагам с признаком «запрет коротких продаж», и/или по ценным бумагам, учитываемым на субсчете депо имущественного пула, рассчитывается как сумма с учетом знака:

31.13.1. для денежных средств:

- Обеспечения Участника клиринга в соответствующей валюте, учитываемого по Расчетному коду, уменьшенного на сумму обязательства с отложенным исполнением в такой валюте, определенного в соответствии со статьей 24 общей части Правил клиринга;
- обязательств и/или требований Участника клиринга по Сделкам, по которым осуществляется клиринг с полным обеспечением по соответствующим денежным средствам, в таких денежных средствах, учитываемых по Расчетному коду;
- всех обязательств по денежным средствам, которые могут возникнуть на основании зарегистрированных заявок, процедура контроля обеспечения по которым осуществляется по Расчетному коду, и по которым осуществляется клиринг с полным обеспечением по денежным средствам;
- Профилей активов по соответствующим денежным средствам, учитываемым по Расчетному коду, являющемуся Расчетным кодом Единого пула, в Клиринговой системе соответствующего биржевого рынка;

31.13.2. для драгоценных металлов:

- Обеспечения Участника клиринга в соответствующих драгоценных металлах, учитываемого по Расчетному коду;
- обязательств и/или требований Участника клиринга по Сделкам, по которым осуществляется клиринг с полным обеспечением по соответствующим драгоценным металлам, в таких драгоценных металлах, учитываемых по

Расчетному коду;

- всех обязательств по драгоценным металлам, которые могут возникнуть на основании зарегистрированных заявок, процедура контроля обеспечения по которым осуществляется по Расчетному коду, и по которым осуществляется клиринг с полным обеспечением по драгоценным металлам;
- Профилей активов по соответствующим драгоценным металлам, учитываемым по Расчетному коду, являющемуся Расчетным кодом Единого пула, в Клиринговой системе соответствующего биржевого рынка;

31.13.3. для ценных бумаг:

- Обеспечения Участника клиринга в ценных бумагах, учитываемых по Торгово-клиринговому счету Т+;
- обязательств и/или требований Участника клиринга по Сделкам, по которым осуществляется клиринг с полным обеспечением по ценным бумагам, в таких ценных бумагах, учитываемых по Торгово-клиринговому счету Т+;
- всех обязательств по ценным бумагам, которые могут возникнуть на основании зарегистрированных заявок, процедура контроля обеспечения по которым осуществляется по Торгово-клиринговому счету Т+, и по которым осуществляется клиринг с полным обеспечением по ценным бумагам;
- Профилей активов по соответствующим ценным бумагам, учитываемым по Торгово-клиринговому счету, в состав которого входит Расчетный код Единого пула, в Клиринговой системе соответствующего биржевого рынка.

31.14. Для исполнения своего обязательства по возврату Участнику клиринга Обеспечения в денежных средствах в соответствующей валюте / соответствующем драгоценном металле на основании Запроса на возврат обеспечения / Постоянного поручения на возврат обеспечения Клиринговый центр перечисляет денежные средства в такой валюте / данные драгоценные металлы на соответствующий Счет для возврата обеспечения.

31.14.1. Обязательство Клирингового центра по возврату Участнику клиринга Обеспечения в денежных средствах на Счет для возврата обеспечения (за исключением возврата Обеспечения на Счет для возврата обеспечения, открытый в Клиринговом центре) считается исполненным с момента списания Расчетной организацией / Расчетным банком денежных средств с клирингового банковского / корреспондентского счета Клирингового центра.

Обязательство Клирингового центра по возврату Участнику клиринга Обеспечения в денежных средствах на Счет для возврата обеспечения, открытый в Клиринговом центре, считается исполненным с момента зачисления денежных средств на Счет для возврата обеспечения.

Обязательство Клирингового центра по возврату Участнику клиринга Обеспечения в драгоценных металлах, учитываемых на обезличенных металлических счетах, считается исполненным с момента списания Клиринговым центром драгоценных металлов со Счета обеспечения Участника клиринга.

Для возврата Обеспечения в драгоценных металлах, учитываемых на торговых банковских счетах, Клиринговый центр формирует и исполняет распоряжение на списание драгоценных металлов с торгового банковского счета на соответствующий Счет для возврата обеспечения. Списание Клиринговым центром

Обеспечения в драгоценных металлах с торгового банковского счета в драгоценных металлах осуществляется при соблюдении условий возврата Обеспечения в драгоценных металлах, установленных пунктом 31.9 общей части Правил клиринга.

Клиринговый центр не несет ответственности за неисполнение (ненадлежащее исполнение) Расчетной организацией / Расчетным банком распоряжения Клирингового центра о списании денежных средств в пользу Участника клиринга за исключением случаев, если такое неисполнение явилось следствием вины Клирингового центра.

Клиринговый центр не несет ответственности за удержание банками-корреспондентами своего вознаграждения из суммы Обеспечения в иностранной валюте, подлежащей возврату Участнику клиринга.

31.14.2. При возврате Участнику клиринга Обеспечения в соответствующей валюте / соответствующем драгоценном металле размер Обеспечения, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, в такой валюте / таком драгоценном металле уменьшается на сумму возвращаемых денежных средств / количество возвращаемого драгоценного металла.

31.14.3. При исполнении Запроса на возврат обеспечения, содержащего код Клиринговой системы валютного рынка и рынка драгоценных металлов / Клиринговой системы срочного рынка и код раздела клиринговых регистров, указанные в соответствии с пунктом 31.6 общей части Правил клиринга, Клиринговый центр также:

- учитывает в Клиринговой системе валютного рынка и рынка драгоценных металлов / Клиринговой системе срочного рынка, изменение Профиля актива, полученного из Клиринговой системы фондового рынка и рынка депозитов, в размере возвращаемой суммы денежных средств / количества драгоценного металла (со знаком «минус»);
- учитывает в Клиринговой системе фондового рынка и рынка депозитов изменение Профиля актива, переданного в Клиринговую систему соответствующего биржевого рынка, в размере возвращаемой суммы денежных средств / количества драгоценного металла (со знаком «плюс»).

31.14.4. При исполнении Запроса на возврат обеспечения / Постоянного поручения на возврат обеспечения, содержащего указание на Расчетный код 2-го уровня, Клиринговый центр также учитывает информацию о возврате Обеспечения по Расчетному коду 2-го уровня.

При исполнении Запроса на возврат обеспечения / Постоянного поручения на возврат обеспечения, содержащего указание на Расчетный код 3-го уровня, Клиринговый центр также учитывает информацию о возврате Обеспечения по Расчетному коду 3-го уровня, указанному в Запросе на возврат обеспечения / Постоянном поручении на возврат обеспечения, и по Расчетному коду 2-го уровня, соответствующему Расчетному коду 3-го уровня, указанному в Запросе на возврат обеспечения / Постоянном поручении на возврат обеспечения.

При этом размер Обеспечения в соответствующей валюте / соответствующем драгоценном металле, информация о котором учитывается по Расчетному коду 2-го и/или 3-го уровня, уменьшается на сумму возвращаемых денежных средств / драгоценных металлов без учета проверки достаточности Обеспечения, информация о котором учитывается по Расчетному коду 2-го и/или 3-го уровня.

31.15. Порядок исполнения Запроса на перевод обеспечения определен пунктами 28.11-28.12 общей части Правил клиринга.

31.16. Распоряжение на перевод денежных средств / ценных бумаг, поданное Участником клиринга с использованием Клиринговой системы, исполняется в соответствии с пунктом 28.10 общей части Правил клиринга.

31.17. Возврат Обеспечения в ценных бумагах на основании Запроса на изменение параметров Торгово-клирингового счета осуществляется в Клиринговой системе фондового рынка и рынка депозитов на Торгово-клиринговый счет Т0, связанный с Торгово-клиринговым счетом Т+.

31.18. Запрос на изменение параметров Торгово-клирингового счета содержит указание Клиринговому центру:

а) о порядке перечисления ценных бумаг с Торгово-клиринговых счетов Т0 на Торгово-клиринговые счета Т+ при исполнении обязательств, включенных в Единый клиринговый пул:

- не перечислять;
- перечислять в сумме / количестве, недостающем для исполнения Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по ценным бумагам;
- перечислять в размере Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по ценным бумагам.

В случае непредоставления Запроса на изменение параметров Торгово-клирингового счета ценные бумаги с Торгово-клиринговых счетов Т0 на Торгово-клиринговые счета Т+ при исполнении обязательств, включенных Единый в клиринговый пул, перечисляются в количестве, недостающем для исполнения Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по ценным бумагам;

б) о порядке возврата ценных бумаг с Торгово-клиринговых счетов Т+ после прекращения обязательств, включенных в Единый клиринговый пул:

- не возвращать;
- возвращать в размере Итогового нетто-требования Участника клиринга по ценным бумагам.

В случае непредоставления Запроса на изменение параметров Торгово-клирингового счета ценные бумаги с Торгово-клиринговых счетов Т+ после прекращения обязательств, включенных в Единый клиринговый пул, не возвращаются.

31.18.1. Запрос на изменение параметров Торгово-клирингового счета исполняется Клиринговым центром, начиная с Расчетного дня, следующего за датой предоставления указанного запроса.

31.18.2. Возврат Клиринговым центром Участнику клиринга Обеспечения в ценных бумагах на основании Запроса на изменение параметров Торгово-клирингового счета осуществляется после прекращения обязательств, включенных в Единый клиринговый пул в соответствии со статьей 40 общей части Правил клиринга, в размере прекращенного Итогового нетто-требования Участника клиринга по ценным бумагам, учитываемого по Торгово-клиринговому счету Т+, но не

превышающем количества ценных бумаг, учитываемых в качестве Обеспечения по Торгово-клиринговому счету Т+, за вычетом соответствующего Ограничительного лимита, и при условии, что возврат этого количества ценных бумаг из Обеспечения не приведет к возникновению у Участника клиринга отрицательного Единого лимита по Расчетному коду, входящему в состав такого Торгово-клирингового счета Т+, либо на максимально возможное количество, не превышающее количество ценных бумаг, учитываемых в качестве Обеспечения по Торгово-клиринговому счету Т+, возврат которого из Обеспечения не приведет к возникновению у Участника клиринга отрицательного Единого лимита по Расчетному коду, входящему в состав такого Торгово-клирингового счета Т+.

31.18.3. Сразу после проверки возможности возврата ценных бумаг из Обеспечения, проведенной в соответствии с подпунктом 31.18.2 общей части Правил клиринга, размер Обеспечения, учитываемого по Торгово-клиринговому счету Т+ Участника клиринга, уменьшается, а размер Обеспечения, учитываемого по Торгово-клиринговому счету Участника клиринга, в состав которого входит Раздел Т0, увеличивается на возвращаемое количество ценных бумаг.

31.18.4. Обязательства по списанию / зачислению ценных бумаг по Запросам на изменение параметров Торгово-клирингового счета, прошедшим проверку возможности их исполнения в соответствии с подпунктом 31.18.2 общей части Правил клиринга, включаются в Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов и учитываются при определении Нетто-обязательств / Нетто-требований Участников клиринга по ценным бумагам по сделкам клирингового пула в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

31.19. Возврат Обеспечения в ценных бумагах на основании поручения на списание ценных бумаг с Раздела Т+, поданного в Расчетный депозитарий, осуществляется на раздел торгового счета депо, указанный в поручении.

31.20. Клиринговый центр вправе осуществить в любое время зачет денежных требований Участника клиринга по возврату ему Обеспечения в соответствующей валюте, учитываемых по Расчетному коду Участника клиринга, с денежными требованиями Клирингового центра к этому Участнику клиринга в такой валюте, учитываемыми по тому же Расчетному коду.

31.21. Особенности возврата Обеспечения Участникам клиринга категории «К» определены в соответствующей специальной части Правил клиринга.

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

### Статья 32. Порядок внесения взносов в Гарантийные фонды и Обеспечения под стресс

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

1) путем перечисления денежных средств на клиринговый банковский счет Клирингового центра по реквизитам, размещенным на Сайте Клирингового

центра, с обязательным указанием в назначении платежа Расчетного кода для учета взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс;

2) путем исполнения распоряжения на перевод денежных средств, поданного Участником клиринга с использованием Клиринговой системы;

3) путем исполнения Запроса на перевод обеспечения.

32.2. Клиринговый центр учитывает в Клиринговой системе денежные средства, перечисленные на соответствующий клиринговый банковский счет Клирингового центра, по Расчетному коду для учета взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс, указанному в назначении платежа, и увеличивает Единый лимит по Гарантийным фондам / Обеспечению под стресс по такому Расчетному коду с учетом перечисленной суммы денежных средств.

32.2.1. Если Расчетный код, указанный в назначении платежа, не найден среди зарегистрированных Клиринговым центром Расчетных кодов для учета взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс, Клиринговый центр вправе запросить у Участника клиринга уточнение назначения платежа. В случае получения от Участника клиринга или от банка плательщика уточнения назначения платежа, учет денежных средств в соответствии с пунктом 32.2 общей части Правил клиринга, осуществляется Клиринговым центром после получения от Участника клиринга / банка плательщика такого уточнения назначения платежа с правильно указанным Расчетным кодом.

32.2.2. Если в течение 5 (пяти) Расчетных дней по соответствующей валюте с даты, следующей за датой зачисления денежных средств в российских рублях / иностранной валюте на соответствующий клиринговый банковский счет Клирингового центра с не указанным / неправильно указанным Расчетным кодом для учета взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс в назначении платежа, Участник клиринга / банк плательщика не предоставит Клиринговому центру уточнение назначения платежа с правильно указанным Расчетным кодом для учета взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс, Клиринговый центр возвращает указанные денежные средства по реквизитам плательщика.

32.2.3. Денежные средства, зачисленные на соответствующий клиринговый банковский счет Клирингового центра, позднее времени, установленного Временным регламентом, учитываются Клиринговым центром в следующем Расчетном дне.

32.3. Порядок подачи и исполнения распоряжений на перевод денежных средств определен пунктом 28.10 общей части Правил клиринга.

32.4. Порядок исполнения Запроса на перевод обеспечения определен пунктами 28.11-28.12 общей части Правил клиринга.

32.5. Для внесения ценных бумаг в качестве взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс Участник клиринга обязан:

1) получить допуск к клиринговому обслуживанию на фондовом рынке и рынке депозитов в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов;

2) выполнить действия, необходимые для открытия субсчета депо гарантийных фондов / субсчета депо обеспечения под стресс, предусмотренные Условиями

осуществления депозитарной деятельности Расчетного депозитария.

32.5.1. Клиринговый центр открывает Торгово-клиринговый счет Гарантийных фондов / Торгово-клиринговый счет Обеспечения под стресс Участника клиринга после получения от Расчетного депозитария списка Разделов / субсчетов депо, в который включена информация об открытом соответствующем субсчете депо гарантийных фондов / субсчете депо обеспечения под стресс.

32.6. Внесение ценных бумаг в качестве взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс возможно двумя способами:

1) путем исполнения распоряжения на перевод ценных бумаг, поданного Участником клиринга с использованием Клиринговой системы;
2) в результате исполнения Запроса на подбор ценных бумаг, поданного Участником клиринга с использованием Клиринговой системы.

32.7. Порядок подачи и исполнения распоряжений на перевод ценных бумаг определен пунктом 28.10 общей части Правил клиринга.

32.7.1. В распоряжении на перевод ценных бумаг, поданного с целью внесения ценных бумаг в качестве взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс, в качестве Торгово-клирингового счета, по которому осуществляется уменьшение ценных бумаг, может быть указан только Торгово-клиринговый счет, в состав которого входит Раздел, открытый на торговом счете депо владельца Участника клиринга.

32.8. Порядок подачи и исполнения Запросов на подбор ценных бумаг определен статьей 30 общей части Правил клиринга.

32.9. Для контроля за исполнением обязательств Участника клиринга по внесению взносов в Гарантийные фонды, Клиринговый центр рассчитывает Единый лимит Участника клиринга по Гарантийным фондам как сумму с учетом знака:

- суммы денежных средств в российских рублях, учитываемой по Расчетному коду для учета взносов в Гарантийные фонды (учитывается со знаком «плюс»);
- суммы денежных средств в иностранной валюте, учитываемой по Расчетному коду для учета взносов в Гарантийные фонды, пересчитанной в российские рубли по соответствующей Нижней границе диапазона оценки рыночных рисков, установленной для такой иностранной валюты в соответствии с Методикой определения риск-параметров валютного рынка и рынка драгоценных металлов (учитывается со знаком «плюс»);
- количества ценных бумаг, учитываемого по Торгово-клиринговому счету Гарантийных фондов, пересчитанного в российские рубли по соответствующей Нижней границе диапазона оценки рыночных рисков, установленной для ценной бумаги в соответствии с Методикой определения риск-параметров фондового рынка и рынка депозитов (учитывается со знаком «плюс»);
- суммы установленных соответствующими специальными частями Правил клиринга минимальных размеров взноса в Гарантийные фонды биржевых рынков, на которых Участник клиринга допущен к клиринговому

обслуживанию с категорией «О» или «Б» (учитываются со знаком «минус»).

32.10. Для контроля за исполнением обязательств Участника клиринга по внесению Обеспечения под стресс, Клиринговый центр рассчитывает Единый лимит Участника клиринга по Обеспечению под стресс как сумму с учетом знака:

- суммы денежных средств в российских рублях, учитываемой по Расчетному коду для учета Обеспечения под стресс (учитывается со знаком «плюс»);
- суммы денежных средств в иностранной валюте, учитываемой по Расчетному коду для учета Обеспечения под стресс, пересчитанной в российские рубли по соответствующей Нижней границе диапазона оценки рыночных рисков, установленной для такой иностранной валюты в соответствии с Методикой определения риск-параметров валютного рынка и рынка драгоценных металлов (учитывается со знаком «плюс»);
- количества ценных бумаг, учитываемого по Торгово-клиринговому счету Обеспечения под стресс, пересчитанного в российские рубли по соответствующей Нижней границе диапазона оценки рыночных рисков, установленной для ценной бумаги в соответствии с Методикой определения риск-параметров фондового рынка и рынка депозитов (учитывается со знаком «плюс»);
- суммы определенных в соответствии с Методикой определения размера Обеспечения под стресс минимальных размеров Обеспечения под стресс Участника клиринга на биржевых рынках, на которых Участник клиринга допущен к клиринговому обслуживанию с категорией «О» или «Б» (учитываются со знаком «минус»).

32.11. Обязательства Участника клиринга по внесению взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс считаются исполненными, если Единый лимит Участника по Гарантийным фондам / Обеспечению под стресс, рассчитанный в соответствии с пунктом 32.9 общей части Правил клиринга, является неотрицательным.

32.12. В случае изменения размера Обеспечения под стресс на соответствующем биржевом рынке в соответствии с Методикой определения размера Обеспечения под стресс, новое значение размера Обеспечения под стресс Участника клиринга используется при расчете Единого лимита Участника клиринга по Обеспечению под стресс, начиная с 5-го Расчетного дня после дня направления Участнику клиринга Клиринговым центром уведомления о новом значении размера Обеспечения под стресс.

32.13. После увеличения суммы денежных средств, учитываемой по Расчетному коду для учета взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс, на сумму денежных средств, внесенных Участником клиринга в Гарантийные фонды / в качестве Обеспечения под стресс, у Клирингового центра возникает обязательство вернуть Участнику клиринга взносы Участника клиринга в Гарантийные фонды / Обеспечение под стресс Участника клиринга. Указанное обязательство по возврату Участнику клиринга взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс исполняется с учетом условий, указанных в пункте 33.5 общей части Правил клиринга.

32.14. Информация о количестве ценных бумаг / сумме денежных средств, внесенных Участником клиринга в Гарантийные фонды / в качестве Обеспечения под стресс, и о размере обязательств Участника клиринга по внесению взносов в Гарантийные фонды соответствующих биржевых рынков / Обеспечения под стресс на соответствующих биржевых рынках предоставляется Участнику клиринга в составе Отчета о гарантийных фондах / Отчета об Обеспечении под стресс.

## Статья 33. Порядок возврата взносов в Гарантийные фонды и Обеспечения под стресс

33.1. Возврат Участнику клиринга взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс Участника клиринга на соответствующем биржевом рынке при прекращении допуска к клиринговому обслуживанию Участника клиринга с категорией «Б» или «О» на таком биржевом рынке осуществляется после прекращения допуска к клиринговому обслуживанию Участника клиринга с категорией «Б» или «О» по основаниям, установленным статьей 13 общей части Правил клиринга, в порядке, предусмотренном пунктом 33.2 общей части Правил клиринга.

33.1.1. Возврат Участнику клиринга взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс Участника клиринга на соответствующем биржевом рынке в денежных средствах и/или ценных бумагах в размере, соответствующем минимальному размеру взноса в Гарантийный фонд соответствующего биржевого рынка / Обеспечения под стресс на соответствующем биржевом рынке, при изменении категории Участника клиринга с категории «Б» или «О» на категорию «В» на таком биржевом рынке осуществляется при соблюдении следующих условий:

- у Участника клиринга отсутствуют непогашенные Задолженности на всех биржевых рынках;
- значения, рассчитанные в соответствии с пунктом 31.13 общей части Правил клиринга для каждой Даты исполнения по каждому Расчетному коду Участника клиринга на соответствующем биржевом рынке, не являются отрицательными. При этом возврат Участнику клиринга взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс осуществляется в порядке, предусмотренном пунктом 33.2 общей части Правил клиринга.

33.2. Возврат Участнику клиринга взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс в денежных средствах за исключением случая, указанного в пункте 4.12 общей части Правил клиринга, осуществляется на основании:

1) Запроса на возврат обеспечения;
2) распоряжения на перевод денежных средств, подаваемого Участником клиринга с использованием Клиринговой системы;
3) Запроса на перевод обеспечения.

33.3. Возврат Клиринговым центром Участнику клиринга взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс в ценных бумагах за исключением случая, указанного в пункте 4.12 общей части Правил клиринга, осуществляется на основании распоряжений на перевод ценных бумаг, подаваемых Участниками клиринга с использованием Клиринговой системы.

33.4. Запрос на возврат обеспечения должен содержать:

а) Расчетный код Участника клиринга для учета взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс;

б) реквизиты Счета для возврата обеспечения;

в) валюту;

г) сумму денежных средств.

Порядок подачи и исполнения Запросов на возврат обеспечения, поданных в целях возврата взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс, соответствует порядку, определенному пунктом 31.3, подпунктами 31.6.1-31.6.4, 31.6.7, 31.6.9 общей части Правил клиринга, условия исполнения указаны в пункте 33.5 общей части Правил клиринга.

33.5. Возврат Клиринговым центром Участнику клиринга взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс в денежных средствах осуществляется при соблюдении следующих условий:

- Единый лимит Участника клиринга по Гарантийным фондам / Обеспечению под стресс, рассчитанный без учета возвращаемой суммы денежных средств, не станет отрицательным;
- возвращаемая сумма денежных средств не превышает суммы денежных средств, учитываемых в качестве взносов Участника клиринга в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс Участника клиринга.

33.6. Возврат Клиринговым центром Участнику клиринга взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс в денежных средствах и ценных бумагах не осуществляется в случае наличия у Участника клиринга Маржинального требования, учитываемого по Расчетному коду, неисполненного в срок, установленный Временным регламентом на соответствующем биржевом рынке, либо если в отношении Участника клиринга проводится процедура кросс-дефолта.

33.7. Для исполнения своего обязательства по возврату Участнику клиринга взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс в денежных средствах в соответствующей валюте на основании Запроса на возврат обеспечения Клиринговый центр перечисляет денежные средства в такой валюте на соответствующий Счет для возврата обеспечения.

33.7.1. Обязательство Клирингового центра по возврату Участнику клиринга взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс в денежных средствах на Счет для возврата обеспечения (за исключением возврата взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс на Счет для возврата обеспечения, открытый в Клиринговом центре), считается исполненным с момента списания Расчетной организацией денежных средств с клирингового банковского счета Клирингового центра.

Обязательство Клирингового центра по возврату Участнику клиринга взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс в денежных средствах на Счет для возврата обеспечения, открытый в Клиринговом центре, считается исполненным с момента зачисления денежных средств на Счет для возврата обеспечения.

Клиринговый центр не несет ответственности за неисполнение (ненадлежащее исполнение) Расчетной организацией распоряжения Клирингового центра о списании денежных средств в пользу Участника клиринга за исключением случаев, если такое неисполнение явилось следствием вины Клирингового центра.

Клиринговый центр не несет ответственности за удержание банками-корреспондентами своего вознаграждения из суммы взноса в Гарантийный фонд в иностранной валюте, подлежащей возврату Участнику клиринга.

33.7.2. При возврате Участнику клиринга денежных средств в соответствующей валюте, учитываемых в качестве взносов Участника клиринга в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс Участника клиринга, размер денежных средств, учитываемых по Расчетному коду Участника клиринга для учета взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс, в такой валюте уменьшается на сумму возвращаемых денежных средств.

33.8. Порядок подачи и исполнения распоряжений на перевод денежных средств / ценных бумаг определен пунктом 28.10 общей части Правил клиринга.

33.8.1. В распоряжении на перевод ценных бумаг, поданного с целью возврата ценных бумаг, учитываемых в качестве взносов Участника клиринга в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс, в качестве Торгово-клирингового счета, по которому осуществляется увеличение количества ценных бумаг, может быть указан только Торгово-клиринговый счет, в состав которого входит Раздел, открытый на торговом счете депо владельца Участника клиринга.

33.9. Порядок исполнения Запроса на перевод обеспечения определен пунктами 28.11-28.12 общей части Правил клиринга.

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

## ПОДРАЗДЕЛ IV-III. ПОРЯДОК ВОЗНИКНОВЕНИЯ И ИСПОЛНЕНИЯ МАРЖИНАЛЬНЫХ ТРЕБОВАНИЙ И МАРЖИНАЛЬНЫХ ТРЕБОВАНИЙ ПО ФОНДАМ / ОБЕСПЕЧЕНИЮ ПОД СТРЕСС

### Статья 34. Порядок проведения клиринговых сессий mark-to-market. Порядок возникновения и исполнения Маржинальных требований

34.1. В срок, установленный Временным регламентом на соответствующем биржевом рынке, Клиринговый центр проводит клиринговую сессию в целях переоценки стоимости Обеспечения, а также обязательств и требований Участника клиринга (далее – клиринговая сессия mark-to-market), в ходе которой Клиринговый центр:

- устанавливает риск-параметры в соответствии с Методикой определения риск-параметров соответствующего биржевого рынка;
- для каждого Участника клиринга осуществляет контроль достаточности Обеспечения по обязательствам с наступившей и ненаступившей Датой исполнения;
- 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 Маржинальных требованиях, содержащий информацию о суммах Маржинальных требований.

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

34.3. На фондовом рынке и рынке депозитов, на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, на товарном рынке Маржинальное требование возникает у Участника клиринга, Единый лимит по Расчетному коду которого по итогам клиринговой сессии mark-to-market стал отрицательным. Сумма Маржинального требования равна абсолютному значению Единого лимита по Расчетному коду, определенного по итогам клиринговой сессии mark-to-market.

34.4. Маржинальное требование по Расчетному коду Единого пула может возникнуть у Участника клиринга в Клиринговой системе любого из биржевых рынков, включенных в единый пул обеспечения.

34.5. Маржинальное требование, возникшее у Участника клиринга по итогам клиринговой сессии mark-to-market, должно быть исполнено Участником клиринга не позднее времени, установленного Временным регламентом на соответствующем биржевом рынке.

34.6. Маржинальное требование должно быть исполнено Участником клиринга путем внесения в Обеспечение в порядке, установленном статьей 28 общей части Правил клиринга, денежных средств в российских рублях и иностранной валюте, драгоценных металлов и/или ценных бумаг, принимаемых в качестве обеспечения исполнения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением.

34.6.1. Маржинальное требование может быть также прекращено полностью или в части:

- путем снятия заявок;
- путем заключения сделок, устраняющих недостаточность Обеспечения по обязательствам с наступившей и ненаступившей Датой исполнения;
- за счет получения Дохода;
- путем подачи и исполнения Поручений на управление риском.

34.6.2. Маржинальное требование, возникшее по Расчетному коду Единого пула, может быть также прекращено полностью или в части путем передачи Профилей активов со знаком «плюс» в Клиринговую систему биржевого рынка, в которой учитывается неисполненное Маржинальное требование по Расчетному коду Единого пула.

Передача Профилей активов осуществляется в соответствии со статьей 29 общей части Правил клиринга.

34.7. Маржинальное требование, учитываемое по Расчетному коду на фондовом рынке и рынке депозитов, на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, на товарном рынке, возникшее у Участника клиринга, считается прекращенным в момент времени, когда Единый лимит по такому Расчетному коду станет неотрицательным.

34.8. В случае неисполнения Участником клиринга Маржинального требования, учитываемого по Расчетному коду, в срок, установленный Временным регламентом на соответствующем биржевом рынке, Клиринговый центр устанавливает для такого Расчетного кода Режим урегулирования, порядок применения которого определен в статье 35 общей части Правил клиринга, и осуществляет действия в следующей последовательности (каждое последующее действие выполняется в случае, если предыдущее действие не привело к исполнению Маржинального требования):

34.8.1. вправе передать Профили активов в Клиринговую систему биржевого рынка, в которой учитывается неисполненное Маржинальное требование по Расчетному коду Единого пула (в случае неисполнения Участником клиринга Маржинального требования по Расчетному коду Единого пула). Передача Профилей активов осуществляется при соблюдении условий, установленных пунктом 29.3 общей части Правил клиринга;

34.8.2. вправе направить Расчетному депозитарию Запрос на подбор ценных бумаг с указанием суммы Маржинального требования и Разделов Т+, входящих в состав Торгово-клиринговых счетов совместно с Расчетным кодом, по которому учитывается неисполненное Маржинальное требование (только для Участников клиринга, соответствующих требованиям, установленным пунктом 12.22 общей части Правил клиринга);

34.8.3. заключает от имени Участника клиринга, не исполнившего Маржинальное требование, закрывающие сделки, в совокупности устраняющие недостаточность Обеспечения по обязательствам с наступившей и ненаступившей Датой исполнения по такому Расчетному коду, и заключает балансирующие сделки.

Порядок заключения закрывающих и балансирующих сделок определен статьей 27 общей части Правил клиринга.

Закрывающие сделки заключаются с указанием любого Торгово-клирингового счета Участника клиринга, в состав которого входит Расчетный код, по которому учитывается неисполненное Маржинальное требование.

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

34.8.4. Если Участник клиринга, не исполнивший Маржинальное требование, является Участником пула, Клиринговый центр вправе заключить от имени такого Участника пула закрывающие Сделки Т+, направленные на продажу имущества (ценных бумаг или иностранной валюты) из имущественного пула, при соблюдении условий погашения клиринговых сертификатов участия, установленных Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов. При заключении закрывающих сделок в соответствии с настоящим подпунктом общей части Правил клиринга Клиринговый центр также заключает балансирующие сделки.

Порядок заключения закрывающих и балансирующих сделок определен статьей 27 общей части Правил клиринга.

Закрывающие сделки заключаются с указанием Торгово-клирингового счета имущественного пула, соответствующего Торгово-клиринговому счету Т+, в состав которого входит Расчетный код, по которому учитывается неисполненное Маржинальное требование.

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

34.9. В случае если после заключения Сделок в соответствии с подпунктами 34.8.3-34.8.4 общей части Правил клиринга Маржинальное требование Участника клиринга осталось неисполненным, Клиринговый центр вправе принять решение о том, что Дата исполнения обязательств по Сделкам считается наступившей в Расчетный день, определенный таким решением Клирингового центра.

Обязательства по Сделкам, Дата исполнения которых была изменена решением Клирингового центра, включаются в клиринговый пул, формируемый в такую Дату исполнения, и исполняются в порядке, установленном Правилами клиринга.

34.10. После исполнения Маржинального требования по Расчетному коду Участника клиринга Клиринговый центр снимает Режим урегулирования для такого Расчетного кода.

34.11. Расчетный депозитарий исполняет Запрос Клирингового центра на подбор ценных бумаг в соответствии с пунктами 30.6-30.7 общей части Правил клиринга.

34.12. Специальной частью Правил клиринга могут быть установлены особенности возникновения и исполнения Маржинальных требований.

### Статья 35. Режим урегулирования (Режим принудительного закрытия позиций)

35.1. Режим урегулирования (Режим принудительного закрытия позиций) (далее – Режим урегулирования), установленный для Расчетного кода / Торгово-

клирингового счета, означает, что для такого Расчетного кода / Торгово-клирингового счета действуют следующие ограничения:

35.1.1. приостановление возможности подачи заявок с указанием клиринговых регистров / разделов клиринговых регистров, соответствующих такому Расчетному коду / Торгово-клиринговому счету, и с указанием Торгово-клиринговых счетов имущественного пула, соответствующих Торгово-клиринговым счетам Т+, в состав которых входит такой Расчетный код (если применимо);

35.1.2. не осуществляется возврат Обеспечения;

35.1.3. не осуществляется закрытие Расчетного кода / Торгово-клирингового счета;

35.1.4. не осуществляется открытие, закрытие и изменение параметров Торгово-клиринговых счетов, в состав которых входит Расчетный код.

35.2. Снятие Режима урегулирования для Расчетного кода / Торгово-клирингового счета означает отмену ограничений, указанных в пункте 35.1 общей части Правил клиринга.

35.3. Клиринговый центр посредством Системы торгов / Торговой системы уведомляет Биржу об установлении / снятии Режима урегулирования для Расчетного кода / Торгово-клирингового счета.

Клиринговый центр посредством Клиринговой системы уведомляет Участника клиринга об установлении / снятии Режима урегулирования для Расчетного кода / Торгово-клирингового счета.

## Статья 36. Порядок возникновения и исполнения Маржинальных требований по фондам / обеспечению под стресс

36.1. В ходе клиринговой сессии mark-to-market, проводимой в Клиринговой системе фондового рынка и рынка депозитов, Клиринговый центр также осуществляет следующие действия:

- для каждого Участника клиринга категории «Б» или «О» рассчитывает значение Единого лимита по Гарантийным фондам; определяет Участников клиринга, у которых возникли Маржинальные требования по фондам;
- для каждого Участника клиринга категории «Б» или «О», к которому Клиринговым центром предъявлено требование о внесении Обеспечения под стресс, размер которого отличен от нуля, рассчитывает значение Единого лимита по Обеспечению под стресс; определяет Участников клиринга, у которых возникли Маржинальные требования по обеспечению под стресс.

36.2. В случае если по итогам клиринговой сессии mark-to-market, проводимой в Клиринговой системе фондового рынка и рынка депозитов, абсолютное значение отрицательного Единого лимита Участника клиринга по Гарантийным фондам становится больше величины, установленной решением Клирингового центра (далее – порог выставления Маржинального требования по фондам), Клиринговый центр предъявляет Участнику клиринга Маржинальное требование по фондам.

Информация о Маржинальном требовании по фондам предоставляется Участнику клиринга в составе Отчета о Маржинальных требованиях, направляемого в соответствии с пунктом 34.1 общей части Правил клиринга.

Маржинальное требование по фондам должно быть исполнено Участником клиринга в срок, установленный Временным регламентом, путем перечисления денежных средств в российских рублях и/или иностранной валюте и/или ценных бумаг для учета в качестве взносов в Гарантийные фонды в порядке, установленном статьей 32 общей части Правил клиринга.

Маржинальное требование по фондам считается исполненным в момент времени, когда Единый лимит Участника клиринга по Гарантийным фондам станет больше либо равен нулю.

36.3. В случае если по итогам клиринговой сессии mark-to-market, проводимой в Клиринговой системе фондового рынка и рынка депозитов, абсолютное значение отрицательного Единого лимита Участника клиринга по Обеспечению под стресс становится больше величины, установленной решением Клирингового центра (далее – порог выставления Маржинального требования по обеспечению под стресс), Клиринговый центр предъявляет Участнику клиринга Маржинальное требование по обеспечению под стресс.

Информация о Маржинальном требовании по обеспечению под стресс направляется Участнику клиринга в составе Отчета о Маржинальных требованиях, направляемого в соответствии с пунктом 34.1 общей части Правил клиринга.

Маржинальное требование по обеспечению под стресс должно быть исполнено Участником клиринга в срок, установленный Временным регламентом, путем перечисления денежных средств в российских рублях и/или иностранной валюте и/или ценных бумаг для учета в качестве Обеспечения под стресс в порядке, установленном статьей 32 общей части Правил клиринга.

Маржинальное требование по обеспечению под стресс считается исполненным в момент времени, когда Единый лимит Участника клиринга по Обеспечению под стресс станет больше либо равен нулю.

36.4. В случае неисполнения Участником клиринга Маржинального требования по фондам в срок, установленный пунктом 36.2 общей части Правил клиринга, за исключением случая неисполнения Участником клиринга Маржинального требования по фондам указанного в пункте 36.5 общей части Правил клиринга, считается, что Участник клиринга не исполнил обязательства по внесению взносов в Гарантийные фонды всех биржевых рынков, к клирингу на которых Участник клиринга допущен с категорией «Б» или «О».

36.5. В случае неисполнения Участником клиринга Маржинального требования по фондам, возникшего в связи с изменением минимального размера взноса в Гарантийный фонд на определенном биржевом рынке, считается, что Участник клиринга не исполнил обязательства по внесению взноса в Гарантийный фонд на том биржевом рынке, на котором минимальный размер взноса в Гарантийный фонд был увеличен.

36.6. В случае неисполнения Участником клиринга Маржинального требования по обеспечению под стресс, в срок, установленный пунктом 36.3 общей части Правил клиринга, за исключением случая неисполнения Участником клиринга Маржинального требования по обеспечению под стресс указанного в пункте 36.7 общей части Правил клиринга считается, что Участник клиринга не исполнил обязательства по внесению Обеспечения под стресс на всех биржевых рынках, на которых согласно соответствующей специальной части Правил клиринга Клиринговым центром к Участнику клиринга предъявлено требование о внесении Обеспечения под стресс.

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

36.8. В случае неисполнения Участником клиринга Маржинального требования по фондам / Маржинального требования по обеспечению под стресс в срок, установленный Временным регламентом, Клиринговый центр вправе осуществить действия в следующей последовательности (каждое последующее действие выполняется в случае, если предыдущее действие не привело к исполнению соответствующего Маржинального требования):

36.8.1. вправе направить Расчетному депозитарию Запрос на подбор ценных бумаг с указанием суммы соответствующего Маржинального требования и субсчетов депо, входящих в состав Торгово-клиринговых счетов для учета взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс (только для Участников клиринга, соответствующих требованиям, установленным пунктом 12.22 общей части Правил клиринга);

36.8.2. вправе заключить от имени Участника клиринга, не исполнившего соответствующее Маржинальное требование, сделки, направленные на продажу иностранной валюты и ценных бумаг, учитываемых в качестве взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс.

36.9. Если по итогам действий, выполненных Клиринговым центром в соответствии с пунктом 36.8 общей части Правил клиринга, Маржинальное требование по фондам / Маржинальное требование по обеспечению под стресс осталось неисполненным, к Участнику клиринга применяются меры, предусмотренные соответствующей специальной частью Правил клиринга.

## ПОДРАЗДЕЛ IV-IV. ПОРЯДОК ИСПОЛНЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ ПО ИТОГАМ КЛИРИНГА

### Статья 37. Общие требования к порядку включения обязательств в клиринговые пулы и к порядку исполнения обязательств

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

Порядок включения обязательств в Единый клиринговый пул определен статьей 40 общей части Правил клиринга.

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

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

37.3. Участник клиринга категории «А» или «К» может заключать биржевые сделки без предварительного внесения индивидуального клирингового обеспечения в денежных средствах и драгоценных металлах.

37.3.1. Для исполнения своих обязательств в соответствующей валюте по сделкам с центральным контрагентом Участник клиринга категории «А» или «К» обязан внести денежные средства на клиринговый банковский или корреспондентский счет Клирингового центра по реквизитам, размещенным на Сайте Клирингового центра, с обязательным указанием в назначении платежа Расчетного кода Участника клиринга до установленного Временным регламентом времени исполнения Участниками клиринга Итоговых нетто-обязательств по денежным средствам в соответствующей валюте.

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

37.3.2. До открытия Участником клиринга категории «А» или «К» торгового банковского счета в драгоценном металле для исполнения своих обязательств в соответствующем драгоценном металле по сделкам с центральным контрагентом Участник клиринга категории «А» или «К» обязан внести драгоценные металлы на свой Счет обеспечения в соответствующем драгоценном металле с обязательным указанием в назначении платежа Расчетного кода Участника клиринга до установленного Временным регламентом времени исполнения Участниками клиринга Итоговых нетто-обязательств по соответствующему драгоценному металлу.

После открытия Участником клиринга категории «А» или «К» торгового банковского счета в драгоценном металле для исполнения своих обязательств в соответствующем драгоценном металле по сделкам с центральным контрагентом Участник клиринга категории «А» или «К» обязан внести драгоценные металлы на свой торговый банковский счет в соответствующем драгоценном металле с обязательным указанием в назначении платежа Расчетного кода Участника клиринга до установленного Временным регламентом времени исполнения Участниками клиринга Итоговых нетто-обязательств по соответствующему драгоценному металлу.

37.4. Правилами клиринга может быть определено, что:

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

37.5. Правилами клиринга могут быть предусмотрены:

- случаи и порядок досрочного исполнения обязательств по Сделкам и иных обязательств, определенных Правилами клиринга;
- порядок и условия замены счетов, по которым должны быть исполнены обязательства по Сделкам и/или иные обязательства, определенные Правилами клиринга;
- случаи, порядок и условия отказа от исполнения обязательств по Сделкам и иных обязательств, определенных Правилами клиринга;
- случаи и порядок принятия Клиринговым центром решения об изменении в одностороннем порядке предмета (объекта) Сделок, обязательства по которым не исполнены, и/или порядка исполнения обязательств по Сделкам;
- порядок и условия изменения договоров, обязательства из которых подлежат включению в клиринговый пул;
- порядок досрочного прекращения договоров, обязательства из которых подлежат включению в клиринговый пул.

37.6. В случаях если между датой заключения Сделки Т+ и Датой исполнения обязательств по Сделке Т+ в отношении ценных бумаг, с которыми заключена Сделка Т+, 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 Т+, в том числе, которые приводят к изменению предмета Сделки Т+, Клиринговый центр вправе принять в отношении таких Сделок Т+ одно из следующих решений:

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

37.6.2. о том, что Дата исполнения обязательств по Сделкам Т+ считается наступившей в Расчетный день, определенный таким решением Клирингового центра.

37.7. Порядок исполнения обязательств, включенных в клиринговый пул, определен в статье 38 общей части Правил клиринга, а также в соответствующих специальных частях Правил клиринга.

**Статья 38. Сроки включения обязательств в клиринговые пулы (ранние расчеты и раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром)**

38.1. Обязательства и требования Участника клиринга и Клирингового центра с наступившей Датой исполнения включаются в соответствующий клиринговый пул в сроки, установленные соответствующим временным регламентом.

38.2. В случае получения от Участника клиринга Запроса на проведение ранних расчетов или Постоянного поручения на проведение ранних расчетов, обязательства и требования такого Участника клиринга и Клирингового центра (по сделкам, заключенным с центральным контрагентом) с наступившей Датой исполнения включаются в соответствующий клиринговый пул в Дату исполнения ранее времени, установленного соответствующим временным регламентом (в случае, если такая возможность предусмотрена соответствующей частью Правил клиринга).

38.2.1. Запрос на проведение ранних расчетов действует в день его предоставления.

38.2.2. Постоянное поручение на проведение ранних расчетов исполняется Клиринговым центром каждый Расчетный день, начиная с первого Расчетного дня, следующего за датой предоставления указанного поручения.

Постоянное поручение на проведение ранних расчетов действует до его отмены Участником клиринга.

Участник клиринга вправе отменить Постоянное поручение на проведение ранних расчетов.

38.2.3. После получения от Участника клиринга Запроса на проведение ранних расчетов Клиринговый центр посредством ПТК ТЦ передает Бирже информацию о проведении ранних расчетов в отношении Участника клиринга, предоставившего Клиринговому центру Запрос на проведение ранних расчетов без указания времени.

Клиринговый центр посредством ПТК ТЦ передает Бирже информацию о проведении ранних расчетов в отношении Участников клиринга, предоставивших Клиринговому центру Запросы на проведение ранних расчетов или Постоянные поручения на проведение ранних расчетов с указанием времени.

38.3. Участник клиринга имеет право завершить заключение Сделок с Клиринговым центром с Датой исполнения, отличной от текущей, ранее установленного Биржей времени окончания торгов. Для реализации указанного права Участник клиринга должен предоставить Клиринговому центру Запрос на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром или Постоянное поручение на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром.

38.3.1. Запрос на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром действует в день его предоставления.

38.3.2. Постоянное поручение на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром исполняется Клиринговым центром каждый Расчетный день, начиная с первого Расчетного дня, следующего за датой предоставления указанного поручения.

Постоянное поручение на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром действует до его отмены Участником клиринга.

Участник клиринга вправе отменить Постоянное поручение на завершение заключения сделок с Клиринговым центром.

38.3.3. Клиринговый центр посредством ПТК ТЦ передает Бирже информацию о раннем завершении заключения Сделок с Клиринговым центром в отношении Участников клиринга, предоставивших Клиринговому центру Запросы на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром или Постоянные поручения на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром.

38.4. Не допускается подача Запроса на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром и Постоянного поручения на завершение заключения сделок с Клиринговым центром в отношении основного Расчетного кода для списания комиссионных вознаграждений.

38.5. Если Участник клиринга предоставил Запрос или Постоянное поручение на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром и не предоставил Запрос или Постоянное поручение на проведение ранних расчетов или предоставил Запрос или Постоянное поручение на проведение ранних расчетов с временем исполнения после времени исполнения Запроса или Постоянного поручения на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром, при исполнении Запроса или Постоянного поручения на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром в отношении такого Участника клиринга Клиринговый центр осуществляет действия, предусмотренные пунктом 38.2 общей части Правил клиринга.

38.6. Для Расчетных кодов Единого пула Запрос на проведение ранних расчетов и Постоянное поручение на проведение ранних расчетов, Запрос на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром и Постоянное поручение на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром действуют одновременно в отношении двух биржевых рынков: фондового рынка и рынка депозитов, валютного рынка и рынка драгоценных металлов.

38.7. Запрос на проведение ранних расчетов, Постоянное поручение на проведение ранних расчетов, Запрос на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром, Постоянное поручение на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром не исполняются в отношении Расчетного кода Участника клиринга в случае, если по такому Расчетному коду учитывается неисполненное Маржинальное требование.

38.8. Участник клиринга, предоставивший Запрос на проведение ранних расчетов и Постоянное поручение на проведение ранних расчетов, Запрос на раннее

завершение заключения сделок с Клиринговым центром и Постоянное поручение на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром вправе возобновить заключение сделок с Клиринговым центром с соответствующими Датами исполнения.

38.8.1. Для возобновления заключения сделок с Клиринговым центром Участник клиринга обязан предоставить Клиринговому центру Запрос на возобновление заключения сделок с Клиринговым центром.

38.8.2. В Запросе на возобновление заключения сделок с Клиринговым центром Участник клиринга указывает тип сделок, для которых действует запрос:

- «TOD», означающий запрос на возобновление заключения сделок с Клиринговым центром с исполнением в дату заключения;
- «TOM», означающий запрос на возобновление заключения сделок с Клиринговым центром с исполнением не ранее, чем в следующий Расчетный день за датой заключения.

38.8.3. Сразу после получения от Участника клиринга Запроса на возобновление заключения сделок с Клиринговым центром Клиринговый центр направляет Бирже уведомление о необходимости возобновления заключения сделок с Клиринговым центром с соответствующими Датами исполнения.

38.9. В случае предоставления Участником клиринга Запроса на возобновление заключения сделок с Клиринговым центром повторное предоставление Участником клиринга соответствующего Запроса на проведение ранних расчетов или Запроса на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром в этот же Расчетный день не допускается, повторное исполнение Клиринговым центром соответствующего Постоянного поручения на проведение ранних расчетов или Постоянного поручения на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром в этот же Расчетный день не осуществляется.

## Статья 39. Порядок исполнения обязательств и требований по денежным средствам / драгоценным металлам Участников клиринга и Клирингового центра

39.1. В срок, установленный соответствующим Временным регламентом, Клиринговый центр определяет Итоговые нетто-обязательства и/или Итоговые нетто-требования по денежным средствам / драгоценным металлам каждого Участника клиринга по каждому Расчетному коду по обязательствам, включенным в соответствующий клиринговый пул в порядке, установленном статьей 40 общей части Правил клиринга или соответствующей специальной частью Правил клиринга.

39.2. Участник клиринга обязан исполнить свои Итоговые нетто-обязательства по денежным средствам / драгоценным металлам, определенные в соответствующем клиринговом пуле, в срок, установленный соответствующим Временным регламентом.

39.3. Для исполнения (прекращения) Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам / драгоценным металлам, учитываемого по Расчетному коду, используется Обеспечение Участника клиринга в

соответствующих денежных средствах / драгоценных металлах, учитываемое по тому же Расчетному коду.

Для исполнения Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам, учитываемого по Расчетному коду имущественного пула, используется имущество, внесенное в имущественный пул в порядке, определенном Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, учитываемое по тому же Расчетному коду имущественного пула.

Обеспечение / имущество, учитываемое по другим Расчетным кодам этого же Участника клиринга, не используется, за исключением случаев, специально установленных Правилами клиринга.

39.3.1. Датой и временем перечисления Участниками клиринга денежных средств на счета Клирингового центра являются дата и время зачисления денежных средств на соответствующие счета Клирингового центра, открытые в Расчетных банках и Расчетных организациях.

39.3.2. Датой и временем внесения Участником клиринга драгоценных металлов в Обеспечение являются дата и время зачисления драгоценных металлов на Счет обеспечения в драгоценном металле Участника клиринга / на торговый банковский счет в драгоценных металлах Участника клиринга.

39.3.3. Перечисление денежных средств позже установленного срока с зачислением их ранее даты перевода (back value) не разрешается.

39.4. В случае исполнения Итогового нетто-обязательства по денежным средствам с нарушением срока, установленного соответствующим Временным регламентом, и/или наличия неисполненного Итогового нетто-обязательства по денежным средствам после выполнения Клиринговым центром действий в соответствии со статьей 42 общей части Правил клиринга или Правилами клиринга на товарном рынке, и/или наличия Задолженности Участника клиринга на момент времени, установленный Временным регламентом на срочном рынке, Участник клиринга любой категории, кроме категории «К», обязан уплатить Клиринговому центру штраф за ненадлежащее исполнение денежных обязательств, размер которого рассчитывается по формуле:

Penalty = D × C × R × n / 365, где

Penalty – сумма штрафа за ненадлежащее исполнение денежных обязательств, в российских рублях,

D – сумма ненадлежаще исполненного Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам в соответствующей валюте, в том числе, в российских рублях / сумма Задолженности в соответствующей валюте,

C – курс иностранной валюты к российскому рублю, установленный Банком России на дату расчета штрафа,

R – ставка, установленная Клиринговым центром в соответствии с Методикой определения риск-параметров валютного рынка и рынка драгоценных металлов и применяемая для случаев урегулирования обязательств по Сделкам с частичным обеспечением, для исполнения которых недостаточно денежных средств,

n – количество календарных дней между датой расчета суммы штрафа и следующим Расчетным днем по соответствующей валюте.

Сумма штрафа, рассчитанная в соответствии с настоящим пунктом общей части Правил клиринга, не облагается НДС.

Обязательство по уплате штрафа за ненадлежащее исполнение денежных обязательств, рассчитанное в соответствии с настоящим пунктом общей части Правил клиринга, учитывается по тому же Расчетному коду Участника клиринга, по которому учитывается ненадлежаще исполненное Итоговое нетто-обязательство Участника клиринга по денежным средствам / Задолженность, а в случае предоставления Участником клиринга Запроса о выборе основного Расчетного кода для списания комиссионных вознаграждений в соответствии с пунктом 53.9 общей части Правил клиринга, в котором указан признак, означающий, что с основного Расчетного кода для списания комиссионных вознаграждений, указанного в таком запросе, необходимо также удерживать штраф за ненадлежащее исполнение денежных обязательств, - с основного Расчетного кода для списания комиссионных вознаграждений, указанного в таком запросе.

Указанное обязательство по уплате штрафа должно быть исполнено в срок, установленный Временным регламентом.

39.5. Клиринговый центр исполняет Итоговые нетто-требования Участника клиринга, учитываемые по Расчетному коду и/или клиринговым регистрам, соответствующим Расчетному коду, определенные в соответствующем клиринговом пуле, при условии исполнения Участником клиринга своих Итоговых нетто-обязательств, учитываемых по такому Расчетному коду и/или клиринговым регистрам, соответствующим такому Расчетному коду, определенных в том же клиринговом пуле, и/или наличия Обеспечения Участника клиринга, учитываемого по тому же Расчетному коду, достаточного для прекращения таких Итоговых нетто-обязательств.

39.6. В срок, установленный соответствующим Временным регламентом, Клиринговый центр осуществляет исполнение / прекращение Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований по денежным средствам / драгоценным металлам.

В случае наличия Обеспечения Участника клиринга, необходимого для исполнения Итогового нетто-обязательства, Клиринговый центр вправе исполнить / прекратить такое Итоговое нетто-обязательство Участника клиринга и соответствующее ему Итоговое нетто-требование / соответствующие ему Итоговые нетто-требования такого Участника клиринга раньше срока, установленного соответствующим Временным регламентом.

39.7. Клиринговый центр зачитывает Итоговое нетто-обязательство Участника клиринга в соответствующей валюте, учитываемое по Расчетному коду Участника клиринга, с требованием Участника клиринга по возврату Обеспечения Участника клиринга в такой валюте, учитываемое по тому же Расчетному коду Участника клиринга.

Итоговое нетто-обязательство Участника клиринга в соответствующей валюте прекращается в объеме, равном минимальному из двух значений: (1) размеру такого Итогового нетто-обязательства и (2) размеру Обеспечения Участника клиринга в такой валюте.

При этом размер Итогового нетто-обязательства и Обеспечения Участника клиринга в соответствующей валюте, учитываемых по Расчетному коду Участника

клиринга, уменьшаются на сумму прекращенного Итогового нетто-обязательства в такой валюте.

39.8. Итоговое нетто-обязательство Участника клиринга в соответствующем драгоценном металле, учитываемое по Расчетному коду Участника клиринга, исполняется за счет Обеспечения Участника клиринга в этом драгоценном металле, учитываемого по тому же Расчетному коду Участника клиринга.

Итоговое нетто-обязательство Участника клиринга в соответствующем драгоценном металле исполняется в объеме, равном минимальному из двух значений: (1) размеру такого Итогового нетто-обязательства и (2) размеру Обеспечения Участника клиринга в таком драгоценном металле.

Клиринговый центр списывает соответствующий драгоценный металл в количестве, равном объему исполненного Итогового нетто-обязательства Участника клиринга в этом драгоценном металле, со Счета обеспечения Участника клиринга в таком драгоценном металле, соответствующего Расчетному коду Участника клиринга, в счет исполнения Итогового нетто-обязательства Участника клиринга в этом драгоценном металле.

При этом размер Обеспечения Участника клиринга в соответствующем драгоценном металле, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, уменьшается на сумму исполненного Итогового нетто-обязательства в этом драгоценном металле.

39.9. Итоговое нетто-обязательство Участника клиринга по денежным средствам в соответствующей валюте / по драгоценным металлам, для исполнения которого недостаточно денежных средств / драгоценных металлов, урегулируется в порядке, установленном статьей 42 общей части Правил клиринга, в сроки, установленные соответствующим Временным регламентом.

Итоговое нетто-обязательство по денежным средствам, учитываемое по Расчетному коду Участника клиринга, не прекращенное по итогам действий, выполненных в соответствии с настоящей статьей общей части Правил клиринга, прекращается возникновением Задолженности Участника клиринга перед Клиринговым центром, учитываемой по такому Расчетному коду Участника клиринга.

Специальной частью Правил клиринга может быть установлен особый порядок урегулирования неисполненных Итоговых нетто-обязательств по денежным средствам.

39.10. Итоговое нетто-требование Участника клиринга в соответствующей валюте, учитываемое по Расчетному коду Участника клиринга, прекращается возникновением обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга Обеспечения в такой валюте в размере Итогового нетто-требования Участника клиринга в такой валюте, учитываемого по тому же Расчетному коду Участника клиринга.

При этом размер Обеспечения Участника клиринга в соответствующей валюте, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, увеличивается на сумму прекращенного Итогового нетто-требования Участника клиринга в такой валюте.

39.11. Для исполнения Итогового нетто-требования Участника клиринга в соответствующем драгоценном металле, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, Клиринговый центр зачисляет соответствующий драгоценный металл в количестве, равном объему Итогового нетто-требования Участника клиринга в этом драгоценном металле, на Счет обеспечения Участника клиринга в таком драгоценном металле, соответствующий Расчетному коду Участника клиринга.

При этом размер Обеспечения Участника клиринга в соответствующем драгоценном металле, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, увеличивается на сумму исполненного Итогового нетто-требования Участника клиринга в этом драгоценном металле.

39.12. При наличии Итогового нетто-требования, а также иных предусмотренных Правилами клиринга требований Участника клиринга, являющихся доходом Участника клиринга – нерезидента, Клиринговый центр в установленных российским налоговым законодательством случаях как налоговый агент удерживает сумму налога на доходы иностранных организаций.

39.13. Клиринговый центр также учитывает информацию о прекращении обязательств по денежным средствам / драгоценным металлам по Сделкам с наступившей Датой исполнения, заключенным с указанием Торгово-клирингового счета 2-го уровня, по Расчетному коду 2-го уровня, входящему в состав Торгово-клирингового счета 2-го уровня, указанного в заявке на заключение такой Сделки, без учета проверки достаточности Обеспечения, информация о котором учитывается по Расчетному коду 2-го уровня.

Клиринговый центр также учитывает информацию о прекращении обязательств по денежным средствам / драгоценным металлам по Сделкам с наступившей Датой исполнения, заключенным с указанием Торгово-клирингового счета 3-го уровня, по Расчетному коду 3-го уровня, входящему в состав Торгово-клирингового счета 3-го уровня, указанного в заявке на заключение такой Сделки, и по Расчетному коду 2-го уровня, соответствующему Торгово-клиринговому счету 3-го уровня, указанного в заявке на заключение такой Сделки, без учета проверки достаточности Обеспечения, информация о котором учитывается по Расчетному коду 2-го и/или 3-го уровня.

При этом размер Обеспечения в соответствующей валюте / соответствующем драгоценном металле, информация о котором учитывается по Расчетному коду 2-го / 3-го уровня, уменьшается / увеличивается на сумму Нетто-обязательства / Нетто-требования в такой иностранной валюте / таком драгоценном металле с наступившей Датой исполнения, информация о котором учитывается по соответствующему Расчетному коду 2-го / 3-го уровня.

### Статья 40. Порядок формирования Единого клирингового пула

40.1. В каждый Расчетный день Клиринговый центр формирует Единый клиринговый пул из следующих обязательств и требований с наступившей Датой исполнения, учитываемых по Расчетным кодам, открытым для фондового рынка и рынка депозитов, и Расчетным кодам Единого пула в Клиринговой системе фондового рынка и рынка депозитов:

- Задолженности Участника клиринга в российских рублях, возникшие в предыдущий Расчетный день и не погашенные на момент определения Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований по денежным средствам в российских рублях (для первого в течение Расчетного дня определения Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований по денежным средствам в российских рублях);
- предыдущее определенное в течение Расчетного дня Итоговое нетто-обязательство / Итоговое нетто-требование по денежным средствам в соответствующей валюте (для второго и последующих в течение Расчетного дня определения Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований по денежным средствам в соответствующей валюте);
- обязательства и требования Участника клиринга и Клирингового центра по денежным средствам и ценным бумагам по Сделкам Т+ с наступившей Датой исполнения, не обеспеченные средствами под исполнение на момент определения Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований по ценным бумагам;
- обязательства и требования Участника клиринга и Клирингового центра по денежным средствам в российских рублях и иностранной валюте / по драгоценным металлам по Сделкам с наступившей Датой исполнения, полученные из Клиринговой системы валютного рынка и рынка драгоценных металлов (для Расчетных кодов Единого пула);
- обязательства по уплате / требования по получению вариационной маржи и премии, определенные в соответствии с Правилами клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов и Правилами клиринга на срочном рынке (для Расчетных кодов Единого пула);
- обязательства и требования Участника клиринга и Клирингового центра по денежным средствам и ценным бумагам с наступившей Датой исполнения по Сделкам Т+, заключенным в соответствии со статьями 43-47 общей части Правил клиринга;
- обязательства по передаче / требования по получению Дохода, определенные в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов;
- обязательства Участника клиринга по уплате комиссионных вознаграждений, определенные в соответствии с общей частью Правил клиринга и Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов;
- обязательства Участника клиринга по уплате комиссионных вознаграждений, определенные в соответствии с Правилами клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов и Правилами клиринга на срочном рынке (для Расчетных кодов Единого пула);
- обязательства Участника клиринга по уплате штрафов, пеней, неустоек, отступного, определенные в соответствии с общей частью Правил клиринга и Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов;
- обязательства Участника клиринга по уплате штрафов, пеней, неустоек, отступного, определенные в соответствии с Правилами клиринга на срочном рынке (для Расчетных кодов Единого пула);
- обязательства Участника клиринга уплатить Клиринговому центру денежные средства в сумме, равной номинальной стоимости клиринговых сертификатов

участия, в отношении которых Участником клиринга не были исполнены обязательства перед Банком России по второй части договора репо, и требования Участника клиринга к Клиринговому центру по получению клиринговых сертификатов участия в количестве, равном полученному Клиринговым центром от Банка России, с наступившей Датой исполнения, определенные в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов;

- иные денежные обязательства Участника клиринга, предусмотренные Правилами клиринга.

40.1.1. Обязательства и требования Участника клиринга и Клирингового центра с наступившей Датой исполнения включаются в Единый клиринговый пул в сроки, установленные Временным регламентом.

40.1.2. Участники клиринга вправе подавать Запросы на проведение ранних расчетов и Постоянные поручения на проведение ранних расчетов, Запросы на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром и Постоянные поручения на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром в отношении Расчетных кодов Единого пула и Расчетных кодов, открытых для фондового рынка и рынка депозитов.

Порядок подачи и исполнения указанных запросов и поручений определен статьей 38 общей части Правил клиринга.

40.2. Нетто-обязательства / Нетто-требования с наступившей Датой исполнения по денежным средствам в российских рублях и иностранной валюте / драгоценным металлам, учитываемые по Расчетным кодам Единого пула в Клиринговой системе валютного рынка и рынка драгоценных металлов, с периодичностью не реже, чем 1 раз в 5 минут, передаются в Клиринговую систему фондового рынка и рынка депозитов.

Обязательства по уплате / требования по получению вариационной маржи и премии, и обязательства Участника клиринга по уплате комиссионных вознаграждений, определенные в Клиринговой системе валютного рынка и рынка драгоценных металлов и Клиринговой системе срочного рынка, после их определения передаются в Клиринговую систему фондового рынка и рынка депозитов.

При этом:

40.2.1. указанные обязательства и требования прекращают учитываться в Клиринговой системе срочного рынка / в Клиринговой системе валютного рынка и рынка драгоценных металлов и начинают учитываться в Клиринговой системе фондового рынка и рынка депозитов в составе Нетто-обязательства / Нетто-требования в соответствующей валюте / драгоценном металле / ценных бумагах с текущей Датой исполнения, учитываемых по Расчетному коду Единого пула;

40.2.2. Профили активов, учитываемые по Расчетному коду Единого пула в Клиринговой системе срочного рынка / в Клиринговой системе валютного рынка и рынка драгоценных металлов, изменяются на объем обязательств / требований, переданных в Клиринговую систему фондового рынка и рынка депозитов: Профили активов в денежных средствах / драгоценных металлах, в которых были переданы обязательства, уменьшаются на объем указанных обязательств, Профили

активов в денежных средствах / драгоценных металлах, в которых были переданы требования – увеличиваются на объем указанных требований;

40.2.3. Профили активов, учитываемые по Расчетному коду Единого пула в Клиринговой системе фондового рынка и рынка депозитов, изменяются на объем обязательств / требований, переданных в такую Клиринговую систему, противоположно изменению Профилей активов в Клиринговой системе валютного рынка и рынка драгоценных металлов / Клиринговой системе срочного рынка;

40.2.4. обязательства / требования, полученные из Клиринговой системы срочного рынка и Клиринговой системы валютного рынка и рынка драгоценных металлов, включаются в Единый клиринговый пул, участвуют в расчете Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований по ценным бумагам / драгоценным металлам / денежным средствам в соответствующей валюте в установленное Временным регламентом ближайшее после их передачи время определения соответствующих Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований и исполняются (прекращаются) в соответствии с настоящей статьей общей части Правил клиринга.

40.3. В момент определения Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований по ценным бумагам / драгоценным металлам / денежным средствам в соответствующей валюте в Едином клиринговом пуле, установленный Временным регламентом, Клиринговый центр прекращает однородные обязательства и требования Участника клиринга и Клирингового центра по денежным средствам, драгоценным металлам или ценным бумагам, включенные в Единый клиринговый пул, по каждому Расчетному коду Участника клиринга / Торгово-клиринговому счету Т+, и определяет Итоговое нетто-обязательство или Итоговое нетто-требование по денежным средствам / драгоценным металлам / ценным бумагам, возникшее в связи с прекращением обязательств и требований, указанных в настоящем пункте общей части Правил клиринга.

40.3.1. После определения Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований Клиринговый центр формирует и передает Участникам клиринга отчеты, содержащие информацию об Итоговых нетто-обязательствах / Итоговых нетто-требованиях по денежным средствам / драгоценным металлам / ценным бумагам.

40.4. Клиринговый центр вправе устанавливать Ограничительные лимиты по Торгово-клиринговому счету Т+ в размере Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по ценным бумагам, учитываемого по Торгово-клиринговому счету Т+, с момента определения Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований до момента исполнения Клиринговым центром Итоговых нетто-требований Участника клиринга.

### Статья 41. Порядок прекращения обязательств в Едином клиринговом пуле

41.1. В целях прекращения обязательств в Едином клиринговом пуле Клиринговый центр в сроки, установленные настоящей статьей общей части Правил клиринга и Временным регламентом:

41.1.1. формирует распоряжения на перевод ценных бумаг / денежных средств с Торгово-клирингового счета Т0 на Торгово-клиринговый счет Т+ в соответствии с пунктами 41.6-41.7 общей части Правил клиринга;

41.1.2. формирует распоряжение на перевод денежных средств / ценных бумаг с Торгово-клирингового счета имущественного пула на Торгово-клиринговый счет Т+ в соответствии с пунктом 41.8 общей части Правил клиринга;

41.1.3. направляет Расчетному депозитарию Запрос на подбор ценных бумаг в соответствии с пунктом 41.10 общей части Правил клиринга;

41.1.4. проверяет наличие денежных средств / драгоценных металлов / ценных бумаг, необходимых для исполнения Итоговых нетто-обязательств;

41.1.5. Участникам клиринга, у которых имеется Итоговое нетто-требование по ценным бумагам, не принимаемым в качестве обеспечения исполнения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением, Клиринговый центр устанавливает Ограничительный лимит в отношении значения Единого лимита по Расчетному коду на сумму, равную произведению размера Итогового нетто-требования по ценным бумагам, не принимаемым в качестве обеспечения исполнения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением, учитываемого по Торгово-клиринговому счету, в состав которого входит такой Расчетный код и Нижней границы диапазона оценки рыночных рисков 1-го уровня, на период заключения сделок РЕПО / сделок купли-продажи ценных бумаг, которые заключаются в случае наличия Итоговых нетто-обязательств по ценным бумагам, для исполнения которых недостаточно ценных бумаг;

41.1.6. в случае недостаточности денежных средств / драгоценных металлов / ценных бумаг / наличия у Участника клиринга Итогового нетто-требования по ценным бумагам, не принимаемым в качестве обеспечения исполнения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением, выполняет действия, предусмотренные статьей 42 общей части Правил клиринга;

41.1.7. осуществляет исполнение / прекращение Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований по денежным средствам / драгоценным металлам.

41.2. Действия, предусмотренные подпунктами 41.1.1-41.1.3 общей части Правил клиринга, также осуществляются в отношении предварительного Итогового нетто-обязательства по ценным бумагам, равного Нетто-обязательству по ценным бумагам с наступившей Датой исполнения, определенному на момент времени, установленный Временным регламентом.

41.3. В сроки, установленные Временным регламентом, Клиринговый центр проводит расчетные клиринговые сессии, в ходе которых осуществляет взаимодействие с Расчетным депозитарием с целью исполнения Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований по ценным бумагам и проведения расчетов по ценным бумагам по итогам клиринга.

41.4. Итоговые нетто-обязательства / Итоговые нетто-требования по денежным средствам / драгоценным металлам исполняются в порядке, определенном статьей 39 общей части Правил клиринга, с учетом особенностей, установленных настоящей статьей общей части Правил клиринга.

41.5. Для исполнения Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по ценным бумагам, учитываемого по Торгово-клиринговому счету Т+, используется Обеспечение Участника клиринга в соответствующих ценных бумагах, учитываемое по тому же Торгово-клиринговому счету Т+. Обеспечение, учитываемое по другим Торгово-клиринговым счетам этого же Участника клиринга, не используется, за исключением случаев, установленных подпунктами 41.6, 41.8 общей части Правил клиринга.

Для исполнения Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по ценным бумагам, учитываемого по Торгово-клиринговому счету имущественного пула, используется имущество, внесенное в имущественный пул в порядке, определенном Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, учитываемое по тому же Торгово-клиринговому счету имущественного пула. Имущество, учитываемое по другим Торгово-клиринговым счетам имущественного пула этого же Участника клиринга, не используется.

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

41.6. Если для исполнения Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по ценным бумагам, учитываемого по Торгово-клиринговому счету Т+, недостаточно ценных бумаг, и у Участника клиринга открыт Торгово-клиринговый счет Т0, связанный с указанным Торгово-клиринговым счетом Т+, Клиринговый центр вправе с момента определения Итоговых нетто-обязательств и Итоговых нетто-требований Участников клиринга по ценным бумагам, сформировать в Клиринговой системе распоряжение на перевод ценных бумаг с целью их внесения в Обеспечение в количестве, недостающем для исполнения Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по ценным бумагам, либо в размере Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по ценным бумагам, в случае предоставления Участником клиринга Запроса на изменение параметров Торгово-клирингового счета, предусмотренного пунктом 31.18 общей части Правил клиринга и содержащего соответствующее указание.

Указанное в настоящем подпункте общей части Правил клиринга распоряжение на перевод ценных бумаг формируется при выполнении условий, указанных в подпункте 28.10.1 общей части Правил клиринга.

Указанное в настоящем подпункте общей части Правил клиринга распоряжение на перевод ценных бумаг не формируется, в случае предоставления Участником клиринга Запроса на изменение параметров Торгово-клирингового счета, содержащего указание не перечислять ценные бумаги с Торгово-клирингового счета Т0 на Торгово-клиринговый счет Т+ при исполнении обязательств по Сделкам.

Указанное в настоящем подпункте общей части Правил клиринга распоряжение на перевод ценных бумаг может формироваться Клиринговым центром неоднократно в течение указанного периода времени.

41.7. Если для исполнения Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам, учитываемого по Расчетному коду, недостаточно денежных средств, и такой Расчетный код Участника клиринга связан со Счетом обеспечения Т0, Клиринговый центр вправе с момента определения Итоговых нетто-обязательств и Итоговых нетто-требований Участников клиринга по денежным средствам и до установленного Временным регламентом времени исполнения Участниками клиринга Итоговых нетто-обязательства по денежным средствам, сформировать в Клиринговой системе распоряжение на перевод денежных средств с целью их внесения в Обеспечение в сумме, недостающей для исполнения Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам, либо в размере Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам, в случае предоставления Участником клиринга Запроса на изменение параметров Торгово-клирингового счета, предусмотренного пунктом 31.18 общей части Правил клиринга и содержащего соответствующее указание.

Указанное в настоящем подпункте общей части Правил клиринга распоряжение на перевод денежных средств формируется при выполнении условий, указанных в подпункте 28.10.1 общей части Правил клиринга.

Указанное в настоящем пункте общей части Правил клиринга распоряжение на перевод денежных средств не формируется, в случае предоставления Участником клиринга Запроса на изменение параметров Торгово-клирингового счета, содержащего указание не перечислять денежные средства со Счетов обеспечения Т0 на Счета обеспечения при исполнении обязательств по Сделкам.

Указанное в настоящем подпункте общей части Правил клиринга распоряжение на перевод денежных средств может формироваться Клиринговым центром неоднократно в течение указанного периода времени.

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

Указанное в настоящем подпункте общей части Правил клиринга распоряжение на перевод денежных средств / ценных бумаг формируется при выполнении условий, указанных в подпункте 28.10.1 общей части Правил клиринга, а распоряжение на перевод денежных средств в российских рублях формируется также при выполнении условий погашения клиринговых сертификатов участия, указанных в Правилах клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов для выдачи имущества из имущественного пула.

Одновременно с формированием распоряжения на перевод ценных бумаг или денежных средств в иностранной валюте, приводящего к нарушению условий

погашения клиринговых сертификатов участия, указанных в Правилах клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов для выдачи денежных средств из имущественного пула, Клиринговый центр формирует в Клиринговой системе распоряжение на перевод денежных средств в российских рублях с Расчетного кода, входящего в состав Торгово-клирингового счета Т+, на Расчетный код имущественного пула, входящий в состав Торгово-клирингового счета имущественного пула, в сумме, недостающей для выполнения условий погашения клиринговых сертификатов участия, указанных в Правилах клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

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

Указанное денежное обязательство Участника пула включается в Единый клиринговый пул в соответствии со статьей 40 общей части Правил клиринга.

Указанное в настоящем подпункте общей части Правил клиринга распоряжение на перевод денежных средств / ценных бумаг может формироваться Клиринговым центром неоднократно в течение указанного периода времени.

41.9. Распоряжения на перевод ценных бумаг / денежных средств между Торгово-клиринговым счетом Т0 / Торгово-клиринговым счетом имущественного пула и Торгово-клиринговым счетом Т+ исполняются в соответствии с подпунктами 28.10.4-28.10.4 общей части Правил клиринга.

41.10. Запросы на подбор ценных бумаг направляются Расчетному депозитарию в сроки, установленные Временным регламентом.

Запросы на подбор ценных бумаг направляются в отношении Участников клиринга, соответствующих требованиям, установленным пунктом 12.22 общей части Правил клиринга.

В случае недостаточности ценных бумаг для исполнения Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по ценным бумагам / предварительного Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по ценным бумагам (за исключением клиринговых сертификатов участия) в Запросе на подбор ценных бумаг указываются код и количество ценных бумаг, соответствующие Итоговому нетто-обязательству Участника клиринга по ценным бумагам / предварительному Итоговому нетто-обязательству Участника клиринга по ценным бумагам, для исполнения которого недостаточно ценных бумаг, и Раздела Т+, входящего в состав Торгово-клирингового счета Т+, по которому учитывается указанное обязательство.

В случае недостаточности клиринговых сертификатов участия для исполнения Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по ценным бумагам / предварительного Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по ценным бумагам в Запросе на подбор ценных бумаг указывается сумма, соответствующая количеству клиринговых сертификатов участия в Итоговом нетто-обязательстве Участника клиринга по ценным бумагам / предварительном Итоговом нетто-обязательстве Участника клиринга по ценным бумагам, для исполнения которого недостаточно клиринговых сертификатов участия, и субсчетов депо

имущественного пула, входящих в состав Торгово-клирингового счета имущественного пула, соответствующего Торгово-клиринговому счету Т+, по которому учитывается указанное Итоговое нетто-обязательство / предварительное Итоговое нетто-обязательство Участника клиринга по ценным бумагам.

41.10.1. Расчетный депозитарий исполняет Запрос Клирингового центра на подбор ценных бумаг в соответствии с пунктами 30.6-30.7 общей части Правил клиринга.

41.11. Ценные бумаги, зачисленные на Раздел Т+ по итогам исполнения Расчетным депозитарием Запроса Клирингового центра на подбор ценных бумаг, или распоряжения на перевод ценных бумаг с Торгово-клирингового счета Т0 / Торгово-клирингового счета имущественного пула на Торгово-клиринговый счет Т+, учитываются в качестве Обеспечения Участника клиринга по соответствующему Торгово-клиринговому счету Т+ и используются для исполнения Итогового нетто-обязательства по ценным бумагам, учитываемого по такому Торгово-клиринговому счету Т+.

41.12. Ценные бумаги, зачисленные на субсчет депо имущественного пула по итогам исполнения Расчетным депозитарием Запроса Клирингового центра на подбор ценных бумаг, или распоряжения на перевод денежных средств с Торгово-клирингового счета Т+ на Торгово-клиринговый счет имущественного пула, вносятся в соответствующий имущественный пул. На имущество, внесенное в соответствующий имущественный пул, Клиринговый центр выдает клиринговые сертификаты участия в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов. Выданные клиринговые сертификаты участия используются для исполнения Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по ценной бумаге клиринговый сертификат участия.

41.13. Если по итогам действий, предусмотренных подпунктами 41.1.1-41.1.3 общей части Правил клиринга, на момент времени, установленный соответствующим Временным регламентом, для исполнения Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам, драгоценным металлам и/или ценным бумагам недостаточно денежных средств / драгоценных металлов / ценных бумаг, данный Участник клиринга признается Недобросовестным участником клиринга, и Клиринговый центр выполняет действия, предусмотренные статьей 42 общей части Правил клиринга.

41.14. По Итоговым нетто-обязательствам Участников клиринга по денежным средствам / драгоценным металлам / ценным бумагам, для исполнения которых достаточно денежных средств / драгоценных металлов / ценных бумаг, и по соответствующих им Итоговым нетто-требованиям Участников клиринга по денежным средствам / драгоценным металлам / ценным бумагам, в том числе определенным по итогам выполнения действий, предусмотренных статьей 42 общей части Правил клиринга, Клиринговый центр изменяет суммы денежных средств / количества драгоценных металлов / ценных бумаг Участников клиринга, учитываемых по соответствующим Расчетным кодам / Торгово-клиринговым счетам.

41.14.1. В случае если Участником клиринга предоставлен Запрос на изменение параметров Торгово-клирингового счета, в соответствии с которым Участник клиринга дает указание Клиринговому центру перечислять ценные бумаги с Разделов Т+ на Разделы Т0 с целью возврата ценных бумаг, получаемых в результате прекращения

обязательств, включенных в Единый клиринговый пул, Клиринговый центр изменяет количество ценных бумаг, учитываемых по Торгово-клиринговым счетам Т+ / Торгово-клиринговым счетам Т0 в соответствии с Запросом на изменение параметров Торгово-клирингового счета.

Порядок предоставления и исполнения Запроса на изменение параметров Торгово-клирингового счета определен пунктами 31.17-31.18 общей части Правил клиринга.

41.15. Итоговые нетто-обязательства / Итоговые нетто-требования по ценным бумагам, в том числе определенные по итогам выполнения действий, предусмотренных статьей 42 общей части Правил клиринга, Клиринговый центр включает Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов с ближайшим временем формирования и исполняет (прекращает) их в порядке, определенном Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

## ПОДРАЗДЕЛ IV-V. ПОРЯДОК ДЕЙСТВИЙ, НАПРАВЛЕННЫХ НА ИСПОЛНЕНИЕ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ

Статьи 42-47 настоящего подраздела общей части Правил клиринга применяется в случае неисполнения (ненадлежащего исполнения) обязательств, учитываемых по Расчетным кодам Единого пула, Расчетным кодам Участника клиринга, открытым для фондового рынка и рынка депозитов, и Расчетным кодам Участника клиринга, открытым для валютного рынка и рынка драгоценных металлов, Расчетным кодам Участника клиринга, открытым для рынка Стандартизированных ПФИ.

### Статья 42. Порядок действий, направленных на исполнение обязательств, в случае наличия Итоговых нетто-обязательств, для исполнения которых недостаточно денежных средств / драгоценных металлов / ценных бумаг

42.1. В случае если для исполнения Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по ценным бумагам / денежным средствам / драгоценным металлам недостаточно соответствующих ценных бумаг / денежных средств / драгоценных металлов Клиринговый центр предпринимает предусмотренные настоящей статьей общей части Правил клиринга действия, направленные на прекращение таких Итоговых нетто-обязательств и соответствующих им Итоговых нетто-требований такого Недобросовестного участника клиринга, и действия, направленные на исполнение (прекращение) Итоговых нетто-требований Добросовестных участников клиринга.

42.2. В случае если для исполнения Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по ценным бумагам (за исключением клиринговых сертификатов участия), определенного в Едином клиринговом пуле, недостаточно ценных бумаг, Клиринговый центр в срок, установленный Временным регламентом, заключает с Недобросовестным участником клиринга сделку РЕПО или сделки / сделку купли-продажи ценных бумаг за российские рубли в соответствии со статьей 44 общей части Правил клиринга.

42.3. В случае если для исполнения Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по ценной бумаге клиринговый сертификат участия, определенного в Едином клиринговом пуле, недостаточно ценных бумаг, Клиринговый центр формирует в Клиринговой системе распоряжение на перевод денежных средств в российских рублях с Торгово-клирингового счета Т+, по которому учитывается Итоговое нетто-обязательство по ценной бумаге клиринговый сертификат участия, для исполнения которого недостаточно ценных бумаг на Торгово-клиринговый счет имущественного пула, соответствующий указанному Торгово-клиринговому счету Т+, в сумме, соответствующей номинальной стоимости клиринговых сертификатов участия, недостающих для исполнения Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по ценной бумаге.

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

Указанное денежное обязательство Участника пула включается в Единый клиринговый пул в соответствии со статьей 40 общей части Правил клиринга.

42.4. В случае если у Участника клиринга имеется Итоговое нетто-требование по ценным бумагам, не принимаемым в качестве обеспечения исполнения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением, учитываемое по Торгово-клиринговому счету Т+, и в результате исполнения (прекращения) указанного Итогового нетто-требования по ценным бумагам Единый лимит по такому Расчетному коду станет отрицательным, Клиринговый центр в срок, установленный Временным регламентом, заключает с Недобросовестным участником клиринга сделку РЕПО или сделки / сделку купли-продажи ценных бумаг за российские рубли в соответствии со статьей 44 общей части Правил клиринга.

42.5. В случае если для исполнения Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам в российских рублях недостаточно денежных средств в российских рублях, Клиринговый центр в срок, установленный соответствующим Временным регламентом, осуществляет действия в следующей последовательности (каждое последующее действие выполняется в случае, если предыдущее действие не привело к исполнению соответствующего обязательства):

1) заключает с Недобросовестным участником клиринга сделку своп или сделку купли-продажи иностранной валюты за российские рубли в соответствии со статьей 43 общей части Правил клиринга;
2) заключает с Недобросовестным участником клиринга сделку РЕПО или сделки / сделку купли-продажи ценных бумаг за российские рубли в соответствии со статьей 44 общей части Правил клиринга.

42.6. В случае если для исполнения Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам в иностранной валюте недостаточно денежных средств в соответствующей иностранной валюте, Клиринговый центр в срок, установленный соответствующим Временным регламентом, осуществляет действия в следующей последовательности (каждое последующее действие выполняется в случае, если предыдущее действие не привело к исполнению соответствующего обязательства):

1) заключает с Недобросовестным участником клиринга сделку своп или сделку купли-продажи с иностранной валютой за другую иностранную валюту в соответствии со статьей 43 общей части Правил клиринга;
3) заключает с Недобросовестным участником клиринга сделку своп или сделку купли-продажи иностранной валюты за российские рубли в соответствии со статьей 43 общей части Правил клиринга.

42.7. В случае если для исполнения Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по драгоценным металлам недостаточно соответствующих драгоценных металлов, Клиринговый центр в срок, установленный соответствующим Временным регламентом, заключает с Недобросовестным участником клиринга сделку своп или сделку / сделки купли-продажи с драгоценным металлом за российские рубли в соответствии со статьей 43 общей части Правил клиринга.

42.8. В случае если Итоговое нетто-обязательство по денежным средствам / драгоценным металлам, для исполнения которого недостаточно денежных средств /

драгоценных металлов, по одному и тому же Расчетному коду Участника клиринга возникает третий Расчетный день подряд, или в случае если Итоговое нетто-обязательство по ценным бумагам, для исполнения которого недостаточно ценных бумаг, по одному и тому же Торгово-клиринговому счету Участника клиринга возникает пятый Расчетный день подряд, с Участника клиринга взимается штраф, рассчитываемый по формуле:

Penalty = ROUND (VAL_OBL × C × K × R / 365;2), где

Penalty – сумма штрафа, в российских рублях,

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

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

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

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

Сумма штрафа, рассчитанная в соответствии с настоящим пунктом общей части Правил клиринга, не облагается НДС.

Обязательство по уплате штрафа, рассчитанное в соответствии с настоящим пунктом общей части Правил клиринга, учитывается по Расчетному коду для списания комиссионных вознаграждений, порядок определения которого установлен пунктом 53.9 общей части Правил клиринга.

Обязательство по уплате штрафа должно быть исполнено в срок, установленный Временным регламентом.

42.8.1. В случае исполнения Участником клиринга Итогового нетто-обязательства по денежным средствам в российских рублях или иностранной валюте / драгоценным металлам / ценным бумагам, учитываемого по одному Расчетному коду / Торгово-клиринговому счету, для исполнения которого было недостаточно денежных средств в российских рублях / такой иностранной валюте / таком драгоценном металле / таких ценных бумаг в предыдущий Расчетный день (предыдущие Расчетные дни), количество Расчетных дней, в течение которых у Участника клиринга возникало Итоговое нетто-обязательство по денежным средствам / драгоценным металлам / ценным бумагам, для исполнения которого недостаточно денежных средств / драгоценных металлов / ценных бумаг, по такому Расчетному коду / Торгово-клиринговому счету, устанавливается равным нулю.

42.8.2. В случае начисления штрафа в соответствии с настоящим пунктом общей части Правил клиринга, количество Расчетных дней, в течение которых у Участника клиринга возникало Итоговое нетто-обязательство по денежным средствам / драгоценным металлам / ценным бумагам, для исполнения которого недостаточно

денежных средств / драгоценных металлов / ценных бумаг, по Расчетному коду / Торгово-клиринговому счету, устанавливается равным нулю.

42.9. При наличии Недобросовестных участников клиринга, имеющих Итоговые нетто-обязательства по денежным средствам / драгоценным металлам / ценным бумагам, для исполнения которых недостаточно денежных средств / драгоценных металлов / ценных бумаг, для исполнения Итоговых нетто-требований по денежным средствам / драгоценным металлам / ценным бумагам Добросовестных участников клиринга Клиринговый центр выполняет действия в следующей последовательности:

42.9.1. использует свободные собственные денежные средства / драгоценные металлы и/или собственные ценные бумаги по усмотрению Клирингового центра;

42.9.2. заключает с Уполномоченными участниками клиринга (за исключением Банка России) сделки своп с иностранной валютой / драгоценными металлами.

Базовый курс и цена сделки своп, заключаемой Клиринговым центром с Уполномоченным участником клиринга, за исключением Банка России, определяются в соответствии с договором, заключенным Клиринговым центром с соответствующим Уполномоченным участником клиринга;

42.9.3. в случае невозможности заключения сделок своп с Уполномоченными участниками клиринга (за исключением Банка России), заключает сделки своп с иностранной валютой с Банком России в соответствии с Договором о взаимодействии.

Условия сделок своп, заключаемых Клиринговым центром с Банком России, и порядок их исполнения определены Договором о взаимодействии;

42.9.4. в случае невозможности заключения сделок своп с Уполномоченными участниками клиринга, включая Банк России, заключает сделку своп / сделку купли-продажи с иностранной валютой / драгоценным металлом с Добросовестными участниками клиринга в соответствии со статьей 45 общей части Правил клиринга;

42.9.5. заключает Сделки РЕПО Клирингового центра в соответствии со статьей 46 общей части Правил клиринга;

42.9.6. в случае невозможности заключения Сделок РЕПО Клирингового центра в соответствии со статьей 46 общей части Правил клиринга заключает сделки РЕПО и/или две сделки / сделку купли-продажи ценных бумаг с Добросовестными участниками клиринга в соответствии со статьей 47 общей части Правил клиринга.

42.10. После заключения с Участниками клиринга сделок, указанных в настоящей статье общей части Правил клиринга, Клиринговый центр включает обязательства по указанным сделкам с наступившей Датой исполнения в соответствующий клиринговый пул и прекращает однородные Итоговые нетто-обязательства / Итоговые нетто-требования по денежным средствам / драгоценным металлам или ценным бумагам и обязательства и требования по указанным заключенным сделкам с наступившей Датой исполнения возникновением Итогового нетто-обязательства / Итогового нетто-требования по денежным средствам / драгоценным металлам / ценным бумагам.

Прекращение указанного Итогового нетто-обязательства / Итогового нетто-требования Участника клиринга по денежным средствам / драгоценным металлам осуществляется в порядке, определенном статьей 39 общей части Правил клиринга.

Для исполнения указанного Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по ценным бумагам, учитываемого по Торгово-клиринговому счету Т+, используется Обеспечение Участника клиринга в соответствующих ценных бумагах, учитываемое по тому же Торгово-клиринговому счету Т+.

Итоговое нетто-обязательство по денежным средствам, учитываемое по Расчетному коду Участника клиринга, не прекращенное по итогам действий, выполненных в соответствии с настоящей статьей общей части Правил клиринга, прекращается возникновением Задолженности Участника клиринга перед Клиринговым центром, учитываемой по такому Расчетному коду Участника клиринга.

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

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

Задолженность Участника клиринга считается погашенной, если значение клирингового регистра, предназначенного для учета Обеспечения в соответствующей валюте по Расчетному коду Участника клиринга, по которому учитывалась Задолженность, является неотрицательным.

42.12. Для урегулирования непогашенной Задолженности Участника клиринга 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 статьей 48 общей части Правил клиринга (начинает процедуру кросс-дефолта в отношении Участника клиринга).

## Статья 43. Порядок заключения и условия сделок своп / сделки купли-продажи с иностранной валютой / драгоценным металлом, заключаемых с Недобросовестными участниками клиринга

43.1. Сделки своп с иностранной валютой / драгоценным металлом, указанные в пунктах 42.5, 42.6 общей части Правил клиринга, заключаются при соблюдении следующих условий:

43.1.1. у Участника клиринга не отозвана (не аннулирована) лицензия Банка России на осуществление банковских операций со средствами в рублях и иностранной валюте;

43.1.2. у Участника клиринга – Банка-нерезидента не отозвано (не аннулировано) специальное разрешение (лицензия или иное основание) компетентного органа государства учреждения Банка-нерезидента, в соответствии с которым Банк-нерезидент имеет право осуществлять банковские операции;

43.1.3. допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию на соответствующем биржевом рынке не приостановлен;

43.1.4. у Клирингового центра отсутствует информация об обстоятельствах в отношении Участника клиринга, перечисленных в статье 13 общей части Правил клиринга, при наступлении которых допуск к клиринговому обслуживанию Участника клиринга на соответствующем биржевом рынке будет приостановлен в следующий Расчетный день.

43.2. Сделки своп с иностранной валютой / драгоценным металлом заключаются Клиринговым центром без подачи заявок от имени Недобросовестного участника клиринга в отношении себя лично в случаях, установленных пунктами 42.5, 42.6 общей части Правил клиринга. Условия указанных сделок своп с иностранной валютой / драгоценным металлом соответствуют определенным Правилами торгов на валютном рынке условиям сделок своп с учетом следующих особенностей:

43.2.1. в случае наличия у Недобросовестного участника клиринга Итогового нетто-обязательства по денежным средствам в российских рублях, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, для исполнения которого недостаточно денежных средств, по первой части сделки своп у Недобросовестного участника клиринга возникают требования в российских рублях и обязательства в иностранной валюте / драгоценном металле (за исключением иностранных валют / драгоценных металлов, не принимаемых в качестве обеспечения исполнения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением), в объеме, соответствующем Итоговому нетто-обязательству в российских рублях, для исполнения которого недостаточно денежных средств, и кратном лоту, установленному Биржей, с округлением в большую сторону, а также не превышающем суммы Итогового нетто-требования Недобросовестного участника клиринга в иностранной валюте / драгоценном металле и Обеспечения Участника клиринга в такой иностранной валюте / таком драгоценном металле, учитываемого по тому же Расчетному коду Участника клиринга. Выбор иностранных валют / драгоценных металлов, в отношении которых заключается сделка своп, осуществляется Клиринговым центром;

43.2.2. в случае наличия у Недобросовестного участника клиринга Итогового нетто-обязательства по денежным средствам в иностранной валюте, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, для исполнения которого недостаточно денежных средств, по первой части сделки своп у Недобросовестного участника клиринга возникают требования в иностранной валюте в объеме, равном Итоговому нетто-обязательству в иностранной валюте, для исполнения которого недостаточно денежных средств, и обязательства в другой иностранной валюте, в объеме, соответствующем Итоговому нетто-обязательству в иностранной валюте, для исполнения которого недостаточно денежных средств, и кратном лоту, установленному Биржей, с округлением в большую сторону, а также не превышающем суммы Итогового нетто-требования Недобросовестного участника клиринга в такой другой иностранной валюте и Обеспечения Недобросовестного участника клиринга в такой другой иностранной валюте, учитываемого по тому же Расчетному коду Участника клиринга;

43.2.3. в случае наличия у Недобросовестного участника клиринга Итогового нетто-обязательства по денежным средствам в иностранной валюте / драгоценным металлам, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, для исполнения

которого недостаточно денежных средств / драгоценных металлов, по первой части сделки своп у Недобросовестного участника клиринга возникают требования в иностранной валюте / драгоценном металле в объеме, равном Итоговому нетто-обязательству в иностранной валюте / драгоценном металле, для исполнения которого недостаточно денежных средств / драгоценных металлов, и обязательства в российских рублях, в объеме, соответствующем Итоговому нетто-обязательству в иностранной валюте / драгоценном металле, для исполнения которого недостаточно денежных средств / драгоценных металлов;

43.2.4. Датой исполнения обязательств по первой части сделки своп является день ее заключения;

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

43.2.6. Базовый курс сделки своп устанавливается равным Центральному курсу иностранной валюты / драгоценного металла, определенному в соответствии с Методикой риск-параметров валютного рынка и рынка драгоценных металлов в 19:00 по московскому времени текущего Торгового дня.

Специальной частью Правил клиринга может быть установлен иной порядок определения базового курса сделки своп.

43.2.7. Цена сделки своп для Участника клиринга любой категории, кроме категории «К», рассчитывается по следующей формуле:

Swap_Price = Rc_ VAL1_VAL2 × S × n / 365, где

Swap_Price – цена сделки своп,

Rc_VAL1_VAL2 – Центральный курс сделок купли-продажи иностранной валюты / драгоценного металла VAL1 за валюту VAL2, определенный в соответствии с Методикой риск-параметров валютного рынка и рынка драгоценных металлов в 19:00 по московскому времени текущего Торгового дня,

VAL – валюта лота сделки своп,

S – ставка, установленная Клиринговым центром в соответствии с Методикой определения риск-параметров валютного рынка и рынка драгоценных металлов и применяемая для случаев урегулирования обязательств по Сделкам с частичным обеспечением, для исполнения которых недостаточно денежных средств,

n – количество календарных дней между датой исполнения первой и второй части сделки своп.

Цена сделки своп для Участника клиринга категории «К» равна нулю.

43.3. Клиринговый центр устанавливает для Расчетного кода Участника клиринга, по которому учитывается Итоговое нетто-обязательство, для исполнения которого недостаточно денежных средств / драгоценных металлов, Режим урегулирования, порядок применения которого определен в статье 35 общей части Правил клиринга, и от имени Недобросовестного участника клиринга в отношении себя лично заключает закрывающую сделку / закрывающие сделки купли-продажи с иностранной валютой / драгоценным металлом и заключает балансирующую сделку / балансирующие сделки, условия которых определены в пункте 43.5 общей части Правил клиринга, при несоблюдении любого из условий, указанных в подпунктах 43.1.3-43.1.4 общей части Правил клиринга, а также в случае, если:

43.3.1. Итоговое нетто-обязательство по денежным средствам в соответствующей валюте / по соответствующему драгоценному металлу, учитываемое по одному Расчетному коду, для исполнения которого недостаточно денежных средств / драгоценных металлов, возникает у Участника клиринга третий Расчетный день подряд.

43.4. Условие, указанное в подпункте 43.3.1 общей части Правил клиринга, не применяется, если причиной наличия Итогового нетто-обязательства, для исполнения которого недостаточно денежных средств / драгоценных металлов, является несвоевременное зачисление денежных средств на клиринговый банковский или корреспондентский счет Клирингового центра, вызванное проведением процедур комплаенс-контроля в банках-корреспондентах, сбоями в работе платежных систем, а также обстоятельствами непреодолимой силы, определенными в пункте 43.7 общей части Правил клиринга.

Участник клиринга обязан предоставить Клиринговому центру документы, подтверждающие действие причин, указанных в настоящем пункте общей части Правил клиринга.

43.5. Условия закрывающих сделок купли-продажи с иностранной валютой / драгоценным металлом и балансирующих сделок, заключаемых в соответствии с пунктом 43.3 общей части Правил клиринга, соответствуют определенным Правилами торгов на валютном рынке условиям сделок своп с учетом следующих особенностей:

43.5.1. в случае наличия у Недобросовестного участника клиринга Итогового нетто-обязательства по денежным средствам в российских рублях, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, для исполнения которого недостаточно денежных средств, у Недобросовестного участника клиринга по закрывающей сделке / закрывающим сделкам возникают требования в российских рублях и обязательства в иностранной валюте / драгоценном металле (за исключением иностранных валют / драгоценных металлов, не принимаемых в качестве обеспечения исполнения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением), в объеме, соответствующем Итоговому нетто-обязательству в российских рублях, для исполнения которого недостаточно денежных средств, и кратном лоту, установленному Биржей, с округлением в большую сторону, а также не превышающем суммы Итогового нетто-требования Недобросовестного участника клиринга в иностранной валюте / драгоценном металле и Обеспечения Недобросовестного участника клиринга в такой иностранной валюте / таком драгоценном металле, учитываемого по тому же Расчетному коду Участника клиринга. Выбор иностранных валют / драгоценных металлов, в отношении которых заключается закрывающая сделка, осуществляется Клиринговым центром;

43.5.2. в случае наличия у Недобросовестного участника клиринга Итогового нетто-обязательства по денежным средствам в иностранной валюте, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, для исполнения которого недостаточно денежных средств, у Недобросовестного участника клиринга по закрывающей сделке / закрывающим сделкам возникают требования в иностранной валюте в объеме, равном Итоговому нетто-обязательству в иностранной валюте, для исполнения которого недостаточно денежных средств, и обязательства в другой иностранной валюте в объеме, соответствующем Итоговому нетто-обязательству в иностранной валюте, для исполнения которого недостаточно денежных средств, и

кратном лоту, установленному Биржей, с округлением в большую сторону, а также не превышающем суммы Итогового нетто-требования Недобросовестного участника клиринга в такой другой иностранной валюте и Обеспечения Участника клиринга в такой другой иностранной валюте, учитываемого по тому же Расчетному коду Участника клиринга;

43.5.3. в случае наличия у Недобросовестного участника клиринга Итогового нетто-обязательства по денежным средствам в иностранной валюте / драгоценным металлам, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, для исполнения которого недостаточно денежных средств / драгоценных металлов, у Недобросовестного участника клиринга по закрывающей сделке / закрывающим сделкам возникают требования в иностранной валюте / драгоценном металле в объеме, равном Итоговому нетто-обязательству в иностранной валюте / драгоценном металле, для исполнения которого недостаточно денежных средств / драгоценных металлов, и обязательства в российских рублях в объеме, соответствующем Итоговому нетто-обязательству в иностранной валюте / драгоценном металле, для исполнения которого недостаточно денежных средств / драгоценных металлов;

43.5.4. Дата исполнения обязательств по закрывающей сделке / закрывающим сделкам соответствует Дате исполнения обязательств по балансирующей сделке / балансирующим сделкам с соответствующей иностранной валютой / драгоценным металлом;

43.5.5. цена закрывающей сделки равна цене балансирующей сделки с соответствующей иностранной валютой / драгоценным металлом;

43.5.6. порядок заключения закрывающих и балансирующих сделок определен статьей 27 общей части Правил клиринга.

43.6. После заключения закрывающих и балансирующих сделок в соответствии с пунктом 43.3 общей части Правил клиринга Клиринговый центр снимает Режим урегулирования для Расчетного кода Участника клиринга.

43.7. В случае наличия у Участника клиринга Итогового нетто-обязательства по денежным средствам / драгоценным металлам, для исполнения которого недостаточно денежных средств / драгоценных металлов, вследствие непреодолимой силы или сбоя в платежной системе Банка России / иных платежных системах, сделки своп с иностранной валютой / драгоценным металлом, заключаемые Клиринговым центром с Недобросовестным участником клиринга в соответствии с настоящей статьей общей части Правил клиринга, заключаются с ценой сделки своп, равной нулю.

Под обстоятельствами непреодолимой силы понимаются:

- военные действия, акты террора, диверсии и саботажа, массовые беспорядки, забастовки, смена политического режима, другие политические осложнения, как в Российской Федерации, так и в иных государствах;
- решения органов государственной власти, иных органов, учреждений и организаций Российской Федерации и/или иных государств;
- пожары или иные несчастные случаи, разрушения или значительные повреждения 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 / драгоценным металлам невозможно, Участник клиринга обязан уведомить Клиринговый центр любыми доступными средствами связи до установленного Временным регламентом срока исполнения указанных Итоговых нетто-обязательств.

Участник клиринга обязан предоставить Клиринговому центру документы, подтверждающие обстоятельства непреодолимой силы в течение 7 (семи) дней. В случае непредоставления Участником клиринга Клиринговому центру таких документов в указанный срок с Участника клиринга по решению Клирингового центра взыскивается неустойка по цене сделки своп, определенной в соответствии с подпунктом 43.2.7 общей части Правил клиринга, в расчете на количество календарных дней между датой исполнения первой части сделки своп и датой расчета неустойки.

43.8. Клиринговый центр вправе принять решение о заключении с Недобросовестными участниками клиринга сделок своп с иностранной валютой / драгоценным металлом в соответствии с настоящей статьей общей части Правил клиринга с ценой сделки своп, равной нулю, при наличии обстоятельств, не указанных в пункте 43.6 общей части Правил клиринга и свидетельствующих об отсутствии вины такого Участника клиринга.

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

## Статья 44. Порядок заключения и условия сделок РЕПО и сделок / сделки купли-продажи ценных бумаг, заключаемых с Недобросовестным участником клиринга

44.1. Сделки РЕПО (сделки купли-продажи ценных бумаг), указанные в пунктах 42.2, 42.4, 42.5 общей части Правил клиринга, заключаются при соблюдении следующих условий:

44.1.1. у Участника клиринга не отозвана (не аннулирована) лицензия Банка России на осуществление банковских операций и/или лицензия профессионального участника рынка ценных бумаг на осуществление брокерской деятельности, дилерской деятельности и/или деятельности по управлению ценными бумагами;

44.1.2. у Участника клиринга – Банка-нерезидента не отозвано (не аннулировано) специальное разрешение (лицензия или иное основание) компетентного органа государства учреждения Банка-нерезидента, в соответствии с которым Банк-нерезидент имеет право осуществлять банковские операции;

44.1.3. допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию на фондовом рынке и рынке депозитов не приостановлен;

44.1.4. у Клирингового центра отсутствует информация об обстоятельствах в отношении Участника клиринга, перечисленных в общей части Правил клиринга, при наступлении которых допуск к клиринговому обслуживанию Участника клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов будет приостановлен в следующий Расчетный день;

44.1.5. у Клирингового центра отсутствует информация о прекращении проведения депозитарных операций с ценной бумагой со следующего Расчетного дня;

44.1.6. 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.

44.2. Две сделки купли-продажи ценных бумаг заключаются Клиринговым центром с Участником клиринга по Торгово-клиринговым счетам, предназначенным для учета ценных бумаг, находящихся в доверительном управлении Участника клиринга, и в состав которых входит Расчетный код, предназначенный для учета денежных средств, находящихся в доверительном управлении.

44.3. Участник клиринга вправе предоставить Клиринговому центру Запрос на изменение параметров Торгово-клирингового счета, в котором указать на необходимость при неисполнении (ненадлежащем исполнении) обязательств по Сделкам в случаях, установленных Правилами клиринга:

а) заключения сделок купли-продажи по иным Торгово-клиринговым счетам, кроме Торгово-клиринговых счетов, указанных в пункте 44.2 общей части Правил клиринга;

б) заключения сделок РЕПО по Торгово-клиринговым счетам, указанным в пункте 44.2 общей части Правил клиринга.

В случае предоставления указанного запроса заключение сделок РЕПО / двух сделок купли-продажи в соответствии с настоящей статьей общей части Правил клиринга осуществляется в соответствии с таким запросом.

44.4. Сделки РЕПО (две сделки купли-продажи ценных бумаг) заключаются Клиринговым центром без подачи заявок от имени Недобросовестного участника клиринга в отношении себя лично в случаях, установленных пунктами 42.2, 42.4, 42.5 общей части Правил клиринга. Условия сделок РЕПО (двух сделок купли-продажи ценных бумаг) соответствуют определенным Правилами торгов на фондовом рынке и рынке депозитов условиям сделок РЕПО с кодом расчетов Y0/Y1 (сделок купли-продажи с кодами расчетов Y0, Y1), заключаемых в Секции рынка РЕПО / Секции Фондового рынка, с учетом следующих особенностей:

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

44.4.2. в случае наличия у Недобросовестного участника клиринга Итогового нетто-требования по ценным бумагам, не принимаемым в качестве обеспечения исполнения обязательств по Сделкам, и Итогового нетто-обязательства по денежным средствам, в результате исполнения (прекращения) которых Единый лимит по Расчетному коду станет отрицательным, по первой части сделки РЕПО (по первой сделке купли-продажи ценных бумаг) у Недобросовестного участника клиринга возникают обязательства в таких ценных бумагах и требования в российских рублях в объемах, необходимых для сохранения неотрицательного значения Единого лимита по Расчетному коду;

44.4.3. в случае наличия у Недобросовестного участника клиринга Итогового нетто-обязательства по денежным средствам в российских рублях, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, для исполнения которого недостаточно денежных средств, по первой части сделки РЕПО (по первой сделке купли-продажи ценных бумаг) у Недобросовестного участника клиринга возникают требования в российских рублях и обязательства в ценных бумагах (за исключением ценных бумаг, не принимаемых в качестве обеспечения исполнения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением), в объеме, соответствующем Итоговому нетто-обязательству в российских рублях, для исполнения которого недостаточно денежных средств, и кратном лоту, установленному Биржей, с округлением в большую сторону, а также не превышающем суммы Итогового нетто-требования Недобросовестного участника клиринга в ценных бумагах и Обеспечения Недобросовестного участника клиринга в таких ценных бумагах, учитываемого по Торгово-клиринговому счету Т+, в состав которого входит тот же Расчетный код Участника клиринга. Выбор ценных бумаг, в отношении которых заключается сделка РЕПО (сделки купли-продажи), осуществляется Клиринговым центром, при этом, в первую очередь, сделки РЕПО заключаются с клиринговыми сертификатами участия. Выбор Торгово-клирингового счета Т+, по которому учитываются возникшие обязательства в ценных бумагах, осуществляется Клиринговым центром;

44.4.4. Датой исполнения обязательств по первой части сделки РЕПО (первой сделке купли-продажи ценных бумаг) является день ее заключения;

44.4.5. Датой исполнения обязательств по второй части сделки РЕПО (второй сделке купли-продажи ценных бумаг) является Расчетный день, следующий за днем ее заключения;

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

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

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

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

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

$R$ - ставка РЕПО, применяемая для случаев урегулирования обязательств по

Сделкам Т+, для исполнения которых недостаточно денежных средств / ценных бумаг, установленная Клиринговым центром в соответствии с Методикой определения риск-параметров фондового рынка и рынка депозитов;

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

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

44.5. Клиринговый центр устанавливает для Расчетного кода Участника клиринга, по которому учитывается Итоговое нетто-обязательство, для исполнения которого недостаточно денежных средств / для Торгово-клирингового счета, по которому учитывается Итоговое нетто-обязательство, для исполнения которого недостаточно ценных бумаг, Режим урегулирования, порядок применения которого определен в статье 35 общей части Правил клиринга, и от имени Недобросовестного участника клиринга в отношении себя лично заключает закрывающую сделку / закрывающие сделки купли-продажи ценных бумаг (за исключением клиринговых сертификатов участия) и заключает балансирующую сделку / балансирующие сделки, условия которых определены в пункте 44.7 общей части Правил клиринга, при несоблюдении любого из условий, указанных в подпунктах 44.1.3-44.1.5 общей части Правил клиринга, а также в случаях если:

44.5.1. отрицательный Единый лимит по Расчетному коду, входящий в состав Торгово-клирингового счета Т+, по которому учитывается Итоговое нетто-требование в ценных бумагах, не принимаемых в качестве обеспечения исполнения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением, возникает у Участника клиринга третий Расчетный день подряд;

44.5.2. Итоговое нетто-обязательство по денежным средствам в соответствующей валюте / по соответствующему драгоценному металлу, учитываемое по одному Расчетному коду, для исполнения которого недостаточно денежных средств / драгоценных металлов, возникает у Участника клиринга третий Расчетный день подряд;

44.5.3. Итоговое нетто-обязательство по соответствующей ценной бумаге, учитываемое по одному Торгово-клиринговому счету Т+, для исполнения которого недостаточно ценных бумаг, возникает у Участника клиринга пятый Расчетный день подряд;

44.5.4. для исполнения Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по ценным бумагам с источником дохода в США, определенного в Едином клиринговом пуле, недостаточно ценных бумаг (с даты предшествующей дате начала периода составления списка лиц, имеющих право на получение дохода, включая эту дату, до даты окончания периода составления списка лиц, имеющих право на получение дохода, включая эту дату, по информации, полученной от Расчетного депозитария).

44.6. Условие, указанное в подпункте 44.5.2 общей части Правил клиринга, не применяется, если причиной наличия Итоговое нетто-обязательства, для исполнения которого недостаточно денежных средств, является несвоевременное зачисление денежных средств на клиринговый банковский или корреспондентский счет Клирингового центра, вызванное проведением процедур комплаенс-контроля в банках-корреспондентах, сбоями в работе платежных систем, а также

обстоятельствами непреодолимой силы, определенными в пункте 44.10 общей части Правил клиринга.

Участник клиринга обязан предоставить Клиринговому центру документы, подтверждающие действие причин, указанных в настоящем пункте общей части Правил клиринга.

44.7. Условия закрывающих сделок купли-продажи ценных бумаг и балансирующих сделок, заключаемых в соответствии с пунктом 44.5 общей части Правил клиринга, соответствуют определенным Правилами торгов на фондовом рынке и рынке депозитов условиям Сделок Т+, заключаемых в Секции Фондового рынка, с учетом следующих особенностей:

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

44.7.2. в случае наличия у Недобросовестного участника клиринга Итогового нетто-требования по ценным бумагам, не принимаемым в качестве обеспечения исполнения обязательств по Сделкам, и Итогового нетто-обязательства по денежным средствам, в результате исполнения (прекращения) которых Единый лимит по Расчетному коду станет отрицательным, по закрывающей сделке купли-продажи / закрывающим сделкам ценных бумаг у Недобросовестного участника клиринга возникают обязательства в таких ценных бумагах и требования в российских рублях в объемах, необходимых для сохранения неотрицательного значения Единого лимита по Расчетному коду;

44.7.3. в случае наличия у Недобросовестного участника клиринга Итогового нетто-обязательства по денежным средствам в российских рублях, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, для исполнения которого недостаточно денежных средств, по закрывающей сделке / закрывающим сделкам купли-продажи ценных бумаг у Недобросовестного участника клиринга возникают требования в российских рублях и обязательства в ценных бумагах (за исключением ценных бумаг, не принимаемых в качестве обеспечения исполнения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением), в объеме, соответствующем Итоговому нетто-обязательству в российских рублях, для исполнения которого недостаточно денежных средств, и кратном лоту, установленному Биржей, с округлением в большую сторону, а также не превышающем суммы Итогового нетто-требования Недобросовестного участника клиринга в ценных бумагах и Обеспечения Недобросовестного участника клиринга в таких ценных бумагах, учитываемого по Торгово-клиринговому счету Т+, в состав которого входит тот же Расчетный код Участника клиринга. Выбор ценных бумаг, в отношении которых заключается закрывающая сделка / закрывающие сделки купли-продажи, осуществляется Клиринговым центром;

44.7.4. Дата исполнения обязательств по закрывающей сделке / закрывающим сделкам купли-продажи ценных бумаг соответствует Дате исполнения обязательств по балансирующей сделке / балансирующим сделкам купли-продажи ценных бумаг;

44.7.5. цена закрывающей сделки купли-продажи ценных бумаг равна цене балансирующей сделки;

44.7.6. порядок заключения закрывающих и балансирующих сделок определен статьей 27 общей части Правил клиринга.

44.8. После заключения закрывающих и балансирующих сделок в соответствии с пунктом 44.5 общей части Правил клиринга Клиринговый центр снимает Режим урегулирования для Расчетного кода / Торгово-клирингового счета Участника клиринга.

44.9. Клиринговый центр вправе принять решение о заключении вместо сделки РЕПО, условия которой предусмотрены пунктом 44.4 общей части Правил клиринга, закрывающей сделки купли-продажи ценных бумаг, условия которой предусмотрены пунктом 44.5 общей части Правил клиринга:

- при принятии Клиринговым центром решения об установлении по ценной бумаге, по которой учитывается Итоговое нетто-обязательство, для исполнения которого недостаточно ценных бумаг, признака «запрет коротких продаж»;
- при наличии у Клирингового центра информации о планируемом приостановлении проведения депозитарных операций с ценной бумагой.

44.10. При принятии Клиринговым центром решения в соответствии с подпунктом 37.6.2 общей части Правил клиринга, Клиринговым центром от имени Недобросовестного участника клиринга в отношении себя лично заключается закрывающая сделка купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов Y0, условия которой соответствуют условиям, определенным в пункте 44.5 общей части Правил клиринга, за исключением суммы сделки купли-продажи, которая определяется как произведение количества ценных бумаг в сделке и Расчетной цены ценных бумаг, определенной Клиринговым центром в соответствии с Методикой определения риск-параметров фондового рынка и рынка депозитов.

44.11. В случае наличия у Участника клиринга Итогового нетто-обязательства по денежным средствам / ценным бумагам, для исполнения которого недостаточно денежных средств / ценных бумаг, вследствие непреодолимой силы или сбоя в платежной системе Банка России / иных платежных системах, сделки РЕПО (две сделки купли-продажи ценных бумаг), заключаемые Клиринговым центром с Недобросовестным участником клиринга в соответствии с настоящей статьей общей части Правил клиринга, заключаются со ставкой РЕПО, равной нулю.

Под обстоятельствами непреодолимой силы понимаются:

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

повреждения 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 срока исполнения указанных Итоговых нетто-обязательств.

Участник клиринга обязан предоставить Клиринговому центру документы, подтверждающие обстоятельства непреодолимой силы в течение 7 (семи) дней. В случае непредоставления Участником клиринга Клиринговому центру таких документов в указанный срок с Участника клиринга по решению Клирингового центра взыскивается неустойка по ставке РЕПО, определенной в соответствии с подпунктом 44.4.7 общей части Правил клиринга, в расчете на количество календарных дней между датой исполнения первой части сделки РЕПО (первой сделки купли-продажи) и датой расчета неустойки.

44.12. Клиринговый центр вправе принять решение о заключении с Недобросовестными участниками клиринга сделок РЕПО (двух сделок купли-продажи ценных бумаг) в соответствии с настоящей статьей общей части Правил клиринга со ставкой РЕПО, равной нулю, при наличии обстоятельств, не указанных в пункте 44.11 общей части Правил клиринга и свидетельствующих об отсутствии вины такого Участника клиринга.

44.13. В случае отзыва (аннулирования) или приостановления действия лицензии профессионального участника рынка ценных бумаг на осуществление депозитарной деятельности у Держателя, Клиринговый центр вправе принять решение о том, что Дата исполнения обязательств по Сделкам Т+ Участника клиринга, учитываемых по Торгово-клиринговому счету Т+, в состав которого входит Раздел Т+ торгового счета депо такого Держателя, считается наступившей в текущий Расчетный день.

44.13.1. Обязательства по Сделкам Т+, в отношении которых Клиринговым центром принято решение в соответствии с пунктом 44.13 общей части Правил клиринга, включаются в Единый клиринговый пул и участвуют в определении Итогового нетто-обязательства / Итогового нетто-требования Участника клиринга в соответствии со статьей 40 общей части Правил клиринга, при этом при наличии неисполненного Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по ценным бумагам 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 44.5 общей части Правил клиринга.

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

## Статья 45. Порядок заключения и условия сделок своп / сделки купли-продажи с иностранной валютой / драгоценным металлом, заключаемых с Добросовестным участником клиринга

45.1. Сделки своп с иностранной валютой / драгоценным металлом заключаются Клиринговым центром без подачи заявок от имени Добросовестного участника клиринга в отношении себя лично в случае, указанном в подпункте 42.9.4 общей части Правил клиринга. Условия сделок своп с иностранной валютой / драгоценным металлом соответствуют определенным Правилами торгов на валютном рынке условиям сделок спот с учетом следующих особенностей:

45.1.1. в случае недостаточности у Клирингового центра иностранной валюты / драгоценного металла для исполнения Итоговых нетто-требований Добросовестного участника клиринга, по первой части сделки своп у такого Участника клиринга возникают требования в российских рублях и обязательства по соответствующей иностранной валюте / соответствующему драгоценному металлу, в объеме, не превышающем Итогового нетто-требования Добросовестного участника клиринга в такой иностранной валюте / таком драгоценном металле;

45.1.2. Датой исполнения обязательств по первой части сделки своп является день ее заключения;

45.1.3. Датой исполнения обязательств по второй части сделки своп является Расчетный день, следующий за днем ее заключения и являющийся одновременно Расчетным днем по валюте лота и сопряженной валюте заключенной сделки своп;

45.1.4. Базовый курс сделки своп устанавливается равным Центральному курсу, определенному в 19:00 по московскому времени текущего Расчетного дня;

45.1.5. Цена сделки своп определяется по формуле, указанной в подпункте 43.2.7 общей части Правил клиринга.

45.2. Сделки своп могут заключаться Клиринговым центром с одним Добросовестным участником клиринга не более, чем 2 (два) Расчетных дня подряд, при наличии у Добросовестного участника клиринга Итогового нетто-требования в иностранной валюте / драгоценном металле.

45.2.1. В случае отсутствия у Клирингового центра возможности в течение 2 (двух) Расчетных дней подряд исполнить Итоговые нетто-требования в иностранной валюте / драгоценном металле одного или нескольких Добросовестных участников клиринга, Клиринговый центр:

- вправе установить по такой иностранной валюте / такому драгоценному металлу признак «запрет коротких продаж»;
- заключает без подачи заявок от имени Добросовестного участника клиринга в отношении себя лично сделку купли-продажи с иностранной валютой / драгоценным металлом, условия которой соответствуют условиям первой части сделки своп, определенным в пункте 45.1 общей части Правил клиринга, за исключением цены покупки/продажи, которая определяется как справедливая рыночная цена иностранной валюты / драгоценного металла в соответствии с Методикой риск-параметров валютного рынка и рынка драгоценных металлов.

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

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

46.1. Сделки РЕПО Клирингового центра заключаются между Клиринговым центром и Участником клиринга в случае, установленном подпунктом 42.9.5 общей части Правил клиринга.

46.2. Предметом Сделок РЕПО Клирингового центра могут являться ценные бумаги, с которыми возможно заключение Сделок Т+ (далее в настоящей статье – Ценные бумаги).

46.3. Сделки РЕПО Клирингового центра заключаются в следующем порядке и на следующих условиях.

46.3.1. Продавцом по первой части Сделки РЕПО Клирингового центра является Участник клиринга, покупателем – Клиринговый центр.

46.3.2. Клиринговый центр вправе заключить Сделку РЕПО Клирингового центра с любым Участником клиринга категории «Б» с использованием любого Торгово-клирингового счета Т+, в состав которого входит Раздел Т+, открытый на торговом счете депо владельца Участника клиринга в Расчетном депозитарии.

46.3.3. Заключение Сделок РЕПО Клирингового центра с Участником клиринга категории «А» осуществляется в случае, если возможность и порядок заключения таких сделок предусмотрены договором, заключенным между Участником клиринга категории «А» и Клиринговым центром.

46.3.4. Для предоставления Клиринговому центру возможности заключения Сделок РЕПО Клирингового центра с использованием иных Торгово-клиринговых счетов Т+ Участников клиринга, кроме указанных в подпункте 46.3.2 общей части Правил клиринга, или с иными Участниками клиринга, Участник клиринга предоставляет Клиринговому центру Запрос на изменение параметров Торгово-клирингового счета.

46.3.5. Участник клиринга, предоставляя указанный запрос Клиринговому центру, гарантирует Клиринговому центру, что он обладает всеми необходимыми поручениями и полномочиями на заключение сделок в отношении ценных бумаг, учитываемых на Разделе Т+, входящем в состав Торгово-клирингового счета Т+, указанного в запросе.

46.3.6. Выбор Участника клиринга, с которым, в случае необходимости, заключается Сделка РЕПО Клирингового центра, и выбор Торгово-клирингового счета Т+ Участника клиринга, с использованием которого будет заключена Сделка РЕПО Клирингового центра, а также определение количества ценных бумаг, в отношении которых заключается Сделка РЕПО Клирингового центра, осуществляется Клиринговым центром.

46.3.7. Условия Сделки РЕПО Клирингового центра соответствуют условиям сделок РЕПО, заключаемых в Режиме торгов «РЕПО с ЦК – Адресные заявки», определенным Правилами торгов на фондовом рынке и рынке депозитов, с учетом следующих особенностей:

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

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

46.4. Сделки РЕПО Клирингового центра заключаются без подачи заявок.

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

соответствующим частям Сделок РЕПО Клирингового центра включаются в Единый клиринговый пул в Дату их исполнения в порядке, установленном статьей 40 общей части Правил клиринга.

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

## Статья 47. Порядок заключения и условия сделок РЕПО и сделок / сделки купли-продажи ценных бумаг, заключаемых с Добросовестным участником клиринга

47.1. Сделки РЕПО (две сделки купли-продажи ценных бумаг) заключаются Клиринговым центром без подачи заявок от имени Добросовестного участника клиринга в отношении себя лично в случае, указанном в подпункте 42.9.6 общей части Правил клиринга. Условия сделок РЕПО (двух сделок купли-продажи ценных бумаг) соответствуют определенным Правилами торгов на фондовом рынке и рынке депозитов условиям сделок РЕПО с кодом расчетов Y0/Y1 (сделок купли-продажи с кодами расчетов Y0, Y1), заключаемых в Секции рынка РЕПО / Секции Фондового рынка, с учетом следующих особенностей:

47.1.1. в случае недостаточности у Клирингового центра ценных бумаг для исполнения Итоговых нетто-требований Добросовестного участника клиринга, по первой части сделки РЕПО (по первой сделке купли-продажи) у такого Участника клиринга возникают требования в российских рублях и обязательства по таким ценным бумагам, в объеме, не превышающем Итогового нетто-требования Добросовестного участника клиринга по таким ценным бумагам;

47.1.2. Датой исполнения обязательств по первой части сделки РЕПО (первой сделке купли-продажи ценных бумаг) является день ее заключения;

47.1.3. Датой исполнения обязательств по второй части сделки РЕПО (второй сделке купли-продажи ценных бумаг) является Расчетный день, следующий за днем ее заключения;

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

47.1.5. Стоимость обратного выкупа (сумма второй сделки купли-продажи ценных бумаг) определяется по формуле, указанной в подпункте 44.4.7 общей части Правил клиринга;

47.1.6. разница между суммой первой и второй части сделки РЕПО (между суммой первой и второй сделки купли-продажи) уплачивается в пользу Добросовестного участника клиринга.

47.2. Сделки РЕПО (две сделки купли-продажи) могут заключаться Клиринговым центром с одним Добросовестным участником клиринга не более, чем 4 (четыре)

Расчетных дня подряд, при наличии у Добросовестного участника клиринга Итогового нетто-требования по ценным бумагам.

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

- вправе установить по такой ценной бумаге признак «запрет коротких продаж»;
- заключает без подачи заявок от имени Добросовестного участника клиринга в отношении себя лично сделку купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов Y0, условия которой соответствуют условиям первой сделки купли-продажи ценных бумаг с кодом расчетов Y0, определенным в пункте 47.1 общей части Правил клиринга, за исключением суммы сделки купли-продажи, которая определяется как произведение количества ценных бумаг в сделке и справедливой рыночной цены ценных бумаг, определенной Клиринговым центром в соответствии с Методикой определения риск-параметров фондового рынка и рынка депозитов.

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

## Статья 48. Порядок использования и возмещения Гарантийных фондов и иных средств в целях погашения Задолженностей Участников клиринга (процедура кросс-дефолта)

48.1. Настоящая статья общей части Правил клиринга применяется при наличии у Участника клиринга Задолженности, учитываемой по Расчетному коду, в следующих случаях:

48.1.1. Если у Участника клиринга по такому Расчетному коду учитывается Маржинальное требование, не исполненное в срок, установленный Правилами клиринга, или

48.1.2. Если Задолженность, учитываемая по Расчетному коду Участника клиринга, у которого отсутствует Маржинальное требование по такому Расчетному коду, не исполненное в срок, установленный Правилами клиринга, возникает 2 (два) Расчетных дня подряд, и по итогам второго Расчетного дня Задолженность, учитываемая по такому Расчетному коду, является непогашенной.

48.2. Настоящая статья общей части Правил клиринга также применяется при неисполнении / ненадлежащем исполнения Провайдером ликвидности обязательств перед Клиринговым центром.

48.3. Индивидуальное клиринговое и иное обеспечение Недобросовестного участника клиринга, в том числе Обеспечение под стресс Недобросовестного участника клиринга, выделенный капитал центрального контрагента, средства Гарантийных фондов, а также иные средства используются при наличии Задолженности

Участника клиринга, учитываемой по Расчетному коду, или неисполненного обязательства Провайдера ликвидности в следующей очередности:

1) свободное Обеспечение Недобросовестного участника клиринга (за исключением клиринговых сертификатов участия) на биржевом рынке, на котором возникла Задолженность, учитываемое по собственным Расчетным кодам / Торгово-клиринговым счетам, в состав которых входит собственный Расчетный код, Недобросовестного участника клиринга (по выбору Клирингового центра) и свободное имущество Недобросовестного участника из имущественного пула, учитываемое по собственным Расчетным кодам имущественного пула / Торгово-клиринговым счетам имущественного пула, в состав которых входит собственный Расчетный код имущественного пула, Недобросовестного участника (по выбору Клирингового центра), в случае если рынком, на котором возникла Задолженность, является фондовый рынок;
2) свободное Обеспечение Недобросовестного участника клиринга (за исключением клиринговых сертификатов участия) на другом биржевом рынке, учитываемое по собственным Расчетным кодам / Торгово-клиринговым счетам, в состав которых входит собственный Расчетный код, Недобросовестного участника клиринга (по выбору Клирингового центра) и свободное имущество Недобросовестного участника из имущественного пула, учитываемое по собственным Расчетным кодам имущественного пула / Торгово-клиринговым счетам имущественного пула, в состав которых входит собственный Расчетный код имущественного пула, Недобросовестного участника (по выбору Клирингового центра), в случае если рынком, выбранным Клиринговым центром, является фондовый рынок.

   Действия, предусмотренные подпунктом 2), повторяются Клиринговым центром для всех биржевых рынков в очередности по выбору Клирингового центра;
3) денежные средства в российских рублях на корреспондентском счете Участника клиринга – кредитной организации в Банке России (только для Участников клиринга, соответствующих требованиям, установленным пунктом 12.23 общей части Правил клиринга);
4) Обеспечение Недобросовестного участника клиринга на биржевом рынке, на котором возникла Задолженность, учитываемое по собственным Расчетным кодам / Торгово-клиринговым счетам, в состав которых входит собственный Расчетный код, Недобросовестного участника клиринга (по выбору Клирингового центра), освободившееся в результате заключения сделок, направленных на увеличение объема свободного Обеспечения Недобросовестного участника клиринга, и/или имущество Недобросовестного участника из имущественного пула, учитываемое по собственным Расчетным кодам имущественного пула / Торгово-клиринговым счетам имущественного пула, в состав которых входит собственный Расчетный код имущественного пула, Недобросовестного участника (по выбору Клирингового центра), освободившееся в результате заключения сделок, приводящих к получению Недобросовестным участником клиринга клиринговых сертификатов участия, для которых будут соблюдаться условия их погашения при выдаче имущества из имущественного пула (в случае если рынком, на котором возникла Задолженность, является фондовый рынок);
5) Обеспечение Недобросовестного участника клиринга на другом биржевом

рынке, учитываемое по собственным Расчетным кодам / Торгово-клиринговым счетам, в состав которых входит собственный Расчетный код, Недобросовестного участника клиринга (по выбору Клирингового центра), освободившееся в результате заключения сделок, направленных на увеличение объема свободного Обеспечения Недобросовестного участника клиринга, и/или имущество Недобросовестного участника из имущественного пула, учитываемое по собственным Расчетным кодам имущественного пула / Торгово-клиринговым счетам имущественного пула, в состав которых входит собственный Расчетный код имущественного пула, Недобросовестного участника (по выбору Клирингового центра), освободившееся в результате заключения сделок, приводящих к получению Недобросовестным участником клиринга клиринговых сертификатов участия, для которых будут соблюдаться условия их погашения при выдаче имущества из имущественного пула (в случае если рынком, выбранным Клиринговым центром, является фондовый рынок).

Действия, предусмотренные подпунктом 5), повторяются Клиринговым центром для всех биржевых рынков в очередности по выбору Клирингового центра;

6) Обеспечение под стресс Недобросовестного участника клиринга на биржевом рынке, на котором возникла Задолженность;

7) взнос Недобросовестного участника клиринга в Гарантийный фонд биржевого рынка, на котором возникла Задолженность, или взнос ПАО Московская Биржа в Гарантийный фонд валютного рынка и рынка драгоценных металлов в размере, равном минимальному размеру взноса в Гарантийный фонд валютного рынка и рынка драгоценных металлов Участников клиринга категорий «Б» или «О», установленному Правилами клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов (в случае неисполнения обязательств Провайдером ликвидности перед Клиринговым центром по Внебиржевым сделкам с иностранной валютой);

8) Обеспечение под стресс Недобросовестного участника клиринга на другом биржевом рынке по выбору Клирингового центра;

9) взнос Недобросовестного участника клиринга в Гарантийный фонд другого биржевого рынка, на котором было использовано Обеспечение под стресс Недобросовестного участника клиринга;

Действия, предусмотренные подпунктами 8)-9), последовательно повторяются Клиринговым центром для всех биржевых рынков в очередности по выбору Клирингового центра;

10) выделенный капитал центрального контрагента, установленный для биржевого рынка, на котором возникла Задолженность / неисполнение обязательств Провайдера ликвидности;

11) дополнительный выделенный капитал центрального контрагента, установленный для всех биржевых рынков;

12) взносы Добросовестных участников клиринга в Гарантийный фонд биржевого рынка, на котором возникла Задолженность, и взнос ПАО Московская Биржа в Гарантийный фонд валютного рынка и рынка драгоценных металлов (если таким биржевым рынком является валютный рынок и рынок драгоценных металлов);

13) взнос ПАО Московская Биржа в Гарантийный фонд биржевого рынка, на котором возникла Задолженность, вносимый по требованию Клирингового центра.

48.4. Для целей описания процедуры кросс-дефолта в Правилах клиринга под свободным Обеспечением понимается Обеспечение в размере, для которого выполняются условия возврата Обеспечения, предусмотренные соответствующей частью Правил клиринга, а под свободным имуществом из имущественного пула – имущество из имущественного пула в размере, для которого соблюдаются условия погашения клиринговых сертификатов участия при выдаче соответствующего имущества из имущественного пула.

48.5. Взносы в Гарантийные фонды и иные средства Участников клиринга каждой очереди, указанной в пункте 48.2 общей части Правил клиринга, а в рамках каждой указанной очереди – для каждого биржевого рынка, используются в следующей очередности:

1) российские рубли или иностранная валюта, в которой учитывается Задолженность;
2) российские рубли;
3) иностранная валюта;
4) ценные бумаги;
5) драгоценные металлы;
6) товары.

48.6. Использование средств Гарантийных фондов и иных средств следующей очереди в соответствии с настоящей статьей общей части Правил клиринга осуществляется в случае, если Задолженность Участника / неисполненные обязательства Провайдера ликвидности клиринга не погашена при использовании средств предыдущей очереди.

48.7. Обеспечение Недобросовестного участника в российских рублях используется для погашения его Задолженности при условии отсутствия Маржинального требования по Расчетному коду, открытому (открытой) для соответствующего биржевого рынка, и в объеме, не приводящем к возникновению Маржинального требования по такому Расчетному коду и/или Задолженности в российских рублях по такому Расчетному коду.

48.8. Обеспечение Недобросовестного участника в иностранной валюте / ценных бумагах (за исключением клиринговых сертификатов участия) / драгоценных металлах / товарах используется для погашения его Задолженности при условии отсутствия Маржинального требования по Расчетному коду, открытому (открытой) для соответствующего биржевого рынка, и в объеме, не приводящем к возникновению Маржинального требования по такому Расчетному коду и/или Задолженности в такой иностранной валюте по такому Расчетному коду.

48.9. Имущество из имущественного пула используется при соблюдении условий погашения клиринговых сертификатов участия при выдаче имущества из имущественного пула, установленных Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

48.10. В целях списания денежных средств в российских рублях с корреспондентского счета Участника клиринга – кредитной организации в Банке России, Клиринговый центр направляет в Банк России инкассовое поручение на безакцептное списание российских рублей с корреспондентского счета Участника клиринга – кредитной организации в Банке России с зачислением на клиринговый банковский счет Клирингового центра, открытый в Расчетной организации и предназначенный для внесения индивидуального клирингового обеспечения (только для Участников клиринга, соответствующих требованиям, установленным пунктом 12.23 общей части Правил клиринга).

Денежные средства в российских рублях, зачисленные на клиринговый банковский счет Клирингового центра в результате исполнения Банком России инкассового поручения на безакцептное списание российских рублей с корреспондентского счета Участника клиринга – кредитной организации в Банке России, учитываются в качестве Обеспечения по Расчетному коду, по которому учитывается Задолженность, и используются для ее погашения.

48.11. Если после использования свободного Обеспечения Недобросовестного участника клиринга, учитываемого по всем собственным Расчетным кодам / всем Торгово-клиринговым счетам, в состав которых входят собственные Расчетные коды, на всех биржевых рынках, имущества из имущественного пула, учитываемого по собственным Расчетным кодам имущественного пула / Торгово-клиринговым счетам имущественного пула, в состав которых входят собственные Расчетные коды имущественного пула, для которого соблюдаются условия погашения клиринговых сертификатов участия при выдаче такого имущества из имущественного пула, денежных средств в российских рублях на корреспондентском счете Участника клиринга – кредитной организации в Банке России, Задолженность Участника клиринга не погашена, Клиринговый центр устанавливает для всех собственных Расчетных кодов / собственных Торгово-клиринговых счетов Участника клиринга Режим урегулирования, порядок применения которого определен в статье 35 общей части Правил клиринга, и от имени Недобросовестного участника клиринга заключает закрывающие сделки, направленные на увеличение объема свободного Обеспечения Недобросовестного участника клиринга, учитываемого по собственным Расчетным кодам / Торгово-клиринговым счетам, в состав которых входит собственный Расчетный код, и заключает балансирующие сделки и/или заключает закрывающие сделки, приводящие к получению клиринговых сертификатов участия, для которых будут соблюдаться условия их погашения при выдаче имущества из имущественного пула, установленные Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов (в случае если рынком, на котором возникла Задолженность, или рынком, выбранным Клиринговым центром, является фондовый рынок и рынок депозитов), и заключает балансирующие сделки, сначала – на биржевом рынке, на котором возникла Задолженность, затем – на других биржевых рынках (по выбору Клирингового центра).

Порядок заключения закрывающих и балансирующих сделок определен статьей 27 общей части Правил клиринга.

Обеспечение и/или имущество из имущественного пула, освободившееся в результате заключения сделок и/или погашения клиринговых сертификатов участия в соответствии с настоящим пунктом общей части Правил клиринга,

переводится Клиринговым центром на Расчетный код, по которому учитывается Задолженность, и используется для ее погашения.

Указанные в настоящем пункте общей части Правил клиринга сделки заключаются до момента погашения Задолженности Участника клиринга, учитываемой по Расчетному коду, или до момента невозможности заключения указанных сделок (в зависимости от того, какое из этих событий наступит раньше).

48.12. Если после совершения действий, указанных в пункте 48.11 общей части Правил клиринга, Задолженность Участника клиринга не погашена, Клиринговый центр устанавливает для всех Расчетных кодов / всех Торгово-клиринговых счетов Участника клиринга на биржевом рынке, на котором возникла Задолженность, Режим урегулирования, порядок применения которого определен в статье 35 общей части Правил клиринга, и от имени Недобросовестного участника клиринга заключает закрывающие сделки, направленные на прекращение обязательств Недобросовестного участника клиринга по всем Расчетным кодам / Торгово-клиринговым счетам на биржевом рынке, на котором возникла Задолженность, и заключает балансирующие сделки.

Порядок заключения закрывающих и балансирующих сделок определен статьей 27 общей части Правил клиринга.

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

48.13. Если после использования Обеспечения под стресс Недобросовестного участника клиринга на биржевом рынке, на котором возникла Задолженность, и взноса Недобросовестного участника клиринга в Гарантийный фонд биржевого рынка, на котором возникла Задолженность, Задолженность Участника клиринга не погашена, Клиринговый центр устанавливает для всех Расчетных кодов / всех Торгово-клиринговых счетов Участника клиринга на другом биржевом рынке (по выбору Клирингового центра) Режим урегулирования, порядок применения которого определен в статье 35 общей части Правил клиринга, и от имени Недобросовестного участника клиринга заключает закрывающие сделки, направленные на прекращение обязательств Недобросовестного участника клиринга по всем Расчетным кодам / Торгово-клиринговым счетам на таком биржевом рынке, и заключает балансирующие сделки.

Порядок заключения закрывающих и балансирующих сделок определен статьей 27 общей части Правил клиринга.

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

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

48.14. Если после совершения действий, указанных в пункте 48.13 общей части Правил клиринга, Задолженность Участника клиринга не погашена, действия, указанные в пункте 48.13 общей части Правил клиринга, совершаются в отношении Недобросовестного участника клиринга на другом биржевом рынке.

48.15. Клиринговый центр, действуя от имени Участника клиринга в отношении себя лично, осуществляет все юридические и фактические действия, необходимые для заключения сделок в соответствии с пунктами 48.11-48.13 общей части Правил клиринга без специального полномочия (доверенности), а также без согласия Участника клиринга.

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

48.17. В случае использования взноса в Гарантийный фонд и/или Обеспечения под стресс Недобросовестного участника клиринга, такой Участник клиринга обязан в течение 1 (одного) Расчетного дня после направления Клиринговым центром Маржинального требования по фонду и/или Маржинального требования по Обеспечению под стресс в соответствии с пунктами 36.2 / 36.3 общей части Правил клиринга восполнить свой взнос в Гарантийный фонд / свое Обеспечение под стресс до размеров, установленных Клиринговым центром.

48.17.1. В случае использования взноса ПАО Московская Биржа в Гарантийный фонд валютного рынка и рынка драгоценных металлов, ПАО Московская Биржа в течение 1 (одного) Расчетного дня после направления Клиринговым центром соответствующего уведомления обязано восполнить свой взнос в Гарантийный фонд валютного рынка и рынка драгоценных металлов до размера, установленного Клиринговым центром.

Указанная обязанность по восполнению взноса в Гарантийный фонд валютного рынка и рынка драгоценных металлов не может возникать у ПАО Московская Биржа чаще, чем 1 (один) раз в Расчетный день и 6 (шесть) раз в течение календарного года.

48.18. Взносы в Гарантийный фонд Добросовестных участников клиринга на соответствующем биржевом рынке, в том числе в части, превышающей минимальный размер взноса в Гарантийный фонд на таком биржевом рынке, и взнос ПАО Московская Биржа в Гарантийный фонд валютного рынка и рынка драгоценных металлов (если таким биржевым рынком является валютный рынок и рынок драгоценных металлов), используются в случае, если сумма Задолженностей Недобросовестных участников клиринга и неисполненных обязательств Провайдеров ликвидности перед Клиринговым центром на таком биржевом рынке превышает размер выделенного капитала Клирингового центра, установленного для такого биржевого рынка, и размер дополнительного выделенного капитала

центрального контрагента, установленного для всех биржевых рынков и использованного для такого биржевого рынка, на котором возникла Задолженность / неисполнение обязательств Провайдером ликвидности.

48.19. Взносы Добросовестных участников клиринга в Гарантийный фонд соответствующего биржевого рынка и взнос ПАО Московская Биржа в Гарантийный фонд валютного рынка и рынка драгоценных металлов (если таким биржевым рынком является валютный рынок и рынок драгоценных металлов), используются в равных долях, если иное не установлено соответствующей специальной частью Правил клиринга.

48.20. В случае возникновения нескольких задолженностей одного или нескольких Недобросовестных участников клиринга на нескольких биржевых рынках, взнос Недобросовестного участника клиринга в Гарантийный фонд биржевого рынка / Обеспечение под стресс Недобросовестного Участника клиринга на биржевом рынке используется, в первую очередь, для погашения Задолженности Участника клиринга, возникшей на таком биржевом рынке, во вторую – Задолженностей, возникших на других биржевых рынках.

48.21. Обеспечение Недобросовестного участника / взнос Недобросовестного участника клиринга в Гарантийный фонд / Обеспечение под стресс / имущество из имущественного пула Недобросовестного участника клиринга / взнос Добросовестного участника клиринга / ПАО Московская Биржа в Гарантийный фонд в российских рублях используются для удовлетворения требований Клирингового центра по Задолженности Недобросовестного участника клиринга / неисполненным обязательствам Провайдера ликвидности путем передачи денежных средств в российских рублях, учитываемых в качестве Обеспечения Недобросовестного участника на соответствующем биржевом рынке / взноса Недобросовестного участника клиринга в Гарантийный фонд соответствующего биржевого рынка / Обеспечения под стресс Недобросовестного участника клиринга на соответствующем биржевом рынке / имущества из имущественного пула Недобросовестного участника клиринга / взноса Добросовестного участника клиринга / ПАО Московская Биржа в Гарантийный фонд, Клиринговому центру в счет погашения Задолженности Недобросовестного участника клиринга.

48.22. Обеспечение Недобросовестного Участника клиринга / взнос Недобросовестного участника клиринга в Гарантийный фонд / Обеспечение под стресс / имущество из имущественного пула Недобросовестного участника клиринга / взнос Добросовестного участника клиринга в Гарантийный фонд в иностранной валюте / ценных бумагах (за исключением клиринговых сертификатов участия) / драгоценных металлах / товарах / используются для удовлетворения требований Клирингового центра по Задолженности Недобросовестного участника клиринга путем:

1) продажи указанной иностранной валюты / ценных бумаг / драгоценных металлов / товаров в объеме, необходимом для погашения указанной Задолженности, с передачей вырученных от продажи денежных средств в российских рублях Клиринговому центру в счет погашения Задолженности Недобросовестного участника клиринга;
2) передачи указанной иностранной валюты / ценных бумаг / драгоценных

металлов / товаров Клиринговому центру в счет погашения Задолженности Недобросовестного участника клиринга (в случае невозможности их продажи).

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

48.22.1. Имущество Недобросовестного участника из имущественного пула используется для удовлетворения требований Клирингового центра по Задолженности Недобросовестного участника клиринга при условии погашения необходимого количества клиринговых сертификатов участия.

48.22.2. Удовлетворение требований за счет Обеспечения / взноса в Гарантийный фонд / Обеспечения под стресс / имущества из имущественного пула Участника клиринга осуществляется Клиринговым центром без предварительного уведомления такого Участника клиринга.

48.22.3. Сумма денежных средств в соответствующей валюте / количество соответствующего драгоценного металла, учитываемых по Расчетному коду / Расчетному коду для учета взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс / количество ценных бумаг, учитываемых по соответствующему Торгово-клиринговому счету / Торгово-клиринговому счету Гарантийных фондов / Обеспечения под стресс / количество товара, учитываемое по соответствующему Торгово-клиринговому счету, Недобросовестного участника клиринга, и размер обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга Обеспечения / взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс уменьшаются на сумму / количество использованных денежных средств / ценных бумаг / драгоценных металлов / товаров из Обеспечения Недобросовестного участника / взноса Недобросовестного участника клиринга в Гарантийный фонд / Обеспечения под стресс Недобросовестного участника клиринга.

48.23. В случае необходимости использования ценных бумаг, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга / взносов Участников клиринга в Гарантийные

фонды / Обеспечения под стресс / имущества из имущественного пула, Клиринговый центр включает распоряжение на перевод ценных бумаг с Раздела / субсчета депо Участника клиринга на субсчет депо Клирингового центра в распоряжение на проведение операций по Разделам / субсчетам депо, направляемое Расчетному депозитарию в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

48.24. В случае необходимости использования драгоценных металлов, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга, Клиринговый центр списывает соответствующий драгоценный металл со Счета обеспечения Участника клиринга.

48.25. В случае необходимости использования товаров, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга, Клиринговый центр включает распоряжение на перевод товаров с торгового раздела торгового товарного счета Участника клиринга на торговый раздел торгового товарного счета Клирингового центра в распоряжение на перевод товаров, направляемое Оператору товарных поставок в соответствии с Правилами клиринга на товарном рынке.

48.26. В случае использования взносов в Гарантийный фонд Добросовестных участников клиринга и/или ПАО Московская Биржа, Недобросовестный участник клиринга обязан в течение 1 (одного) Расчетного дня возместить Клиринговому центру в российских рублях использованные средства Гарантийного фонда.

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

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

48.27. После возмещения Недобросовестным участником клиринга использованных средств Гарантийного фонда из взносов Добросовестных участников клиринга, Клиринговый центр возмещает в российских рублях использованные взносы в Гарантийные фонды Добросовестных участников клиринга и взнос ПАО Московская Биржа в Гарантийный фонд.

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

При этом сумма денежных средств в российских рублях, учитываемых по Расчетному коду учета взносов в Гарантийные фонды Добросовестного участника клиринга, и размер обязательства Клирингового центра по возврату Участнику

клиринга / ПАО Московская Биржа взносов в Гарантийные фонды увеличиваются на сумму возмещенных денежных средств.

48.27.1. После исполнения Провайдером ликвидности обязательств, неисполнение которых привело к использованию взноса ПАО Московская Биржа в Гарантийный фонд валютного рынка и рынка драгоценных металлов, Клиринговый центр возмещает в российских рублях использованный взнос в ПАО Московская Биржа в Гарантийный фонд валютного рынка и рынка драгоценных металлов.

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

48.29. В случае использования взносов Добросовестных участников клиринга в Гарантийный фонд соответствующего биржевого рынка, Добросовестные участники клиринга обязаны в течение 1 (одного) Расчетного дня после направления Клиринговым центром Маржинальных требований по фонду в соответствии с пунктом 36.2 общей части Правил клиринга восполнить в российских рублях свои взносы в Гарантийный фонд соответствующего биржевого рынка до размера, установленного Клиринговым центром.

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

## Статья 49. Порядок действий, направленных на исполнение обязательств Участника торгов перед Участником клиринга

49.1. Участник клиринга, не совпадающий в одном лице с Участником торгов и действующий в качестве Клирингового брокера, вправе предоставить Клиринговому центру Запрос на заключение сделки за счет Участника торгов / клиента Участника торгов.

49.1.1. Запрос на заключение сделки за счет Участника торгов / клиента Участника торгов предоставляется с использованием Клиринговой системы в период проведения Торговой сессии на соответствующем биржевом рынке.

49.1.2. Подача указанного запроса является согласием Участника клиринга на заключение Клиринговым центром Сделки на условиях, указанных в запросе.

49.1.3. На основании указанного запроса Клиринговый центр подает заявку на заключение Сделки от имени Участника клиринга за счет Участника торгов / клиента Участника торгов в отношении себя лично на условиях, указанных в запросе.

Условия Сделки определяются в соответствии с Правилами торгов соответствующего биржевого рынка, а также условиями, указанными в заявке, поданной Клиринговым центром.

49.2. Участник клиринга, не совпадающий в одном лице с Участником торгов и действующий в качестве Клирингового брокера, вправе предоставить Клиринговому центру Запрос на проверку достаточности обеспечения по клиринговому регистру 2-го уровня.

Участник клиринга, не совпадающий в одном лице с Участником торгов и действующий в качестве Клирингового брокера, которому оказываются услуги по ведению клиринговых регистров 3-го уровня, вправе предоставить Клиринговому центру Запрос на проверку достаточности обеспечения по клиринговому регистру 3-го уровня.

49.2.1. Запрос на проверку достаточности обеспечения по клиринговому регистру 2-го или 3-го уровня предоставляется с использованием Клиринговой системы в период проведения Торговой сессии на соответствующем биржевом рынке.

49.2.2. На основании Запроса на проверку достаточности обеспечения по клиринговому регистру 2-го уровня Клиринговый центр осуществляет проверку достаточности обеспечения для всех заявок, поданных с указанием такого клирингового регистра 2-го и/или клиринговых регистров 3-го уровня, соответствующих такому клиринговому регистру 2-го уровня.

49.2.3. На основании Запроса на проверку достаточности обеспечения по клиринговому регистру 3-го уровня Клиринговый центр осуществляет проверку достаточности обеспечения для всех заявок, поданных с указанием клирингового регистра 3-го уровня.

49.2.4. Проверка достаточности обеспечения осуществляется Клиринговым центром в соответствии с порядком, установленным соответствующей специальной частью Правил клиринга.

49.2.5. В случае недостаточности обеспечения Участник клиринга, не совпадающий в одном лице с Участником торгов и действующий в качестве Клирингового брокера, считается отказавшимся от указания его в качестве Клирингового брокера в отношении активных заявок Участника торгов, поданных с указанием соответствующих клиринговых регистров 2-го и/или 3-го уровней. В указанном случае Клиринговый центр направляет Бирже уведомление о необходимости удаления всех заявок, поданных с указанием соответствующих клиринговых регистров 2-го и/или 3-го уровней.

## ПОДРАЗДЕЛ IV-VI. ПОРЯДОК ВЗАИМОДЕЙСТВИЯ С РАСЧЕТНОЙ ОРГАНИЗАЦИЕЙ И РАСЧЕТНЫМ ДЕПОЗИТАРИЕМ. ПОРЯДОК ДЕЙСТВИЙ В СЛУЧАЕ ОБРАЩЕНИЯ ВЗЫСКАНИЯ ИЛИ НАЛОЖЕНИЯ АРЕСТА НА ИМУЩЕСТВО УЧАСТНИКА КЛИРИНГА, НАХОДЯЩЕЕСЯ НА ТОРГОВОМ ИЛИ КЛИРИНГОВОМ СЧЕТЕ

### Статья 50. Порядок взаимодействия с Расчетной организацией, в которой открыты торговые или клиринговые банковские счета для учета денежных средств

50.1. Клиринговый центр взаимодействует с Расчетной организацией по клиринговым банковским счетам в соответствии с условиями договора банковского счета.

50.2. Перечень документов, которыми обмениваются Клиринговый центр и Расчетная организация в процессе взаимодействия при осуществлении клиринга и расчетов по денежным средствам по итогам клиринга по торговым банковским счетам, а также форматы указанных документов и сроки их предоставления определяются договором, заключенным между Клиринговым центром и Расчетной организацией.

50.3. В случае использования при осуществлении клиринга и расчетов торговых банковских счетов, списание денежных средств с торговых банковских счетов осуществляется на основании распоряжений Клирингового центра или на основании распоряжений лица, которому открыт такой торговый банковский счет с согласия Клирингового центра.

50.4. Клиринговый центр соглашается с проведением любых операций зачисления на торговый банковский счет на основании распоряжений лица, которому открыт такой торговый банковский счет.

50.5. В случае обращения взыскания или наложения ареста на имущество Участника клиринга, находящееся на торговом банковском счете и/или на клиринговом банковском счете:

50.5.1. Расчетная организация незамедлительно передает информацию об обращении взыскания или наложении ареста Клиринговому центру.

50.5.2. Незамедлительно после получения от Расчетной организации информации об обращении взыскания или наложении ареста на имущество Участника клиринга, находящееся на торговом банковском счете и/или на клиринговом банковском счете Клиринговый центр:

- устанавливает Ограничительный лимит на сумму, указанную в документе, являющемся основанием для обращения взыскания и/или наложения ареста, в отношении Счета обеспечения Т0 Участника клиринга, соответствующего торговому банковскому счету, в отношении которого наложен арест / обращено взыскание;
- устанавливает ограничение на списание и иное использование денежных средств, учитываемых по Расчетному коду, соответствующему Счету обеспечения, на котором учитываются денежные средства, находящиеся на

клиринговом банковском счете, в отношении которого наложен арест / обращено взыскание, в сумме, указанной в документе, являющемся основанием для обращения взыскания и/или наложения ареста;

- вправе направить Бирже уведомление о необходимости приостановки возможности заключения Сделок Т+ с указанием Торгово-клиринговых счетов Т+, в состав которых входят указанные Счет обеспечения Т0 / Расчетный код.

50.5.3. Клиринговый центр:

1) не позднее дня, следующего за днем получения Клиринговым центром копии исполнительных документов, исполняет (прекращает) обязательства Участника клиринга с наступившей Датой исполнения;

2) не позднее дня, следующего за днем получения Клиринговым центром копии исполнительных документов, направляет Расчетной организации сведения о размере денежных средств, оставшиеся после исполнения (прекращения) обязательств Участника клиринга денежные средства.

50.5.4. Денежные средства, оставшиеся после выплаты денежных средств по исполнительному документу и расходов по совершению исполнительных действий и исполнительского сбора, могут быть возвращены Клиринговым центром Участнику клиринга по его запросу.

50.5.5. Действия Клирингового центра в случае обращения взыскания на денежные средства Участника клиринга на рынке депозитов осуществляются с учетом особенностей, установленных Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

## Статья 51. Порядок действий в случае обращения взыскания или наложения ареста на имущество Участника клиринга, находящееся на торговом банковском счете в драгоценном металле

51.1. В случае обращения взыскания или наложения ареста на имущество Участника клиринга, находящееся на торговом банковском счете в драгоценном металле Клиринговый центр:

- устанавливает ограничение на списание и иное использование драгоценных металлов, учитываемых на торговом банковском счете, в отношении которого наложен арест / обращено взыскание, в количестве, указанном в документе, являющемся основанием для обращения взыскания и/или наложения ареста;
- вправе направить Бирже уведомление о необходимости приостановки возможности заключения Сделок с драгоценным металлом с указанием Торгово-клиринговых счетов, в состав которых входит Расчетный код, которому соответствует торговый банковский счет, в отношении которого наложен арест / обращено взыскание.

51.1.1. Клиринговый центр:

1) не позднее дня, следующего за днем получения Клиринговым центром копии исполнительных документов, исполняет (прекращает) обязательства Участника клиринга с наступившей Датой исполнения;

2) не позднее дня, следующего за днем получения Клиринговым центром исполнительных документов, сообщает судебному приставу-исполнителю

сведения о количестве драгоценного металла, оставшегося после исполнения (прекращения) обязательств Участника клиринга денежные средства.

## Статья 52. Порядок взаимодействия с Расчетным депозитарием и иными депозитариями

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

52.2. Списание ценных бумаг с Разделов осуществляется на основании распоряжений Клирингового центра или на основании распоряжений лица, которому открыт такой торговый счет депо с согласия Клирингового центра.

52.2.1. Учет ценных бумаг, принадлежащих Участнику клиринга на праве собственности и переданных Участником клиринга в качестве взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс, осуществляется на соответствующих субсчетах депо. Для открытия субсчета депо Участник клиринга должен предоставить в Расчетный депозитарий комплект документов, предусмотренный Условиями осуществления депозитарной деятельности Расчетного депозитария.

52.2.2. Списание / зачисление ценных бумаг с субсчетов / на субсчета депо осуществляется на основании распоряжений Клирингового центра.

52.2.3. Доходы и иные выплаты, причитающиеся Участникам клиринга по ценным бумагам, учитываемые на субсчетах депо, перечисляются в качестве взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс, на соответствующий клиринговый счет Клирингового центра, в случае, если это предусмотрено внутренними документами Расчетного депозитария, в порядке, предусмотренном договором Клирингового центра с Расчетным депозитарием.

Доходы и иные выплаты по ценным бумагам, перечисленные в качестве взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс в соответствии с настоящим подпунктом общей части Правил клиринга, учитываются как средства Участника клиринга, зачисленные на соответствующий клиринговый счет Клирингового центра.

52.3. Клиринговый центр соглашается с проведением любых операций зачисления на Разделы на основании распоряжений лица, которому открыт такой торговый счет депо.

52.4. В случае если торговые счета депо Участников клиринга, клиентов Участника клиринга и иных лиц открыты в депозитарии, открывшем в Расчетном депозитарии торговый счет депо номинального держателя, Клиринговый центр соглашается с проведением любых операций по таким торговым счетам депо, включая закрытие таких торговых счетов депо. Указанное согласие Клирингового центра действует до момента его отзыва Клиринговым центром в указанном депозитарии или до момента направления Клиринговым центром указанному депозитарию распоряжения, устанавливающего иные условия проведения операций по таким торговым счетам депо.

52.5. Каждый Расчетный день до начала торгов на фондовом рынке, а также в ходе торгов на фондовом рынке в случае изменения, Клиринговый центр с использованием WEB-сервиса Расчетного депозитария передает Расчетному депозитарию:

- перечень ценных бумаг, принимаемых в каждый из имущественных пулов, в качестве Обеспечения, взносов в Гарантийные фонды, Обеспечение под стресс, и информацию о ценах соответствующих ценных бумаг, которые необходимо использовать при подборе. В качестве таких цен указываются Нижние границы диапазона оценки рыночных рисков 1-го уровня;
- список Разделов / субсчетов депо и кодов ценных бумаг, запрещенных к подбору на указанные Разделы / субсчета депо.

52.6. Каждый Расчетный день до начала торгов на фондовом рынке Расчетный депозитарий передает Клиринговому центру список Разделов / субсчетов депо и выписку по Разделам / субсчетам депо.

52.7. После получения от Расчетного депозитария выписки по Разделам / субсчетам депо Клиринговый центр устанавливает значение количества ценных бумаг, учитываемых по Торгово-клиринговым счетам в соответствии с информацией о количестве ценных бумаг, учитываемых на Разделах / субсчетах депо, полученной от Расчетного депозитария в Выписке по Разделам / субсчетам депо.

52.8. При увеличении в ходе торгов количества ценных бумаг, учитываемых на Разделе, Расчетный депозитарий передает Клиринговому центру информацию о таком увеличении, а Клиринговый центр учитывает это увеличение по Торгово-клиринговым счетам Т0 / Торгово-клиринговым счетам Т+.

52.9. 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 (за исключением клиринговых сертификатов участия) с Раздела Т+ при соблюдении условий возврата ценных бумаг, установленных пунктом 31.12 общей части Правил клиринга.

Клиринговый центр дает согласие на списание клиринговых сертификатов участия при соблюдении условий, установленных Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

Клиринговый центр дает согласие на списание ценных бумаг с Разделов Т0 при соблюдении условий возврата ценных бумаг, установленных подпунктом 31.12.1 общей части Правил клиринга.

При согласии Клирингового центра на списание ценных бумаг количество ценных бумаг, учитываемое по соответствующему Торгово-клиринговому счету, и количество ценных бумаг, учитываемое на соответствующем Разделе, входящем в состав такого Торгово-клирингового счета, по информации, полученной от Расчетного депозитария, уменьшается на количество ценных бумаг, указанное в запросе.

52.10. Порядок проведения расчетов по ценным бумагам установлен Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

52.11. После окончания третьей расчетной клиринговой сессии Клиринговый центр направляет Расчетному депозитарию Уведомление о согласии на проведение операций по Разделам.

Направление Расчетному депозитарию указанного уведомления означает согласие Клирингового центра на проведение любых операций по Разделам Т0 до момента передачи Клиринговому центру Расчетным депозитарием выписки по Разделам / субсчетам депо, за исключением Разделов Т0, в отношении которых Клиринговым центром от Расчетного депозитария получена информация об обращении взыскания или наложении ареста на имущество Участника клиринга, находящееся на торговом счете депо, на котором открыт Раздел Т0.

52.12. В случае обращения взыскания или наложения ареста на имущество Участника клиринга, находящееся на торговом счете депо и/или на клиринговом счете депо:

52.12.1. Расчетный депозитарий незамедлительно передает информацию об обращении взыскания или наложении ареста Клиринговому центру.

52.12.2. Незамедлительно после получения от Расчетного депозитария информации об обращении взыскания или наложении ареста на имущество Участника клиринга, находящееся на торговом счете депо и/или на клиринговом счете депо Клиринговый центр:

- устанавливает ограничение на списание и иное использование ценных бумаг Участника клиринга с указанных счетов в количестве ценных бумаг, указанном в документе, являющемся основанием для обращения взыскания и/или наложения ареста;
- вправе направить Бирже уведомление о необходимости приостановки возможности заключения Сделок Т+ с указанием Торгово-клиринговых счетов Т+, в состав которых входят торговые счета депо, в отношении которых наложен арест / обращено взыскание.

52.12.3. Клиринговый центр:

1) не позднее дня, следующего за днем получения Клиринговым центром копии исполнительных документов, исполняет (прекращает) обязательства Участника клиринга с наступившей Датой исполнения;
2) в случае обращения взыскания или наложения ареста на клиринговые сертификаты участия выполняет действия в соответствии с пунктом 52.13 общей части Правил клиринга.

52.13. В случае обращения взыскания / наложения ареста на клиринговые сертификаты участия Участника клиринга Клиринговый центр не позднее дня, следующего за днем получения Клиринговым центром копии исполнительных документов:

52.13.1. выводит из имущественного пула денежные средства и/или продает из имущественного пула ценные бумаги и иностранную валюту, внесенные в имущественный пул Участником клиринга, являющимся Участником пула, на имущество которого обращено взыскание / наложен арест, в объеме, необходимом для исполнения исполнительных документов, расходов по совершению

исполнительных действий и исполнительского сбора, и погашает клиринговые сертификаты участия в соответствующем количестве.

Необходимым условием вывода из имущественного пула денежных средств и продажи имущества, внесенного в имущественный пул, является наличие клиринговых сертификатов участия в необходимом количестве в плановом значении позиции депо по Разделу Т+, входящему в состав Торгово-клирингового счета Т+ Участника клиринга, соответствующего Торгово-клирингового счета имущественного пула;

52.13.2. зачисляет денежные средства, оставшиеся после прекращения обязательств Участника клиринга и/или полученные от продажи имущества из имущественного пула, в объеме, необходимом для исполнения исполнительных документов, расходов по совершению исполнительных действий и исполнительского сбора, на клиринговый банковский счет;

52.13.3. направляет Расчетному депозитарию сведения о размере денежных средств и реквизитах клирингового банковского счета, на котором учитываются или на который перечислены оставшиеся после исполнения (прекращения) обязательств Участника клиринга денежные средства.

Расчетный депозитарий сообщает судебному приставу-исполнителю сведения о размере денежных средств и реквизитах открытого в Расчетном депозитарии клирингового банковского счета, на котором учитываются или на который перечислены оставшиеся после исполнения (прекращения) обязательств Участника клиринга денежные средства.

Денежные средства, оставшиеся после выплаты денежных средств по исполнительному документу и расходов по совершению исполнительных действий и исполнительского сбора, могут быть возвращены Клиринговым центром Участнику клиринга по его запросу.

# РАЗДЕЛ V. ОБЩИЙ ПОРЯДОК ОПЛАТЫ УСЛУГ

## Статья 53. Общий порядок оплаты услуг Клирингового центра, Биржи и Технического центра, а также порядок начисления и выплаты процентов на денежные средства, составляющие индивидуальное или коллективное клиринговое обеспечение

53.1. Клиринговый центр в соответствии с тарифами, применяемыми на соответствующем биржевом рынке, взимает с Участников клиринга следующие виды комиссионных вознаграждений:

- комиссионное вознаграждение за оказание клиринговых услуг в пользу Клирингового центра, включая комиссионное вознаграждение за учет индивидуального клирингового и иного обеспечения;
- комиссионное вознаграждение в пользу Клирингового центра за оказание Участнику торгов услуг по договору о ведении клиринговых регистров;
- комиссионное вознаграждение за организацию торгов / биржевой сбор в пользу Биржи;
- абонентскую плату / плату за абонентское обслуживание в пользу Биржи;
- плату за услуги технического доступа в пользу Технического центра;
- вознаграждение в пользу Технического центра за предоставление интегрированного технологического сервиса (ИТС), включая дополнительное вознаграждение / дополнительный комиссионный сбор за предоставление ИТС, установленный документами Технического центра;
- дополнительный сбор за неэффективные транзакции и дополнительный сбор за ошибочные транзакции в пользу Технического центра;
- иные виды комиссионных вознаграждений в пользу указанных или иных лиц, предусмотренные специальными частями Правил клиринга.

53.2. Размер комиссионного вознаграждения за оказание клиринговых услуг, подлежащего уплате Участником клиринга (далее – комиссионное вознаграждение Клирингового центра), рассчитывается Клиринговым центром в соответствии с Тарифами Клирингового центра.

53.3. Участник клиринга исполняет обязательства по уплате комиссионных вознаграждений Биржи, Клирингового центра и Технического центра за Участника торгов, не совпадающего в одном лице с Участником клиринга и имеющего право подавать заявки с указанием Торгово-клиринговых счетов 2-го уровня, соответствующих Расчетным кодам данного Участника клиринга.

53.4. Комиссионное вознаграждение за организацию торгов / биржевой сбор и абонентская плата / плата за абонентское обслуживание в пользу Биржи (далее – комиссионные вознаграждения Биржи) рассчитываются и взимаются Клиринговым центром в соответствии с действующими размерами комиссионного

вознаграждения за организацию торгов, утвержденными Биржей, на основании договора, заключенного с Биржей.

53.5. Вознаграждение в пользу Технического центра за предоставление интегрированного технологического сервиса (ИТС), включая дополнительное вознаграждение / дополнительный комиссионный сбор за предоставление ИТС, установленный документами Технического центра, плата за услуги технического доступа, сбор за неэффективные транзакции и сбор за ошибочные транзакции (далее – вознаграждение Технического центра) рассчитываются и взимаются Клиринговым центром в соответствии с действующими размерами вознаграждения за предоставление ИТС, утвержденными Техническим центром, действующими тарифами Технического центра, на основании договора, заключенного с Техническим центром.

53.6. Комиссионное вознаграждение Биржи взимается с Участника клиринга, являющегося Участником торгов, или с Участника клиринга, исполняющего указанные обязательства за Участника торгов в соответствии с пунктом 53.3 общей части Правил клиринга или в соответствии со специальной частью Правил клиринга.

53.7. Вознаграждение Технического центра взимается с Участника клиринга, или с Участника клиринга, являющегося Участником торгов, или с Участника клиринга, исполняющего указанные обязательства за Участника торгов в соответствии с пунктом 53.3 общей части Правил клиринга или в соответствии со специальной частью Правил клиринга.

53.8. Обязательства по уплате комиссионных вознаграждений Клирингового центра, Биржи и вознаграждений Технического центра исполняются в российских рублях.

53.8.1. В случае если сумма комиссионного вознаграждения Клирингового центра, Биржи или вознаграждения Технического центра выражена в иностранной валюте, указанная сумма пересчитывается в российские рубли по курсу такой иностранной валюты к российскому рублю, установленному Банком России на дату определения соответствующего вознаграждения.

53.9. Удержание Клиринговым центром с Участника клиринга:

- абонентской платы / платы за абонентское обслуживание;
- постоянных частей комиссионных вознаграждений;
- комиссионного вознаграждения за предоставление Участникам клиринга копий отчетов, предусмотренных пунктами 54.2-54.3 общей части Правил клиринга и специальными частями Правил клиринга;
- комиссионного вознаграждения по тарифному плану «Размещения-фиксированный»;
- дополнительного вознаграждения / дополнительного комиссионного сбора за предоставление ИТС;
- платы за услуги технического доступа;
- комиссионного вознаграждения Биржи и Технического центра по сделкам, клиринг по которым осуществляет иная клиринговая организация;

- комиссионного вознаграждения за учет индивидуального клирингового и иного обеспечения, рассчитанного по Счетам гарантийных фондов и Счетам обеспечения под стресс;
- иных комиссионных вознаграждений в пользу Клирингового центра, Биржи или Технического центра, за исключением оборотных частей комиссионных вознаграждений;
- Возмещения,

а также зачисление Возмещения осуществляется в отношении Расчетного кода, указанного Участником клиринга в представленном Клиринговому центру Запросе о выборе основного Расчетного кода для списания комиссионных вознаграждений.

В случае непредоставления Участником клиринга Запроса о выборе основного Расчетного кода для списания комиссионных вознаграждений операции, указанные выше в настоящем пункте общей части Правил клиринга, осуществляются в отношении собственного Расчетного кода Участника клиринга, открытого первым.

Расчетный код Участника клиринга, определенный в соответствии с настоящим пунктом общей части Правил клиринга, далее именуется основным Расчетным кодом для списания комиссионных вознаграждений.

53.9.1. В Запросе о выборе основного Расчетного кода для списания комиссионных вознаграждений Участником клиринга могут быть также указаны любые из следующих признаков:

1) признак, означающий, что с основного Расчетного кода для списания комиссионных вознаграждений, указанного в таком запросе, необходимо удерживать оборотную часть комиссионных вознаграждений по Сделкам с расчетами в российских рублях и иностранной валюте;
2) признак, означающий, что с основного Расчетного кода для списания комиссионных вознаграждений, указанного в таком запросе, необходимо удерживать комиссионное вознаграждение Клирингового центра за учет индивидуального клирингового и иного обеспечения;
3) признак, означающий, что с основного Расчетного кода для списания комиссионных вознаграждений, указанного в таком запросе, необходимо удерживать штраф за ненадлежащее исполнение денежных обязательств.

53.10. Участник клиринга вправе предоставить Клиринговому центру Запрос на изменение параметров Расчетного кода, в котором указать Расчетный код для списания комиссионных вознаграждений - Расчетный код Участника клиринга, по которому должна удерживаться оборотная часть комиссионных вознаграждений по Сделкам с расчетами в российских рублях и иностранной валюте, заключенным с указанием Торгово-клирингового счета, в состав которого входит / которому соответствует Расчетный код Участника клиринга, указанный в таком запросе.

Для каждого Расчетного кода Участника клиринга, входящего в состав / соответствующего Торгово-клиринговому счету, может быть указан только один Расчетный код для списания комиссионных вознаграждений, по которому должна удерживаться оборотная часть комиссионных вознаграждений по Сделкам, заключенным с указанием такого Торгово-клирингового счета.

53.11. Запрос о выборе основного Расчетного кода для списания комиссионных вознаграждений и Запрос на изменение параметров Расчетного кода действует, начиная с Расчетного дня, следующего за днем его предоставления.

53.12. Удержание Клиринговым центром с Участника клиринга оборотной части комиссионных вознаграждений по Сделкам с расчетами в российских рублях и в иностранной валюте осуществляется в российских рублях:

1) по Расчетному коду для списания комиссионных вознаграждений, указанному Участником клиринга в Запросе на изменение параметров Расчетного кода для Расчетного кода Участника клиринга, входящего в состав / соответствующего Торгово-клиринговому счету, указанному в заявке на заключение Сделки;

2) по основному Расчетному коду для списания комиссионных вознаграждений, в случае предоставления Участником клиринга Запроса о выборе основного Расчетного кода для списания комиссионных вознаграждений в соответствии с пунктом 53.9 общей части Правил клиринга, в котором указан признак, означающий, что с Расчетного кода, указанного в таком запросе, необходимо также удерживать оборотную часть комиссионных вознаграждений по Сделкам с расчетами в российских рублях и иностранной валюте, и в случае непредоставления Участником клиринга Запроса на изменение параметров Расчетного кода с указанием Расчетного кода для списания комиссионных вознаграждений для Расчетного кода Участника клиринга, входящего в состав / соответствующего Торгово-клиринговому счету, указанному в заявке на заключение Сделки;

4) по Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета Т+, указанного в заявке на заключение Сделки / Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета Т+, соответствующего Торгово-клиринговому счету имущественного пула (по Сделкам, заключенным с указанием Торгово-клирингового счета имущественного пула), в случае непредоставления Участником клиринга запросов, указанных в подпунктах 1) и 2) настоящего пункта общей части Правил клиринга;

5) по Счету обеспечения Т0, входящему в состав Торгово-клирингового счета Т0, указанного в заявке на заключение Сделки / по Счету обеспечения Т0 в российских рублях, соответствующего Счету обеспечения Т) в иностранной валюте, входящему в состав Торгово-клирингового счета Т0, указанного в заявке на заключение Сделки, в случае непредоставления Участником клиринга запросов, указанных в подпунктах 1) и 2) настоящего пункта общей части Правил клиринга. В случае отсутствия Счета обеспечения Т0 в российских рублях, соответствующего Счету обеспечения Т0 в иностранной валюте, оборотная часть комиссионного вознаграждения по такой сделке удерживается по Расчетному коду, соответствующему Счету обеспечения Т0 в иностранной валюте.

53.13. Размер обязательства Участника клиринга / Участника торгов по уплате комиссионного вознаграждения может рассчитываться с учетом выбранного Участником клиринга / Участником торгов тарифного плана, если это предусмотрено соответствующими тарифами.

53.13.1. Тарифный план действует для Идентификатора Участника торгов / для Идентификатора Участника клиринга. Тарифный план применяется для всех соответствующих Сделок, заключенных на основании заявок, поданных с указанием Торгово-клирингового счета Участника клиринга, а также с указанием Торгово-клиринговых счетов 2-го и 3-го уровней, открытых в рамках Идентификатора Участника торгов / Идентификатора Участника клиринга.

53.13.2. Выбор или изменение тарифного плана осуществляется Участником торгов / Участником клиринга путем предоставления Клиринговому центру соответствующего Запроса о выборе тарифного плана.

Тарифные планы применяются с первого числа календарного месяца, за исключением тарифных планов без постоянной части комиссионного вознаграждения, которые, в случае первоначального допуска к клиринговому обслуживанию, могут применяться с любого числа календарного месяца.

Запрос о выборе 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.

53.13.3. Если тарифами предусмотрено наличие тарифных планов по соответствующим сделкам, Участникам торгов / Участникам клиринга, не выбравшим ни один из тарифных планов по соответствующим сделкам, устанавливается тарифный план без постоянной части комиссионного вознаграждения, 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.

53.13.4. В случае выбора Участником торгов / Участником клиринга тарифного плана, содержащего постоянную часть комиссионного вознаграждения, такая постоянная часть комиссионного вознаграждения определяется в первый Расчетный день календарного месяца, за который взимается постоянная часть комиссионного вознаграждения.

53.13.5. В случае приостановки / прекращения допуска Участника торгов к торгам / Участника клиринга к клиринговому обслуживанию в течение календарного месяца, постоянная часть комиссионного вознаграждения Биржи за организацию торгов, постоянная часть вознаграждения Технического центра за предоставление ИТС и/или постоянная часть комиссионного вознаграждения Клирингового центра за клиринговое обслуживание, уплаченная Участником торгов / Участником клиринга, не пересчитывается и Участнику торгов / Участнику клиринга не возвращается.

53.14. Тарифами Клирингового центра и/или Биржи может быть предусмотрено предоставление Участнику клиринга / Участнику торгов премии при выполнении условий, необходимых для получения премии.

Порядок перечисления премии установлен в соответствующей специальной части Правил клиринга.

53.15. Комиссионное вознаграждение Клирингового центра за учет индивидуального клирингового и иного обеспечения определяется и взимается Клиринговым

центром с Участника клиринга не позднее 25 числа календарного месяца, следующего за месяцем оказания услуг (за исключением случаев, предусмотренных Тарифами Клирингового центра).

53.15.1. Комиссионное вознаграждение за учет индивидуального клирингового и иного обеспечения, рассчитанное по Счетам гарантийных фондов и Счетам обеспечения под стресс (а также плата в пользу Технического центра за услуги технического доступа), учитывается по основному Расчетному коду для списания комиссионных вознаграждений, открытому для фондового рынка и рынка депозитов, в случае его отсутствия – по Расчетному коду для списания комиссионных вознаграждений, открытому для валютного рынка и рынка драгоценных металлов, в случае его отсутствия – по Расчетному коду для списания комиссионных вознаграждений, открытому для срочного рынка, в случае его отсутствия – по Расчетному коду для списания комиссионных вознаграждений, открытому для товарного рынка, в случае его отсутствия – по Расчетному коду для списания комиссионных вознаграждений, открытому для рынка Стандартизированных ПФИ.

53.15.2. Комиссионное вознаграждение за учет индивидуального клирингового и иного обеспечения, рассчитанное по Счетам обеспечения, учитывается по Расчетному коду, соответствующему Счету обеспечения, на котором учитывалось указанное индивидуальное клиринговое или иное обеспечение, а в случае предоставления Участником клиринга Запроса о выборе основного Расчетного кода для списания комиссионных вознаграждений в соответствии с пунктом 53.9 общей части Правил клиринга, в котором указан признак, означающий, что с основного Расчетного кода для списания комиссионных вознаграждений, указанного в таком запросе, необходимо также удерживать комиссионное вознаграждение Клирингового центра за учет индивидуального клирингового и иного обеспечения, - по основному Расчетному коду для списания комиссионных вознаграждений, указанного в таком запросе.

53.15.3. В случае закрытия Расчетного кода, на котором учитывалось индивидуальное клиринговое и иное обеспечение, и непредоставления Участником клиринга Запроса о выборе основного Расчетного кода для списания комиссионных вознаграждений, указанного в подпункте 53.15.2 общей части Правил клиринга, удержание комиссионного вознаграждения Клирингового центра за учет индивидуального клирингового и иного обеспечения производится с основного Расчетного кода для списания комиссионных вознаграждений.

53.16. Если Правилами клиринга, и / или Тарифами Клирингового центра, и/или документами Биржи / Технического центра не установлено иное, комиссионное вознаграждение Клирингового центра, Биржи, Технического центра определяется в дату оказания услуги – для ежедневных комиссионных вознаграждений, в месяц оказания услуг в дату, установленную соответствующими тарифами, - для ежемесячных комиссионных вознаграждений.

53.16.1. Если Правилами клиринга, и / или Тарифами Клирингового центра, и/или Временным регламентом не установлено иное, комиссионное вознаграждение Клирингового центра, Биржи, Технического центра взимается с Участника клиринга в день его определения.

53.16.2. Информация о рассчитанных комиссионных вознаграждениях предоставляется Клиринговым центром Участникам клиринга в отчетах о комиссионных вознаграждениях, предусмотренных специальными частями Правил клиринга.

53.16.3. Информация о комиссионных вознаграждениях, удержанных с Участников клиринга по Расчетным кодам Участника клиринга, предоставляется Клиринговым центром Участникам клиринга в Отчете о движении денежных средств.

53.17. Начисление процентов на денежные средства, составляющие индивидуальное или коллективное клиринговое обеспечение, производится Клиринговым центром в каждый Расчетный день по соответствующей валюте за каждый календарный день месяца. Если за Расчетным днем по соответствующей валюте следует день (дни) текущего месяца, не являющийся Расчетным днем по соответствующей валюте, сумма процентов в такой Расчетный день начисляется с учетом этих дней, если первому Расчетному дню месяца по соответствующей валюте предшествует день (дни) этого месяца, не являющиеся Расчетными днями по соответствующей валюте, сумма процентов в такой Расчетный день начисляется с учетом этих дней.

53.17.1. Выплата Участникам клиринга процентов на денежные средства, составляющие индивидуальное или коллективное клиринговое обеспечение, производится Клиринговым центром в первый Расчетный день месяца по соответствующей валюте, следующего за месяцем, за который выплачиваются указанные проценты.

Решением Клирингового центра о начислении и выплате Участникам клиринга процентов на денежные средства, составляющие индивидуальное и/или коллективное клиринговое обеспечение, может быть установлен иной порядок выплаты процентов.

53.17.2. При прекращении договора об оказании клиринговых услуг выплата процентов на денежные средства, составляющие индивидуальное или коллективное клиринговое обеспечение, производится в последний день действия указанного договора.

53.17.3. При прекращении договора об оказании клиринговых услуг в случае отзыва (аннулировании) лицензии на осуществление банковских операций у Участника клиринга – Кредитной организации начисление процентов на денежные средства, составляющие индивидуальное или коллективное клиринговое обеспечение, производится до дня (включительно), предшествующего дню отзыва (аннулирования) лицензии на осуществление банковских операций у Участника клиринга – Кредитной организации, выплата указанных процентов – в день отзыва (аннулирования) лицензии на осуществление банковских операций у Участника клиринга – Кредитной организации.

53.17.4. При прекращении договора об оказании клиринговых услуг в случае назначения временной администрации или принятия арбитражным судом решения о введении одной из процедур банкротства в отношении Участника клиринга – Некредитной организации начисление процентов на денежные средства, составляющие индивидуальное или коллективное клиринговое обеспечение, производится до дня (включительно), предшествующего дате назначения временной администрации, или дате принятия арбитражным судом решения о введении одной из процедур банкротства, или дате принятия арбитражным судом решения о признании Участника клиринга банкротом и об открытии конкурсного производства, в зависимости от того, какая из указанных дат наступила ранее, выплата указанных процентов – в день, следующий за датой назначения временной администрации,

или день, следующий за датой принятия арбитражным судом решения о введении одной из процедур банкротства, или день, следующий за датой принятия арбитражным судом решения о признании Участника клиринга банкротом и об открытии конкурсного производства, в зависимости от того, какая из указанных дат наступила ранее.

53.17.5. Проценты на денежные средства, составляющие индивидуальное или коллективное клиринговое обеспечение, начисляются на сумму денежных средств в соответствующей валюте, не превышающую требования к размеру Обеспечения / Обеспечения под стресс / взносов в Гарантийные фонды, предъявляемого Клиринговым центром к соответствующему Участнику клиринга, при этом для целей определения указанной суммы ценные бумаги и денежные средства, внесенные в качестве соответствующего вида обеспечения Участника клиринга, учитываются в следующей последовательности:

1) ценные бумаги;
2) иностранная валюта;
3) российские рубли.

Последовательность учета иностранных валют для целей определения указанной суммы устанавливается в решении Клирингового центра о начислении и выплате Участникам клиринга процентов на денежные средства, составляющие индивидуальное и/или коллективное клиринговое обеспечение.

Решением Клирингового центра о начислении и выплате Участникам клиринга процентов на денежные средства, составляющие индивидуальное и/или коллективное клиринговое обеспечение, может быть установлена иная последовательность учета ценных бумаг и/или денежных средств для целей определения суммы денежных средств, на которую начисляются проценты.

При этом ценные бумаги и иностранная валюта учитываются по Нижней границе диапазона оценки рыночных рисков с учётом лимитов концентрации.

53.17.6. Проценты на денежные средства в российских рублях, составляющие индивидуальное или коллективное клиринговое обеспечение, выплачиваются в российских рублях.

Проценты на денежные средства в иностранной валюте, составляющие индивидуальное или коллективное клиринговое обеспечение, выплачиваются в соответствующей иностранной валюте.

При выплате процентов Участникам клиринга – нерезидентам Клиринговый центр в установленных российским законодательством случаях как налоговый агент удерживает сумму налога на доходы.

53.17.7. Сумма процентов в соответствующей валюте на денежные средства, составляющие индивидуальное или коллективное клиринговое обеспечение, увеличивает сумму соответствующего Обеспечения / Обеспечения под стресс / взносов в Гарантийные фонды, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга / Расчетному коду для учета Обеспечения под стресс / взносов в Гарантийные фонды, на денежные средства, учитываемые по которым, начислены проценты.

53.17.8. Информация о начисленных и выплаченных процентах на денежные средства, составляющие индивидуальное или коллективное клиринговое обеспечение, предоставляется Клиринговым центром Участникам клиринга в Отчете о движении

денежных средств, о начисленных – ежедневно, о выплаченных – ежемесячно в дату выплаты.

53.18. Плата в пользу Технического центра за услуги технического доступа, учитывается по основному Расчетному коду для списания комиссионных вознаграждений, порядок определения которого установлен подпунктом 53.15.1 общей части Правил клиринга, и удерживается не позднее пятого рабочего дня месяца, следующего за месяцем оказания услуг.

## Статья 54. Общий порядок представления отчетов по итогам клиринга

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

- Отчет об Итоговых нетто-обязательствах / Итоговых нетто-требованиях, содержащий информацию об обязательствах, определенных по результатам клиринга (по Расчетным кодам Единого пула и Расчетным кодам Участника клиринга, открытым для фондового рынка), содержащий информацию об обязательствах, определенных по итогам клиринга;
- Отчет о движении денежных средств, содержащий информацию о размере Обеспечения в денежных средствах / драгоценных металлах, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, об изменении размера такого Обеспечения, включая информацию об использовании Обеспечения, в том числе для исполнения обязательств, определенных по итогам клиринга;
- Отчет о гарантийных фондах, содержащий информацию, указанную в пункте 32.14 общей части Правил клиринга;
- Отчет об обеспечении под стресс, содержащий информацию, указанную в пункте 32.14 общей части Правил клиринга;
- Отчет о Маржинальном требовании, содержащий информацию о наличии Маржинального требования, Маржинального требования по фондам, Маржинального требования по обеспечению под стресс, и о размере указанных маржинальных требований;
- Требование о погашении Задолженности, содержащий информацию о наличии у Участника клиринга Задолженности и ее размере;
- Отчет о Клиринговых идентификаторах, содержащий информацию о Клиринговых идентификаторах, являющихся Аналогом собственноручной подписи на соответствующих биржевых рынках.

Специальными частями Правил клиринга установлен перечень отчетов, направляемых по итогам клиринга на соответствующем биржевом рынке.

54.2. Отчеты, указанные в пункте 54.1 общей части Правил клиринга, направляются Участнику клиринга в форме электронных документов в соответствии с Порядком ЭДО.

На основании письменного запроса Участника клиринга могут быть изготовлены (распечатаны) копии электронных документов на бумажном носителе.

Копии электронных документов на бумажном носителе подписываются уполномоченным лицом Клирингового центра и предоставляются/направляются Участнику клиринга.

54.3. Участнику клиринга на основании его письменного запроса могут быть выданы отчеты, не предусмотренные пунктом 54.1 общей части Правил клиринга и специальными частями Правил клиринга (далее – нестандартные отчеты), в форме электронного документа или в бумажной форме.

54.4. Копии отчетов в бумажной форме или в форме электронных документов, указанные в пункте 54.2 общей части Правил клиринга, а также нестандартные отчеты в форме электронного документа или в бумажной форме, указанные в пункте 54.3 общей части Правил клиринга, предоставляются/направляются Участникам клиринга в течение 5-ти рабочих дней после получения Клиринговым центром от Участника клиринга соответствующего запроса.

За предоставление указанных копий отчетов с Участника клиринга взимается комиссионное вознаграждение в соответствии с Тарифами Клирингового центра.

54.5. 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.

54.6. Перечень отчетов, предоставляемых Клиринговым центром в соответствии с общей и специальными частями Правил клиринга, а также форматы электронных документов, предоставляемых посредством ЭДО, и формы документов, предоставляемых в бумажной форме, установлены соответствующими внутренними документами Клирингового центра (соответствующими частями внутренних документов Клирингового центра). Указанные документы раскрываются Клиринговым центром путем размещения на Сайте Клирингового центра.

# РАЗДЕЛ VI. ПРОЧИЕ УСЛОВИЯ

## Статья 55. Перевод обязательств и Обеспечения одного Участника клиринга другому Участнику клиринга

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

В Заявлении должны быть указаны:

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

55.1.1. основания, предусмотренные подпунктами 13.1.3-13.1.15, 13.13.2-13.13.8, 13.15.2-13.15.4 общей части Правил клиринга;

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

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

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

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

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

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

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

55.2. Клиринговый центр вправе отказать в исполнении Заявления на Перевод обязательств и Обеспечения, если основания для осуществления Перевода обязательств и Обеспечения, указанные в Заявлении, наступили ранее, чем за 30 (тридцать) дней до дня подачи Заявления.

55.3. Днем начала процедуры Перевода обязательств и Обеспечения считается день отзыва (аннулирования) Банком России лицензии на осуществление банковских операций у Участника клиринга – кредитной организации или день назначения временной администрации или день принятия арбитражным судом решения о введении в отношении Участника клиринга – Некредитной организации одной из процедур банкротства, в случае проведения процедуры Перевода обязательств и Обеспечения по указанным основаниям (далее – основания, установленные законодательством), или день получения Клиринговым центром от Обособленного клиента Заявления на перевод обязательств и Обеспечения, в случае проведения процедуры Перевода обязательств и Обеспечения по иным основаниям, предусмотренным пунктом 55.1 общей части Правил клиринга.

55.4. Процедура Перевода обязательств и Обеспечения не может занимать более 2 (двух) дней со дня ее начала, в случае проведения процедуры Перевода обязательств и Обеспечения по основаниям отзыва (аннулирования) Банком России лицензии на осуществление банковских операций у Участника клиринга – кредитной организации, назначения временной администрации или принятия арбитражным судом решения о введении в отношении Участника клиринга – Некредитной организации одной из процедур банкротства, или более 2 (двух) Расчетных дней со дня ее начала, в случае проведения процедуры Перевода обязательств и Обеспечения по иным основаниям, предусмотренным пунктом 55.1 общей части Правил клиринга.

55.5. Подача Базовым Участником клиринга Запроса на регистрацию Обособленного клиента является безусловным согласием Базового участника клиринга на раскрытие (передачу) Клиринговым центром Участнику клиринга – реципиенту информации о Базовом участнике, предусмотренной пунктом 55.10 общей части Правил клиринга. Такое согласие не может быть отозвано Базовым Участником клиринга.

55.6. Перевод обязательств и Обеспечения не осуществляется при отсутствии согласия Участника клиринга – реципиента, предусмотренного пунктом 55.11 общей части Правил клиринга.

55.7. Заявление на перевод обязательств и Обеспечения предоставляется Обособленным клиентом вместе с копией документа, подтверждающего полномочия лица, подписавшего Заявление (в случае если такой документ не был предоставлен Клиринговому центру ранее). Подача Заявления на перевод обязательств и Обеспечения является безусловным согласием Обособленного клиента на раскрытие (передачу) Клиринговым центром Участнику клиринга – реципиенту информации, предусмотренной пунктом 55.10 общей части Правил клиринга.

55.7.1. Обособленный клиент вправе предоставить Клиринговому центру Заявление на перевод обязательств и Обеспечения с указанием оснований, установленных законодательством, заранее, до наступления указанных оснований.

55.7.2. В случае если между Обособленным клиентом и Клиринговым центром предусмотрен обмен сообщениями с использованием ЭДО или по системе S.W.I.F.T., Обособленный клиент вправе направить Заявление на перевод обязательств и Обеспечения в форме сообщения с использованием ЭДО или по системе S.W.I.F.T.

55.7.3. Клиринговый центр не осуществляет проверку достоверности оснований для Перевода обязательств и Обеспечения, указанных Обособленным клиентом в Заявлении. При этом Клиринговый центр вправе отказать Обособленному клиенту в исполнении Заявления на перевод обязательств и Обеспечения при наличии информации об отсутствии указанных в Заявлении оснований.

55.7.4. Клиринговый центр не несет ответственности за убытки, понесенные Базовым участником клиринга / Обособленным клиентом / Участником клиринга – реципиентом в случае исполнения / неисполнения Клиринговым центром Заявления, поданного Обособленным клиентом в соответствии с пунктом 55.1 общей части Правил клиринга.

55.8. В случае если Клиринговому центру стало известно о наступлении в отношении Базового Участника клиринга одного или нескольких оснований для Перевода обязательств и Обеспечения, предусмотренных пунктом 55.1 общей части Правил клиринга, а Заявление на перевод обязательств и Обеспечения от Обособленного клиента не получено, Клиринговый центр вправе сообщить Обособленному клиенту о наличии таких оснований путем направления сообщения по адресу электронной почты указанному в Запросе на регистрацию Обособленного клиента.

55.9. Клиринговый центр незамедлительно после принятия к исполнению Заявления на перевод обязательств и Обеспечения, но не ранее наступления оснований, установленных законодательством (для Заявлений с указанием таких оснований), уведомляет Биржу:

- о принятии к исполнению Заявления на перевод обязательств и Обеспечения;
- о необходимости установления запрета на подачу Участниками торгов заявок на заключение сделок, стороной по которым будет являться Базовый Участник клиринга, за счет Обособленного клиента, предоставившего Заявление на перевод обязательств и Обеспечения;
- о необходимости снятия таких зарегистрированных заявок.

В случае проведения процедуры Перевода обязательств и Обеспечения по основанию, предусмотренному подпунктом 55.1.8 общей части Правил клиринга, Клиринговый центр вправе осуществить действия, указанные в настоящем пункте общей части Правил клиринга в иное время, до момента направления Участнику клиринга – реципиенту информации в соответствии с пунктом 55.10 общей части Правил клиринга.

Клиринговый центр вправе не осуществлять действия, указанные в настоящем пункте общей части Правил клиринга, в случае, если на момент, когда Клиринговый центр должен уведомить Биржу, Биржей не проводятся организованные торги на биржевом рынке, на котором необходимо осуществить Перевод обязательств и Обеспечения, в том числе в связи с окончанием времени торгов на соответствующем биржевом рынке.

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

55.11. Участник клиринга – реципиент предоставляет Клиринговому центру согласие на прием обязательств / требований и Обеспечения Базового Участника клиринга в денежных средствах / ценных бумагах / драгоценных металлах / товарах, информация о которых передана Участнику клиринга – реципиенту в соответствии с пунктом 55.10 общей части Правил клиринга (далее – Согласие на прием обязательств и Обеспечения), не позднее времени, указанного во Временном регламенте.

55.11.1. Согласие на прием обязательств и Обеспечения должно содержать информацию, предусмотренную соответствующей специальной частью Правил клиринга.

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

Указание в Согласии на прием обязательств и Обеспечения на необходимость обособления клиента, предоставившего Заявление, является Запросом Участника клиринга – реципиента на регистрацию Обособленного клиента.

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

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

55.13. После получения от Участника клиринга – реципиента Согласия на прием обязательств и Обеспечения в соответствии с пунктом 55.11 общей части Правил клиринга и до конца соответствующего дня, следующего за днем начала процедуры Перевода обязательств и Обеспечения, Клиринговый центр исполняет Заявление на перевод обязательств и Обеспечения, для чего:

- открывает клиентский Расчетный код Участнику клиринга – реципиенту для Обособленного клиента, предоставившего Заявление на перевод обязательств и Обеспечения, если в Согласии на прием обязательств и Обеспечения Расчетный код не был указан;

- осуществляет действия, предусмотренные соответствующей специальной частью Правил клиринга;
- прекращает учитывать обязательства / требования и Обеспечение Базового Участника клиринга в денежных средствах / ценных бумагах / драгоценных металлах / товарах, определенные в пункте 55.10 общей части Правил клиринга, как обязательства и требования Базового Участника клиринга в отношении Клирингового центра;
- начинает учитывать обязательства / требования и Обеспечение Базового Участника клиринга в денежных средствах / ценных бумагах / драгоценных металлах / товарах, определенные в пункте 55.10 общей части Правил клиринга, как обязательства и требования Участника клиринга – реципиента в отношении Клирингового центра;
- аннулирует регистрацию Расчетных кодов, открытых Базовым Участником клиринга для Обособленного клиента.

55.14. Обособленный клиент вправе до получения Клиринговым центром от Участника клиринга – реципиента Согласия на прием обязательств и Обеспечения отозвать свое Заявление о переводе обязательств и Обеспечения путем направления Клиринговому центру Заявления на отзыв заявления на перевод обязательств и Обеспечения. Заявление на отзыв заявления на перевод обязательств и Обеспечения предоставляется Обособленным клиентом вместе с копией документа, подтверждающего полномочия лица, подписавшего Заявление (в случае если такой документ не был предоставлен Клиринговому центру ранее).

55.14.1. В случае если между Обособленным клиентом и Клиринговым центром предусмотрен обмен сообщениями с использованием ЭДО или по системе S.W.I.F.T., Обособленный клиент вправе направить Заявление на отзыв заявления на перевод обязательств и Обеспечения в форме сообщения с использованием ЭДО или по системе S.W.I.F.T.

55.15. Обособленный клиент вправе до получения Клиринговым центром от Участника клиринга – реципиента Согласия на прием обязательств и Обеспечения заменить первоначально указанного Участника клиринга – реципиента на другого Участника клиринга – реципиента путем направления Клиринговому центру Заявления на перевод обязательств и Обеспечения с указанием наименования нового Участника клиринга – реципиента. Такое Заявление на перевод обязательств и Обеспечения должно содержать сведения, предусмотренные пунктом 55.1 общей части Правил клиринга и предоставляться в порядке, предусмотренном настоящей статьей общей части Правил клиринга.

55.16. В случае неполучения Клиринговым центром Согласия на прием обязательств и Обеспечения от Участника клиринга – реципиента, указанного Обособленным клиентом, в срок, установленный Временным регламентом, Обособленный клиент вправе предоставить Клиринговому центру заявление о возобновлении возможности заключения сделок, стороной по которым будет являться Базовый Участник клиринга, за исключением случаев проведения процедуры Перевода обязательств и Обеспечения по основаниям, установленным законодательством. Получив такое заявление от Обособленного клиента, Клиринговый центр незамедлительно уведомляет Биржу о необходимости возобновления подачи

Участниками торгов заявок на заключение сделок, стороной по которым будет являться Базовый Участник клиринга, за счет Обособленного клиента, предоставившего указанное заявление.

55.17. За осуществление процедур Перевода обязательств и Обеспечения с Участника клиринга – реципиента взимается плата в размере, установленном Тарифами Клирингового центра.

55.18. В целях осуществления Перевода обязательств и Обеспечения Клиринговый центр раскрывает (передает) предусмотренную настоящей статьей общей части Правил клиринга информацию, в том числе инсайдерскую информацию Клирингового центра.

**Статья 56. Порядок действий в случае включения Участника клиринга в перечень организаций, в отношении которых имеются сведения об их причастности к экстремистской деятельности или терроризму, или в перечень организаций, в отношении которых имеются сведения об их причастности к распространению оружия массового уничтожения**

56.1. В дату включения Участника клиринга в перечень организаций, определенный в подпункте 13.13.10 общей части Правил клиринга (далее по тексту настоящей статьи Правил клиринга – перечень), Клиринговый центр незамедлительно:

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

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

- по каждой ценной бумаге суммы (с учетом знака) Нетто-обязательств / Нетто-требований по ценной бумаге по всем Торгово-клиринговым счетам

Участника клиринга, учитываемых на дату включения Участника клиринга в перечень, пересчитанной в российские рубли по Расчетной цене соответствующей ценной бумаги, установленной Клиринговым центром на дату включения Участника клиринга в перечень;

- по каждой иностранной валюте / драгоценному металлу суммы (с учетом знака) Нетто-обязательств / Нетто-требований в соответствующей валюте / соответствующем драгоценном металле Участника клиринга по всем Расчетным кодам и всем Датам исполнения, учитываемых на дату включения Участника клиринга в перечень, пересчитанной в российские рубли по Центральному курсу соответствующей иностранной валюты / драгоценного металла, установленному Клиринговым центром на дату включения Участника клиринга в перечень;
- по каждому товару суммы (с учетом знака) Нетто-обязательств / Нетто-требований по товарам по всем Торгово-клиринговым счетам Участника клиринга, учитываемых на дату включения Участника клиринга в перечень, пересчитанной в российские рубли по Расчетной цене соответствующего товара, установленной Клиринговым центром на дату включения Участника клиринга в перечень;
- суммы (с учетом знака) Нетто-обязательств / Нетто-требований в российских рублях Участника клиринга по всем Расчетным кодам и всем Датам исполнения, учитываемых на дату включения Участника клиринга в перечень;
- по каждому Срочному контракту суммы (с учетом знака) позиций по Срочным контрактам по всем разделам регистра учета позиций Участника клиринга, учитываемых на дату включения Участника клиринга в перечень, пересчитанной в российские рубли по Расчетной цене соответствующего Срочного контракта, установленной Клиринговым центром на дату включения Участника клиринга в перечень;
- по каждому Договору СПФИ расчетной стоимости каждого Договора СПФИ, учитываемого на регистре учета позиций Участника клиринга, рассчитанной для Участника клиринга на конец дня включения Участника клиринга в перечень (учитывается со знаком, обратным к знаку, который имеет расчетная стоимость Договора СПФИ). Расчетная стоимость в иностранной валюте пересчитывается в российские рубли по Центральному курсу соответствующей иностранной валюты, установленному Клиринговым центром на дату включения Участника клиринга в перечень.

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

56.3. Клиринговый центр вправе предъявить к Участнику клиринга требование о взыскании нетто-обязательства Участника клиринга, рассчитанного в порядке, предусмотренном пунктом 56.2 общей части Правил клиринга.

Клиринговый центр вправе использовать средства Гарантийного фонда, за исключением средств Участника клиринга, включенного в перечень, для

исполнения указанного нетто-обязательства в порядке, предусмотренном статьей 48 общей части Правил клиринга.

56.4. После исключения Участника клиринга из перечня:

56.4.1. в случае если для исполнения нетто-обязательства Участника клиринга, рассчитанного в порядке, предусмотренном пунктом 56.2 общей части Правил клиринга, не были использованы средства Гарантийного фонда, и по Участнику клиринга учитываются Обеспечение, Обеспечение под стресс и/или взнос в Гарантийный фонд, Клиринговый центр осуществляет действия, необходимые для исполнения указанного нетто-обязательства за счет указанных средств, полностью или частично, а в случае, если указанных средств недостаточно, - направляет Участнику клиринга уведомление с требованием о погашении указанного нетто-обязательства в неисполненной части;

56.4.2. в случае если для исполнения нетто-обязательства Участника клиринга, рассчитанного в порядке, предусмотренном пунктом 56.2 общей части Правил клиринга, были использованы средства Гарантийного фонда, и по Участнику клиринга учитываются Обеспечение, Обеспечение под стресс и/или взнос в Гарантийный фонд, Клиринговый центр осуществляет действия, необходимые для возмещения средств Гарантийного фонда за счет указанных средств, полностью или частично, а в случае, если указанных средств недостаточно, - направляет Участнику клиринга уведомление с требованием о возмещении средств Гарантийного фонда.

## Статья 57. Порядок урегулирования обязательств в случае прекращения допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию (ликвидационный неттинг в отношении Участника клиринга)

57.1. В случае отзыва (аннулирования) Банком России у Участника клиринга – Кредитной организации лицензии на осуществление банковских операций, допуск к клиринговому обслуживанию и клиринговое обслуживание Участника клиринга – Кредитной организации прекращается с даты, следующей за датой отзыва (аннулирования) Банком России у такого Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций, за исключением расчета Клиринговым центром нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга в соответствии с пунктами 57.11-57.12 общей части Правил клиринга и исполнения обязательств по возврату Участнику клиринга денежных средств / драгоценных металлов / ценных бумаг в соответствии с пунктом 57.15 общей части Правил клиринга.

Обязательства по Сделкам, стороной по которым является Участник клиринга, заключенным до даты отзыва такой лицензии, и обязательства по договору об имущественном пуле прекращаются полностью на дату, следующую за датой отзыва (аннулирования) Банком России у такого Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций, в порядке, установленном пунктом 57.9 общей части Правил клиринга.

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

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

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

57.2. В случае назначения временной администрации или принятия арбитражным судом решения о введении в отношении Участника клиринга – Некредитной организации одной из процедур банкротства, допуск к клиринговому обслуживанию и клиринговое обслуживание Участника клиринга – Некредитной организации прекращается с даты, следующей за датой назначения временной администрации, или даты, следующей за датой принятия арбитражным судом решения о введении в отношении Участника клиринга одной из процедур банкротства, или даты, следующей за датой принятия арбитражным судом решения о признании участника клиринга банкротом и об открытии конкурсного производства, в зависимости от того, какая дата наступила ранее, за исключением расчета Клиринговым центром нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга в соответствии с пунктами 57.11-57.12 общей части Правил клиринга и исполнения обязательств по возврату Участнику клиринга денежных средств / драгоценных металлов / ценных бумаг в соответствии с пунктом 57.15 общей части Правил клиринга.

Обязательства по Сделкам, стороной по которым является Участник клиринга, и обязательства по договору об имущественном пуле прекращаются полностью на дату, следующую за датой назначения временной администрации, или дату, следующую за датой принятия арбитражным судом решения о введении в отношении Участника клиринга одной из процедур банкротства, или дату, следующую за датой принятия арбитражным судом решения о признании участника клиринга банкротом и об открытии конкурсного производства, в зависимости от того, какая дата наступила ранее, в порядке, установленном пунктом 57.9 общей части Правил клиринга.

57.3. В случае назначения временной администрации по управлению Участником клиринга – Кредитной организацией в рамках мер по предупреждению банкротства кредитной организации и введения моратория на удовлетворение требований кредиторов Участника клиринга – Кредитной организации, допуск к клиринговому обслуживанию и клиринговое обслуживание Участника клиринга – Кредитной организации прекращается с даты, следующей за датой введения моратория на удовлетворение требований кредиторов Участника клиринга – Кредитной организации, за исключением расчета Клиринговым центром нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга в соответствии с пунктами 57.11-57.12 общей части Правил клиринга и исполнения обязательств по возврату Участнику

клиринга денежных средств / драгоценных металлов / ценных бумаг в соответствии с пунктом 57.15 общей части Правил клиринга

Обязательства по Сделкам, стороной по которым является Участник клиринга, и обязательства по договору об имущественном пуле прекращаются полностью на дату, следующую за датой введения моратория на удовлетворение требований кредиторов Участника клиринга – Кредитной организации в порядке, установленном пунктом 57.9 общей части Правил клиринга.

57.4. В случае назначения временной администрации по управлению Участником клиринга – Кредитной организацией в рамках мер по предупреждению банкротства кредитной организации Клиринговый центр вправе начиная с даты назначения временной администрации принять решение о:

- прекращении допуска к клиринговому обслуживанию и клирингового обслуживания Участника клиринга – Кредитной организации;
- о прекращении обязательств по Сделкам, стороной по которым является Участник клиринга, и обязательств по договору об имущественном пуле;
- о проведении Клиринговым центром расчета нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга в соответствии с пунктами 57.11-57.12 общей части Правил клиринга.

В случае принятия решения в соответствии с настоящим пунктом общей части Правил клиринга обязательства по Сделкам, стороной по которым является Участник клиринга, и обязательства по договору об имущественном пуле прекращаются полностью на дату, следующую за датой принятия указанного решения, в порядке, установленном пунктом 57.9 общей части Правил клиринга.

Клиринговый центр посредством ЭДО уведомляет Участника клиринга – Кредитную организацию о принятии решения в соответствии с настоящим пунктом общей части Правил клиринга не позднее дня принятия указанного решения.

57.5. В случае назначения временной администрации или принятия уполномоченным органом решения о введении в отношении Участника клиринга – Нерезидента – некредитной организации одной из процедур банкротства, допуск к клиринговому обслуживанию и клиринговое обслуживание Участника клиринга – Нерезидента – некредитной организации прекращается с даты, следующей за датой, в которую Клиринговый центр узнал о назначении временной администрации или принятии арбитражным судом решения о введении в отношении Участника клиринга – Нерезидента – некредитной организации одной из процедур банкротства, за исключением расчета Клиринговым центром нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга в соответствии с пунктами 57.11-57.12 общей части Правил клиринга и исполнения обязательств по возврату Участнику клиринга денежных средств / драгоценных металлов / ценных бумаг в соответствии с пунктом 57.15 общей части Правил клиринга.

Обязательства по Сделкам, стороной по которым является Участник клиринга, и обязательства по договору об имущественном пуле прекращаются полностью на дату, следующую за датой, в которую Клиринговый центр узнал о назначении временной администрации или принятии уполномоченным органом решения о введении в отношении Участника клиринга – Нерезидента – некредитной

организации одной из процедур банкротства, в порядке, установленном пунктом 57.9 общей части Правил клиринга.

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

57.6. В случае отзыва (аннулирования) специального разрешения (лицензии или иного основания), выданного компетентным органом государства учреждения Участника клиринга – Нерезидента, на основании которого Участник клиринга – Нерезидент имеет право осуществлять банковские операции и/или иные операции на финансовых рынках, предусмотренные личным законом Участника клиринга – Нерезидента, допуск к клиринговому обслуживанию и клиринговое обслуживание Участника клиринга – Нерезидента, в том числе Участника клиринга – Банка ЕврАзЭс/ЕАЭС, прекращается с даты, следующей за датой, в которую Клиринговый центр узнал об отзыве (аннулировании) такого специального разрешения (лицензии или иного основания), за исключением расчета Клиринговым центром нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга – Нерезидента в соответствии с пунктами 57.11-57.12 общей части Правил клиринга и исполнения обязательств по возврату Участнику клиринга денежных средств / драгоценных металлов / ценных бумаг в соответствии с пунктом 57.15 общей части Правил клиринга.

Обязательства по Сделкам, стороной по которым является Участник клиринга, и обязательства по договору об имущественном пуле прекращаются полностью на дату, следующую за датой, в которую Клиринговый центр узнал об отзыве (аннулировании) такого специального разрешения (лицензии или иного основания), в порядке, установленном пунктом 57.9 общей части Правил клиринга.

57.6.1. Подтверждением факта отзыва (аннулирования) указанного специального разрешения (лицензии или иного основания), выданного компетентным органом государства учреждения Участника клиринга – Нерезидента, является письменное уведомление компетентного органа государства учреждения Участника клиринга – Нерезидента, направленное Клиринговому центру (в том числе, посредством факсимильной связи) и/или размещенная компетентным органом государства учреждения Участника клиринга – Нерезидента на сайте вышеуказанного компетентного органа в сети Интернет информации о принятом решении об отзыве (аннулировании) выданного Участнику клиринга – Нерезиденту специального разрешения (лицензии или иного основания), в соответствии с которым Участник клиринга – Нерезидент имеет право осуществлять банковские операции и/или иные операции на финансовых рынках, предусмотренные личным законом Участника клиринга – Нерезидента, и/или направленное компетентным органом по

электронному адресу Клирингового центра соответствующее электронное сообщение.

57.7. В случае прекращения Соглашения о сотрудничестве/Договора ЕАЭС для Российской Федерации либо для государства – стороны Соглашения о сотрудничестве/Договора ЕАЭС, являющегося государством учреждения Участника-клиринга – Банка ЕврАзЭс/ЕАЭС, допуск к клиринговому обслуживанию и клиринговое обслуживание такого Участника клиринга – Банка ЕврАзЭс/ЕАЭС прекращается с даты, следующей за датой прекращения Соглашения о сотрудничестве/Договора ЕАЭС для Российской Федерации либо для государства – стороны Соглашения о сотрудничестве/Договора ЕАЭС, являющегося государством учреждения такого Участника-клиринга – Банка ЕврАзЭс/ЕАЭС, за исключением расчета Клиринговым центром нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга – Банка ЕврАзЭс/ЕАЭС в соответствии с пунктами 57.11-57.12 общей части Правил клиринга и исполнения обязательств по возврату Участнику клиринга денежных средств / драгоценных металлов / ценных бумаг в соответствии с пунктом 57.15 общей части Правил клиринга.

Обязательства по Сделкам, стороной по которым является Участник клиринга, и обязательства по договору об имущественном пуле прекращаются полностью на дату, следующую за датой прекращения Соглашения о сотрудничестве/Договора ЕАЭС для Российской Федерации либо для государства – стороны Соглашения о сотрудничестве/Договора ЕАЭС, являющегося государством учреждения такого Участника-клиринга – Банка ЕврАзЭс/ЕАЭС, в порядке, установленном пунктом 57.9 общей части Правил клиринга.

57.8. В случае прекращения международного договора, в соответствии с которым учрежден Участник-клиринга – Международная организация, для Российской Федерации либо в случае принятия уполномоченными лицами сторон указанного международного договора решения о прекращении деятельности Участника-клиринга – Международной организации, допуск к клиринговому обслуживанию и клиринговое обслуживание Участника-клиринга – Международной организации прекращается с даты, следующей за датой прекращения международного договора, в соответствии с которым такой Участник-клиринга – Международная организация учрежден, для Российской Федерации, либо с даты, следующей за датой принятия уполномоченными лицами сторон указанного международного договора решения о прекращении деятельности Участника-клиринга – Международной организации, за исключением расчета Клиринговым центром нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга – Международной организации в соответствии с пунктами 57.11-57.12 общей части Правил клиринга и исполнения обязательства по возврату Участнику клиринга денежных средств / драгоценных металлов / ценных бумаг в соответствии с пунктом 57.15 общей части Правил клиринга.

Обязательства по Сделкам, стороной по которым является Участник клиринга, и обязательства по договору об имущественном пуле прекращаются полностью на дату, следующую за датой прекращения международного договора, в соответствии с которым такой Участник-клиринга – Международная организация учрежден, для Российской Федерации, либо на дату, следующую за датой принятия уполномоченными лицами сторон указанного международного договора решения о

прекращении деятельности Участника-клиринга – Международной организации, в порядке, установленном пунктом 57.9 общей части Правил клиринга.

57.9. В случаях прекращения клирингового обслуживания Участника клиринга по основаниям, указанным в пунктах 57.1-57.8 общей части Правил клиринга, обязательства по Сделкам с центральным контрагентом, стороной по которым является Участник клиринга, и обязательства по договору об имущественном пуле прекращаются возникновением нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга, рассчитанных в соответствии с пунктом 57.11 общей части Правил клиринга, обязательства по Сделкам без центрального контрагента – прекращаются возникновением нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга в отношении других Участников клиринга – его контрагентов по указанным Сделкам, рассчитанных в соответствии с пунктом 57.12 общей части Правил клиринга, за исключением случая, предусмотренного пунктом 57.10 общей части Правил клиринга.

57.10. При урегулировании обязательств в случае прекращения допуска к клиринговому обслуживанию Участника клиринга, являющегося одновременно участником клиринга НКО АО НРД, основаниям, указанным в пунктах 57.1, 57.3, 57.4 общей части Правил клиринга, и при наличии у такого Участника клиринга непрекращенных обязательств по Сделкам, заключенным с Банком России, клиринг по которым осуществляет как Клиринговый центр, так и НКО АО НРД, и при принятии НКО АО НРД решения о прекращении допуска к клиринговому обслуживанию и клирингового обслуживания Участника клиринга – Кредитной организации, прекращении обязательств по Сделкам, стороной по которым является Участник клиринга, и проведении расчета нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга в случае назначения временной администрации по управлению Участником клиринга – Кредитной организацией в рамках мер по предупреждению банкротства кредитной организации, Клиринговый центр в соответствии с пунктом 57.12 общей части Правил клиринга рассчитывает предварительное нетто-обязательство / нетто-требование Участника клиринга – кредитной организации в отношении контрагента – Банка России, и не позднее 3 (трех) рабочих дней с даты отзыва (аннулирования) лицензии на осуществление банковских операций у Участника клиринга – Кредитной организации / с даты введения моратория на удовлетворение требований кредиторов Участника клиринга – Кредитной организации / с даты принятия Клиринговым центром решения в соответствии с пунктом 57.4 общей части Правил клиринга передает информацию о рассчитанном предварительном нетто-обязательстве / нетто-требовании НКО АО НРД для определения нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга – кредитной организации и Банка России. Указанный порядок применяется для обязательств, возникших из договоров, заключенных на условиях одного генерального соглашения.

57.11. Клиринговый центр рассчитывает сумму нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга в российских рублях по Сделкам с центральным контрагентом в порядке, предусмотренном подпунктами 57.11.1-57.11.9 общей части Правил клиринга, отдельно по каждому клиентскому Расчетному коду, по каждому Расчетному коду ДУ и по всем собственным Расчетным кодам Участника клиринга.

57.11.1. Клиринговый центр для каждого имущественного пула и для Расчетного кода (Расчетных кодов) имущественного пула, соответствующего (соответствующих) Расчетному коду (Расчетным кодам) Участника клиринга, по которому (которым) осуществляется расчет суммы нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга:

1) рассчитывает промежуточную величину нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в клиринговых сертификатах участия, равную сумме с учетом знака:
   - Нетто-обязательств / Нетто-требований Участника клиринга по клиринговым сертификатам участия по сделкам РЕПО с центральным контрагентом с клиринговыми сертификатами участия, учитываемых на конец дня прекращения обязательств по Сделкам по Торгово-клиринговым счетам Т+, в состав которых входит Расчетный код (Расчетные коды), по всем Датам исполнения;
   - требований Участника клиринга к Клиринговому центру по получению клиринговых сертификатов участия в количестве, равном полученному Клиринговым центром от Банка России при выкупе клиринговых сертификатов участия у Банка России в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, учитываемых на конец дня прекращения обязательств по Сделкам по Торгово-клиринговым счетам Т+, в состав которых входит Расчетный код (Расчетные коды), по всем Датам исполнения;

   Если величина, рассчитанная в соответствии с настоящим пунктом общей части Правил клиринга положительная, у Участника клиринга учитывается промежуточная величина нетто-требования в клиринговых сертификатах участия, если отрицательная – промежуточная величина нетто-обязательства в клиринговых сертификатах участия.

   Клиринговый центр прибавляет (с учетом знака) к промежуточной величине нетто-обязательства Участника клиринга в клиринговых сертификатах участия количество клиринговых сертификатов участия, учитываемых на конец дня прекращения обязательств по Сделкам по Торгово-клиринговым счетам Т+, в состав которых входит Расчетный код (Расчетные коды), но не большее, чем абсолютное значение указанной промежуточной величины нетто-обязательства Участника клиринга в клиринговых сертификатах участия. При этом Клиринговый центр формирует и передает Расчетному депозитарию распоряжение на перевод клиринговых сертификатов участия в указанном количестве с Раздела Т+, входящего в состав указанного Торгово-клирингового счета Т+, на казначейский счет депо Клирингового центра;

2) рассчитывает промежуточную величину нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в российских рублях по сделкам РЕПО с клиринговыми сертификатами участия, равную сумме с учетом знака:
   - Нетто-обязательств / Нетто-требований Участника клиринга по денежным средствам по сделкам РЕПО с центральным контрагентом с клиринговыми сертификатами участия, учитываемых на конец дня прекращения обязательств по Сделкам по Расчетному коду (Расчетным кодам) по всем Датам исполнения. При этом значение, рассчитанное по сделкам РЕПО с расчетами в иностранной валюте, пересчитывается в

российские рубли по курсу Сделки / средневзвешенному курсу Сделок с иностранной валютой, заключенной / заключенных Клиринговым центром в соответствии с подпунктом 57.11.5 общей части Правил клиринга;

- обязательств Участника клиринга уплатить Клиринговому центру денежные средства в сумме, равной сумме номинальной стоимости клиринговых сертификатов участия, в отношении которых Участником клиринга не были исполнены обязательства перед Банком России по второй части договора репо, учитываемых на конец дня прекращения обязательств по Сделкам по Расчетному коду (Расчетным кодам) по всем Датам исполнения.

Если величина, рассчитанная в соответствии с настоящим пунктом общей части Правил клиринга положительная, у Участника клиринга учитывается промежуточная величина нетто-требования в российских рублях по сделкам РЕПО с клиринговыми сертификатами участия, если отрицательная – промежуточная величина нетто-обязательства в российских рублях по сделкам РЕПО с клиринговыми сертификатами участия;

3) если Участник клиринга является Участником пула, Клиринговый центр продает ценные бумаги и иностранную валюту, учитываемые по Расчетному коду (Расчетным кодам) имущественного пула Участника пула, на соответствующих биржевых рынках в количестве / сумме, соответствующей положительной разности абсолютного значения промежуточной величины нетто-обязательства Участника клиринга в российских рублях, рассчитанной в соответствии с пунктом 2) подпункта 57.11.1 общей части Правил клиринга, и суммы денежных средств в российских рублях, учитываемой на конец дня прекращения обязательств по Сделкам по Расчетному коду (Расчетным кодам) имущественного пула.

Выбор имущества, подлежащего продаже из имущественного пула, осуществляется Клиринговым центром.

Если сумма денежных средств в российских рублях, учитываемая на конец дня прекращения обязательств по Сделкам по Расчетному коду (Расчетным кодам) имущественного пула, а также полученная от продажи ценных бумаг и иностранной валюты, учитываемых по Расчетному коду (Расчетным кодам) имущественного пула Участника пула, больше абсолютного значения указанной промежуточной величины нетто-обязательства Участника клиринга в российских рублях, Клиринговый центр учитывает денежные средства в сумме такого превышения по Расчетному коду (Расчетным кодам), входящему в состав Торгово-клирингового счета Т+, соответствующего Торгово-клиринговому счету имущественного пула, а положительную разность между оставшейся суммой денежных средств в российских рублях и номинальной стоимостью клиринговых сертификатов участия в промежуточной величине нетто-требования Участника клиринга в клиринговых сертификатах участия, прибавляет (с учетом знака) к промежуточной величине нетто-обязательства Участника клиринга в российских рублях.

Если у Участника клиринга, являющегося Участником пула, учитывается промежуточная величина нетто-требования в клиринговых сертификатах

участия, рассчитанная в соответствии с пунктом 1) подпункта 57.11.1 общей части Правил клиринга, сумма денежных средств в российских рублях, равная номинальной стоимости клиринговых сертификатов участия в указанной промежуточной величине нетто-требования Участника клиринга в клиринговых сертификатах участия, вносится Клиринговым центром в соответствующий имущественный пул.

Если сумма денежных средств в российских рублях, учитываемая на конец дня прекращения обязательств по Сделкам по Расчетному коду (Расчетным кодам) имущественного пула, а также полученная от продажи ценных бумаг и иностранной валюты, учитываемых по Расчетному коду (Расчетным кодам) имущественного пула Участника пула, меньше, чем номинальная стоимость клиринговых сертификатов участия в указанной промежуточной величине нетто-требования Участника клиринга в клиринговых сертификатах участия, неисполненное обязательство Участника пула по внесению имущества в имущественный пул учитывается при дальнейшем расчете соответствующего нетто-обязательства / нетто-требования Участника пула в соответствии с подпунктом 57.11.3 общей части Правил клиринга;

4) Клиринговый центр складывает (с учетом знака) промежуточную величину нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в российских рублях, определенную по итогам действий, указанных в пунктах 2)-3) подпункта 57.11.1 общей части Правил клиринга, и произведение 1 (одного) российского рубля, являющегося номинальной стоимостью одного клирингового сертификата участия, и промежуточной величины нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в клиринговых сертификатах участия, определенной по итогам действий, указанных в пункте 1) подпункта 57.11.1 общей части Правил клиринга.

Рассчитанная в соответствии с настоящим пунктом общей части Правил клиринга промежуточная величина нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в российских рублях по сделкам РЕПО с клиринговыми сертификатами участия учитывается при дальнейшем расчете соответствующего нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в соответствии с подпунктом 57.11.3 общей части Правил клиринга.

57.11.2. Клиринговый центр с использованием Клиринговой системы формирует и исполняет распоряжения на перевод ценных бумаг / денежных средств с Торгово-клирингового счета имущественного пула Участника клиринга, оставшихся по итогам действий, указанных в подпункте 57.11.1 общей части Правил клиринга, на соответствующий Торгово-клиринговый счет Т+.

Клиринговые сертификаты участия, учитываемые по Торгово-клиринговому счету Т+, погашаются в количестве, соответствующем количеству / сумме имущества, выданного из имущественного пула в соответствии с настоящим подпунктом общей части Правил клиринга, и определяемом в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

При этом прекращаются все обязательства Участника клиринга, являющегося Участником пула, из договора об имущественном пуле, Клиринговый центр перестает учитывать обязательства по возврату Участнику пула имущества из имущественного пула.

57.11.3. Клиринговый центр рассчитывает следующие промежуточные величины:

- промежуточную величину нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга по ценным бумагам (за исключением клиринговых сертификатов участия), равную сумме значений (с учетом знака) Нетто-обязательств / Нетто-требований Участника клиринга по ценной бумаге (за исключением клиринговых сертификатов участия) по Сделкам с центральным контрагентом (за исключением сделок РЕПО с клиринговыми сертификатами участия), учитываемых на конец дня прекращения обязательств по Сделкам, по каждому Торгово-клиринговому счету Т+ / Торгово-клиринговому счету имущественного пула, соответствующему Расчетному коду, по которому осуществляется расчет нетто-обязательства / нетто-требования / по всем Торгово-клиринговым счетам Т+ / Торгово-клиринговым счетам имущественного пула, соответствующим Расчетным кодам, по которым осуществляется расчет нетто-обязательства / нетто-требования, по всем Датам исполнения;
- промежуточную величину нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга по драгоценным металлам / денежным средствам в иностранной валюте, равную сумме значений (с учетом знака) Нетто-обязательств / Нетто-требований Участника клиринга по драгоценным металлам / денежным средствам в иностранной валюте по Сделкам с центральным контрагентом (за исключением сделок РЕПО с клиринговыми сертификатами участия), учитываемых на конец дня прекращения обязательств по Сделкам, по Расчетному коду (Расчетным кодам) / Расчетному коду (Расчетным кодам) имущественного пула, по всем Датам исполнения;
- промежуточную величину нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга по товарам, равную сумме значений (с учетом знака) Нетто-обязательств / Нетто-требований Участника клиринга по товарам по Сделкам с центральным контрагентом, учитываемых на конец дня прекращения обязательств по Сделкам, по каждому Торгово-клиринговому счету, соответствующему Расчетному коду, по которому осуществляется расчет нетто-обязательства / нетто-требования / по всем Торгово-клиринговым счетам, соответствующим Расчетным кодам, по которым осуществляется расчет нетто-обязательства / нетто-требования, по всем Датам исполнения.

Если промежуточная величина, рассчитанная в соответствии с настоящим подпунктом общей части Правил клиринга положительная, у Участника клиринга учитывается промежуточная величина нетто-требования по соответствующим ценным бумагам (за исключением клиринговых сертификатов участия) / драгоценным металлам / денежным средствам в иностранной валюте / товарам, если отрицательная – промежуточная величина нетто-обязательства по соответствующим ценным бумагам (за исключением клиринговых сертификатов участия) / драгоценным металлам / денежным средствам в иностранной валюте / товарам.

Клиринговый центр прибавляет (с учетом знака) к промежуточной величине нетто-обязательства Участника клиринга по соответствующим ценным бумагам (за исключением клиринговых сертификатов участия) / драгоценным металлам / денежным средствам в иностранной валюте / товарам количество (сумму) таких ценных бумаг / драгоценных металлов / денежных средств в иностранной валюте / товаров, учитываемых на конец дня прекращения обязательств по Сделкам по тому

же Расчетному коду (тем же Расчетным кодам) / Расчетному коду (Расчетным кодам) имущественного пула / тому же Торгово-клиринговому счету (тем же Торгово-клиринговым счетам) / Торгово-клиринговому счету (Торгово-клиринговым счетам) имущественного пула, но не большее, чем абсолютное значение указанной промежуточной величины нетто-обязательства.

57.11.4. Клиринговый центр по Расчетному коду (Расчетным кодам) Участника клиринга рассчитывает следующие величины:

- POS_RUB – как сумму значений (с учетом знака):
  - Нетто-обязательств / Нетто-требований Участника клиринга в российских рублях по Сделкам с центральным контрагентом (за исключением сделок РЕПО с клиринговыми сертификатами участия), учитываемых на конец дня прекращения обязательств по Сделкам по Расчетному коду (Расчетным кодам) и соответствующему (соответствующим) ему Расчетному коду (Расчетным кодам) имущественного пула по всем Датам исполнения;
  - требований Участника клиринга по возврату депозитов в российских рублях, учитываемых по Расчетному коду (Расчетным кодам), с Датой исполнения не позднее, чем Дата прекращения обязательств по Сделкам, включающих всю сумму процентов, рассчитанную исходя из условий депозитного договора;
- POS_$VAL_j$ – как сумму значений (с учетом знака):
  - рассчитанных в соответствии с подпунктом 57.11.3 общей части Правил клиринга промежуточных величин нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга по денежным средствам в j-ой иностранной валюте / j-ом драгоценном металле по Расчетному коду (Расчетным кодам) и соответствующему (соответствующим) ему Расчетному коду (Расчетным кодам) имущественного пула;
  - требований Участника клиринга по возврату депозитов в j-ой иностранной валюте, учитываемых по Расчетному коду (Расчетным кодам), с Датой исполнения не позднее, чем Дата прекращения обязательств по Сделкам, включающих всю сумму процентов, рассчитанную исходя из условий депозитного договора;
- RUB_DEPOSIT – как сумму требований Участника клиринга по возврату депозитов в российских рублях, учитываемых по Расчетному коду (Расчетным кодам), с Датой исполнения позднее, чем Дата прекращения обязательств по Сделкам, включающих сумму процентов, рассчитанную исходя из фактического срока депозита, прошедшего от даты внесения депозита, не включая эту дату, до даты прекращения обязательств по Сделкам, включая эту дату;
- $VAL_j$_DEPOSIT – как сумму требований Участника клиринга по возврату депозитов в j-ой иностранной валюте, учитываемых по Расчетному коду (Расчетным кодам), с Датой исполнения позднее, чем Дата прекращения обязательств по Сделкам, включающих сумму процентов, рассчитанную исходя из фактического срока депозита, прошедшего от даты внесения депозита, не включая эту дату, до даты прекращения обязательств по Сделкам, включая эту дату;

- $POS_C_i$ – сумма значений (с учетом знака) рассчитанных в соответствии с подпунктом 57.11.3 общей части Правил клиринга промежуточных величин нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга по i-ой ценной бумаге (за исключением клиринговых сертификатов участия) по Торгово-клиринговым счетам Т+ / Торгово-клиринговым счетам имущественного пула, в состав которых входит (входят) Расчетный код (Расчетные коды) и соответствующий (соответствующие) ему Расчетный код (Расчетные коды) имущественного пула;
- $POS_T_l$ – сумма значений (с учетом знака) рассчитанных в соответствии с подпунктом 57.11.3 общей части Правил клиринга промежуточных величин нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга по l-му товару по Торгово-клиринговым счетам, в состав которых входит (входят) Расчетный код (Расчетные коды);
- $POS_D_k$ – нетто-позиция (с учетом знака) Участника клиринга по k-му Срочному контракту, рассчитанная как сумма (с учетом знака) позиций по k-му Срочному контракту, учитываемых на конец дня прекращения обязательств по Сделкам на всех разделах регистра учета позиций Участника клиринга, относящихся к Расчетному коду (Расчетным кодам).

57.11.5. Клиринговый центр в порядке, определенном статьей 27 общей части Правил клиринга заключает следующие балансирующие сделки:

- балансирующие сделки с иностранной валютой / драгоценными металлами;
- балансирующие сделки РЕПО с КСУ, направленные на привлечение Клиринговым центром денежных средств в суммах RUB_DEPOSIT и $VAL_j$_DEPOSIT, рассчитанных в соответствии подпунктом 57.11.4 общей части Правил клиринга;
- балансирующие сделки с ценными бумагами (за исключением клиринговых сертификатов участия);
- балансирующие сделки с товарами;
- Срочные контракты, являющиеся балансирующими сделками;
- Договоры СПФИ, являющиеся балансирующими сделками;
- балансирующие сделки по продаже Обеспечения / Обеспечения под стресс / взносов в Гарантийные фонды Участника клиринга в иностранной валюте / драгоценных металлах / ценных бумагах / товарах (по выбору Клирингового центра) в сумме / количестве, необходимой / необходимом для определения нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга в соответствии с подпунктом 57.11.7 общей части Правил клиринга.

57.11.6. Клиринговый центр по каждому Расчетному коду Участника клиринга рассчитывает величину $SUM_{SC}$ по формуле:

$SUM_{SC} = POS_RUB + RUB_DEPOSIT - RUB_REPO_PERC + \sum_j ((POS_VAL_j + VAL_j_DEPOSIT - VAL_j_REPO_PERC) \times C_VAL_j) + \sum_i (POS_C_i \times CC_i \times C_VAL_i) + \sum_k (POS_D_k \times (CD_k - SP_k)) + \sum_l (POS_T_l \times CT_l) + \sum_m SC_m$, где

$POS_RUB$, $RUB_DEPOSIT$, $POS_VAL_j$, $VAL_j_DEPOSIT$, $POS_C_i$, $POS_D_k$, $POS_T_l$ – величины, рассчитанные в соответствии подпунктом 57.11.4 общей части Правил клиринга;

RUB_REPO_PERC - сумма процентов по балансирующим сделкам РЕПО с КСУ с

расчетами в российских рублях, заключенных Клиринговым центром в соответствии с подпунктом 57.11.5 общей части Правил клиринга;

$VAL_j$_ REPO_PERC - сумма процентов по балансирующим сделкам РЕПО с КСУ с расчетами в j-ой иностранной валюте, заключенных Клиринговым центром в соответствии с подпунктом 57.11.5 общей части Правил клиринга;

$CC_i$ – цена сделки / средневзвешенная цена сделок с ценными бумагами, заключенной / заключенных Клиринговым центром в соответствии с подпунктом 57.11.5 общей части Правил клиринга с i-ой ценной бумагой;

$C_VAL_i$ – курс сделки / средневзвешенный курс сделок с иностранной валютой, заключенной / заключенных Клиринговым центром в соответствии с подпунктом 57.11.5 общей части Правил клиринга с i-ой иностранной валютой. Если $CC_i$ выражена в российских рублях, то $C_VAL_i=1$;

$\sum_i$ – сумма по ценным бумагам;

$C_VAL_j$ – курс сделки / средневзвешенный курс сделок с иностранной валютой / драгоценным металлом, заключенной / заключенных Клиринговым центром в соответствии с подпунктом 57.11.5 общей части Правил клиринга с j-ой иностранной валютой / j-ым драгоценным металлом;

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

$CD_k$ – цена сделки / средневзвешенная цена сделок, заключенной / заключенных Клиринговым центром в соответствии с подпунктом 57.11.5 общей части Правил клиринга по k-му Срочному контракту;

$SP_k$ – Расчетная цена k-го Срочного контракта, определенная Клиринговым центром в ходе вечерней клиринговой сессии дня, предшествующего дате заключения сделок в соответствии с подпунктом 57.11.5 общей части Правил клиринга по k-му Срочному контракту;

$\sum_k$ – сумма по Срочным контрактам;

$CT_l$ – цена сделки / средневзвешенная цена сделок с товарами, заключенной / заключенных Клиринговым центром в соответствии с подпунктом 57.11.5 общей части Правил клиринга с l-ым товаром (в российских рублях);

$\sum_l$ – сумма по товарам,

$SC_m$ – расчетная стоимость (с учетом знака) m-го Договора СПФИ, являющегося балансирующей сделкой, определенная в отношении Клирингового центра. Расчетная стоимость в иностранной валюте пересчитывается в российские рубли по по курсу, установленному Банком России на дату прекращения обязательств по Сделкам;

$\sum_m$ – сумма по Договорам СПФИ, являющимся балансирующими сделками,

и

а) промежуточной величины нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в российских рублях по сделкам РЕПО с клиринговыми сертификатами участия, рассчитанной в соответствии с подпунктом 57.11.1 общей части Правил клиринга (с учетом знака), и

б) Задолженности (со знаком «минус») Участника клиринга в российских рублях, учитываемой по Расчетному коду (Расчетным кодам) на конец дня прекращения обязательств по Сделкам, не включающей неисполненные обязательства Участника клиринга по уплате комиссионных вознаграждений,

неустоек (штрафов, пеней), подлежащих уплате Участником клиринга в соответствии с Правилами клиринга, и

в) обязательств Участника клиринга по передаче Дохода, учитываемых по Расчетному коду (Расчетным кодам) и не исполненных по состоянию на конец дня прекращения обязательств по Сделкам, при отзыве (аннулировании) у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций – обязательства по передаче Дохода, возникшие до дня отзыва (аннулирования) у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций (учитываются со знаком «минус»), и

г) обязательств Клирингового центра по передаче Дохода Участнику клиринга, учитываемых по Расчетному коду (Расчетным кодам) и не исполненных по состоянию на конец дня прекращения обязательств по Сделкам, при отзыве (аннулировании) у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций – обязательства по передаче Дохода, возникшие до дня отзыва (аннулирования) у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций (учитываются со знаком «плюс»), и

д) значений (с учетом знака) обязательств / требований Участника клиринга в российских рублях по уплате / получению вариационной маржи, учитываемых по Расчетному коду (Расчетным кодам) на конец дня прекращения обязательств по Сделкам, за исключением обязательств / требований Участника клиринга по уплате / получению вариационной маржи из Договоров СПФИ, определенных в день прекращения обязательств по Сделкам и в день, предшествующий дню прекращения обязательств по Сделкам, и

е) обязательств Участника клиринга по уплате комиссионных вознаграждений, а также неустоек (штрафов, пеней), подлежащих уплате Участником клиринга в соответствии с Правилами клиринга, учитываемых по Расчетному коду (Расчетным кодам) (учитываются со знаком «минус»), за исключением следующих случаев:

- отзыв (аннулирование) у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций;
- принятие арбитражным судом решения о введении в отношении Участника клиринга одной из процедур банкротства;
- назначение временной администрации в отношении Участника клиринга/ назначение временной администрации по управлению Участником клиринга,

и

ж) обязательств Участника пула по внесению имущества в имущественный пул, оставшихся после продажи имущества из имущественного пула в соответствии с подпунктом 57.11.1 общей части Правил клиринга (учитываются со знаком «минус»);

з) обязательств Участника клиринга по возмещению Клиринговому центру стоимости в российских рублях средств Гарантийных фондов из взносов Добросовестных участников клиринга (учитываются со знаком «минус» по собственным Расчетным кодам Участника клиринга).

Если величина, рассчитанная в соответствии с настоящим подпунктом общей части Правил клиринга, отрицательная, расчет соответствующего нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга продолжается в соответствии с подпунктом 57.11.7 общей части Правил клиринга, если неотрицательная – в соответствии с подпунктом 57.11.8 общей части Правил клиринга.

57.11.7. Клиринговый центр рассчитывает сумму с учетом знака отрицательной величины $SUM_{SC}$, рассчитанной в соответствии с подпунктом 57.11.6 общей части Правил клиринга, и следующих величин, учитываемых по Расчетному коду (Расчетным кодам) / Торгово-клиринговым счетам, в состав которых входит (входят) Расчетный код (Расчетные коды), на конец дня прекращения обязательств по Сделкам, в следующей очередности и размере:

1) величины, равной минимальной из двух величин: (1) величине обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга его Обеспечения в российских рублях (учитывается со знаком «плюс»), или (2) величине абсолютного значения отрицательной величины $SUM_{SC}$, рассчитанной в соответствии с подпунктом 57.11.6 общей части Правил клиринга;
2) по собственным Расчетным кодам Участника клиринга - величины, равной минимальной из двух величин: (1) величине обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга его Обеспечения под стресс в российских рублях (учитывается со знаком «плюс»), или (2) величине абсолютного значения отрицательной величины $SUM_{SC}$, рассчитанной в соответствии с пунктом 1) настоящего подпункта 57.11.7 общей части Правил клиринга;
3) по собственным Расчетным кодам Участника клиринга - величины, равной минимальной из двух величин: (1) величине обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга его взносов в Гарантийные фонды в российских рублях (учитывается со знаком «плюс»), или (2) величине абсолютного значения отрицательной величины $SUM_{SC}$, рассчитанной в соответствии с предыдущими пунктами настоящего подпункта 57.11.7 общей части Правил клиринга;
4) величины обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга его Обеспечения в иностранной валюте, уменьшенной на сумму иностранной валюты, использованной при расчете промежуточной величины нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга по денежным средствам в иностранной валюте в соответствии с подпунктом 57.11.3 общей части Правил клиринга, и пересчитанной в российские рубли по курсу / средневзвешенному курсу сделок с иностранной валютой, заключенных Клиринговым центром в соответствии с подпунктом 57.11.5 общей части Правил клиринга (учитывается со знаком «плюс»);
5) по собственным Расчетным кодам Участника клиринга - величины обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга его Обеспечения под стресс в иностранной валюте, пересчитанной в российские рубли по курсу / средневзвешенному курсу сделок с иностранной валютой, заключенных Клиринговым центром в соответствии с подпунктом 57.11.5 общей части Правил клиринга (учитывается со знаком «плюс»);
6) по собственным Расчетным кодам Участника клиринга - величины обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга его

взносов в Гарантийные фонды в иностранной валюте, пересчитанной в российские рубли по курсу / средневзвешенному курсу сделок с иностранной валютой, заключенных Клиринговым центром в соответствии с подпунктом 57.11.5 общей части Правил клиринга (учитывается со знаком «плюс»);

7) величины, равной минимальной из двух величин: (1) величине Обеспечения Участника клиринга в ценных бумагах, уменьшенной на количество ценных бумаг, использованных при расчете промежуточной величины нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга по ценным бумагам в соответствии с пунктом 57.11.3 общей части Правил клиринга, и пересчитанной в российские рубли по цене / средневзвешенной цене сделок с ценными бумагами, заключенных Клиринговым центром в соответствии с подпунктом 57.11.5 общей части Правил клиринга (учитывается со знаком «плюс»), или (2) величине абсолютного значения отрицательной величины $SUM_{SC}$, рассчитанной в соответствии с предыдущими пунктами настоящего подпункта 57.11.7 общей части Правил клиринга;

8) по собственным Расчетным кодам Участника клиринга - величины, равной минимальной из двух величин: (1) величине обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга его Обеспечения под стресс в ценных бумагах, пересчитанной в российские рубли по цене / средневзвешенной цене сделок с ценными бумагами, заключенных Клиринговым центром в соответствии с подпунктом 57.11.5 общей части Правил клиринга (учитывается со знаком «плюс»), или (2) величине абсолютного значения отрицательной величины $SUM_{SC}$, рассчитанной в соответствии с предыдущими пунктами настоящего подпункта 57.11.7 общей части Правил клиринга;

9) по собственным Расчетным кодам Участника клиринга (по выбору Клирингового центра) - величины, равной минимальной из двух величин: (1) величине обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга его взносов в Гарантийные фонды в ценных бумагах, пересчитанной в российские рубли по цене / средневзвешенной цене сделок с ценными бумагами, заключенных Клиринговым центром в соответствии с подпунктом 57.11.5 общей части Правил клиринга (учитывается со знаком «плюс»), или (2) величине абсолютного значения отрицательной величины $SUM_{SC}$, рассчитанной в соответствии с предыдущими пунктами настоящего подпункта 57.11.7 общей части Правил клиринга;

10) величины обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга его Обеспечения в драгоценных металлах, уменьшенной на количество драгоценных металлов, использованной при расчете промежуточной величины нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга по драгоценным металлам в соответствии с подпунктом 57.11.3 общей части Правил клиринга, и пересчитанной в российские рубли по курсу / средневзвешенному курсу сделок с драгоценным металлом, заключенных Клиринговым центром в соответствии с подпунктом 57.11.5 общей части Правил клиринга (учитывается со знаком «плюс»);

11) величины, равной минимальной из двух величин: (1) величине Обеспечения Участника клиринга в товарах, уменьшенной на количество товаров, использованных при расчете промежуточной величины нетто-обязательства /

нетто-требования Участника клиринга по товарам в соответствии с подпунктом 57.11.3 общей части Правил клиринга, и пересчитанной в российские рубли по цене / средневзвешенной цене сделок с товаром, заключенных Клиринговым центром в соответствии с подпунктом 57.11.5 общей части Правил клиринга (учитывается со знаком «плюс»), или (2) величине абсолютного значения отрицательной величины $SUM_{SC}$, рассчитанной в соответствии с предыдущими пунктами настоящего подпункта 57.11.7 общей части Правил клиринга.

Если в результате последовательного выполнения любого из действий, предусмотренных пунктами 1 – 11 настоящего подпункта 57.11.7 общей части Правил клиринга, полученное значение $SUM_{SC}$ является неотрицательной величиной, расчет соответствующего нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга продолжается в соответствии с подпунктом 57.11.8 общей части Правил клиринга.

57.11.8. Если величина $SUM_{SC}$, рассчитанная в соответствии с подпунктом 57.11.6 или 57.11.7 общей части Правил клиринга по Расчетному коду (Расчетным кодам) равна нулю, это означает отсутствие у Участника клиринга нетто-обязательства / нетто-требования по такому Расчетному коду (таким Расчетным кодам), при этом расчет нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга по такому Расчетному коду (таким Расчетным кодам) прекращается.

Если величина $SUM_{SC}$, рассчитанная в соответствии с подпунктом 57.11.7 общей части Правил клиринга по собственным Расчетным кодам, отрицательная, это означает наличие нетто-обязательства Участника клиринга по отношению к Клиринговому центру по собственным Расчетным кодам, равного абсолютному значению величины $SUM_{SC}$, при этом расчет нетто-обязательства Участника клиринга по собственным Расчетным кодам прекращается.

Если величина $SUM_{SC}$, рассчитанная в соответствии с подпунктом 57.11.6 или 57.11.7 общей части Правил клиринга по Расчетному коду, за исключением собственных Расчетных кодов, положительная, это означает наличие нетто-требования Участника клиринга по такому Расчетному коду, равного величине $SUM_{SC}$, при этом расчет нетто-требования Участника клиринга по такому Расчетному коду прекращается.

При наличии отрицательных величин $SUM_{SC1}$, рассчитанных в соответствии с подпунктом 57.11.7 общей части Правил клиринга по клиентским Расчетным кодам (включая Расчетные коды, открытые для Обособленных клиентов) и Расчетных кодов ДУ, и положительной величины $SUM_{SC2}$, рассчитанной в соответствии с подпунктом 57.11.7 общей части Правил клиринга по собственным Расчетным кодам, расчет нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга по каждому такому Расчетному коду (таким Расчетным кодам) продолжается следующим образом:

$$SUM_{SCi} = SUM_{SCi} + \min\left(\left(SUM_{SCown} / \sum_{i} SUM_{SCi}\right) \times SUM_{SCi}; abc(SUM_{SCi})\right),$$

$$SUM_{SCown} = SUM_{SCown} - \sum_{i} \left(\min\left(\left(SUM_{SCown} / \sum_{i} SUM_{SCi}\right) \times SUM_{SCi}; abc(SUM_{SCi})\right)\right), \text{ где}$$

$SUM_{SCi}$ – отрицательная величина $SUM_{SC}$, рассчитанная в соответствии с подпунктом 57.11.7 общей части Правил клиринга по клиентскому Расчетному

коду (в т.ч. Расчетному коду, открытому для Обособленного клиента) или Расчетному коду ДУ;

$SUM_{SCown}$ – положительная величина $SUM_{SC}$, рассчитанная в соответствии с подпунктом 57.11.6 и/или 57.11.7 общей части Правил клиринга по собственным Расчетным кодам.

Если в результате указанного расчета $SUM_{SCi} = 0$, это означает отсутствие у Участника клиринга нетто-обязательства / нетто-требования по такому Расчетному коду,

для $SUM_{SCi} < 0$, расчет нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга по таким Расчетным кодам продолжается в соответствии с подпунктом 57.11.7 общей части Правил клиринга с использованием Обеспечения, учитываемого по собственным Расчетным кодам и соответствующих им Торгово-клиринговым счетам, Обеспечения под стресс и взносов в Гарантийные фонды, не использованных при расчете нетто-обязательства / нетто-требования по собственным Расчетным кодам. Если в результате $SUM_{SCi}$ останется отрицательной, это означает наличие нетто-обязательства Участника клиринга по такому Расчетному коду, равного абсолютному значению величины $SUM_{SCi}$.

По собственным Расчетным кодам, задействованным в расчете в соответствии с настоящим подпунктом общей части Правил клиринга, значение нетто-требования Участника клиринга равно положительной величине $SUM_{SCown}$ по итогам указанного расчета либо, если $SUM_{SCown} = 0$, нетто-обязательство / нетто-требование Участника клиринга по собственным Расчетным кодам отсутствует.

57.11.9. Каждое из обязательств, перечисленных в подпункте 57.11.7 общей части Правил клиринга, включенное в расчет нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга, в соответствующей части прекращается.

При этом:

- обязательство Клирингового центра по возврату Обеспечения, Обеспечения под стресс, взносов в Гарантийные фонд в российских рублях прекращается в части, равной сумме денежных средств в российских рублях, использованных при расчете нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в соответствии с подпунктом 57.11.7 общей части Правил клиринга;
- обязательство Клирингового центра по возврату Обеспечения, Обеспечения под стресс, взносов в Гарантийные фонд в иностранной валюте прекращается в части, равной сумме иностранной валюты, использованной при расчете промежуточной величины нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга по денежным средствам в иностранной валюте в соответствии с подпунктом 57.11.3 общей части Правил клиринга, и сумме иностранной валюты в сделках по продаже Обеспечения, Обеспечения под стресс или взносов в Гарантийные фонды в иностранной валюте, заключенных Клиринговым центром в соответствии с подпунктом 57.11.5 общей части Правил клиринга;
- обязательство Клирингового центра по возврату Обеспечения под стресс или взносов в Гарантийные фонды в ценных бумагах прекращается в части, равной количеству ценных бумаг в сделках по продаже Обеспечения под стресс или взносов в Гарантийные фонды в ценных бумагах, заключенных Клиринговым центром в соответствии с подпунктом 57.11.5 общей части

Правил клиринга;

- Обеспечение в ценных бумагах используется в количестве, равном количеству ценных бумаг, использованных при расчете промежуточной величины нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга по ценным бумагам в соответствии с подпунктом 57.11.3 общей части Правил клиринга, и количеству ценных бумаг в сделках по продаже Обеспечения в ценных бумагах, заключенных Клиринговым центром в соответствии с подпунктом 57.11.5 общей части Правил клиринга.

  Для использования Обеспечения в ценных бумагах Клиринговый центр формирует и передает Расчетному депозитарию распоряжение на перевод ценных бумаг в указанном количестве с Раздела на субсчет депо Клирингового центра на клиринговом счете депо;
- обязательство Клирингового центра по возврату Обеспечения в драгоценных металлах прекращается в части, равной количеству драгоценных металлов, использованных при расчете промежуточной величины нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в драгоценных металлах в соответствии с подпунктом 57.11.3 общей части Правил клиринга, и количеству драгоценных металлов в сделках по продаже Обеспечения в драгоценных металлах, заключенных Клиринговым центром в соответствии с подпунктом 57.11.5 общей части Правил клиринга;
- Обеспечение в товарах используется в количестве, равном количеству товаров, использованных при расчете промежуточной величины нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга по товарам в соответствии с подпунктом 57.11.3 общей части Правил клиринга, и количеству товаров в сделках по продаже Обеспечения в товарах, заключенных Клиринговым центром в соответствии с подпунктом 57.11.5 общей части Правил клиринга.

  Для использования Обеспечения в товарах Клиринговый центр формирует и передает Оператору товарных поставок распоряжение на перевод товаров в указанном количестве с торгового раздела Участника клиринга на торговый раздел Клирингового центра.

57.12. Клиринговый центр рассчитывает сумму нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в российских рублях в отношении других Участников клиринга – его контрагентов по Сделкам без центрального контрагента в порядке, предусмотренном подпунктами 57.12.1-57.12.3 общей части Правил клиринга, отдельно по каждому клиентскому Расчетному коду, по каждому Расчетному коду ДУ и по всем собственным Расчетным кодам Участника клиринга:

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

$SUM = POS_RUB + \sum_i (POS_C_i \times CC_i;\ 2) + \sum_i (POS_R_i \times CC_i) + \sum_j (POS_VAL_j \times C_VAL_j)$, где

$POS_RUB = ST - SO$,

$POS_VAL_j = ST_j - SO_j$,

$POS_C_i = STC_i - SOC_i$,

$POS_R_i = STR_i - SOR_i$,

POS_RUB – обязательство (требование) Участника клиринга по денежным средствам в российских рублях;

$POS_C_i$ – обязательство (требование) Участника клиринга по i-ой ценной бумаге по сделкам купли-продажи ценных бумаг;

$POS_VAL_j$ – обязательство (требование) Участника клиринга по денежным средствам в j-ой иностранной валюте;

$POS_R_i$ – обязательство (требование) Участника клиринга по i-ой ценной бумаге по сделкам РЕПО;

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

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

При этом сумма обязательств и требований по вторым частям сделок РЕПО рассчитывается исходя из фактического срока сделки РЕПО, прошедшего от фактической даты исполнения обязательств по первой части РЕПО, включая эту дату, до даты прекращения обязательств по сделкам, не включая эту дату.

В случае если Дата исполнения обязательств по второй части сделки РЕПО совпадает с датой, предшествующей дате прекращения обязательств по сделкам, сумма обязательств и требований по вторым частям сделок РЕПО рассчитывается исходя из фактического срока сделки РЕПО, прошедшего от фактической даты исполнения обязательств по первой части РЕПО, включая эту дату, до Даты исполнения обязательств по второй части сделки РЕПО, не включая эту дату.

В случае если обязательства по первой части сделки РЕПО не исполнены на дату прекращения обязательств по Сделкам в соответствии с настоящей статьей общей части Правил клиринга, в целях расчета нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в отношении Участников клиринга – его контрагентов срок сделки РЕПО принимается равным нулю.

Сумма обязательств и требований по вторым частям сделок РЕПО рассчитывается с учетом уменьшения на величину уплаченного купонного (процентного) дохода и/или на величину погашенной части основного долга (амортизационной выплаты) в соответствии с условиями сделки РЕПО.

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

- сделкам с кодом расчетов B0-B30.

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

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

$CC_i$ – цена (в российских рублях), равная сумме расчетной цены i-ой ценной бумаги (за исключением клиринговых сертификатов участия), определенной Биржей в соответствии с Правилами торгов на фондовом рынке и рынке депозитов

по итогам Торгового дня прекращения обязательств по Сделкам, или последней использовавшейся расчетной цены такой ценной бумаги, и НКД на дату прекращения обязательств по Сделкам (при условии его расчета для данной ценной бумаги). Если расчетная цена и НКД для i-ой ценной бумаги определены в иностранной валюте, расчёт цены осуществляется по курсу соответствующей иностранной валюты, установленному Банком России на дату прекращения обязательств по Сделкам. Для клиринговых сертификатов участия $CC_i$ равна номинальной стоимости одного клирингового сертификата участия;

$\sum_i$ – сумма по ценным бумагам;

$C_VAL_j$ – курс j-ой иностранной валюты, установленный Банком России на дату прекращения обязательств по Сделкам ;

$\sum_j$ – сумма по иностранным валютам.

57.12.2. Если величина, рассчитанная в соответствии с подпунктом 57.12.1 общей части Правил клиринга, положительная, это означает наличие нетто-требования Участника клиринга по отношению к Участнику клиринга – контрагенту, отрицательная – наличие нетто-обязательства Участника клиринга по отношению к Участнику клиринга – контрагенту.

57.12.3. Если Участником клиринга – контрагентом является Банк России, то при урегулировании обязательств в случае прекращения допуска к клиринговому обслуживанию Участника клиринга, являющегося одновременно участником клиринга НКО АО НРД, по основаниям, указанным в пунктах 57.1, 57.3 общей части Правил клиринга, и при наличии у такого Участника клиринга непрекращенных обязательств по сделкам, заключенным с Банком России, клиринг по которым осуществляет как Клиринговый центр, так и НКО АО НРД, и при принятии НКО АО НРД решения о прекращении допуска к клиринговому обслуживанию и клирингового обслуживания Участника клиринга – Кредитной организации, прекращении обязательств по сделкам, стороной по которым является Участник клиринга, и проведении расчета нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга в случае назначения временной администрации по управлению Участником клиринга – Кредитной организацией в рамках мер по предупреждению банкротства кредитной организации, положительная величина, рассчитанная в соответствии с подпунктом 57.12.1 общей части Правил клиринга, является предварительным нетто-требованием Участника клиринга по отношению к Банку России, отрицательная – предварительным нетто-обязательством Участника клиринга по отношению к Банку России. Указанный порядок применяется для обязательств, возникших из договоров, заключенных на условиях одного генерального соглашения.

57.13. Клиринговый центр направляет Участнику клиринга, клиринговое обслуживание которого прекращено, уведомление о прекращении обязательств по Сделкам в течение 3 (трех) рабочих дней, следующих за датой прекращения клирингового обслуживания. Указанное уведомление также содержит информацию о рассчитанных по каждому Расчетному коду Участника клиринга в соответствии с пунктом 57.11 общей части Правил клиринга нетто-обязательствах / нетто-требованиях Участника клиринга в отношении Клирингового центра, а также о рассчитанных по каждому Расчетному коду Участника клиринга в соответствии с пунктом 57.12 общей части Правил клиринга нетто-обязательствах / нетто-

требованиях Участника клиринга в отношении его контрагентов по Сделкам без центрального контрагента.

Уведомления о нетто-обязательствах / нетто-требованиях Участника клиринга – кредитной организации и Банка России, в случае расчета Клиринговым центром предварительного нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга – кредитной организации в отношении контрагента – Банка России в соответствии с пунктом 57.10 общей части Правил клиринга, направляются таким Участникам клиринга НКО АО НРД в соответствии с правилами клиринга НКО АО НРД.

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

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

57.14. Клиринговый центр направляет Доверенному владельцу счетов в форме электронного документа уведомление о рассчитанной в соответствии с пунктом 57.11 общей части Правил клиринга сумме нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга по Расчетным кодам, с которыми связана Обособленная Брокерская фирма, за которой закреплен указанный Доверенный владелец счетов.

Доверенный владелец счетов вправе подать в Клиринговый центр Запрос на возврат обеспечения, составляющих Обеспечение, обязательства по возврату которого учитываются по таким Расчетным кодам, в сумме, не использованной для определения указанного нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга. Возврат указанных денежных средств осуществляется в порядке, установленном Правилами клиринга на срочном рынке.

57.15. Возврат Участнику клиринга денежных средств в российских рублях в сумме нетто-требований Участника клиринга, определенных в соответствии с пунктом 57.11 общей части Правил клиринга, а также Обеспечения / Обеспечения под стресс / взносов в Гарантийные фонды в денежных средствах / ценных бумагах (за исключением клиринговых сертификатов участия), не использованных для определения нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга в соответствии с пунктом 57.11 общей части Правил клиринга, осуществляется Клиринговым центром в соответствии с пунктом 4.12 общей части Правил клиринга.

57.15.1. Для исполнения обязательств по возврату Участнику клиринга Обеспечения / Обеспечения под стресс / взносов в Гарантийные фонды в иностранной валюте / драгоценных металлах, не использованных для определения нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга в соответствии с пунктом 57.11 общей части Правил клиринга, Клиринговый центр на основании пункта 3.20 общей части Правил клиринга осуществляет на соответствующих биржевых рынках продажу соответствующей иностранной валюты / соответствующих драгоценных металлов в

сумме / количестве, равном размеру обязательств Клирингового центра по возврату Обеспечения / Обеспечения под стресс / взносов в Гарантийные фонды Участника клиринга в соответствующей иностранной валюте / соответствующих драгоценных металлах, не использованных для определения нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга в соответствии с пунктом 57.11 общей части Правил клиринга.

Обеспечение / Обеспечение под стресс / взносы в Гарантийные фонды Участника клиринга в иностранной валюте и драгоценных металлах в суммах / количестве, меньшем лота, установленного Биржей, конвертируются в российские рубли по курсу иностранной валюты, установленному Банком России на дату прекращения Договора об оказании клиринговых услуг / по Центральному курсу соответствующего драгоценного металла, установленному Клиринговым центром на дату прекращения Договора об оказании клиринговых услуг.

57.15.2. Клиринговый центр возвращает Участнику клиринга денежные средства в российских рублях в сумме:

- нетто-требований Участника клиринга, определенных в соответствии с пунктом 57.11 общей части Правил клиринга;
- Обеспечения / Обеспечения под стресс / взносов в Гарантийные фонды в российских рублях, не использованных для определения нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга в соответствии с пунктом 57.11 общей части Правил клиринга;
- денежных средств в российских рублях, полученных от продажи / конвертации Обеспечения / Обеспечения под стресс / взносов в Гарантийные фонды в иностранной валюте / драгоценных металлах в соответствии с подпунктом 57.15.1 общей части Правил клиринга, а в случае, если такая продажа невозможна, в размере соответствующих обязательств по возврату Участнику клиринга денежных средств в иностранной валюте / драгоценных металлов, пересчитанных в российские рубли по курсу иностранной валюты, установленному Банком России на дату прекращения Договора об оказании клиринговых услуг / по Центральному курсу соответствующего драгоценного металла, установленному Клиринговым центром на дату прекращения Договора об оказании клиринговых услуг.

57.15.3. Ценные бумаги, оставшиеся на Разделах Участника клиринга / Держателя / Доверенного владельца счетов / клиента Участника клиринга после определения нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга в соответствии с пунктом 57.11 общей части Правил клиринга, списываются с Разделов Участника клиринга без согласия Клирингового центра.

57.15.4. Товары, оставшиеся на торговых разделах торговых товарных счетов Участников клиринга после определения нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга в порядке, предусмотренном пунктом 57.11 общей части Правил клиринга, списываются с торговых разделов торговых товарных счетов Участника клиринга без согласия Клирингового центра.

57.16. Клиринговый центр вправе предъявить к Участнику клиринга требование о взыскании нетто-обязательств Участника клиринга, рассчитанных в порядке, предусмотренном пунктом 57.11 общей части Правил клиринга, а также неустоек (штрафов, пеней), и комиссионных вознаграждений, подлежащих уплате в

соответствии с Правилами клиринга и не участвовавших в определении нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга, в общем порядке, предусмотренном законодательством о несостоятельности (банкротстве).

57.17. При зачислении на казначейский счет депо Клирингового центра клиринговых сертификатов участия в количестве, соответствующем промежуточной величине нетто-требования Участника клиринга в клиринговых сертификатах участия, рассчитанной в соответствии с пунктом 1) подпункта 57.11.1 общей части Правил клиринга по сделкам РЕПО с клиринговыми сертификатами участия, обязательства по которым были прекращены в ходе ликвидационного неттинга, проведенного в соответствии с настоящей статьей общей части Правил клиринга в отношении Участника клиринга, клиринговые сертификаты в указанном количестве погашаются Клиринговым центром, денежные средства в сумме номинальной стоимости погашенных клиринговых сертификатов участия выводятся из соответствующего имущественного пула.

## Статья 58. Порядок урегулирования обязательств в случае банкротства клиента Участника клиринга (ликвидационный неттинг в отношении клиента Участника клиринга)

58.1. В случаях:

- отзыва (аннулирования) Банком России у клиента Участника клиринга, являющегося кредитной организацией, лицензии на осуществление банковских операций;
- принятия арбитражным судом решения о введении одной из процедур банкротства в отношении клиента Участника клиринга,

Участник клиринга вправе обратиться к Клиринговому центру за расчетом нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга по Сделкам, заключенным за счет такого клиента Участника клиринга, обязательства по которым не исполнены и/или не прекращены по иным основаниям, предусмотренным Правилами клиринга, предоставив Заявление о проведении ликвидационного неттинга в отношении клиента Участника клиринга.

58.1.1. Предоставление Заявления о проведении ликвидационного неттинга в отношении клиента Участника клиринга возможно не ранее даты отзыва (аннулирования) Банком России у клиента Участника клиринга, являющегося кредитной организацией, лицензии на осуществление банковских операций, или даты принятия арбитражным судом решения о введении одной из процедур банкротства в отношении клиента Участника клиринга.

58.2. В Заявлении о проведении ликвидационного неттинга в отношении клиента Участника клиринга (далее по тексту настоящей статьи общей части Правил клиринга также – Заявление) или совместно с Заявлением Участник клиринга обязан предоставить Клиринговому центру:

1) Расчетные коды / Расчетные коды имущественного пула, открытые Участником клиринга для Обособленного клиента;
2) идентификационные данные клиента Участника клиринга, не являющегося Обособленным клиентом, аналогичные идентификационным данным,

указываемым в соответствии с требованиями, предъявляемыми Биржей при регистрации клиентов Участников торгов;

3) документы и/или информацию, подтверждающую наличие оснований, указанных в пункте 58.1 общей части Правил клиринга;

4) номера сделок, стороной по которым является Участник клиринга, заключенным на соответствующих биржевых рынках за счет клиента Участника клиринга, указанного в Заявлении (указанная информация не предоставляется для Обособленных клиентов);

5) информацию о суммах денежных средств или о сумме Задолженности, а также о количествах ценных бумаг, драгоценных металлов, товаров клиента Участника клиринга, учитываемых на Расчетных кодах / Расчетных кодах имущественного пула, Торгово-клиринговых счетах / Торгово-клиринговых счетах имущественного пула и/или разделах денежного и депо регистров обеспечения Участника клиринга и о номерах (кодах) таких Расчетных кодов, Торгово-клиринговых счетов и/или разделов денежного и депо регистров обеспечения (указанная информация не предоставляется для Обособленных клиентов);

6) иную информацию по требованию Клирингового центра, необходимую для расчета нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга по Сделкам, заключенным за счет клиента Участника клиринга.

58.3. Клиринговый центр вправе отказать Участнику клиринга в исполнении Заявления:

58.3.1. в случае непредоставления Участником клиринга документов и/или информации, указанных в пункте 58.2 общей части Правил клиринга;

58.3.2. в случае, если, по мнению Клирингового центра, исполнение Заявления может создать угрозу финансовой стабильности Клирингового центра;

58.3.3. в случае предоставления Заявления позднее времени, указанного во Временном регламенте;

58.3.4. в случае, если, по мнению Клирингового центра, исполнение Заявления невозможно в срок, установленный законодательством;

58.3.5. если Клиринговым центром начато прекращение обязательств Участника клиринга по основаниям, установленным Правилами клиринга;

58.3.6. в случае если обязательства по сделкам, стороной по которым является Участник клиринга, заключенным на соответствующих биржевых рынках за счет клиента Участника клиринга, указанного в Заявлении, прекращены.

58.4. Исполнение Заявления о проведении ликвидационного неттинга в отношении клиента Участника клиринга осуществляется в следующем порядке.

58.4.1. В случае отзыва (аннулирования) Банком России у клиента Участника клиринга, являющегося кредитной организацией, лицензии на осуществление банковских операций обязательства по Сделкам с центральным контрагентом, стороной по которым является Участник клиринга, заключенным за счет такого клиента Участника клиринга до даты отзыва такой лицензии, и обязательства по возврату Участнику клиринга имущества такого клиента, внесенного Участником клиринга в имущественный пул, прекращаются полностью на дату, следующую за датой

отзыва (аннулирования) Банком России у такого клиента Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций, возникновением нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга, рассчитанного в соответствии с пунктом 58.5 общей части Правил клиринга; обязательства по Сделкам без центрального контрагента, стороной по которым является Участник клиринга, заключенным за счет такого клиента Участника клиринга до даты отзыва такой лицензии, прекращаются полностью на дату, следующую за датой отзыва (аннулирования) Банком России у такого клиента Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций, возникновением нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга в отношении других Участников клиринга – его контрагентов по указанным Сделкам, рассчитанных в соответствии с пунктом 58.6 общей части Правил клиринга.

58.4.2. В случае принятия арбитражным судом решения о введении в отношении клиента Участника клиринга одной из процедур банкротства, обязательства по Сделкам с центральным контрагентом, стороной по которым является Участник клиринга, заключенным за счет такого клиента Участника клиринга, и обязательства по возврату Участнику клиринга имущества такого клиента, внесенного Участником клиринга в имущественный пул, прекращаются полностью на дату, следующую за датой принятия арбитражным судом решения о введении в отношении клиента Участника клиринга одной из процедур банкротства, возникновением нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга, рассчитанного в соответствии с пунктом 58.5 общей части Правил клиринга; обязательства по Сделкам без центрального контрагента, стороной по которым является Участник клиринга, заключенным за счет такого клиента Участника клиринга, прекращаются полностью на дату, следующую за датой принятия арбитражным судом решения о введении в отношении клиента Участника клиринга одной из процедур банкротства, возникновением нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга в отношении других Участников клиринга – его контрагентов по указанным Сделкам, рассчитанных в соответствии с пунктом 58.6 общей части Правил клиринга.

58.5. Клиринговый центр рассчитывает сумму нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в российских рублях по Сделкам с центральным контрагентом, заключенным за счет клиента Участника клиринга, с использованием информации о суммах денежных средств, сумме Задолженности, а также о количествах ценных бумаг, драгоценных металлов, товаров клиента Участника клиринга, полученной от Участника клиринга в соответствии с пунктом 58.2 общей части Правил клиринга, в следующем порядке.

58.5.1. Клиринговый центр для каждого имущественного пула и для каждого Расчетного кода имущественного пула и соответствующего ему Расчетного кода Участника клиринга, по которым учитывается имущество клиента Участника клиринга:

1) рассчитывает промежуточную величину нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в клиринговых сертификатах участия по сделкам РЕПО с центральным контрагентом, заключенным за счет клиента Участника клиринга, равную сумме с учетом знака:

   - Нетто-обязательств / Нетто-требований Участника клиринга по клиринговым сертификатам участия по сделкам РЕПО с центральным контрагентом с клиринговыми сертификатами участия, заключенным за

счет клиента Участника клиринга, учитываемых на конец дня прекращения обязательств по Сделкам по Торгово-клиринговым счетам Т+, в состав которых входит Расчетный код, по всем Датам исполнения;

- требований Участника клиринга к Клиринговому центру по получению клиринговых сертификатов участия в количестве, равном полученному Клиринговым центром от Банка России при выкупе клиринговых сертификатов участия клиента Участника клиринга у Банка России в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, учитываемых на конец дня прекращения обязательств по Сделкам по Торгово-клиринговым счетам Т+, в состав которых входит Расчетный код, по всем Датам исполнения.

Если величина, рассчитанная в соответствии с настоящим пунктом общей части Правил клиринга положительная, у Участника клиринга учитывается промежуточная величина нетто-требования в клиринговых сертификатах участия по сделкам РЕПО с центральным контрагентом, заключенным за счет клиента Участника клиринга, если отрицательная – промежуточная величина нетто-обязательства в клиринговых сертификатах участия по сделкам РЕПО с центральным контрагентом, заключенным за счет клиента Участника клиринга.

Клиринговый центр прибавляет (с учетом знака) к промежуточной величине нетто-обязательства Участника клиринга в клиринговых сертификатах участия по сделкам РЕПО с центральным контрагентом, заключенным за счет клиента Участника клиринга, количество клиринговых сертификатов участия, учитываемых на конец дня прекращения обязательств по Сделкам по Торгово-клиринговым счетам Т+, в состав которых входит Расчетный код, но не большее, чем абсолютное значение указанной промежуточной величины нетто-обязательства Участника клиринга в клиринговых сертификатах участия. При этом Клиринговый центр формирует и передает Расчетному депозитарию распоряжение на перевод клиринговых сертификатов участия в указанном количестве с Раздела Т+, входящего в состав указанного Торгово-клирингового счета Т+, на казначейский счет депо Клирингового центра;

2) рассчитывает промежуточную величину нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в российских рублях по сделкам РЕПО с центральным контрагентом с клиринговыми сертификатами участия, заключенным за счет клиента Участника клиринга, равную сумме с учетом знака:

   - Нетто-обязательств / Нетто-требований Участника клиринга по денежным средствам по сделкам РЕПО с центральным контрагентом с клиринговыми сертификатами участия, заключенным за счет клиента Участника клиринга, учитываемых на конец дня прекращения обязательств по Сделкам по Расчетному коду по всем Датам исполнения. При этом значение, рассчитанное по сделкам РЕПО с расчетами в иностранной валюте, пересчитывается в российские рубли по курсу сделки / средневзвешенному курсу сделок с иностранной валютой, заключенной / заключенных Клиринговым центром в соответствии с подпунктом 58.5.5 общей части Правил клиринга;
   - обязательств Участника клиринга уплатить Клиринговому центру

денежные средства в сумме, равной сумме номинальной стоимости клиринговых сертификатов участия клиента Участника клиринга, в отношении которых клиентом Участника клиринга не были исполнены обязательства перед Банком России по второй части договора репо, учитываемых на конец дня прекращения обязательств по Сделкам по Расчетному коду по всем Датам исполнения.

Если величина, рассчитанная в соответствии с настоящим пунктом общей части Правил клиринга положительная, у Участника клиринга учитывается промежуточная величина нетто-требования в российских рублях по сделкам РЕПО с центральным контрагентом с клиринговыми сертификатами участия, заключенным за счет клиента Участника клиринга, если отрицательная – промежуточная величина нетто-обязательства в российских рублях по сделкам РЕПО с центральным контрагентом с клиринговыми сертификатами участия, заключенным за счет клиента Участника клиринга;

3) если Участник клиринга является Участником пула, Клиринговый центр продает ценные бумаги и иностранную валюту клиента Участника клиринга, учитываемые по Расчетному коду имущественного пула Участника пула, на соответствующих биржевых рынках в количестве / сумме, соответствующей положительной разности абсолютного значения промежуточной величины нетто-обязательства Участника клиринга в российских рублях, рассчитанной в соответствии с пунктом 2) подпункта 58.5.1 общей части Правил клиринга, и суммы денежных средств, учитываемой на конец дня прекращения обязательств по Сделкам по Расчетному коду имущественного пула.

Выбор имущества клиента Участника клиринга, подлежащего продаже из имущественного пула, осуществляется Клиринговым центром.

Если сумма денежных средств в российских рублях, учитываемая на конец дня прекращения обязательств по Сделкам по Расчетному коду имущественного пула, а также полученная от продажи ценных бумаг и иностранной валюты клиента Участника клиринга, учитываемых по Расчетному коду имущественного пула Участника пула, больше абсолютного значения указанной промежуточной величины нетто-обязательства Участника клиринга в российских рублях, Клиринговый центр учитывает денежные средства в сумме такого превышения по Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета Т+, соответствующего Торгово-клиринговому счету имущественного пула, а положительную разность между оставшейся суммой денежных средств в российских рублях и номинальной стоимостью клиринговых сертификатов участия клиента Участника клиринга в промежуточной величине нетто-требования Участника клиринга в клиринговых сертификатах участия, прибавляет (с учетом знака) к промежуточной величине нетто-обязательства Участника клиринга в российских рублях.

Если у Участника клиринга, являющегося Участником пула, учитывается промежуточная величина нетто-требования в клиринговых сертификатах участия, рассчитанная в соответствии с пунктом 1) подпункта 58.5.1 общей части Правил клиринга, сумма денежных средств в российских рублях, равная номинальной стоимости клиринговых сертификатов участия клиента Участника клиринга в указанной промежуточной величине нетто-требования

Участника клиринга в клиринговых сертификатах участия, вносится Клиринговым центром в соответствующий имущественный пул.

Если сумма денежных средств, учитываемая на конец дня прекращения обязательств по Сделкам по Расчетному коду имущественного пула, а также полученная от продажи ценных бумаг и иностранной валюты клиента Участника клиринга, учитываемых по Расчетному коду имущественного пула Участника пула, меньше, чем номинальная стоимость клиринговых сертификатов участия клиента Участника клиринга в указанной промежуточной величине нетто-требования Участника клиринга в клиринговых сертификатах участия, неисполненное обязательство Участника пула по внесению имущества клиента Участника клиринга в имущественный пул учитывается при дальнейшем расчете соответствующего нетто-обязательства / нетто-требования Участника пула в соответствии с подпунктом 58.5.3 общей части Правил клиринга;

4) Клиринговый центр складывает (с учетом знака) промежуточную величину нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в российских рублях, определенную по итогам действий, указанных в пунктах 2)-3) подпункта 58.5.1 общей части Правил клиринга, и произведение 1 (одного) российского рубля, являющегося номинальной стоимостью одного клирингового сертификата участия, и промежуточной величины нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в клиринговых сертификатах участия, определенной по итогам действий, указанных в пункте 1) подпункта 58.5.1 общей части Правил клиринга.

Рассчитанная в соответствии с настоящим пунктом общей части Правил клиринга промежуточная величина нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в российских рублях по сделкам РЕПО с центральным контрагентом с клиринговыми сертификатами участия, заключенным за счет клиента Участника клиринга, учитывается при дальнейшем расчете соответствующего нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в соответствии с подпунктом 58.5.3 общей части Правил клиринга.

58.5.2. Клиринговый центр с использованием Клиринговой системы формирует и исполняет распоряжения на перевод ценных бумаг / денежных средств клиента Участника клиринга с Торгово-клирингового счета имущественного пула Участника клиринга, оставшихся по итогам действий, указанных в подпункте 58.5.1 общей части Правил клиринга, на соответствующий Торгово-клиринговый счет Т+.

Клиринговые сертификаты участия клиента Участника клиринга, учитываемые по Разделу Т+, входящему в состав указанного Торгово-клирингового счета Т+, погашаются в количестве, соответствующем количеству / сумме имущества клиента Участника клиринга, выданного из имущественного пула в соответствии с настоящим подпунктом общей части Правил клиринга, и определяемом в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

При этом Клиринговый центр перестает учитывать обязательства по возврату Участнику пула из имущественного пула имущества такого клиента Участника клиринга.

58.5.3. Клиринговый центр рассчитывает следующие промежуточные величины:

- промежуточную величину нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга по ценным бумагам (за исключением клиринговых сертификатов участия), равную сумме значений (с учетом знака) Нетто-обязательств / Нетто-требований Участника клиринга по ценной бумаге (за исключением клиринговых сертификатов участия) по Сделкам с центральным контрагентом (за исключением сделок РЕПО с клиринговыми сертификатами участия), заключенным за счет клиента Участника клиринга, учитываемых на конец дня прекращения обязательств по Сделкам, по каждому Торгово-клиринговому счету Т+ / Торгово-клиринговому счету имущественного пула, по всем Датам исполнения;
- промежуточную величину нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга по драгоценным металлам / денежным средствам в иностранной валюте, равную сумме значений (с учетом знака) Нетто-обязательств / Нетто-требований Участника клиринга по драгоценным металлам / денежным средствам в иностранной валюте по Сделкам с центральным контрагентом (за исключением сделок РЕПО с клиринговыми сертификатами участия), заключенным за счет клиента Участника клиринга, учитываемых на конец дня прекращения обязательств по Сделкам, по каждому Расчетному коду / Расчетному коду имущественного пула, по всем Датам исполнения;
- промежуточную величину нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга по товарам, равную сумме значений (с учетом знака) Нетто-обязательств / Нетто-требований Участника клиринга по товарам по Сделкам с центральным контрагентом, заключенным за счет клиента Участника клиринга, учитываемых на конец дня прекращения обязательств по Сделкам, по каждому Торгово-клиринговому счету, по всем Датам исполнения.

Если промежуточная величина, рассчитанная в соответствии с настоящим подпунктом общей части Правил клиринга положительная, у Участника клиринга учитывается промежуточная величина нетто-требования по соответствующим ценным бумагам (за исключением клиринговых сертификатов участия) / драгоценным металлам / денежным средствам в иностранной валюте / товарам, если отрицательная – промежуточная величина нетто-обязательства по соответствующим ценным бумагам (за исключением клиринговых сертификатов участия) / драгоценным металлам / денежным средствам в иностранной валюте / товарам.

Клиринговый центр прибавляет (с учетом знака) к промежуточной величине нетто-обязательства Участника клиринга по соответствующим ценным бумагам (за исключением клиринговых сертификатов участия) / драгоценным металлам / денежным средствам в иностранной валюте / товарам количество (сумму) таких ценных бумаг / драгоценных металлов / денежных средств в иностранной валюте / товаров, внесенного клиентом Участника клиринга в качестве Обеспечения Участника клиринга, учитываемых на конец дня прекращения обязательств по Сделкам по тому же Расчетному коду / Расчетному коду имущественного пула / Торгово-клиринговому счету / Торгово-клиринговому счету имущественного пула, но не большее, чем абсолютное значение указанной промежуточной величины нетто-обязательства.

58.5.4. Клиринговый центр по каждому Расчетному коду Участника клиринга, по которому учитывается имущество клиента Участника клиринга, рассчитывает следующие величины:

- POS_RUB – как сумму значений (с учетом знака) Нетто-обязательств / Нетто-требований Участника клиринга в российских рублях по Сделкам с центральным контрагентом (за исключением сделок РЕПО с клиринговыми сертификатами участия), заключенным за счет клиента Участника клиринга, учитываемых на конец дня прекращения обязательств по Сделкам по Расчетному коду и соответствующему ему Расчетному коду имущественного пула по всем Датам исполнения;
- $POS_VAL_j$ – сумма значений (с учетом знака) рассчитанных в соответствии с подпунктом 58.5.3 общей части Правил клиринга промежуточных величин нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга по денежным средствам в j-ой иностранной валюте / j-ом драгоценном металле по Расчетному коду и соответствующему ему Расчетному коду имущественного пула;
- $POS_C_i$ – сумма значений (с учетом знака) рассчитанных в соответствии с подпунктом 58.5.3 общей части Правил клиринга промежуточных величин нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга по i-ой ценной бумаге (за исключением клиринговых сертификатов участия) по Торгово-клиринговым счетам Т+ / Торгово-клиринговым счетам имущественного пула, в состав которых входит Расчетный код и соответствующий ему Расчетный код имущественного пула;
- $POS_T_l$ – сумма значений (с учетом знака) рассчитанных в соответствии с подпунктом 58.5.3 общей части Правил клиринга промежуточных величин нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга по l-му товару по Торгово-клиринговым счетам, в состав которых входит Расчетный код;
- $POS_D_k$ – нетто-позиция (с учетом знака) Участника клиринга по k-му Срочному контракту, рассчитанная как сумма (с учетом знака) позиций по k-му Срочному контракту, заключенному за счет клиента Участника клиринга, учитываемых на конец дня прекращения обязательств по Сделкам на всех разделах регистра учета позиций Участника клиринга, относящихся к Расчетному коду.

58.5.5. Клиринговый центр в порядке, определенном статьей 27 общей части Правил клиринга заключает следующие балансирующие сделки:

- балансирующие сделки с иностранной валютой / драгоценными металлами;
- балансирующие сделки с ценными бумагами (за исключением клиринговых сертификатов участия), соответствующие по объему и направленности величине $POS_C_i$, рассчитанной в соответствии подпунктом 58.5.4 общей части Правил клиринга;
- балансирующие сделки с товарами;
- Срочные контракты, являющиеся балансирующими сделками;
- Договоры СПФИ, являющиеся балансирующими сделками к Договорам СПФИ, заключенным за счет клиента Участника клиринга;
- балансирующие сделки по продаже Обеспечения в иностранной валюте / драгоценных металлах / ценных бумагах / товарах (по выбору Клирингового центра), внесенного клиентом Участника клиринга, в сумме / количестве, необходимой / необходимом для определения нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга в соответствии с подпунктом 58.5.7 общей

части Правил клиринга.

58.5.6. Клиринговый центр по каждому Расчетному коду Участника клиринга, по которому учитывается имущество клиента Участника клиринга, рассчитывает величину $SUM_{SC}$ по формуле:

$SUM_{SC} = POS_RUB + \sum_j (POS_VAL_j \times C_VAL_j) + \sum_i (POS_C_i \times CC_i \times C_VAL_i) + + \sum_k (POS_D_k \times (CD_k - SP_k)) + \sum_l (POS_T_l \times CT_l) + \sum_m SC_m$, где

$POS_RUB$, $POS_VAL_j$, $POS_C_i$, $POS_D_k$, $POS_T_l$ – величины, рассчитанные в соответствии подпунктом 58.5.4 общей части Правил клиринга;

$CC_i$ – цена сделки / средневзвешенная цена сделок с ценными бумагами, заключенной / заключенных Клиринговым центром в соответствии с пунктом 58.5.5 общей части Правил клиринга с i-ой ценной бумагой;

$C_VAL_i$ – курс сделки / средневзвешенный курс сделок с иностранной валютой, заключенной / заключенных Клиринговым центром в соответствии с пунктом 58.5.5 общей части Правил клиринга с i-ой иностранной валютой. Если $CC_i$ выражена в российских рублях, то $C_VAL_i=1$;

$\sum_i$ – сумма по ценным бумагам;

$C_VAL_j$ – курс сделки / средневзвешенный курс сделок с иностранной валютой / драгоценным металлом, заключенной / заключенных Клиринговым центром в соответствии с пунктом 58.5.5 общей части Правил клиринга с j-ой иностранной валютой / j-ым драгоценным металлом;

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

$CD_k$ – цена сделки / средневзвешенная цена сделок, заключенной / заключенных Клиринговым центром в соответствии с пунктом 58.5.5 общей части Правил клиринга по k-му Срочному контракту;

$SP_k$ – Расчетная цена k-го Срочного контракта, определенная Клиринговым центром в ходе вечерней клиринговой сессии дня, предшествующего дате заключения сделок в соответствии с пунктом 58.5.5 общей части Правил клиринга по k-му Срочному контракту;

$\sum_k$ – сумма по Срочным контрактам;

$CT_l$ – цена сделки / средневзвешенная цена сделок с товарами, заключенной / заключенных Клиринговым центром в соответствии с пунктом 58.5.5 общей части Правил клиринга с l-ым товаром (в российских рублях);

$\sum_l$ – сумма по товарам;

$SC_m$ – расчетная стоимость (с учетом знака) m-го Договора СПФИ, являющегося балансирующей сделкой, заключенной в связи с прекращением обязательств по Договору СПФИ, заключенному за счет клиента Участника клиринга, определенная в отношении Клирингового центра. Расчетная стоимость в иностранной валюте пересчитывается в российские рубли по по курсу, установленному Банком России на дату прекращения обязательств по Сделкам;

$\sum_m$ – сумма по Договорам СПФИ, являющимся балансирующими сделками, заключенными в связи с прекращением обязательств по Договорам СПФИ, заключенным за счет клиента Участника клиринга,

и

а) промежуточной величины нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в российских рублях по сделкам РЕПО с центральным контрагентом

с клиринговыми сертификатами участия, заключенным за счет клиента Участника клиринга, рассчитанной в соответствии с подпунктом 58.5.1 общей части Правил клиринга (с учетом знака);

б) Задолженности (со знаком «минус») Участника клиринга в российских рублях по Сделкам, заключенным за счет такого клиента Участника клиринга, учитываемой на конец дня прекращения обязательств по Сделкам, не включающей неисполненные обязательства Участника клиринга по уплате комиссионных вознаграждений, неустоек (штрафов, пеней), подлежащих уплате Участником клиринга в соответствии с Правилами клиринга, и

в) обязательств Участника клиринга по передаче Дохода по Сделкам, заключенным за счет такого клиента Участника клиринга, не исполненных по состоянию на конец дня прекращения обязательств по Сделкам, при отзыве (аннулировании) у клиента Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций – обязательства по передаче Дохода, возникшие до дня отзыва (аннулирования) у клиента Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций (учитываются со знаком «минус»), и

г) обязательств Клирингового центра по передаче Дохода Участнику клиринга по Сделкам, заключенным за счет такого клиента Участника клиринга, не исполненных по состоянию на конец дня прекращения обязательств по Сделкам, при отзыве (аннулировании) у клиента Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций – обязательства по передаче Дохода, возникшие до дня отзыва (аннулирования) у клиента Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций (учитываются со знаком «плюс»), и

д) значений (с учетом знака) обязательств / требований Участника клиринга в российских рублях по уплате / получению вариационной маржи по Сделкам, заключенным за счет такого клиента Участника клиринга, учитываемых на конец дня прекращения обязательств по Сделкам, за исключением обязательств / требований Участника клиринга по уплате / получению вариационной маржи по Договорам СПФИ, заключенным за счет такого клиента Участника клиринга, определенных в день прекращения обязательств по Сделкам и в день, предшествующий дню прекращения обязательств по Сделкам, и

е) обязательств Участника пула по внесению имущества клиента Участника клиринга в имущественный пул, оставшихся после продажи имущества клиента Участника клиринга из имущественного пула в соответствии с подпунктом 58.5.1 общей части Правил клиринга (учитываются со знаком «минус»).

Если величина, рассчитанная в соответствии с настоящим подпунктом общей части Правил клиринга, неотрицательная, расчет нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга по Сделкам, заключенным за счет клиента Участника клиринга, прекращается, если отрицательная – продолжается в соответствии с подпунктом 58.5.7 общей части Правил клиринга.

58.5.7. Клиринговый центр рассчитывает сумму с учетом знака отрицательной величины $SUM_{SC}$, рассчитанной в соответствии с подпунктом 58.5.6 общей части Правил

клиринга, и следующих величин, учитываемых на конец дня прекращения обязательств по Сделкам, в следующей очередности и размере:

1) величины, равной минимальной из двух величин: (1) величине обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга его Обеспечения в российских рублях, внесенного клиентом Участника клиринга (учитываются со знаком «плюс»), или (2) величине абсолютного значения отрицательной величины $SUM_{SC}$, рассчитанной в соответствии с подпунктом 58.5.6 общей части Правил клиринга;

2) величины, равной минимальной из двух величин: (1) величине обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга его Обеспечения в иностранной валюте, внесенного клиентом Участника клиринга, уменьшенной на сумму иностранной валюты, использованной при расчете промежуточной величины нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга по денежным средствам в иностранной валюте в соответствии с подпунктом 58.5.3 общей части Правил клиринга, пересчитанной в российские рубли по курсу / средневзвешенному курсу сделок с иностранной валютой, заключенных Клиринговым центром в соответствии с подпунктом 58.5.5 общей части Правил клиринга (учитывается со знаком «плюс»), или (2) величине абсолютного значения отрицательной величины $SUM_{SC}$, рассчитанной в соответствии с пунктом 1) настоящего подпункта общей части Правил клиринга;

3) величины, равной минимальной из двух величин: (1) величине Обеспечения Участника клиринга в ценных бумагах, внесенного клиентом Участника клиринга, уменьшенной на количество ценных бумаг, использованных при расчете промежуточной величины нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга по ценным бумагам в соответствии с подпунктом 58.5.3 общей части Правил клиринга, и пересчитанной в российские рубли по цене / средневзвешенной цене сделок с ценными бумагами, заключенных Клиринговым центром в соответствии с подпунктом 58.5.5 общей части Правил клиринга (учитывается со знаком «плюс»), или (2) величине абсолютного значения отрицательной величины $SUM_{SC}$, рассчитанной в соответствии с пунктом 2) настоящего подпункта общей части Правил клиринга;

4) величины, равной минимальной из двух величин: (1) величине обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга его Обеспечения в драгоценных металлах, внесенного клиентом Участника клиринга, уменьшенной на количество драгоценных металлов, использованных при расчете промежуточной величины нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга по драгоценным металлам в соответствии с подпунктом 58.5.3 общей части Правил клиринга, и пересчитанной в российские рубли по курсу / средневзвешенному курсу сделок с драгоценным металлом, заключенных Клиринговым центром в соответствии с подпунктом 58.5.5 общей части Правил клиринга (учитывается со знаком «плюс»), или (2) величине абсолютного значения отрицательной величины $SUM_{SC}$, рассчитанной в соответствии с пунктом 3) настоящего подпункта общей части Правил клиринга;

5) величины, равной минимальной из двух величин: (1) величине Обеспечения Участника клиринга в товарах, внесенного клиентом Участника клиринга,

уменьшенной на количество товаров, использованных при расчете промежуточной величины нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга по товарам в соответствии с подпунктом 58.5.3 общей части Правил клиринга, и пересчитанной в российские рубли по цене / средневзвешенной цене сделок с товаром, заключенных Клиринговым центром в соответствии с подпунктом 58.5.5 общей части Правил клиринга (учитывается со знаком «плюс»), или (2) величине абсолютного значения отрицательной величины $SUM_{SC}$, рассчитанной в соответствии с пунктом 4) настоящего подпункта общей части Правил клиринга.

Если в результате последовательного выполнения любого из действий, предусмотренных пунктами 1 – 5 настоящего подпункта общей части Правил клиринга, полученное значение $SUM_{SC}$ является неотрицательной величиной, расчет нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга по Сделкам, заключенным за счет клиента Участника клиринга, по такому Расчетному коду прекращается.

58.5.8. Клиринговый центр складывает (с учетом знака) все значения $SUM_{SC}$, рассчитанные в соответствии с подпунктами 58.5.6 и 58.5.7 общей части Правил клиринга по всем Расчетным кодам и Расчетным кодам имущественного пула, по которым учитывается имущество клиента Участника клиринга.

Если полученная сумма равна нулю, это означает отсутствие у Участника клиринга нетто-обязательства / нетто-требования по Сделкам, заключенным за счет клиента Участника клиринга.

Если полученная сумма положительная, это означает наличие нетто-требования Участника клиринга по отношению к Клиринговому центру по Сделкам, заключенным за счет клиента Участника клиринга.

Если полученная сумма отрицательная, это означает наличие нетто-обязательства Участника клиринга по отношению к Клиринговому центру по Сделкам, заключенным за счет клиента Участника клиринга.

58.5.9. Каждое из обязательств, перечисленных в подпункте 58.5.7 общей части Правил клиринга, включенное в расчет нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга по Сделкам, заключенным за счет клиента Участника клиринга, в соответствующей части прекращается.

При этом:

- обязательство Клирингового центра по возврату Обеспечения в российских рублях прекращается в части, равной сумме денежных средств в российских рублях, использованных при расчете нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в соответствии с подпунктом 58.5.7 общей части Правил клиринга;
- обязательство Клирингового центра по возврату Обеспечения в иностранной валюте прекращается в части, равной сумме иностранной валюты, использованной при расчете промежуточной величины нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга по денежным средствам в иностранной валюте в соответствии с подпунктом 58.5.3 общей части Правил клиринга, и сумме иностранной валюты в сделках по продаже Обеспечения, заключенных Клиринговым центром в соответствии с подпунктом 58.5.5 общей части Правил клиринга;

- Обеспечение в ценных бумагах используется в количестве, равном количеству ценных бумаг, использованных при расчете промежуточной величины нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга по ценным бумагам в соответствии с подпунктом 58.5.3 общей части Правил клиринга, и количеству ценных бумаг в сделках по продаже Обеспечения в ценных бумагах, заключенных Клиринговым центром в соответствии с подпунктом 58.5.5 общей части Правил клиринга;

  Для использования Обеспечения в ценных бумагах Клиринговый центр формирует и передает Расчетному депозитарию распоряжение на перевод ценных бумаг в указанном количестве с Раздела на субсчет депо Клирингового центра на клиринговом счете депо;
- обязательство Клирингового центра по возврату Обеспечения в драгоценных металлах прекращается в части, равной количеству драгоценных металлов, использованных при расчете промежуточной величины нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в драгоценных металлах в соответствии с подпунктом 58.5.3 общей части Правил клиринга, и количеству драгоценных металлов в сделках по продаже Обеспечения в драгоценных металлах, заключенных Клиринговым центром в соответствии с подпунктом 58.5.5 общей части Правил клиринга;
- Обеспечение в товарах используется в количестве, равном количеству товаров, использованных при расчете промежуточной величины нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга по товарам в соответствии с подпунктом 58.5.3 общей части Правил клиринга, и количеству товаров в сделках по продаже Обеспечения в товарах, заключенных Клиринговым центром в соответствии с подпунктом 58.5.5 общей части Правил клиринга.

  Для использования Обеспечения в товарах Клиринговый центр формирует и передает Оператору товарных поставок распоряжение на перевод товаров в указанном количестве с торгового раздела Участника клиринга на торговый раздел Клирингового центра.

58.6. Клиринговый центр рассчитывает сумму нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в российских рублях в отношении других Участников клиринга – его контрагентов по Сделкам без центрального контрагента, заключенным за счет клиента Участника клиринга, в следующем порядке.

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

$SUM = POS_RUB + \sum_i (POS_C_i \times CC_i) + \sum_i (POS_R_i \times CC_i) + \sum_j (POS_VAL_j \times C_VAL_j)$, где

$POS_RUB = ST - SO$,

$POS_VAL_j = ST_j - SO_j$,

$POS_C_i = STC_i - SOC_i$,

$POS_R_i = STR_i - SOR_i$,

POS_RUB – обязательство (требование) Участника клиринга по денежным средствам в российских рублях;

$POS_C_i$ – обязательство (требование) Участника клиринга по i-ой ценной бумаге по сделкам купли-продажи ценных бумаг;

$POS_VAL_j$ – обязательство (требование) Участника клиринга по денежным средствам в j-ой иностранной валюте;

$POS_R_i$ – обязательство (требование) Участника клиринга по i-ой ценной бумаге по сделкам РЕПО;

ST – сумма требований, а SO – сумма обязательств Участника клиринга по денежным средствам в соответствующей валюте, учитываемых на дату прекращения обязательств по Сделкам, заключенным за счет клиента Участника клиринга, по:

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

При этом сумма обязательств и требований по вторым частям сделок РЕПО рассчитывается исходя из фактического срока сделки РЕПО, прошедшего от фактической даты исполнения обязательств по первой части РЕПО, включая эту дату, до даты прекращения обязательств по Сделкам, не включая эту дату.

В случае если Дата исполнения обязательств по второй части сделки РЕПО совпадает с датой, предшествующей дате прекращения обязательств по сделкам, сумма обязательств и требований по вторым частям сделок РЕПО рассчитывается исходя из фактического срока сделки РЕПО, прошедшего от фактической даты исполнения обязательств по первой части РЕПО, включая эту дату, до Даты исполнения обязательств по второй части сделки РЕПО, не включая эту дату.

В случае если обязательства по первой части сделки РЕПО не исполнены на дату прекращения обязательств по Сделкам в соответствии с настоящей статьей общей части Правил клиринга, в целях расчета нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в отношении Участников клиринга – его контрагентов срок сделки РЕПО принимается равным нулю.

Сумма обязательств и требований по вторым частям сделок РЕПО рассчитывается с учетом уменьшения на величину уплаченного купонного (процентного) дохода и/или на величину погашенной части основного долга (амортизационной выплаты) в соответствии с условиями сделки РЕПО.

$STC_i$ – сумма требований, а $SOC_i$ – сумма обязательств Участника клиринга по i-ой ценной бумаге, учитываемых на дату прекращения обязательств по Сделкам, заключенным за счет клиента Участника клиринга, по:

- сделкам с кодом расчетов B0-B30.

$STR_i$ – сумма требований, а $SOR_i$ – сумма обязательств Участника клиринга по i-ой ценной бумаге, учитываемых на дату прекращения обязательств по Сделкам, заключенным за счет клиента Участника клиринга, по:

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

$CC_i$ – цена (в российских рублях), равная сумме расчетной цены i-ой ценной бумаги (за исключением клиринговых сертификатов участия), определенной Биржей в соответствии с Правилами торгов на фондовом рынке и рынке депозитов

по итогам Торгового дня прекращения обязательств по Сделкам, или последней использовавшейся расчетной цены такой ценной бумаги, и НКД на дату прекращения обязательств по Сделкам (при условии его расчета для данной ценной бумаги). Если расчетная цена и НКД для i-ой ценной бумаги определены в иностранной валюте, расчёт цены осуществляется по курсу соответствующей иностранной валюты, установленному Банком России на дату прекращения обязательств по Сделкам. Для клиринговых сертификатов участия $CC_i$ равна номинальной стоимости одного клирингового сертификата участия;

$\sum_i$ – сумма по ценным бумагам;

$C_VAL_j$ – курс j-ой иностранной валюты, установленный Банком России на дату прекращения обязательств по Сделкам;

$\sum_j$ – сумма по иностранным валютам.

58.6.2. Если величина, рассчитанная в соответствии с подпунктом 58.6.1 общей части Правил клиринга, положительная, это означает наличие нетто-требования Участника клиринга по отношению к Участнику клиринга – контрагенту, отрицательная – наличие нетто-обязательства Участника клиринга по отношению к Участнику клиринга – контрагенту.

58.7. Клиринговый центр не позднее 3 (трех) рабочих дней, следующих за датой получения от Участника клиринга Заявления о проведении ликвидационного неттинга в отношении клиента Участника клиринга, направляет Участнику клиринга уведомление о прекращении обязательств по Сделкам, заключенным за счет такого клиента Участника клиринга. Указанное уведомление также содержит информацию о рассчитанном в соответствии с пунктом 58.5 общей части Правил клиринга нетто-обязательстве / нетто-требовании Участника клиринга в отношении Клирингового центра по Сделкам с центральным контрагентом, заключенным за счет такого клиента Участника клиринга, а также о рассчитанных в соответствии с пунктом 58.6 общей части Правил клиринга нетто-обязательствах / нетто-требованиях Участника клиринга в отношении его контрагентов по Сделкам без центрального контрагента, заключенным за счет такого клиента Участника клиринга.

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

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

- денежные средства в российских рублях в сумме нетто-требования Участника клиринга, определенного в соответствии с пунктом 58.5 общей части Правил клиринга;
- денежные средства в российских рублях в сумме Обеспечения Участника клиринга в российских рублях, внесенного клиентом Участника клиринга и не использованного для определения нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в соответствии с пунктом 58.5 общей части Правил

клиринга;

- денежные средства в иностранной валюте – в сумме Обеспечения Участника клиринга в соответствующей иностранной валюте, внесенного клиентом Участника клиринга и не использованного для определения нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в соответствии с пунктом 58.5 общей части Правил клиринга;
- драгоценные металлы – в размере Обеспечения Участника клиринга в соответствующем драгоценном металле, внесенного клиентом Участника клиринга и не использованного для определения нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в соответствии с пунктом 58.5 общей части Правил клиринга.

58.9. Нетто-обязательство Участника клиринга, рассчитанное в соответствии с пунктом 58.5 общей части Правил клиринга, учитывается как Задолженность такого Участника клиринга и исполняется за счет Обеспечения Участника клиринга, учитываемого по собственным Расчетным кодам, а также Обеспечения под стресс и взносов в Гарантийные фонды в порядке, установленном статьей 48 общей части Правил клиринга.

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

58.11. При зачислении на казначейский счет депо Клирингового центра клиринговых сертификатов участия в количестве, соответствующем промежуточной величине нетто-требования Участника клиринга в клиринговых сертификатах участия по сделкам РЕПО с центральным контрагентом, заключенным за счет клиента Участника клиринга, рассчитанной в соответствии с пунктом 1) подпункта 58.5.1 общей части Правил клиринга по сделкам РЕПО с клиринговыми сертификатами участия, обязательства по которым были прекращены в ходе ликвидационного неттинга, проведенного в соответствии с настоящей статьей общей части Правил клиринга в отношении клиента Участника клиринга, клиринговые сертификаты в указанном количестве погашаются Клиринговым центром, денежные средства в сумме номинальной стоимости погашенных клиринговых сертификатов участия выводятся из соответствующего имущественного пула.

## Статья 59. Порядок урегулирования обязательств в случае отзыва (аннулирования) лицензии на осуществление банковских операций у Клирингового центра (ликвидационный неттинг в отношении Клирингового центра)

59.1. В случае отзыва (аннулирования) лицензии на осуществление банковских операций у Клирингового центра, обязательства по Сделкам с центральным контрагентом, заключенным до даты отзыва (аннулирования) такой лицензии, и обязательства по договору об имущественном пуле прекращаются полностью на дату, предшествующую дате отзыва (аннулирования) лицензии на осуществление банковских операций у Клирингового центра.

Указанные обязательства прекращаются возникновением нетто-обязательств / нетто-требований Клирингового центра, рассчитанных в соответствии с пунктом 59.4 общей части Правил клиринга.

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

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

59.2. В случае назначения временной администрации по управлению Клиринговым центром в рамках мер по предупреждению банкротства кредитной организации и введения моратория на удовлетворение требований кредиторов Клирингового центра, обязательства по Сделкам с центральным контрагентом, заключенным до даты введения моратория на удовлетворение требований кредиторов, и обязательства по договору об имущественном пуле прекращаются полностью на дату, предшествующую дате введения в отношении Клирингового центра моратория на удовлетворение требований кредиторов.

Указанные обязательства прекращаются возникновением нетто-обязательств / нетто-требований Клирингового центра, рассчитанных в соответствии с пунктом 59.4 общей части Правил клиринга.

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

59.3. В случае отзыва (аннулирования) лицензии на осуществление банковских операций у Клирингового центра, а также в случае назначения временной администрации по управлению Клиринговым центром в рамках мер по предупреждению банкротства кредитной организации и введения моратория на удовлетворение требований кредиторов Клирингового центра Участник клиринга, являющийся Участником пула, вправе в дату отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций / в дату введения моратория на удовлетворение требований кредиторов Клирингового центра подать Клиринговому центру заявление на выдачу активов из имущественного пула.

Указанное заявление содержит указание на Торгово-клиринговый счет имущественного пула, код и сумму / количество денежных средств / ценных бумаг и исполняется при соблюдении условий погашения клиринговых сертификатов участия при выдаче указанного имущества из имущественного пула, установленных Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

Для исполнения указанного заявления Клиринговый центр формирует и исполняет распоряжения на перевод денежных средств со Счетов обеспечения, относящихся к Расчетным кодам имущественного пула, входящим в состав Торгово-клирингового счета имущественного пула, на Счета обеспечения, относящиеся к Расчетным

кодам, входящим в состав соответствующих Торгово-клиринговых счетов Т+, а также формирует и направляет Расчетному депозитарию распоряжение на перевод ценных бумаг с субсчетов депо имущественного пула, входящих в состав Торгово-клирингового счета имущественного пула, на Разделы Т+, входящие в состав соответствующих Торгово-клиринговых счетов Т+.

Клиринговые сертификаты участия, учитываемые по Разделу Т+, входящему в состав указанного Торгово-клирингового счета Т+, погашаются в количестве, определяемом в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов.

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

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

59.4.1. Клиринговый центр для каждого имущественного пула и для всех соответствующих Расчетных кодов и Расчетных кодов имущественного пула Участника клиринга:

1) рассчитывает промежуточную величину нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в клиринговых сертификатах участия, равную сумме с учетом знака:
   - Нетто-обязательств / Нетто-требований Участника клиринга по клиринговым сертификатам участия по сделкам РЕПО с центральным контрагентом с клиринговыми сертификатами участия, учитываемых на конец дня прекращения обязательств по Сделкам по Торгово-клиринговым счетам Т+, в состав которых входят соответствующие Расчетные коды, по всем Датам исполнения;
   - требований Участника клиринга к Клиринговому центру по получению клиринговых сертификатов участия в количестве, равном полученному Клиринговым центром от Банка России при выкупе клиринговых сертификатов участия у Банка России в соответствии с Правилами

клиринга на фондовом рынке и рынке депозитов, учитываемых на конец дня прекращения обязательств по Сделкам по Торгово-клиринговым счетам Т+, в состав которых входят соответствующие Расчетные коды, по всем Датам исполнения.

Если величина, рассчитанная в соответствии с настоящим пунктом общей части Правил клиринга положительная, у Участника клиринга учитывается промежуточная величина нетто-требования в клиринговых сертификатах участия, если отрицательная – промежуточная величина нетто-обязательства в клиринговых сертификатах участия.

Клиринговый центр прибавляет (с учетом знака) к промежуточной величине нетто-обязательства Участника клиринга в клиринговых сертификатах участия количество клиринговых сертификатов участия, учитываемых на конец дня прекращения обязательств по Сделкам по Торгово-клиринговым счетам Т+, в состав которых входят соответствующие Расчетные коды, но не большее, чем абсолютное значение указанной промежуточной величины нетто-обязательства Участника клиринга в клиринговых сертификатах участия;

2) рассчитывает промежуточную величину нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в российских рублях по сделкам РЕПО с клиринговыми сертификатами участия, равную сумме с учетом знака:
   - Нетто-обязательств / Нетто-требований Участника клиринга по денежным средствам по сделкам РЕПО с центральным контрагентом с клиринговыми сертификатами участия, учитываемых на конец дня прекращения обязательств по Сделкам по соответствующим Расчетным кодам по всем Датам исполнения. При этом значение, рассчитанное по сделкам РЕПО с расчетами в иностранной валюте, пересчитывается в российские рубли по курсу, установленному Банком России на день отзыва у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций / день введения в отношении Клирингового центра моратория на удовлетворение требований кредиторов;
   - обязательств Участника клиринга уплатить Клиринговому центру денежные средств в сумме, равной сумме номинальной стоимости клиринговых сертификатов участия, в отношении которых Участником клиринга не были исполнены обязательства перед Банком России по второй части договора репо, учитываемых на конец дня прекращения обязательств по Сделкам по соответствующим Расчетным кодам по всем Датам исполнения.

   Если величина, рассчитанная в соответствии с настоящим пунктом общей части Правил клиринга положительная, у Участника клиринга учитывается промежуточная величина нетто-требования в российских рублях по сделкам РЕПО с клиринговыми сертификатами участия, если отрицательная – промежуточная величина нетто-обязательства в российских рублях по сделкам РЕПО с клиринговыми сертификатами участия;

3) если Участник клиринга является Участником пула, Клиринговый центр продает ценные бумаги и иностранную валюту, оставшиеся в имущественном пуле после исполнения распоряжения Участника клиринга, указанного в пункте 59.2 общей части Правил клиринга, и учитываемые по

соответствующим Расчетным кодам имущественного пула Участника пула, на соответствующих биржевых рынках.

Если сумма денежных средств в российских рублях, учитываемая на конец дня прекращения обязательств по Сделкам по соответствующим Расчетным кодам имущественного пула, а также полученная от продажи ценных бумаг и иностранной валюты, учитываемых по соответствующим Расчетным кодам имущественного пула Участника пула, больше абсолютного значения промежуточной величины нетто-обязательства Участника клиринга в российских рублях, Клиринговый центр учитывает денежные средства в сумме такого превышения по Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета Т+, соответствующего Торгово-клиринговому счету имущественного пула, а положительную разность между оставшейся суммой денежных средств в российских рублях и номинальной стоимостью клиринговых сертификатов участия в промежуточной величине нетто-требования Участника клиринга в клиринговых сертификатах участия, прибавляет (с учетом знака) к промежуточной величине нетто-обязательства Участника клиринга в российских рублях.

Если сумма денежных средств, учитываемая на конец дня прекращения обязательств по Сделкам по соответствующим Расчетным кодам имущественного пула, а также полученная от продажи ценных бумаг и иностранной валюты, учитываемых по соответствующим Расчетным кодам имущественного пула Участника пула, меньше, чем номинальная стоимость клиринговых сертификатов участия в указанной промежуточной величине нетто-требования Участника клиринга в клиринговых сертификатах участия, неисполненное обязательство Участника пула по внесению имущества в имущественный пул учитывается при дальнейшем расчете соответствующего нетто-обязательства / нетто-требования Участника пула в соответствии с подпунктом 59.4.3 общей части Правил клиринга;

4) Клиринговый центр прибавляет (с учетом знака) к промежуточной величине нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в российских рублях, определенной по итогам действий, указанных в пунктах 2)-3) подпункта 59.4.1 общей части Правил клиринга, и произведения 1 (одного) российского рубля, являющегося номинальной стоимостью одного клирингового сертификата участия, и промежуточной величины нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в клиринговых сертификатах участия, определенной по итогам действий, указанных в пункте 1) подпункта 59.4.1 общей части Правил клиринга.

Рассчитанная в соответствии с настоящим пунктом общей части Правил клиринга промежуточная величина нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в российских рублях по сделкам РЕПО с клиринговыми сертификатами участия учитывается при дальнейшем расчете соответствующего нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в соответствии с подпунктом 59.4.3 общей части Правил клиринга.

59.4.2. После выполнения действий, указанных в подпункте 59.4.1 общей части Правил клиринга, все клиринговые сертификаты участия погашаются.

При этом прекращаются все обязательства Участника клиринга, являющегося Участником пула, из договора об имущественном пуле, Клиринговый центр

перестает учитывать обязательства по возврату Участнику пула имущества из имущественного пула.

59.4.3. Клиринговый центр рассчитывает сумму с учетом знака:

а) по каждой ценной бумаге суммы (с учетом знака) Нетто-обязательств / Нетто-требований по Сделкам с центральным контрагентом по ценной бумаге, учитываемых на конец дня прекращения обязательств по Сделкам, по Торгово-клиринговым счетам Т+ / Торгово-клиринговым счетам имущественного пула, в состав которых входят соответствующие Расчетные коды / Расчетные коды имущественного пула, по всем Датам исполнения, пересчитанной в российские рубли по Расчетной цене соответствующей ценной бумаги, установленной Клиринговым центром на день отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций / день введения в отношении Клирингового центра моратория на удовлетворение требований кредиторов;

б) суммы (с учетом знака) Нетто-обязательств / Нетто-требований по Сделкам с центральным контрагентом по денежным средствам в российских рублях Участника клиринга, учитываемых на конец дня прекращения обязательств по Сделкам по соответствующим Расчетным кодам / Расчетным кодам имущественного пула, по всем Датам исполнения;

в) по каждой иностранной валюте суммы (с учетом знака) Нетто-обязательств / Нетто-требований по Сделкам с центральным контрагентом по денежным средствам в иностранной валюте Участника клиринга, учитываемых на конец дня прекращения обязательств по Сделкам по соответствующим Расчетным кодам / Расчетным кодам имущественного пула по всем Датам исполнения, пересчитанной в российские рубли по курсу, установленному Банком России на день отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций / день введения в отношении Клирингового центра моратория на удовлетворение требований кредиторов;

г) требований Участника клиринга по возврату депозитов в российских рублях, учитываемых по соответствующим Расчетным кодам, включающих сумму процентов, рассчитанную исходя из фактического срока депозита, прошедшего от даты внесения депозита, не включая эту дату, до даты прекращения обязательств по Сделкам, включая эту дату;

д) требований Участника клиринга по возврату депозитов в j-ой иностранной валюте, учитываемых по соответствующим Расчетным кодам, включающих сумму процентов, рассчитанную исходя из фактического срока депозита, прошедшего от даты внесения депозита, не включая эту дату, до даты прекращения обязательств по Сделкам, включая эту дату, пересчитанных в российские рубли по курсу, установленному Банком России на день отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций / день введения в отношении Клирингового центра моратория на удовлетворение требований кредиторов;

е) по каждому драгоценному металлу суммы (с учетом знака) Нетто-обязательств / Нетто-требований по Сделкам с центральным контрагентом по драгоценным металлам, учитываемых на конец дня прекращения обязательств по Сделкам по соответствующим Расчетным кодам по всем

Датам исполнения, пересчитанной в российские рубли по Центральному курсу соответствующего драгоценного металла, установленному Клиринговым центром на день отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций / день введения в отношении Клирингового центра моратория на удовлетворение требований кредиторов;

ж) по каждому товару суммы (с учетом знака) Нетто-обязательств / Нетто-требований по Сделкам с центральным контрагентом по товару, учитываемых на конец дня прекращения обязательств по Сделкам по Торгово-клиринговым счетам, в состав которых входят соответствующие Расчетные коды, по всем Датам исполнения, пересчитанной в российские рубли по Расчетной цене соответствующего товара, установленной Клиринговым центром на день отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций / день введения в отношении Клирингового центра моратория на удовлетворение требований кредиторов;

з) расчетной стоимости (с учетом знака) каждого Договора СПФИ, учитываемого на регистре учета позиций Участника клиринга, рассчитанной на дату прекращения обязательств по Сделкам (учитывается со знаком, обратным к знаку, который имеет расчетная стоимость Договора СПФИ). Расчетная стоимость в иностранной валюте пересчитывается в российские рубли по курсу, установленному Банком России на день отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций / день введения в отношении Клирингового центра моратория на удовлетворение требований кредиторов;

и) промежуточной величины нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в российских рублях по сделкам РЕПО с клиринговыми сертификатами участия, рассчитанной в соответствии с подпунктом 59.4.1 общей части Правил клиринга (с учетом знака);

к) номинальной стоимости (в российских рублях) клиринговых сертификатов участия, предъявленных к выкупу Банком России;

л) Обеспечения Участника клиринга в российских рублях, учитываемого по соответствующим Расчетным кодам на конец дня прекращения обязательств по Сделкам (учитывается со знаком «плюс»);

м) Обеспечения Участника клиринга в иностранной валюте, учитываемого по соответствующим Расчетным кодам на конец дня прекращения обязательств по Сделкам, пересчитанного в российские рубли по курсу, установленному Банком России на день отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций / день введения в отношении Клирингового центра моратория на удовлетворение требований кредиторов (учитывается со знаком «плюс»);

н) Обеспечения Участника клиринга в ценных бумагах, учитываемого по Торгово-клиринговым счетам Гарантийных фондов / Торгово-клиринговым счетам Обеспечения под стресс, на конец дня прекращения обязательств по Сделкам, пересчитанного в российские рубли по Расчетной цене соответствующей ценной бумаги, установленной Клиринговым центром на день отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на

осуществление банковских операций / день введения в отношении Клирингового центра моратория на удовлетворение требований кредиторов;

о) Обеспечения Участника клиринга в драгоценных металлах, учитываемого по соответствующим Расчетным кодам на конец дня прекращения обязательств по Сделкам, пересчитанного в российские рубли по Центральному курсу соответствующего драгоценного металла, установленного Клиринговым центром на день отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций / день введения в отношении Клирингового центра моратория на удовлетворение требований кредиторов;

п) Обеспечения Участника клиринга в товарах, учитываемого по Торгово-клиринговым счетам, в состав которых входят соответствующие Расчетные коды, на конец дня прекращения обязательств по Сделкам, пересчитанного в российские рубли по Расчетной цене соответствующего товара, установленной Клиринговым центром на день отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций / день введения в отношении Клирингового центра моратория на удовлетворение требований кредиторов;

р) Обеспечения под стресс Участника клиринга в российских рублях, учитываемого на конец дня прекращения обязательств по Сделкам (учитывается со знаком «плюс», только для собственных Расчетных кодов);

с) Обеспечения под стресс Участника клиринга в иностранной валюте, учитываемого на конец дня прекращения обязательств по Сделкам, пересчитанного в российские рубли по курсу, установленному Банком России на день отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций / день введения в отношении Клирингового центра моратория на удовлетворение требований кредиторов (учитывается со знаком «плюс», только для собственных Расчетных кодов);

т) Обеспечения под стресс Участника клиринга в ценных бумагах, учитываемого на конец дня прекращения обязательств по Сделкам, пересчитанного в российские рубли по Расчетной цене соответствующей ценной бумаги, установленной Клиринговым центром на день отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций / день введения в отношении Клирингового центра моратория на удовлетворение требований кредиторов (учитывается со знаком «плюс», только для собственных Расчетных кодов);

у) взноса Участника клиринга в Гарантийный фонд в российских рублях, учитываемого на конец дня прекращения обязательств по Сделкам (учитывается со знаком «плюс», только для собственных Расчетных кодов);

ф) взноса Участника клиринга в Гарантийный фонд в иностранной валюте, учитываемого на конец дня прекращения обязательств по Сделкам, пересчитанного в российские рубли по курсу, установленному Банком России на день отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций / день введения в отношении Клирингового центра моратория на удовлетворение требований кредиторов (учитывается со знаком «плюс», только для собственных Расчетных кодов);

х) взноса Участника клиринга в Гарантийный фонд в ценных бумагах, учитываемого на конец дня прекращения обязательств по Сделкам, пересчитанного в российские рубли по Расчетной цене соответствующей ценной бумаги, установленной Клиринговым центром на день отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций / день введения в отношении Клирингового центра моратория на удовлетворение требований кредиторов (учитывается со знаком «плюс», только для собственных Расчетных кодов);

ц) Задолженности Участника клиринга в российских рублях, возникшей до даты отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций / даты введения в отношении Клирингового центра моратория на удовлетворение требований кредиторов, учитываемой по соответствующим Расчетным кодам, не включающей неисполненные обязательства Участника клиринга по уплате комиссионных вознаграждений, неустоек (штрафов, пеней), подлежащих уплате Участником клиринга в соответствии с Правилами клиринга (учитывается со знаком «минус»);

ч) обязательств Участника клиринга по передаче Дохода, учитываемых по соответствующим Расчетным кодам и не исполненных по состоянию на день отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций / день введения в отношении Клирингового центра моратория на удовлетворение требований кредиторов (учитываются со знаком «минус»);

ш) требований Участника клиринга по получению Дохода, учитываемых по соответствующим Расчетным кодам и не исполненных по состоянию на день отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций / день введения в отношении Клирингового центра моратория на удовлетворение требований кредиторов (учитываются со знаком «плюс»);

щ) обязательств Участника клиринга по внесению имущества в имущественный пул, оставшихся после продажи имущества из имущественного пула в соответствии с подпунктом 59.4.1 общей части Правил клиринга (учитываются со знаком «минус»).

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

59.5. Информация о сумме нетто-обязательств / нетто-требований Клирингового центра в российских рублях в отношении Участника клиринга, определенных в соответствии с пунктом 59.4 общей части Правил клиринга, направляется Клиринговым центром Участнику клиринга.

59.6. Информация о сумме нетто-обязательства / нетто-требования Клирингового центра в российских рублях в отношении Участника клиринга, определенных в соответствии с пунктом 59.4 общей части Правил клиринга по Сделкам,

заключенным за счет средств Доверенного владельца счетов, направляется Клиринговым центром Доверенному владельцу счетов.

59.7. После определения нетто-обязательств / нетто-требований Клирингового центра в отношении Участника клиринга в соответствии с пунктом 59.4 общей части Правил клиринга все имущественные пулы прекращаются.

**Статья 60. Взаимодействие с Биржей при возникновении обстоятельств, которые могут повлиять на возможность проведения Торгов**

60.1. В случае возникновения обстоятельств, вызывающих и/или создающих предпосылки к возникновению сбоев (отказов) при эксплуатации Клиринговой системы и/или непосредственно препятствующие ее нормальному (штатному) функционированию, в том числе, обстоятельства непреодолимой силы, а также сбои, неисправности и отказы оборудования; сбои и ошибки программного обеспечения; сбои, неисправности и отказы систем связи, энергоснабжения, кондиционирования и других систем жизнеобеспечения, а также иные обстоятельства, такие как случаи нарушения правил разграничения доступа и/или попыток несанкционированного доступа к Клиринговой системе, Клиринговый центр незамедлительно уведомляет об этом Биржу и/или Расчетную организацию и/или Расчетный депозитарий любым из доступных средств связи и предпринимает все возможные меры, направленные на устранение указанных обстоятельств.

**Статья 61. Чрезвычайные ситуации**

61.1. Чрезвычайной ситуацией может быть признана ситуация, связанная с наступлением обстоятельств, препятствующих клиринговому обслуживанию Участника клиринга / Участников клиринга и/или исполнению Клиринговым центром своих обязательств перед Участником клиринга / Участниками клиринга по возврату им денежных средств, в том числе:

- обстоятельства, вызывающие и/или создающие предпосылки к возникновению сбоев (отказов) при эксплуатации Клиринговой системы и/или непосредственно препятствующие ее нормальному (штатному) функционированию, в том числе, обстоятельства непреодолимой силы, а также сбои, неисправности и отказы оборудования; сбои и ошибки программного обеспечения; сбои, неисправности и отказы систем связи, энергоснабжения, кондиционирования и других систем жизнеобеспечения, а также иные обстоятельства, такие как случаи нарушения правил разграничения доступа и/или попыток несанкционированного доступа к Клиринговой системе, последствия которых не устранены в течение 3 (трех) часов со времени окончания торгов;
- военные действия, акты террора, диверсии и саботажа, массовые беспорядки, забастовки, смена политического режима, другие политические осложнения, как в Российской Федерации, так и в иных государствах;
- решения органов государственной власти, иных органов, учреждений и организаций Российской Федерации и/или иных государств;
- пожары или иные несчастные случаи, разрушения или значительные повреждения в занимаемых Клиринговым центром помещениях;

- любые иные обстоятельства, которые создают или могут создать угрозу жизни или здоровью работников Клирингового центра;
- получение сообщения Биржи о возникновении чрезвычайной ситуации, которая может привести к нарушению клирингового обслуживания Участников клиринга;
- прекращение / приостановление оказания Клиринговому центру услуг, необходимых для клирингового обслуживания Участника клиринга / Участников клиринга, включая прекращение / приостановление обслуживания корреспондентского счета Клирингового центра банком или небанковской кредитной организацией, в том числе иностранной кредитной организацией;
- иные обстоятельства, препятствующие клиринговому обслуживанию Участника клиринга / Участников клиринга, которые, находятся вне контроля Клирингового центра.

61.2. Признание ситуации чрезвычайной осуществляется по решению Клирингового центра. Ситуация может быть признана чрезвычайной в отношении одного или нескольких Участников клиринга.

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

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

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

- об изменении Временного регламента и/или сроков осуществления документооборота в процессе взаимодействия Клирингового центра с Расчетной организацией, Расчетным депозитарием и Биржей;
- об исключении из клирингового пула обязательств по некоторым или всем Сделкам;
- об изменении способа, порядка и Даты исполнения обязательств Участником клиринга / Участниками клиринга и/или Клиринговым центром, в том числе в соответствии с пунктом 61.5 общей части Правил клиринга;
- об осуществлении иных действий, направленных на урегулирование чрезвычайной ситуации.

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

61.5. В случае признания ситуации чрезвычайной в связи с обстоятельствами, предусмотренными пунктом 61.1 общей части Правил клиринга, Клиринговый центр вправе принять решения:

1) об изменении условий Сделок с расчетами в иностранной валюте: установить, что обязательства по таким Сделкам, определенные в иностранной валюте, исполняются в российских рублях по курсу, установленному решением Клирингового центра по согласованию с Банком России;
2) о том, что Дата исполнения обязательств по Сделкам с расчетами в иностранной валютой считается наступившей в Расчетный день, установленный решением Клирингового центра по согласованию с Банком России, и об исполнении обязательств по указанным Сделкам в порядке, установленном подпунктами 61.5.1- общей части Правил клиринга.

61.5.1. В случае принятия решения об изменении даты исполнения обязательств по Сделкам с расчетами в иностранной валюте, срок сделок РЕПО и депозитных договоров с расчетами в иностранной валюте рассчитывается исходя из фактического срока сделки РЕПО / депозита, прошедшего от фактической даты исполнения обязательств по первой части РЕПО / даты внесения депозита, не включая эту дату, до даты исполнения обязательств по Сделкам, установленной решением Клирингового центра, включая эту дату.

61.5.2. Обязательства по Сделкам с расчетами в иностранной валютой, пересчитанные в российские рубли по курсу, установленному решением Клирингового центра по согласованию с Банком России, включаются в клиринговый пул, формируемый в Расчетный день, установленный решением Клирингового центра, и прекращаются в указанном клиринговом пуле в порядке, установленном соответствующей частью Правил клиринга.

61.6. При принятии решений по урегулированию чрезвычайных ситуаций (при необходимости по согласованию с Биржей) Клиринговый центр вправе:

- устанавливать сроки и порядок исполнения своих решений Участником клиринга / Участниками клиринга;
- обуславливать порядок вступления в силу своих решений определенными обстоятельствами.

61.7. О мерах, предпринятых по решению Клирингового центра в целях урегулирования чрезвычайной ситуации, Банк России, Участник клиринга / Участники клиринга, в отношении которых ситуация признана чрезвычайной, и Биржа оповещаются имеющимися доступными средствами связи не позднее дня принятия данных мер.

61.8. Клиринговый центр не несет ответственности за убытки, которые могут возникнуть в связи с неосуществлением клирингового обслуживания Участника клиринга / Участников клиринга в соответствии с Правилами клиринга в случае признания ситуации чрезвычайной в связи с обстоятельствами, предусмотренными пунктом 61.1 общей части Правил клиринга.

## Статья 62. Порядок разрешения споров

62.1. Все споры и разногласия, возникшие в связи с применением, нарушением, толкованием Правил клиринга, исполнением обязательств, вытекающих из Правил клиринга, признанием недействительными Правил клиринга или их части, подлежат рассмотрению и разрешению в Арбитражном центре при Общероссийской общественной организации «Российский союз промышленников и предпринимателей» в соответствии с его регламентом, действующим на момент подачи искового заявления.

62.2. Решения Арбитражного центра при Общероссийской общественной организации «Российский союз промышленников и предпринимателей» являются окончательными и обязательными для исполнения. Неисполненное добровольно решение Арбитражного центра при Общероссийской общественной организации «Российский союз промышленников и предпринимателей» подлежит принудительному исполнению в соответствии с законодательством Российской Федерации или законодательством страны места принудительного исполнения и/или международными соглашениями.

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

**Договор об оказании клиринговых услуг №_____**

**город Москва** **«___» _____20__ года**

| | |
|---|---|
| **Участник клиринга (полное фирменное наименование)** | |
| **Клиринговая организация** | Небанковская кредитная организация-центральный контрагент «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество) |

1. Клиринговая организация обязуется в соответствии с правилами клиринга оказывать участнику клиринга клиринговые и иные связанные с клирингом услуги, а участник клиринга обязуется оплачивать указанные услуги, если иное не предусмотрено законодательством Российской Федерации.

2. Состав услуг, условия и порядок их оказания, порядок оплаты, а также иные права и обязанности сторон, связанные с клиринговым обслуживанием, устанавливаются правилами клиринга клиринговой организации. Клиринговая организация вправе утверждать различные правила клиринга, регламентирующие различные направления клиринговой деятельности.

| | **От имени участника клиринга** | **От имени клиринговой организации** |
|---|---|---|
| **ФИО** | | |
| **Должность** | | |
| **Основание полномочий** | | |
| **Подпись, печать** | | |

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

**Договор о ведении клиринговых регистров №_____**

**город Москва** **«___» _____20__ года**

| | |
|---|---|
| **Участник торгов (полное фирменное наименование)** | |
| **Клиринговая организация** | Небанковская кредитная организация-центральный контрагент «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество) |

1. Клиринговая организация обязуется оказывать участнику торгов услуги, связанные с открытием клиринговых регистров, а участник торгов обязуется оплачивать указанные услуги.

2. Состав услуг, условия и порядок их оказания, порядок оплаты, а также иные права и обязанности сторон, связанные с оказанием услуг по ведению клиринговых регистров, устанавливаются правилами клиринга клиринговой организации.

3. Во исполнение договора о ведении клиринговых регистров, заключенного с участником торгов, Клиринговая организация в объеме, предусмотренном правилами клиринга и необходимом для оказания Клиринговой организацией участнику торгов услуг по данному договору, предоставляет участнику торгов доступ, в том числе путем передачи, к информации, в том числе инсайдерской, об обязательствах и обеспечении участника клиринга, являющегося стороной по сделкам, заключаемым участником торгов, а также иной информации в отношении такого участника клиринга, в том числе инсайдерской.

4. Споры и разногласия, возникающие из настоящего договора или в связи с ним, стороны будут стремиться разрешить путем переговоров.
   Стороны соглашаются, что если им не удастся разрешить споры и/или разногласия путем переговоров, то все споры и разногласия, возникающие из настоящего договора или в связи с ним, в том числе, касающиеся его заключения, исполнения, нарушения, прекращения или действительности подлежат разрешению в Арбитражном центре при Общероссийской общественной организации «Российский союз промышленников и предпринимателей» (далее – Третейский суд) в соответствии с документами, определяющими правовой статус Третейского суда и порядок разрешения им споров, действующими на момент подачи искового заявления.
   Решения Третейского суда признаются сторонами окончательными и обязательными для исполнения. Неисполненное добровольно решение Третейского суда подлежит принудительному исполнению в соответствии с законодательством Российской Федерации или законодательством страны места принудительного исполнения и международными соглашениями.

| | От имени участника торгов | От имени клиринговой организации |
|---|---|---|
| **ФИО** | | |
| **Должность** | | |
| **Основание полномочий** | | |
| **Подпись, печать** | | |

**Приложение № 3**
к общей части Правил клиринга

# Порядок проведения технической экспертизы

1) Проведение технической экспертизы в случае возникновения конфликтной ситуации в связи с использованием АСП осуществляется технической комиссией, формируемой в случае невозможности разрешения конфликтной ситуации в рабочем порядке.

2) Если стороны в конфликтной ситуации не договорятся об ином, в состав технической комиссии входит равное количество, но не менее чем по одному уполномоченному представителю каждой из конфликтующих сторон и Технического центра. Право представлять в технической комиссии соответствующую сторону должно подтверждаться доверенностью, выданной каждому представителю на срок работы технической комиссии.

3) Проведение технической экспертизы при разрешении конфликтных ситуаций в соответствии с особенностями функционирования Клиринговой системы требует применения специального программного и информационного обеспечения для выполнения необходимых проверок и документирования данных, используемых при выполнении необходимых проверок.

4) Для проведения технической экспертизы необходимы:
   - информация от заявителя претензии (Участника клиринга, Участника торгов или Клирингового центра) о параметрах Предложения / электронного сообщения, в отношении которого проводится техническая экспертиза:
     - дата и время формирования Предложения / электронного сообщения;
     - номер Предложения / электронного сообщения, зарегистрированный в Клиринговой системе;
     - иные параметры Предложения / электронного сообщения, необходимые для рассмотрения претензии;
   - архив регистрации транзакций в Клиринговой системе на указанную дату;
   - рабочее место, позволяющее просматривать и распечатывать информацию из архива регистрации транзакций в Клиринговой системе в удобном для восприятия членами технической комиссии виде;
   - документы, подтверждающие направление в установленном порядке уведомления о присвоении Клирингового идентификатора на соответствующем биржевом рынке уполномоченному представителю заявителю претензии;
   - в случае если Предложение / электронное сообщение подавалось с использованием Рабочего места Блумберг или Рабочего места Рейтер, протокол переговоров между Участником клиринга и Клиринговым центром по Системе Блумберг / Системе Рейтер.

5) Проведение технической экспертизы включает в себя выполнение следующих действий:

- изготовление (распечатку) на бумажном носителе копии Предложения / электронного сообщения, в отношении которого проводится техническая экспертиза;
- проверку наличия в изготовленной (распечатанной) на бумажном носителе копии Предложения / электронного сообщения информации о регистрации Предложения / электронного сообщения, в отношении которого проводится техническая экспертиза;
- проверку соответствия АСП в копии Предложения / электронного сообщения на бумажном носителе присвоенному Участнику клиринга / Участнику торгов / Клиринговому центру Клиринговому идентификатору на соответствующем биржевом рынке;
- в случае если Предложение / электронное сообщение подавалось с использованием Рабочего места Блумберг или Рабочего места Рейтер, проверку соответствия параметров Предложения / электронного сообщения, зарегистрированного в Клиринговой системе, параметрам информационного сообщения, содержащимся в протоколе переговоров между Участником клиринга и Клиринговым центром по Системе Блумберг / Системе Рейтер;
- фиксирование результатов проверки в протоколе работы технической комиссии.

6) В случае, если:

- Предложение / электронное сообщение, в отношении которого проводится техническая экспертиза, найдено в архиве регистрации транзакций в Клиринговой системе;
- Предложение / электронное сообщение, в отношении которого проводится техническая экспертиза, соответствует копии Предложения / электронного сообщения, изготовленной (распечатанной) на бумажном носителе;
- установлено соответствие АСП в копии Предложения / электронного сообщения на бумажном носителе присвоенному Участнику клиринга / Участнику торгов / Клиринговому центру Клиринговому идентификатору на соответствующем биржевом рынке;
- в случае если Предложение / электронное сообщение подавалось с использованием Рабочего места Блумберг или Рабочего места Рейтер и установлено соответствие параметров Предложения / электронного сообщения, зарегистрированного в Клиринговой системе, параметрам информационного сообщения, содержащимся в протоколе переговоров между Участником клиринга и Клиринговым центром по Системе Блумберг / Системе Рейтер;

считается установленным, что:

- Предложение / электронное сообщение, в отношении которого возникла конфликтная ситуация, было сформировано Участником клиринга / Участником торгов / Клиринговым центром;
- после подачи Предложения / электронного сообщения Участником клиринга / Участником торгов / Клиринговым центром с использованием Клиринговой системы не было изменено ни одного параметра данного Предложения / электронного сообщения.

7) Все действия, предпринимаемые технической комиссией для выяснения фактических обстоятельств, а также выводы, сделанные комиссией, заносятся в Протокол работы технической комиссии. Протокол работы технической комиссии должен содержать следующие данные:

- состав технической комиссии с указанием сведений о должности и месте работы каждого из членов технической комиссии;
- краткое изложение обстоятельств возникшей конфликтной ситуации;
- мероприятия, проводимые технической комиссией для установления причин и последствий возникшей конфликтной ситуации, с указанием даты, времени и места их проведения;
- выводы, к которым пришла техническая комиссия в результате проведенных мероприятий;
- подписи всех членов технической комиссии.

Протокол составляется на бумажном носителе в количестве экземпляров, равном количеству организаций, уполномоченные представители которых принимали участие в работе технической комиссии.

**Приложение № 4**
к общей части Правил клиринга

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

## I. Список документов, предоставляемых Резидентом

1) Анкета Участника клиринга (клиента) (Анкета юридического лица), являющаяся приложением к Порядку предоставления информации и отчетности и размещенная на Сайте Клирингового центра, в форме электронного документа и/или на бумажном носителе.

2) Копии учредительных документов юридического лица с изменениями и дополнениями с отметкой о регистрации федеральным органом исполнительной власти, уполномоченным на осуществление государственной регистрации юридических лиц. Указанные копии должны быть заверены федеральным органом исполнительной власти, уполномоченным на осуществление государственной регистрации юридических лиц, или нотариально.

3) В отношении Руководителя:

- нотариально удостоверенная копия или копия, заверенная подписью Руководителя и печатью юридического лица (при наличии), письма Банка России с подтверждением согласования кандидатуры Руководителя (для некредитных финансовых организаций);
- подлинник или нотариально удостоверенная копия или копия, заверенная подписью Руководителя и печатью юридического лица (при наличии), решения уполномоченного органа юридического лица (также могут быть предоставлены нотариально удостоверенная выписка из решения или подлинник выписки, заверенный подписью лица, уполномоченного на подписание решения, или заверенный подписью Руководителя и печатью юридического лица (при наличии)) об избрании (назначении) Руководителя;
- копия документа, удостоверяющего личность Руководителя, заверенная подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии) или письмо юридического лица в произвольной форме, содержащее следующие сведения о Руководителе: фамилия, имя, отчество (при наличии), гражданство, реквизиты документа, удостоверяющего личность, дату и место рождения, адресе места жительства (регистрации) или места пребывания, заверенное подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии) при одновременном предоставлении оригинала или копии документа, удостоверяющего личность Руководителя, заверенной подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии) для сверки предоставленных сведений.

4) Оригинал доверенности, или нотариально удостоверенная копия, или копия, заверенная лицом, выдавшим указанную доверенность на представителя юридического лица, уполномоченного осуществлять действия (операции) от имени юридического лица во взаимоотношениях с Клиринговым центром, включая полномочия по подписанию необходимых документов. В случае если доверенность

предоставляет полномочия на совершение операций с денежными средствами или иным имуществом, дополнительно предоставляются:

- копия документа, удостоверяющего личность представителя юридического лица, заверенная подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии) или письмо юридического лица в произвольной форме, содержащее следующие сведения о представителе: фамилия, имя, отчество (при наличии), гражданство, реквизиты документа, удостоверяющего личность, дату и место рождения, адресе места жительства (регистрации) или места пребывания, заверенное подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии) при одновременном предоставлении оригинала или копии документа, удостоверяющего личность Руководителя, заверенной подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии) для сверки предоставленных сведений.

5) Отзывы о деловой репутации юридического лица в соответствии с пунктом 10.7 общей части Правил клиринга.

6) Согласие лиц, указанных в документах юридического лица, направляемых им в Клиринговый центр в соответствии с Правилами клиринга, на обработку персональных данных по форме, размещенной на Сайте Клирингового центра (в случае, если документы содержат персональные данные субъекта персональных данных в соответствии с Федеральным законом «О персональных данных» и если иное не вытекает из требований законодательства).

7) В случае если физическое лицо, на которое требуется предоставить копию документа, удостоверяющего личность, является иностранным гражданином (лицом без гражданства), пребывающим в Российской Федерации, то дополнительно необходимо предоставить:

- заверенную подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии) копию документа, подтверждающего право иностранного гражданина (лица без гражданства) на пребывание (проживание) в Российской Федерации (вид на жительство, разрешение на временное проживание, виза, иной документ, подтверждающий в соответствии с законодательством Российской Федерации право иностранного гражданина или лица без гражданства на пребывание (проживание) в Российской Федерации);
- заверенную подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии) копию миграционной карты;
- письмо со сведениями об адресе места жительства (регистрации) или места пребывания (в случае если такая информация не содержится в иных документах, предоставленных в соответствии с настоящим списком).

8) Отчетность, указанная в пунктах 1), 3) – 8) приложения № 5 к общей части Правил клиринга, в форме электронного документа:

- Кредитные организации предоставляют месячные формы отчетности – за четыре последние отчетные даты, квартальные формы отчетности – на последнюю отчетную дату, отчеты по форме 0409051 «Список аффилированных лиц» и по форме 0409052 «Список аффилированных лиц, принадлежащих к группе лиц, к которой принадлежит кредитная организация», актуальные по состоянию на дату предоставления документов;

- Некредитные организации, указанные в пунктах 3) - 6) приложения № 5 к общей части Правил клиринга предоставляют годовые формы отчетности на последнюю отчетную дату, квартальные формы отчетности – за три последние отчетные даты, месячные формы отчетности – за четыре последние отчетные даты (по состоянию на 31 марта, 30 июня, 30 сентября, 31 декабря), по формам 0420402, 0420152, 0420251, содержащие сведения об акционерах (участниках) и аффилированных лицах, актуальные по состоянию на дату предоставления документов;
- Некредитные организации, указанные в пунктах 7), 8) приложения № 5 к общей части Правил клиринга предоставляют годовой бухгалтерский баланс и годовой отчет о финансовых результатах на последнюю отчетную дату, квартальные формы отчетности – за три последние отчетные даты, а также финансовую отчетность по МСФО (в т.ч. консолидированную) на русском или английском языке – по мере составления или публикации.

9) Анкета для целей выявления иностранных налогоплательщиков в форме электронного документа, а также иные прилагаемые к Анкете для целей выявления иностранных налогоплательщиков документы и сведения, предоставляемые для целей FATCA (с учетом положений, предусмотренных пунктом 10.9 общей части Правил клиринга).

10) 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.

## II. Список документов, предоставляемых государственной корпорацией

1) Анкета Участника клиринга (клиента) (Анкета юридического лица), являющаяся приложением к Порядку предоставления информации и отчетности и размещенная на Сайте Клирингового центра, в форме электронного документа и/или на бумажном носителе.

2) В отношении Руководителя:

- подлинник или нотариально удостоверенная копия решения уполномоченного органа государственной корпорации (также могут быть предоставлены нотариально удостоверенная выписка из решения или подлинник выписки, заверенный подписью лица, уполномоченного на подписание решения), предусмотренного федеральным законом, определяющим статус, цели деятельности, функции и полномочия данной государственной корпорации, о назначении Руководителя;
- копия документа, удостоверяющего личность Руководителя государственной корпорации, заверенная подписью уполномоченного лица и печатью государственной корпорации или письмо юридического лица в произвольной форме, содержащее следующие сведения о Руководителе: фамилия, имя, отчество (при наличии), гражданство, реквизиты документа,

удостоверяющего личность, дату и место рождения, адресе места жительства (регистрации) или места пребывания, заверенное подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии) при одновременном предоставлении оригинала или копии документа, удостоверяющего личность Руководителя, заверенной подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии) для сверки предоставленных сведений.

3) Оригинал доверенности, или нотариально удостоверенная копия, или копия, заверенная лицом, выдавшим указанную доверенность на представителя государственной корпорации, уполномоченного осуществлять действия (операции) от имени государственной корпорации во взаимоотношениях с Клиринговым центром, включая полномочия по подписанию необходимых документов. В случае если доверенность предоставляет полномочия на совершение операций с денежными средствами или иным имуществом, дополнительно предоставляются:

- копия документа, удостоверяющего личность представителя государственной корпорации, заверенная подписью уполномоченного лица и печатью государственной корпорации или письмо юридического лица в произвольной форме, содержащее следующие сведения о представителе: фамилия, имя, отчество (при наличии), гражданство, реквизиты документа, удостоверяющего личность, дату и место рождения, адресе места жительства (регистрации) или места пребывания, заверенное подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии) при одновременном предоставлении оригинала или копии документа, удостоверяющего личность Руководителя, заверенной подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии) для сверки предоставленных сведений.

4) Отзывы о деловой репутации государственной корпорации в соответствии с пунктом 10.7 общей части Правил клиринга.

5) Согласие лиц, указанных в документах государственной корпорации, направляемых в Клиринговый центр в соответствии с Правилами клиринга, на обработку персональных данных по форме, размещенной на Сайте Клирингового центра (в случае, если документы содержат персональные данные субъекта персональных данных в соответствии с Федеральным законом «О персональных данных» и если иное не вытекает из требований законодательства).

6) В случае если физическое лицо, на которое требуется предоставить копию документа, удостоверяющего личность, является иностранным гражданином (лицом без гражданства), пребывающим в Российской Федерации, то дополнительно необходимо предоставить:

- заверенную подписью уполномоченного лица и печатью государственной корпорации копию документа, подтверждающего право иностранного гражданина (лица без гражданства) на пребывание (проживание) в Российской Федерации (вид на жительство, разрешение на временное проживание, виза, иной документ, подтверждающий в соответствии с законодательством Российской Федерации право иностранного гражданина или лица без гражданства на пребывание (проживание) в Российской Федерации);
- заверенную подписью уполномоченного лица и печатью государственной корпорации копию миграционной карты;

- письмо со сведениями об адресе места жительства (регистрации) или места пребывания (если такая информация не содержится в иных документах, предоставленных в соответствии с настоящим списком).

7) Отчетность, указанная в пунктах 2), 7) и 8) приложения № 5 к общей части Правил клиринга, в форме электронного документа: месячные формы отчетности – за четыре последние отчетные даты, квартальные формы отчетности – за четыре последние отчетные даты, финансовая отчетность по МСФО (в т.ч. консолидированная) на русском или английском языке (при наличии), актуальная на дату предоставления документов.

8) Анкета для целей выявления иностранных налогоплательщиков в форме электронного документа, а также иные прилагаемые к Анкете для целей выявления иностранных налогоплательщиков документы и сведения, предоставляемые для целей FATCA (с учетом положений, предусмотренных пунктом 10.9 общей части Правил клиринга).

9) Иные документы, которые могут быть запрошены Клиринговым центром в необходимых случаях, также Клиринговый центр вправе потребовать уточнения информации, содержащейся в ранее предоставленных документах.

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

## III. Список документов, предоставляемых Международной организацией

1) Анкета Участника клиринга (клиента) (Анкета юридического лица), являющаяся приложением к Порядку предоставления информации и отчетности и размещенная на Сайте Клирингового центра, в форме электронного документа и/или на бумажном носителе.

2) Нотариально удостоверенная копия международного договора, включая учредительные документы (со всеми изменениями и дополнениями), или копия, удостоверенная уполномоченным лицом организации, осуществляющей хранение международных договоров в соответствии с законодательством Российской Федерации.

3) Копия свидетельства о постановке на учет в налоговом органе (при наличии), заверенная подписью уполномоченного лица и печатью Международной организации (при наличии).

4) В отношении лица, уполномоченного действовать от имени Международной организации в соответствии с международным договором и/или учредительными документами (далее – Руководитель):

- нотариально удостоверенная копия протокола или выписка из протокола заседания уполномоченного органа Международной организации, содержащая решение уполномоченного органа Международной организации об избрании (назначении) Руководителя;
- копия документа, удостоверяющего личность Руководителя, заверенная подписью уполномоченного лица и печатью Международной организации

(при наличии) или письмо юридического лица в произвольной форме, содержащее следующие сведения о Руководителе: фамилия, имя, отчество (при наличии), гражданство, реквизиты документа, удостоверяющего личность, дату и место рождения, адресе места жительства (регистрации) или места пребывания, заверенное подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии) при одновременном предоставлении оригинала или копии документа, удостоверяющего личность Руководителя, заверенной подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии) для сверки предоставленных сведений;

- копия свидетельства о постановке на учет в налоговом органе (ИНН) Руководителя, заверенная подписью уполномоченного лица и печатью Международной организации (при наличии), либо письмо в произвольной форме с указанием ИНН (при наличии).

5) Оригинал доверенности, или нотариально удостоверенная копия или копия, заверенная лицом, выдавшим указанную доверенность на представителя Международной организации, уполномоченного осуществлять действия (операции) от имени Международной организации во взаимоотношениях с Клиринговым центром, включая полномочия по подписанию необходимых документов. В случае если доверенность предоставляет полномочия на совершение операций с денежными средствами или иным имуществом, дополнительно предоставляются:

- копия документа, удостоверяющего личность представителя Международной организации, заверенная подписью уполномоченного лица и печатью Международной организации (при наличии) или письмо юридического лица в произвольной форме, содержащее следующие сведения о представителе: фамилия, имя, отчество (при наличии), гражданство, реквизиты документа, удостоверяющего личность, дату и место рождения, адресе места жительства (регистрации) или места пребывания, заверенное подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии) при одновременном предоставлении оригинала или копии документа, удостоверяющего личность Руководителя, заверенной подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии) для сверки предоставленных сведений;
- копия свидетельства о постановке на учет в налоговом органе (ИНН) представителя Международной организации, заверенная подписью уполномоченного лица и печатью Международной организации (при наличии), либо письмо в произвольной форме с указанием ИНН (при наличии).

6) Отзывы о деловой репутации Международной организации в соответствии с пунктом 10.7 общей части Правил клиринга.

7) Согласие лиц, указанных в документах Международной организации, направляемых в Клиринговый центр в соответствии с Правилами клиринга, на обработку персональных данных по форме, размещенной на Сайте Клирингового центра (в случае, если документы содержат персональные данные субъекта персональных данных в соответствии с Федеральным законом «О персональных данных» и если иное не вытекает из требований законодательства).

8) В случае если физическое лицо, на которое требуется предоставить копию документа, удостоверяющего личность, является иностранным гражданином (лицом без гражданства), пребывающим в Российской Федерации, то

дополнительно необходимо предоставить:

- заверенную подписью уполномоченного лица и печатью Международной организации (при наличии) копию документа, подтверждающего право иностранного гражданина (лица без гражданства) на пребывание (проживание) в Российской Федерации (вид на жительство, разрешение на временное проживание, виза, иной документ, подтверждающий в соответствии с законодательством Российской Федерации право иностранного гражданина или лица без гражданства на пребывание (проживание) в Российской Федерации);
- заверенную подписью уполномоченного лица и печатью Международной организации (при наличии) копию миграционной карты;
- письмо со сведениями об адресе места жительства (регистрации) или места пребывания (если такая информация не содержится в иных документах, предоставленных в соответствии с настоящим списком).

9) Отчетность, указанная в пункте 10) приложения № 5 к общей части Правил клиринга, в форме электронного документа: месячные формы отчетности – за четыре последние отчетные даты, квартальные формы отчетности – за четыре последние отчетные даты, финансовая отчетность по МСФО (в т.ч. консолидированная) на русском или английском языке (при наличии), актуальная на дату предоставления документов.

10) Анкета для целей выявления иностранных налогоплательщиков в форме электронного документа, а также иные прилагаемые к Анкете для целей выявления иностранных налогоплательщиков документы и сведения, предоставляемые для целей FATCA (с учетом положений, предусмотренных пунктом 10.9 общей части Правил клиринга).

11) Документы, предусмотренные международным договором, регулирующим создание международной организации, и (или) учредительными документами, необходимые для применения порядка налогообложения, предусмотренного таким международным договором и (или) учредительными документами (если применимо).

12) Документ, подтверждающий постоянное местонахождение юридического лица в государстве, с которым Российская Федерация имеет международный договор (соглашение), регулирующий вопросы налогообложения (если применимо/при наличии). Документ должен быть заверен компетентным органом соответствующего иностранного государства.

13) Подтверждение наличия права юридического лица на применение льгот по международному договору (соглашению), регулирующему вопросы налогообложения, в соответствии со статьями, регулирующими ограничение льгот (если применимо/при наличии).

14) Подтверждение наличия фактического права юридического лица на получение дохода (доходов), указанного(ых) в Правилах клиринга (если применимо/при наличии).

15) В случае если юридическое лицо не имеет фактического права на получение дохода (доходов), указанного(ых) в Правилах клиринга, юридическое лицо представляет подтверждение об отсутствии фактического права на получение

дохода (доходов), указанного(ых) в Правилах клиринга, и информацию о бенефициаре (бенефициарах) – лице (лицах), которое (которые) является (являются) фактическим (фактическими) получателем (получателями) дохода (если применимо/при наличии). В отношении каждого такого бенефициара юридическое лицо предоставляет документы, подписанные бенефициаром, подтверждающие право бенефициара на применение положений международного договора, регулирующего вопросы налогообложения (если применимо/при наличии), указанные выше в пунктах 12, 13 и 14.

16) Иные документы, которые могут быть запрошены Клиринговым центром в необходимых случаях, также Клиринговый центр вправе потребовать уточнения информации, содержащейся в ранее предоставленных документах.

Документы, указанные выше в пунктах 12 и 13, предоставляются ежегодно не позднее более ранней из дат: первой даты выплаты дохода (доходов), указанного (указанных) в Правилах клиринга (если применимо/при наличии), или не позднее 1 марта текущего года.

В случае изменения информации, содержащейся в подтверждениях, указанных выше в пунктах 14 и 15, которая может повлиять на применение положений международных договоров, регулирующих вопросы налогообложения, юридическое лицо незамедлительно письменно сообщает о таких изменениях Клиринговому центру.

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

## IV. Список документов, предоставляемых Нерезидентом

1) Анкета Участника клиринга (клиента) (Анкета юридического лица), являющаяся приложением к Порядку предоставления информации и отчетности и размещенная на Сайте Клирингового центра, в форме электронного документа и/или на бумажном носителе.

2) Опросная Анкета банка-нерезидента.

3) Письмо – подтверждение (в произвольной форме) об осуществлении юридическим лицом мер по противодействию легализации (отмыванию) доходов, полученных преступным путем, и финансированию терроризма, подписанное уполномоченным лицом юридического лица (для Некредитных организаций – Нерезидентов).

4) Действующие редакции учредительных документов юридического лица и все изменения к ним.

5) Документ, подтверждающий государственную регистрацию юридического лица.

6) Документ о постановке на учет в налоговом органе юридического лица (при наличии).

7) Специальное разрешение (лицензия), выданное уполномоченным органом государства учреждения юридического лица, на право осуществления деятельности, осуществление которой в соответствии с национальным законодательством государства юридического лица возможно при наличии соответствующего специального разрешения уполномоченного органа.

8) Документ, подтверждающий постановку юридического лица на налоговый учет в Российской Федерации (копия, верность которой засвидетельствована нотариусом или самим юридическим лицом) (при наличии).

9) В отношении лица, уполномоченного действовать от имени юридического лица в соответствии с учредительными документами (далее по тексту – Руководитель):

- документ, подтверждающий согласование кандидатуры Руководителя юридического лица уполномоченным органом государства учреждения юридического лица (если такое согласование предусмотрено законодательством государства учреждения юридического лица);
- документ уполномоченного органа юридического лица, подтверждающий избрание (назначение) Руководителя;
- копия документа, удостоверяющего личность Руководителя, или других документов, которые установлены федеральным законом или признаваемые в соответствии с международным договором Российской Федерации в качестве документа, удостоверяющего личность;
- копия свидетельства о постановке на учет в налоговом органе (ИНН) Руководителя, заверенная подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии), либо письмо в произвольной форме с указанием ИНН (при наличии).

10) Доверенности на представителей юридического лица, уполномоченных осуществлять действия (операции) от имени юридического лица во взаимоотношениях с Клиринговым центром, включая полномочия по подписанию необходимых документов. В случае если доверенность предоставляет полномочия на совершение операций с денежными средствами или иным имуществом, дополнительно предоставляются:

- заверенная подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии) копия документа, удостоверяющего личность представителя юридического лица, или других документов, которые установлены федеральным законом или признаваемые в соответствии с международным договором Российской Федерации в качестве документа, удостоверяющего личность;
- копия свидетельства о постановке на учет в налоговом органе (ИНН) представителя юридического лица, заверенная подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии), либо письмо в произвольной форме с указанием ИНН (при наличии).

11) Отзывы о деловой репутации юридического лица в соответствии с пунктом 10.7 общей части Правил клиринга.

12) Согласие лиц, указанных в документах юридического лица, направляемых им в Клиринговый центр в соответствии с Правилами клиринга, на обработку персональных данных по форме, размещенной на Сайте Клирингового центра (в случае, если документы содержат персональные данные субъекта персональных данных в соответствии с Федеральным законом «О персональных данных» и если иное не вытекает из требований законодательства).

13) В случае если физическое лицо, на которое требуется предоставить копию документа, удостоверяющего личность, является иностранным гражданином (лицом без гражданства), пребывающим в Российской Федерации, то дополнительно необходимо предоставить:

- заверенную подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии) копию документа, подтверждающего право иностранного гражданина (лица без гражданства) на пребывание (проживание) в Российской Федерации (вид на жительство, разрешение на временное проживание, виза, иной документ, подтверждающий в соответствии с законодательством Российской Федерации право иностранного гражданина или лица без гражданства на пребывание (проживание) в Российской Федерации);
- заверенную подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии) копию миграционной карты;
- письмо со сведениями об адресе места жительства (регистрации) или места пребывания (если такая информация не содержится в иных документах, предоставленных в соответствии с настоящим списком).

14) Отчетность, указанная в пункте 10) приложения № 5 к общей части Правил клиринга, в форме электронного документа: квартальные формы отчетности – за четыре последние отчетные даты, годовой бухгалтерский баланс и годовой отчет о финансовых результатах – на последнюю отчетную дату, финансовая отчетность по МСФО на русском или английском языке за последний отчетный год, заверенная аудитором, а при ее отсутствии аудированная финансовая отчетность, составленная в соответствии с требованиями национального законодательства государства учреждения.

15) Анкета для целей выявления иностранных налогоплательщиков в форме электронного документа, а также иные прилагаемые к Анкете для целей выявления иностранных налогоплательщиков документы и сведения, предоставляемые для целей FATCA.

16) Документ, подтверждающий постоянное местонахождение юридического лица в государстве, с которым Российская Федерация имеет международный договор (соглашение), регулирующий вопросы налогообложения (если применимо/при наличии). Документ должен быть заверен компетентным органом соответствующего иностранного государства.

Предоставление указанного документа не требуется в случае выплаты доходов по операциям с Банком-нерезидентом / Банком ЕврАзЭс/ЕАЭС, если факт постоянного местонахождения юридического лица в государстве, с которым у Российской Федерации имеется международный договор (соглашение), регулирующий вопросы налогообложения, подтверждается сведениями общедоступных информационных справочников.

17) Подтверждение наличия права юридического лица на применение льгот по международному договору (соглашению), регулирующему вопросы налогообложения, в соответствии со статьями, регулирующими ограничение льгот (если применимо/при наличии).

18) Подтверждение наличия фактического права юридического лица на получение дохода (доходов), указанного(ых) в Правилах клиринга (если применимо/при наличии).

19) В случае если юридическое лицо не имеет фактического права на получение дохода (доходов), указанного(ых) в Правилах клиринга, юридическое лицо представляет подтверждение об отсутствии фактического права на получение дохода (доходов), указанного(ых) в Правилах клиринга, и информацию о бенефициаре (бенефициарах)– лице(лицах), которое(которые) является(являются) фактическим (фактическими) получателем (получателями) (если применимо/при наличии). В отношении каждого такого бенефициара юридическое лицо предоставляет документы, подписанные бенефициаром, подтверждающие право бенефициара на применение положений международного договора, регулирующего вопросы налогообложения (если применимо/при наличии), указанные выше в пунктах 16, 17 и 18.

20) Иные документы, которые могут быть запрошены Клиринговым центром в необходимых случаях, также Клиринговый центр вправе потребовать уточнения информации, содержащейся в ранее предоставленных документах.

Документы, указанные выше в пунктах 16 и 17, предоставляются ежегодно не позднее более ранней из дат: первой даты выплаты дохода (доходов), указанного (указанных) в Правилах клиринга (если применимо/при наличии), или не позднее 1 марта текущего года.

В случае изменения информации, содержащейся в подтверждениях, указанных выше в пунктах 18 и 19, которая может повлиять на применение положений международных договоров, регулирующих вопросы налогообложения, юридическое лицо незамедлительно письменно сообщает о таких изменениях Клиринговому центру.

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.

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

## Отчетность, представляемая Участниками клиринга Клиринговому центру

1) Кредитные организации представляют Клиринговому центру:
   - отчет о финансовых результатах кредитной организации (форма 0409102), список аффилированных лиц (форма 0409051)[1], список аффилированных лиц, принадлежащих к группе лиц, к которой принадлежит кредитная организация (форма 0409052)[2] – ежеквартально;
   - оборотную ведомость по счетам бухгалтерского учета кредитной организации (форма 0409101), информацию об обязательных нормативах и о других показателях деятельности кредитной организации (форма 0409135), расчет собственных средств (капитала) («Базель III») (форма 0409123), справку о численном значении норматива максимального размера риска на одного заемщика или группу связанных заемщиков (Н6) (по данным формы 0409118), справку о численном значении норматива максимального размера риска на связанное с банком лицо или группу связанных с банком лиц (Н25) (по данным формы 0409118) – ежемесячно;
   - информацию об уровне концентрации обязательств и их составе – по запросу.

2) Государственные корпорации и Международные организации, осуществляющие ведение бухгалтерского учета в соответствии с российскими стандартами бухгалтерского учета и отчетности, установленными для кредитных организаций, представляют Клиринговому центру:
   - отчет о финансовых результатах (форма 0409102) – ежеквартально;
   - оборотную ведомость по счетам бухгалтерского учета (форма 0409101), расчет собственных средств (капитала) («Базель III») (форма 0409123) – ежемесячно.

3) Некредитные организации, являющиеся профессиональными участниками рынка ценных бумаг, представляют Клиринговому центру:
   - бухгалтерский баланс некредитной финансовой организации (форма 0420002), отчет о финансовом результате некредитной финансовой организации (форма 0420003), отчет о потоках денежных средств некредитной финансовой организации (форма 0420005) – ежегодно и ежеквартально;
   - оборотную ведомость по счетам бухгалтерского учета (форма 0420410) – за март, июнь, сентябрь, декабрь отчетного года;
   - сведения об аффилированных лицах и структуре собственности

[1] На дату представления отчета сведения, содержащиеся в нем, должны соответствовать последней актуальной информации об аффилированных лицах, представленной в Банк России.

[2] На дату представления отчета сведения, содержащиеся в нем, должны соответствовать последней актуальной информации об аффилированных лицах, представленной в Банк России.

профессионального участника (форма 0420402), сведения о дебиторской и кредиторской задолженности профессионального участника (форма 0420412), расчет собственных средств (форма 0420413), сведения о займах и кредитах (форма 0420414), отчет профессионального участника по ценным бумагам (форма 0420415), расчет показателя краткосрочной ликвидности брокера (форма 0420454) – по состоянию на 31 марта, 30 июня, 30 сентября, 31 декабря отчетного года.

4) Некредитные организации, являющиеся страховыми организациями и обществами взаимного страхования, представляют Клиринговому центру:

- отчет об акционерах (участниках) и список аффилированных лиц (форма 0420152)[3] – ежегодно;
- бухгалтерский баланс страховой организации (форма 0420125), отчет о финансовых результатах страховой организации (форма 0420126), отчет о потоках денежных средств страховой организации (форма 0420128), бухгалтерский баланс общества взаимного страхования (форма 0420140), отчет о финансовых результатах общества взаимного страхования (форма 0420142), отчет о потоках денежных средств общества взаимного страхования (форма 0420144), отчет о страховых резервах (форма 0420155), отчет о платежеспособности (форма 0420156)[4], сведения о деятельности страховщика (форма 0420162) – ежегодно и ежеквартально;
- сведения о привлеченных средствах (форма 0420160), отчет о выданных поручительствах, независимых гарантиях и других обеспечениях исполнения обязательств (форма 0420161) – ежеквартально;
- отчет о составе и структуре активов (форма 0420154), оборотную ведомость по счетам бухгалтерского учета страховщика (форма 0420164) – за март, июнь, сентябрь, декабрь отчетного года.

5) Некредитные организации, являющиеся негосударственными пенсионными фондами, представляют Клиринговому центру:

- акционерными обществами - бухгалтерский баланс негосударственного пенсионного фонда (форма 0420201), отчет о финансовых результатах негосударственного пенсионного фонда (форма 0420202), отчет о потоках денежных средств негосударственного пенсионного фонда (форма 0420204), отчет о деятельности по обязательному пенсионному страхованию (форма 0420255); некоммерческими организациями - бухгалтерский баланс негосударственного пенсионного фонда (форма 0420205), отчет о финансовых результатах негосударственного пенсионного фонда (форма 0420207), отчет о потоках денежных средств негосударственного пенсионного фонда (форма 0420209); акционерными обществами и некоммерческими организациями - отчет об акционерах и иных аффилированных лицах негосударственного пенсионного фонда (форма 0420251), общие сведения о деятельности негосударственного пенсионного

[3] Не представляется обществами взаимного страхования.
[4] Не представляется обществами взаимного страхования.

фонда (форма 0420252), отчет о деятельности по негосударственному пенсионному обеспечению (форма 0420254) – ежегодно и ежеквартально;

- отчет о составе портфеля собственных средств (имущества, предназначенного для осуществления уставной деятельности (форма 0420256), оборотную ведомость по счетам бухгалтерского учета негосударственного пенсионного фонда (форма 0420260) – за март, июнь, сентябрь, декабрь отчетного года.

6) Некредитные организации, являющиеся акционерными инвестиционными фондами, управляющими компаниями инвестиционного фонда, паевого инвестиционного фонда и негосударственного пенсионного фонда, представляют Клиринговому центру:

- бухгалтерский баланс некредитной финансовой организации (форма 0420002), отчет о финансовом результате некредитной финансовой организации (форма 0420003), отчет о потоках денежных средств некредитной финансовой организации (форма 0420005) – ежегодно и ежеквартально;
- оборотную ведомость по счетам бухгалтерского учета акционерного инвестиционного фонда, управляющей компании (форма 0420521) – за март, июнь, сентябрь, декабрь отчетного года;
- общие сведения об управляющей компании (форма 0420501), справку о стоимости чистых активов, в том числе стоимости активов (имущества), акционерного инвестиционного фонда (паевого инвестиционного фонда), подтвержденную специализированным депозитарием (форма 0420502), расчет собственных средств управляющей компании инвестиционных фондов, паевых инвестиционных фондов и негосударственных пенсионных фондов (форма 0420514) – по состоянию на 31 марта, 30 июня, 30 сентября, 31 декабря отчетного года.

7) Некредитные организации, не перечисленные в пунктах 3) – 6) настоящего приложения, а также Государственные корпорации и Международные организации, осуществляющие ведение бухгалтерского учета и отчетности по российским стандартам, но не указанные в пункте 2) настоящего приложения, являющиеся Участниками клиринга категории «В», представляют Клиринговому центру:

- бухгалтерский баланс (форма 0710001), отчет о финансовых результатах (форма 0710002), отчет о движении денежных средств (форма 0710004) – ежегодно;
- бухгалтерский баланс, отчет о финансовых результатах, отчет о движении денежных средств по формам, составляемым Участниками клиринга – ежеквартально;
- финансовую отчетность по МСФО (в т.ч. консолидированную) на русском или английском языке (при наличии).

8) Некредитные организации, не перечисленные в пунктах 3) – 6) настоящего приложения, а также Государственные корпорации и Международные организации, осуществляющие ведение бухгалтерского учета и отчетности по российским стандартам, но не указанные в пункте 2) настоящего приложения, являющиеся Участниками клиринга категорий «Б» и «О», представляют Клиринговому центру:

- бухгалтерский баланс (форма 0710001), отчет о финансовых результатах (форма 0710002), отчет о движении денежных средств (форма 0710004) – ежегодно;
- бухгалтерский баланс, отчет о финансовых результатах, отчет о движении денежных средств по формам, составляемым Участниками клиринга – ежеквартально;
- отчет эмитента (при наличии) – ежеквартально (в случае направления в адрес Участника клиринга соответствующего запроса);
- финансовую отчетность по МСФО (в т.ч. консолидированную) на русском или английском языке (при наличии).

9) Участники клиринга обязаны представлять отчетность, указанную в пунктах 1) – 6) настоящего приложения к общей части Правилам клиринга, в следующие сроки:

Кредитные организации:

- расчет собственных средств (капитала) («Базель III») (форма 0409123), оборотную ведомость по счетам бухгалтерского учета (форма 0409101), информацию об обязательных нормативах и о других показателях деятельности кредитной организации (форма 0409135) - не позднее 15 рабочего дня месяца, следующего за отчетным месяцем;
- справку о численном значении норматива максимального размера риска на одного заемщика или группу связанных заемщиков (Н6) кредитной организации и справку о численном значении норматива максимального размера риска на связанное с банком лицо или группу связанных с банком лиц (Н25) (по данным формы 0409118) – не позднее 15 рабочего дня месяца, следующего за отчетным месяцем, при этом по состоянию на 1 апреля, 1 июля и 1 октября – не позднее 10 рабочего дня второго месяца квартала, следующего за отчетным месяцем, а по состоянию на 1 января – не позднее двух месяцев года, следующего за отчетным месяцем;
- отчет о финансовых результатах (форма 0409102), список аффилированных лиц (форма 0409051), список аффилированных лиц, принадлежащих к группе лиц, к которой принадлежит кредитная организация (форма 0409052) – не позднее 15 рабочего дня месяца, следующего за отчетным кварталом;
- информацию об уровне концентрации обязательств и их составе – по запросу.

Государственные корпорации и Международные организации, указанные в пункте 2) настоящего приложения:

- оборотную ведомость по счетам бухгалтерского учета (форма 0409101), расчет собственных средств (капитала) («Базель III») (форма 0409123) – не позднее 15 рабочего дня месяца, следующего за отчетным месяцем;
- отчет о финансовых результатах (форма 0409102) - не позднее 15 рабочего дня месяца, следующего за отчетным кварталом.

Некредитные организации, являющиеся профессиональными участниками рынка ценных бумаг:

- бухгалтерский баланс некредитной финансовой организации (форма 0420002), отчет о финансовых результатах некредитной финансовой организации (форма 0420003), отчет о потоках денежных средств некредитной финансовой организации (форма 0420005) за первый квартал,

первое полугодие, девять месяцев отчетного года; оборотную ведомость по счетам бухгалтерского учета (форма 0420410) за март, июнь, сентябрь отчетного года; сведения об аффилированных лицах и структуре собственности профессионального участника (форма 0420402), сведения о дебиторской и кредиторской задолженности профессионального участника (форма 0420412), расчет размера собственных средств (форма 0420413), сведения о займах и кредитах (форма 0420414), отчет профессионального участника по ценным бумагам (форма 0420415), расчет показателя краткосрочной ликвидности брокера (форма 0420454) по состоянию на 31 марта, 30 июня, 30 сентября отчетного года – не позднее одного календарного месяца, следующего за отчетным периодом/датой;

- бухгалтерский баланс некредитной финансовой организации (форма 0420002), отчет о финансовых результатах некредитной финансовой организации (форма 0420003), отчет о потоках денежных средств некредитной финансовой организации (форма 0420005) за отчетный год; оборотную ведомость по счетам бухгалтерского учета (форма 0420410) за декабрь отчетного года; сведения об аффилированных лицах и структуре собственности профессионального участника (форма 0420402), сведения о дебиторской и кредиторской задолженности профессионального участника (форма 0420412), расчет размера собственных средств (форма 0420413), сведения о займах и кредитах (форма 0420414), отчет профессионального участника по ценным бумагам (форма 0420415), расчет показателя краткосрочной ликвидности брокера (форма 0420454) по состоянию на 31 декабря отчетного года – не позднее 15 февраля, следующего за отчетным периодом/датой.

Некредитные организации, являющиеся страховыми организациями и обществами взаимного страхования:

- бухгалтерский баланс страховой организации (форма 0420125), отчет о финансовых результатах страховой организации (форма 0420126), отчет о потоках денежных средств страховой организации (форма 0420128), бухгалтерский баланс общества взаимного страхования (форма 0420140), отчет о финансовых результатах общества взаимного страхования (форма 0420142), отчет о потоках денежных средств общества взаимного страхования (форма 0420144), отчет о страховых резервах (форма 0420155), отчет о платежеспособности (форма 0420156)[5], сведения о деятельности страховщика (форма 0420162) - за первый квартал, первое полугодие, девять месяцев отчетного года; сведения о привлеченных средствах (форма 0420160), отчет о выданных поручительствах, независимых гарантиях и других обеспечениях исполнения обязательств (форма 0420161) за первый, второй и третий кварталы отчетного года; отчет о составе и структуре активов (форма 0420154), оборотную ведомость по счетам бухгалтерского учета страховщика (форма 0420164) за март, июнь, сентябрь отчетного года – не позднее одного календарного месяца, следующего за отчетным периодом;

[5] Не представляется обществами взаимного страхования.

- бухгалтерский баланс страховой организации (форма 0420125), отчет о финансовых результатах страховой организации (форма 0420126), отчет о потоках денежных средств страховой организации (форма 0420128), бухгалтерский баланс общества взаимного страхования (форма 0420140), отчет о финансовых результатах общества взаимного страхования (форма 0420142), отчет о потоках денежных средств общества взаимного страхования (форма 0420144), отчет об акционерах (участниках) и список аффилированных лиц (форма 0420152)[6], отчет о страховых резервах (форма 0420155), отчет о платежеспособности (форма 0420156)[7], сведения о деятельности страховщика (форма 0420162) за отчетный год; сведения о привлеченных средствах (форма 0420160), отчет о выданных поручительствах, независимых гарантиях и других обеспечениях исполнения обязательств (форма 0420161) за 4 квартал отчетного года; отчет о составе и структуре активов (форма 0420154), оборотную ведомость по счетам бухгалтерского учета страховщика (форма 0420164) за декабрь отчетного года - не позднее 01 марта, следующего за отчетным периодом.

Некредитные организации, являющиеся негосударственными пенсионными фондами:

- бухгалтерский баланс негосударственного пенсионного фонда (форма 0420201), отчет о финансовых результатах негосударственного пенсионного фонда (форма 0420202), отчет о потоках денежных средств негосударственного пенсионного фонда (форма 0420204), бухгалтерский баланс негосударственного пенсионного фонда (форма 0420205), отчет о финансовых результатах негосударственного пенсионного фонда (форма 0420207), отчет о потоках денежных средств негосударственного пенсионного фонда (форма 0420209), отчет об акционерах и иных аффилированных лицах негосударственного пенсионного фонда (форма 0420251), общие сведения о деятельности негосударственного пенсионного фонда (форма 0420252), отчет о деятельности по негосударственному пенсионному обеспечению (форма 0420254), отчет о деятельности по обязательному пенсионному страхованию (форма 0420255)[8] за первый квартал, первое полугодие, девять месяцев отчетного года; отчет о составе портфеля собственных средств (имущества, предназначенного для осуществления уставной деятельности (форма 0420256), оборотную ведомость по счетам бухгалтерского учета негосударственного пенсионного фонда (форма 0420260) за март, июнь, сентябрь отчетного года – не позднее одного календарного месяца, следующего за отчетным периодом;
- бухгалтерский баланс негосударственного пенсионного фонда (форма 0420201), отчет о финансовых результатах негосударственного пенсионного фонда (форма 0420202), отчет о потоках денежных средств негосударственного пенсионного фонда (форма 0420204), бухгалтерский баланс негосударственного пенсионного фонда (форма 0420205), отчет о

[6] Не представляется обществами взаимного страхования.
[7] Не представляется обществами взаимного страхования.
[8] Не представляется некоммерческими организациями.

финансовых результатах негосударственного пенсионного фонда (форма 0420207), отчет о потоках денежных средств негосударственного пенсионного фонда (форма 0420209), отчет об акционерах и иных аффилированных лицах негосударственного пенсионного фонда (форма 0420251), общие сведения о деятельности негосударственного пенсионного фонда (форма 0420252), отчет о деятельности по негосударственному пенсионному обеспечению (форма 0420254), отчет о деятельности по обязательному пенсионному страхованию (форма 0420255)[9] за отчетный год; отчет о составе портфеля собственных средств (имущества, предназначенного для осуществления уставной деятельности (форма 0420256), оборотную ведомость по счетам бухгалтерского учета негосударственного пенсионного фонда (форма 0420260) за декабрь отчетного года – не позднее 31 марта, следующего за отчетным периодом.

Некредитные организации, являющиеся акционерными инвестиционными фондами, управляющими компаниями инвестиционного фонда, паевого инвестиционного фонда и негосударственного пенсионного фонда:

- бухгалтерский баланс некредитной финансовой организации (форма 0420002), отчет о финансовых результатах некредитной финансовой организации (форма 0420003), отчет о потоках денежных средств некредитной финансовой организации (форма 0420005) за первый квартал, первое полугодие, девять месяцев, отчетный год; общие сведения об управляющей компании (форма 0420501); справку о стоимости чистых активов, в том числе стоимости активов (имущества), акционерного инвестиционного фонда (паевого инвестиционного фонда), подтвержденную специализированным депозитарием (форма 0420502), расчет собственных средств управляющей компании инвестиционных фондов, паевых инвестиционных фондов и негосударственных пенсионных фондов (форма 0420514), оборотную ведомость по счетам бухгалтерского учета акционерного инвестиционного фонда, управляющей компании (форма 0420521) за март, июнь, сентябрь, декабрь отчетного года - не позднее одного календарного месяца, следующего за отчетным периодом.

Некредитные организации, Государственные корпорации и Международные организации, указанные в пунктах 7) и 8) настоящего приложения:

- ежеквартальный бухгалтерский баланс некредитной организации (форма 0710001), ежеквартальный отчет о финансовых результатах некредитной организации (форма 0710002), ежеквартальный отчет о движении денежных средств (форма 0710004) – не позднее одного календарного месяца, следующего за отчетным кварталом;
- годовой бухгалтерский баланс некредитной организации (форма 0710001), годовой отчет о финансовых результатах некредитной организации (форма 0710002), годовой отчет о движении денежных средств (форма 0710004) – не позднее 15 апреля года, следующего за отчетным годом;

[9] Не представляется некоммерческими организациями.

- финансовую отчетность по МСФО (в т.ч. консолидированную) на русском или английском языке – по мере составления или публикации.

10) Банки-нерезиденты, Некредитные организации-нерезиденты, Банки ЕврАзЭс/ЕАЭС, а также Международные организации, не осуществляющие ведение бухгалтерского учета и составление отчетности по российским стандартам (далее – Нерезиденты), не позднее 15 (пятнадцати) рабочих дней с даты сдачи квартальной отчетности соответственно или с даты, определенной компетентным органом государства учреждения Нерезидента для сдачи квартальной отчетности соответственно (в случае если сроки сдачи отчетности устанавливаются компетентным органом государства учреждения Нерезидента), представляют Клиринговому центру следующие документы, составленные на русском или английском языке:

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

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

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

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

12) Документы, указанные в пункте 10) настоящего приложения к общей части Правилам клиринга, должны быть апостилированы или легализованы в установленном порядке, переведены на русский язык. Верность перевода или подлинность подписи переводчика должна быть засвидетельствована нотариусом.

**Приложение № 6**
к общей части Правил клиринга

# Временной регламент

| № п/п | Наименование операции | Время (московское) |
|---|---|---|
| **1.** | **Время (сроки) проведения клиринговых операций в Клиринговой системе фондового рынка и рынка депозитов** | |
| 1.1. | Получение от Расчетного депозитария выписки по Разделам / субсчетам депо. | до 9:30 |
| 1.2. | Проведение клиринговой сессии mark-to-market. | до 10:00 Расчетного дня |
| 1.3. | Проведение первой расчетной клиринговой сессии. | с 17:30 до 18:00 |
| 1.4. | Проведение второй расчетной клиринговой сессии. | с 19:00 до 20:00 |
| 1.5. | Проведение третьей расчетной клиринговой сессии. | с 20:00 до 20:45 |
| 1.6. | Передача Участником клиринга в Клиринговый центр Запроса на проведение ранних расчетов и Запросов на ранее завершение заключения сделок с Клиринговым центром. | с 9:00 до 18:00 |
| **2.** | **Время (сроки) внесения и возврата Обеспечения** | |
| 2.1. | Зачисление денежных средств на клиринговый банковский или корреспондентский счет Клирингового центра для учета в текущем Расчетном дне. | до 23:50 |
| 2.2. | Передача Участником клиринга Клиринговому центру распоряжений на перевод денежных средств с целью внесения / возврата Обеспечения / взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс (с использованием Клиринговой системы фондового рынка и рынка депозитов). | с 09:30 до 20:00 Расчетного дня |
| 2.3. | Передача Участником клиринга Клиринговому центру распоряжений на перевод ценных бумаг с целью внесения / возврата Обеспечения / взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс (с использованием Клиринговой системы фондового рынка и рынка депозитов). | с 09:30 до 20:30 Расчетного дня |
| 2.4. | Прием Клиринговым центром от Участников клиринга Запросов на перевод Обеспечения в иностранной валюте, российских рублях, драгоценных металлах. | с 09:30 до 20:00 Расчетного дня |
| 2.5. | Прием Клиринговым центром от Участников клиринга Запросов на возврат обеспечения в целях возврата денежных средств из Обеспечения / Гарантийных фондов / Обеспечения под стресс и Запросов на депонирование, а также прием Клиринговым центром от НКО АО НРД Запросов на получение денежных средств: | в указанное время Расчетного дня по соответствующей валюте |
| | - гонконгских долларов; | до 11:00 Расчетного дня |
| | - юаней, белорусских рублей, тенге, сомони; | до 12:00 Расчетного дня |
| | - турецких лир; | до 13:30 Расчетного дня |
| | - швейцарских франков; | до 14:00 Расчетного дня |
| | - евро, фунтов стерлингов с клиринговых счетов в НКО АО НРД; | до 16:25 Расчетного дня |
| | - евро, фунтах стерлингов с клиринговых / корреспондентских счетов в Расчетных организациях / Расчетных банках (кроме НКО | до 17:00 Расчетного дня |

| | | |
|---|---|---|
| | АО НРД); | |
| | - российских рублей; | до 19:30 Расчетного дня |
| | - долларов США, драгоценных металлов; | до 20:00 Расчетного дня |
| | - иен с зачислением на счет получателя не позднее Расчетного дня, следующего за датой получения запроса. | до 20:00 Расчетного дня |
| 2.6. | Исполнение Постоянных поручений на возврат обеспечения содержащих признак, указывающий на необходимость возврата всей доступной суммы денежных средств / всего доступного количества драгоценного металла, для внешних платежей[1] в: | |
| | - гонконгских долларах; | 12:45 |
| | - белорусских рублях, тенге, сомони; | 13:00 |
| | - швейцарских франках, турецких лирах; | 14:00 |
| | - юанях; | 14:30 |
| | - евро, фунтах стерлингов с клиринговых счетов в НКО АО НРД; | 16:20 |
| | - евро, фунтах стерлингов с клиринговых / корреспондентских счетов в Расчетных организациях / Расчетных банках (кроме НКО АО НРД); | 17:35[2] / 18:35 |
| | - российских рублях; | 19:45 |
| | - долларах США, драгоценных металлов; | 20:00 |
| | - иенах с зачислением на счет получателя не позднее Расчетного дня, следующего за датой получения запроса. | 20:00 |
| 2.7. | Исполнение Постоянных поручений на возврат обеспечения содержащих признак, указывающий на необходимость возврата всей доступной суммы денежных средств / всего доступного количества драгоценного металла, для внутренних платежей[1] в: | |
| | - гонконгских долларах; | 12:45 |
| | - белорусских рублях, тенге, сомони; | 13:00 |
| | - швейцарских франках; | 14:00 |
| | - юанях; | 14:30 |
| | - турецких лирах; | 15:00 |
| | - евро, фунтах стерлингов; | 18:50[2] / 19:50 |
| | - долларах США, российских рублях, драгоценных металлов; | 20:00 |
| | - иенах с зачислением на счет получателя не позднее Расчетного дня, следующего за датой получения запроса. | 20:00 |
| 2.8. | Возврат Клиринговым центром Участникам клиринга денежных средств, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга, на основании Запроса на возврат обеспечения / Постоянного поручения на возврат обеспечения[3]. | В являющийся Расчетным днем день получения Запроса на возврат обеспечения / в Расчетный день |
| **3.** | **Сроки определения подлежащих исполнению обязательств по денежным средствам / драгоценным металлам по Расчетным кодам Единого пула, Расчетным кодам, открытым для фондового рынка и рынка депозитов, Расчетным кодам, открытым для валютного рынка и рынка драгоценных металлов** | |
| 3.1. | Определение Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований по денежным средствам / драгоценным металлам: | |
| | - Участников клиринга, у которых Итоговое нетто-обязательство, для исполнения которого недостаточно денежных средств / драгоценных металлов, и/или отрицательный Единый лимит по Расчетному коду, входящий в состав Торгово-клирингового счета | 10:00 Даты исполнения |

| | | |
|---|---|---|
| | Т+, по которому учитывается Итоговое нетто-требование в ценных бумагах, не принимаемых в качестве обеспечения исполнения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением, возникали 2 Расчетных дня подряд, в третий Расчетный день; | |
| 3.2. | Определение Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований по денежным средствам / драгоценным металлам (указанное Итоговое нетто-требование используется для исполнения Постоянного поручения на возврат обеспечения содержащих признак, указывающий на необходимость возврата денежных средств / драгоценного металла в размере Итогового нетто-требования): | |
| | - в гонконгских долларах, сомони; | 11:00 Даты исполнения |
| | - в юанях, белорусских рублях, тенге, швейцарских франках, турецких лирах; | 12:00 Даты исполнения |
| | - в евро, фунтах стерлингов, долларах США, российских рублях, иенах, драгоценных металлах для Участников клиринга, предоставивших Запрос на проведение ранних расчетов без указания времени до 11:00 или Запрос на проведение ранних расчетов / Постоянное поручение на проведение ранних расчетов с указанием времени 11:00; | 11:00 Даты исполнения |
| | - в евро, фунтах стерлингов, долларах США, российских рублях, иенах, драгоценных металлах для Участников клиринга, предоставивших Запрос на проведение ранних расчетов без указания времени с 11:00 до 14:00; | в течение 15 минут после получения Клиринговым центром Запроса на проведение ранних расчетов |
| | - в евро, фунтах стерлингов, долларах США, российских рублях, иенах, драгоценных металлах для Участников клиринга, предоставивших Запрос на проведение ранних расчетов / Постоянное поручение на проведение ранних расчетов с указанием времени 12:00; | 12:00 Даты исполнения |
| | - в евро, фунтах стерлингов, для Участников клиринга, не предоставивших Запрос на проведение ранних расчетов или Постоянное поручение на проведение ранних расчетов; | 15:15 Даты исполнения |
| | - в долларах США, российских рублях, иенах, драгоценных металлах для Участников клиринга, предоставивших Запрос на проведение ранних расчетов без указания времени с 14:00 до 15:15 или Запрос на проведение ранних расчетов / Постоянное поручение на проведение ранних расчетов с указанием времени 15:15; | 15:15 Даты исполнения |
| | - в долларах США, российских рублях, иенах, драгоценных металлах для Участников клиринга, предоставивших Запрос на проведение ранних расчетов без указания времени с 15:15 до 17:30; | в течение 15 минут после получения Клиринговым центром Запроса на проведение ранних расчетов |
| | - в долларах США, российских рублях, иенах, драгоценных металлах для Участников клиринга, предоставивших Запрос на проведение ранних расчетов с 17:30 до 18:00 без указания времени или Запрос на проведение ранних расчетов / Постоянное поручение на проведение ранних расчетов с указанием времени 18:00. | 18:00 Даты исполнения |
| 3.3. | Определение Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований по денежным средствам / драгоценным металлам: | |
| | - в долларах США, российских рублях, иенах, драгоценных металлах для Участников клиринга, не предоставивших Запрос на | 19:20 Даты исполнения |

| | | |
|---|---|---|
| | проведение ранних расчетов или Постоянное поручение на проведение ранних расчетов, по сделкам, заключенным до 19:00 Даты исполнения;<br>- в российских рублях по сделкам РЕПО / сделкам купли-продажи ценных бумаг, заключенным в соответствии с пунктом 5.7 Временного регламента; | |
| | - в гонконгских долларах, сомони по сделкам, заключенным с 11:00 до 19:00 Даты исполнения;<br>- в юанях, белорусских рублях, тенге, швейцарских франках, турецких лирах по сделкам, заключенным с 12:00 до 19:00 Даты исполнения;<br>- в евро, фунтах стерлингов по сделкам, заключенным с 15:15 до 19:00 Даты исполнения. | 19:20 Даты исполнения |
| **4.** | **Сроки определения подлежащих исполнению обязательств по ценным бумагам по Торгово-клиринговым счетам Единого пула, Торгово-клиринговым счетам, открытым для фондового рынка и рынка депозитов** | |
| 4.1. | Определение Итоговых нетто-обязательств по ценным бумагам в отношении Участников клиринга, у которых Итоговое нетто-обязательство по ценной бумаге, для исполнения которого недостаточно ценных бумаг, возникало 4 Расчетных дня подряд, в пятый Расчетный день. | 10:00 Даты исполнения |
| 4.2. | Определение Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований по ценным бумагам по сделкам, заключенным до 16:00 Даты исполнения. | 16:00 Даты исполнения |
| 4.3. | Направление Клиринговым центром Расчетному депозитарию Запроса на подбор ценных бумаг. | С 16:30 до 16:45 |
| 4.4. | Определение предварительных Итоговых нетто-обязательств по ценным бумагам по сделкам, заключенным с 16:00 до 18:30 Даты исполнения. | 18:30 Даты исполнения |
| 4.5. | Направление Клиринговым центром Расчетному депозитарию Запроса на подбор ценных бумаг. | С 18:30 до 19:00 |
| 4.6. | Определение Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований по ценным бумагам по сделкам, заключенным с 16:00 до 19:00 Даты исполнения. | 19:00 Даты исполнения |
| **5.** | **Сроки исполнения обязательств** | |
| 5.1. | Исполнение Итоговых нетто-обязательств по / денежным средствам / драгоценным металлам Участниками клиринга, у которых Итоговое нетто-обязательство, для исполнения которого недостаточно денежных средств / драгоценных металлов, и/или отрицательный Единый лимит по Расчетному коду, входящий в состав Торгово-клирингового счета Т+, по которому учитывается Итоговое нетто-требование в ценных бумагах, не принимаемых в качестве обеспечения исполнения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением, или Задолженность возникало 2 (два) Расчетных дня подряд, в третий Расчетный день.<br>Исполнение Итоговых нетто-обязательств по ценным бумагам Участниками клиринга, у которых Итоговое нетто-обязательство, для исполнения которого недостаточно ценных бумаг, возникало 4 (четыре) Расчетных дня подряд, в пятый Расчетный день.<br>Исполнение Итоговых нетто-обязательств по ценным бумагам с источником дохода в США (с даты, предшествующей дате начала периода составления списка лиц, имеющих право на получение | 10:00 Даты исполнения |

| | | |
|---|---|---|
| | дохода, включая эту дату, до даты окончания периода составления списка лиц, имеющих право на получение дохода, включая эту дату, по информации, полученной от Расчетного депозитария). | |
| 5.2. | Исполнение Участниками клиринга Итоговых нетто-обязательств по ценным бумагам по сделкам, заключенным до 16:00 Даты исполнения. | 17:00 Даты исполнения |
| 5.3. | Исполнение Участниками клиринга Итоговых нетто-обязательств по ценным бумагам по сделкам, заключенным с 16:00 до 19:00 Даты исполнения. | 19:00 Даты исполнения |
| 5.4. | Исполнение Участниками клиринга Итоговых нетто-обязательств по денежным средствам / драгоценным металлам: | |
| | - в гонконгских долларах, сомони, определенных по сделкам, заключенным до 11:00 Даты исполнения; | до 12:00 Даты исполнения[4] |
| | - в юанях, белорусских рублях, тенге, швейцарских франках, определенных по сделкам, заключенным до 12:00 Даты исполнения; | до 13:00 Даты исполнения[4] |
| | - в турецких лирах, определенных по сделкам, заключенным до 12:00 Даты исполнения; | до 14:00 Даты исполнения[4] |
| | - в фунтах стерлингов, определенных по сделкам, заключенным до 15:15 Даты исполнения; | до 17:00 Даты исполнения[4] |
| | - в евро, определенных по сделкам, заключенным до 15:15 Даты исполнения; | до 17:00[2] / 18:00 Даты исполнения[4] |
| | - в долларах США, российских рублях, иенах, драгоценных металлах по сделкам, заключенным до 19:00 Даты исполнения;<br>- в гонконгских долларах, сомони, определенных по сделкам, заключенным с 11:00 до 19:00 Даты исполнения;<br>- в юанях, белорусских рублях, тенге, швейцарских франках, турецких лирах, определенных по сделкам, заключенным с 12:00 до 19:00 Даты исполнения;<br>- в евро, фунтах стерлингов, определенных по сделкам, заключенным с 15:15 до 19:00 Даты исполнения;<br>- в гонконгских долларах, сомони, определенных по сделкам, заключенным с 11:00 до 19:00 Даты исполнения;<br>- в юанях, белорусских рублях, тенге, швейцарских франках, турецких лирах, определенных по сделкам, заключенным с 12:00 до 19:00 Даты исполнения;<br>- в евро, фунтах стерлингов, определенных по сделкам, заключенным с 15:15 до 19:00 Даты исполнения. | до 20:00 Даты исполнения[4] |
| 5.5. | Исполнение Маржинальных требований по фондам, Маржинальных требований по обеспечению под стресс, Маржинальных требований, возникших по Расчетным кодам Единого пула и Расчетным кодам, открытым для фондового рынка и рынка депозитов и для валютного рынка и рынка драгоценных металлов. | до 17:30 дня возникновения соответствующего Маржинального требования |
| 5.6 | Заключение сделок РЕПО / сделок купли-продажи ценных бумаг в случае наличия Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований по ценным бумагам по сделкам, заключенным до 16:00 Даты исполнения, для исполнения которых недостаточно ценных бумаг и в случае наличия у Участника клиринга Итогового нетто-требования по ценным бумагам, не принимаемым в качестве обеспечения исполнения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением, в результате исполнения (прекращения) которого Единый лимит по Расчетному коду станет отрицательным. | с 17:00 до 17:30 Расчетного дня |
| 5.7. | Заключение сделок РЕПО / сделок купли-продажи ценных бумаг в | с 19:00 до 19:20 |

| | | |
|---|---|---|
| | случае наличия Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований по ценным бумагам по сделкам, заключенным с 16:00 до 19:00 Даты исполнения, для исполнения которых недостаточно ценных бумаг и в случае наличия у Участника клиринга Итогового нетто-требования по ценным бумагам, не принимаемым в качестве обеспечения исполнения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением, в результате исполнения (прекращения) которого Единый лимит по Расчетному коду станет отрицательным. | Расчетного дня |
| 5.8. | Заключение сделок своп / РЕПО в случае наличия Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований по денежным средствам / драгоценным металлам, для исполнения которых недостаточно денежных средств / драгоценных металлов. | с 20:00 до 20:30 Расчетного дня[4] |
| 5.9. | Прекращение Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований по денежным средствам / драгоценным металлам. | 20:30[4] Даты исполнения |
| 5.10. | Возврат Клиринговым центром Участникам клиринга денежных средств, учитываемых в качестве взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс на основании Запроса на возврат обеспечения. | в являющийся Расчетным днем день получения Запроса на возврат обеспечения |
| **6.** | **Сроки предоставления отчетов по итогам клиринга** | |
| 6.1. | Передача Клиринговым центром Участникам клиринга Требований о погашении задолженности, Отчетов о движении денежных средств, Отчетов о гарантийных фондах, Отчетов об обеспечении под стресс. | до 9:00 |
| 6.2. | Передача Клиринговым центром Участникам клиринга Отчетов о Маржинальных требованиях. | 9:30 – 10:00 |
| 6.3. | Передача Клиринговым центром Участникам клиринга Отчетов об Итоговых нетто-обязательствах / Итоговых нетто-требований по Расчетным кодам Единого пула, Расчетным кодам, открытым для фондового рынка и рынка депозитов, Расчетным кодам, открытым для валютного рынка и рынка драгоценных металлов, по: | |
| | - денежным средствам / драгоценным металлам / ценным бумагам для Участников клиринга, у которых Итоговое нетто-обязательство, для исполнения которого недостаточно денежных средств / драгоценных металлов, и/или отрицательный Единый лимит по Расчетному коду, входящий в состав Торгово-клирингового счета Т+, по которому учитывается Итоговое нетто-требование в ценных бумагах, не принимаемых в качестве обеспечения исполнения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением, возникали 2 Расчетных дня подряд, в третий Расчетный день, или для Участников клиринга, у которых Итоговое нетто-обязательство по ценной бумаге, для исполнения которого недостаточно ценных бумаг, возникало 4 Расчетных дня подряд, в пятый Расчетный день; | с 10:00 до 10:15 Даты исполнения |
| | - денежным средствам в гонконгских долларах, сомони, определенных по сделкам, заключенным до 11:00 Даты исполнения; | с 11:00 до 11:15 Даты исполнения |
| | - денежным средствам в юанях, белорусских рублях, тенге, швейцарских франках, турецких лирах, определенных по сделкам, заключенным до 12:00 Даты исполнения; | с 12:00 до 12:15 Даты исполнения |
| | - денежным средствам в евро, фунтах стерлингов, долларах США, российских рублях, иенах, драгоценных металлах Участникам клиринга, предоставившим Запрос на проведение ранних расчетов без указания времени до 11:00 или Запрос на проведение ранних расчетов / Постоянное поручение на проведение ранних расчетов | с 11:00 до 11:15 Даты исполнения |

| | | |
|---|---|---|
| | с указанием времени 11:00; | |
| | - денежным средствам в евро, фунтах стерлингов, долларах США, российских рублях, иенах, драгоценных металлах Участникам клиринга, предоставивших Запрос на проведение ранних расчетов без указания времени с 11:00 до 14:00; | в течение 15 минут после получения Клиринговым центром Запроса на проведение ранних расчетов |
| | - денежным средствам в евро, фунтах стерлингов, долларах США, российских рублях, иенах, драгоценных металлах Участникам клиринга, предоставившим Запрос на проведение ранних расчетов / Постоянное поручение на проведение ранних расчетов с указанием времени 12:00; | с 12:00 до 12:15 Даты исполнения |
| | - денежным средствам в евро, фунтах стерлингов, определенных по сделкам, заключенным до 15:15 Даты исполнения; | с 15:15 до 15:30 Даты исполнения |
| | - денежным средствам в долларах США, российских рублях, иенах, драгоценных металлах Участникам клиринга, предоставившим Запрос на проведение ранних расчетов без указания времени с 14:00 до 15:15 или Запрос на проведение ранних расчетов / Постоянное поручение на проведение ранних расчетов с указанием времени 15:15; | с 15:15 до 15:30 Даты исполнения |
| | - денежным средствам в долларах США, российских рублях, иенах, драгоценных металлах Участникам клиринга, предоставившим Запрос на проведение ранних расчетов без указания времени с 15:15 до 17:30; | в течение 15 минут после получения Клиринговым центром Запроса на проведение ранних расчетов |
| | - денежным средствам в долларах США, российских рублях, иенах, драгоценных металлах Участникам клиринга, предоставившим Запрос на проведение ранних расчетов без указания времени с 17:30 до 18:00 или Запрос на проведение ранних расчетов / Постоянное поручение на проведение ранних расчетов с указанием времени 18:00; | с 18:00 до 18:15 Даты исполнения |
| | - денежным средствам в долларах США, российских рублях, иенах, драгоценных металлах по сделкам, заключенным до 19:00 Даты исполнения, Участникам клиринга, не предоставившим Запрос на проведение ранних расчетов или Постоянное поручение на проведение ранних расчетов;<br>- денежным средствам в гонконгских долларах, сомони, определенных по сделкам, заключенным с 11:00 до 19:00 Даты исполнения, Участникам клиринга, не предоставившим Запрос на проведение ранних расчетов или Постоянное поручение на проведение ранних расчетов;<br>- денежным средствам в юанях, белорусских рублях, тенге, швейцарских франках, турецких лирах, определенных по сделкам, заключенным с 12:00 до 19:00 Даты исполнения, Участникам клиринга, не предоставившим Запрос на проведение ранних расчетов или Постоянное поручение на проведение ранних расчетов;<br>- денежным средствам в евро, фунтах стерлингов, определенных по сделкам, заключенным с 15:15 до 19:00 Даты исполнения, Участникам клиринга, не предоставившим Запрос на проведение ранних расчетов или Постоянное поручение на проведение ранних расчетов; | с 19:00 до 19:35 Даты исполнения |
| | ценным бумагам по сделкам, заключенным до 16:00 Даты исполнения; | с 16:00 до 16:15 Даты исполнения |

| | | |
|---|---|---|
| | - ценным бумагам по сделкам, заключенным с 16:00 до 19:00 Даты исполнения; | с 19:00 до 19:15 Даты исполнения |
| | - денежным средствам и ценным бумагам по итогам заключения сделок своп и/или РЕПО в случае наличия Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований по денежным средствам / драгоценным металлам, для исполнения которых недостаточно денежных средств. | до 20:45 Расчетного дня[4] |
| 6.4. | Передача Клиринговым центром Участникам клиринга Отчетов об Итоговых нетто-обязательствах / Итоговых нетто-требованиях по итогам заключения сделок своп в случае наличия Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований по денежным средствам / драгоценным металлам, для исполнения которых недостаточно денежных средств. | до 20:45[1] Расчетного дня |
| 6.5. | Передача Клиринговым центром Участникам клиринга Отчетов о комиссионных вознаграждениях на фондовом рынке и рынке депозитов, на валютном рынке и рынке драгоценных металлов: | |
| | - Участникам клиринга, предоставившим Запрос на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром без указания времени до 11:00 или Запрос / Постоянное поручение на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром с указанием времени 11:00; | с 11:00 до 11:15 даты заключения сделок |
| | - Участникам клиринга, предоставившим Запрос на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром без указания времени с 11:00 до 14:00 или с 15:15 до 17:30; | в течение 15 минут после получения Клиринговым центром Запроса на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром |
| | - Участникам клиринга, предоставившим Запрос / Постоянное поручение на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром с указанием времени 12:00; | с 12:00 до 12:15 даты заключения сделок |
| | - Участникам клиринга, предоставившим Запрос на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром без указания времени с 14:00 до 15:15 или Запрос / Постоянное поручение на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром с указанием времени 15:15; | с 15:15 до 15:30 даты заключения сделок |
| | - Участникам клиринга, предоставившим Запрос на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром без указания времени с 17:30 до 18:00 или Запрос / Постоянное поручение на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром с указанием времени 18:00; | с 18:00 до 18:15 даты заключения сделок |
| | - Участникам клиринга, предоставившим Запрос / Постоянное поручение на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром с указанием времени 19:00; | до 19:15 даты заключения сделок |
| | - содержащих информацию о комиссионных вознаграждениях по сделкам, заключенным до 19:00: Участникам клиринга, не предоставившим Запрос / Постоянное поручение на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром; | до 19:15 даты заключения сделок |
| | - содержащих информацию о комиссионных вознаграждениях по сделкам, заключенным после 19:00: Участникам клиринга, не предоставившим Запрос / Постоянное поручение на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром. | до 09:00 Расчетного дня, следующего за датой заключения сделок |
| **7.** | **Сроки перевода обязательств и Обеспечения** | |

| | | |
|---|---|---|
| 7.1. | Передача Обособленным клиентом Клиринговому центру Заявления на перевод обязательств и Обеспечения. | до 16:00 дня, следующего за днем начала процедуры Перевода обязательств и Обеспечения, при проведении процедуры Перевода обязательств и Обеспечения по основаниям, установленным законодательством; с 9:00 до 18:00 рабочего дня при проведении процедуры Перевода обязательств и Обеспечения по иным основаниям |
| 7.2. | Передача Клиринговым центром Участнику клиринга – реципиенту сообщения о размере обязательств / требований Базового Участника клиринга в денежных средствах / ценных бумагах / драгоценных металлах по обязательствам, допущенным к клирингу, по Сделкам, заключенным за счет Обособленного клиента, а также о размере Обеспечения Базового Участника клиринга в денежных средствах / ценных бумагах / драгоценных металлах, учитываемых по Расчетному коду Базового Участника клиринга, за которым закреплен Обособленный клиент, предоставивший Заявление на перевод обязательств и Обеспечения. | не позднее 17:45 дня, следующего за днем начала процедуры Перевода обязательств и Обеспечения, при проведении процедуры Перевода обязательств и Обеспечения по основаниям, установленным законодательством; не позднее 17:45 Расчетного дня, следующего за днем начала процедуры Перевода обязательств и Обеспечения, при проведении процедуры Перевода обязательств и Обеспечения по иным основаниям |
| 7.3. | Передача Участником клиринга – реципиентом Клиринговому центру Согласия на прием обязательств и Обеспечения. | не позднее 18:30 дня, следующего за днем начала процедуры Перевода обязательств и Обеспечения, при проведении процедуры Перевода обязательств и Обеспечения по основаниям, установленным законодательством; не позднее 18:30 Расчетного дня, следующего за днем начала процедуры Перевода обязательств |

| | | |
|---|---|---|
| | | и Обеспечения, при проведении процедуры Перевода обязательств и Обеспечения по иным основаниям |
| **8.** | **Сроки проведения ликвидационного неттинга в отношении клиента Участника клиринга** | |
| 8.1. | Передача Участником клиринга Клиринговому центру Заявления о проведении ликвидационного неттинга в отношении клиента Участника клиринга. | до 15:00 даты отзыва (аннулирования) Банком России у клиента Участника клиринга, являющегося кредитной организацией, лицензии на осуществление банковских операций, или даты принятия арбитражным судом решения о введении одной из процедур банкротства в отношении клиента Участника клиринга |

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

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

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

[4] – при наличии сбоя в платежных системах указанное время может быть продлено по решению Клирингового центра до устранения указанного сбоя.