

УТВЕРЖДЕНЫ

решением Наблюдательного совета  
НКО НКЦ (АО)

от « 23 » июня 2023 года (Протокол № 26 )

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

Москва, 2023 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 .....	26
Статья 4. Права и обязанности Участников клиринга и Клирингового центра. Заверения Участников клиринга / Участников торгов, заключивших договор о ведении клиринговых регистров .....	34
Статья 5. Договор о ведении клиринговых регистров .....	38
Статья 6. Конфиденциальность .....	42
Статья 7. Выполнение Клиринговым центром функций налогового агента в отношении доходов иностранных организаций от источников в Российской Федерации.....	45
Статья 8. Выполнение Клиринговым центром функций Квалифицированного дилера деривативов (QDD) в отношении дохода от источника в США .....	52
Статья 9. Порядок использования Простой электронной подписи .....	55
Статья 10. Торговые и клиринговые счета.....	57
Статья 11. Клиринговые регистры .....	61
РАЗДЕЛ II. ТРЕБОВАНИЯ К УЧАСТНИКАМ КЛИРИНГА .....	67
Статья 12. Требования к Участникам клиринга .....	67
Статья 13. Категории Участников клиринга.....	70
Статья 14. Условия клирингового обслуживания. Порядок предоставления допуска к клиринговому обслуживанию .....	74
Статья 15. Порядок приостановления и прекращения допуска к клиринговому обслуживанию.....	90
Статья 16. Порядок регистрации Участников клиринга, клиентов Участника клиринга, порядок открытия и закрытия Расчетных кодов.....	104
Статья 17. Общий порядок открытия и закрытия Торгово-клиринговых счетов ..	111
Статья 18. Порядок предоставления информации об Участнике торгов, не совпадающем в одном лице с Участником клиринга.....	113
Статья 19. Порядок открытия Расчетных кодов 2-го уровня и Торгово-клиринговых счетов 2-го уровня .....	115
Статья 20. Порядок открытия Расчетных кодов 3-го уровня и Торгово-клиринговых счетов 3-го уровня .....	117
Статья 21. Порядок присвоения Расчетному коду признака «Единый пул» .....	118
Статья 22. Порядок присвоения Клиринговых идентификаторов .....	123
Статья 23. Порядок регистрации Обособленных клиентов Участников клиринга	124
РАЗДЕЛ III. МЕРЫ, НАПРАВЛЕННЫЕ НА УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ ПРИ ОСУЩЕСТВЛЕНИИ КЛИРИНГА .....	126
Статья 24. Перечень мер, направленных на управление рисками при осуществлении клиринга.....	126
Статья 25. Единый лимит по Расчетному коду и риск-параметры.....	129

Статья 26. Порядок заключения закрывающих и/или балансирующих сделок .....	134
<b>РАЗДЕЛ IV. ПОРЯДОК ПРОВЕДЕНИЯ КЛИРИНГА .....</b>	<b>139</b>
<b>ПОДРАЗДЕЛ IV-I. ПОРЯДОК ВНЕСЕНИЯ И ВОЗВРАТА ОБЕСПЕЧЕНИЯ .....</b>	<b>139</b>
Статья 27. Порядок внесения Обеспечения .....	139
Статья 28. Порядок передачи Профилей активов.....	149
Статья 29. Порядок подачи и исполнения Запросов на подбор ценных бумаг .....	151
Статья 30. Порядок возврата Обеспечения .....	152
<b>ПОДРАЗДЕЛ IV-II. ПОРЯДОК ВНЕСЕНИЯ И ВОЗВРАТА ОБЕСПЕЧЕНИЯ ПОД СТРЕСС, ВЗНОСОВ В ГАРАНТИЙНЫЕ ФОНДЫ, ОБЕСПЕЧЕНИЯ ПОД РИСКИ КОНЦЕНТРАЦИИ НА ЭМИТЕНТОВ.....</b>	<b>169</b>
Статья 31. Порядок внесения взносов в Гарантийные фонды, Обеспечения под стресс, Обеспечения под риски концентрации на эмитентов .....	169
Статья 32. Единый лимит по Гарантийным фондам, Единый лимит по Обеспечению под стресс, Единый лимит по рискам концентрации на эмитентов .....	171
Статья 33. Порядок возврата взносов в Гарантийные фонды, Обеспечения под стресс, Обеспечения под риски концентрации на эмитентов .....	177
<b>ПОДРАЗДЕЛ IV-III. ПОРЯДОК ВОЗНИКНОВЕНИЯ И ИСПОЛНЕНИЯ МАРЖИНАЛЬНЫХ ТРЕБОВАНИЙ, МАРЖИНАЛЬНЫХ ТРЕБОВАНИЙ ПО ФОНДАМ / ОБЕСПЕЧЕНИЮ ПОД СТРЕСС, МАРЖИНАЛЬНЫХ ТРЕБОВАНИЙ ПО РИСКУ КОНЦЕНТРАЦИИ НА ЭМИТЕНТА, МАРЖИНАЛЬНЫХ ТРЕБОВАНИЙ ПО РАСЧЕТНОМУ КОДУ ДЛЯ УПЛАТЫ НАЛОГОВ .....</b>	<b>180</b>
Статья 34. Порядок проведения клиринговых сессий mark-to-market. Порядок возникновения и исполнения Маржинальных требований .....	180
Статья 35. Режим урегулирования .....	184
Статья 36. Порядок возникновения и исполнения Маржинальных требований по фондам / обеспечению под стресс.....	185
Статья 37. Порядок возникновения и исполнения Маржинальных требований по рискам концентрации на эмитентов.....	187
Статья 38. Порядок возникновения и исполнения Маржинальных требований по Расчетному коду для уплаты налогов.....	189
<b>ПОДРАЗДЕЛ IV-IV. ПОРЯДОК ИСПОЛНЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ ПО ИТОГАМ КЛИРИНГА.....</b>	<b>192</b>
Статья 39. Общие требования к порядку включения обязательств в клиринговые пулы и к порядку исполнения обязательств .....	192
Статья 40. Сроки включения обязательств в клиринговые пулы (ранние расчеты и ограничение времени заключения Сделок с Клиринговым центром).....	196
Статья 41. Порядок исполнения обязательств и требований по денежным средствам / драгоценным металлам Участников клиринга и Клирингового центра .....	199
Статья 42. Порядок формирования Единого клирингового пула .....	204
Статья 43. Порядок прекращения обязательств в Едином клиринговом пуле .....	208
<b>ПОДРАЗДЕЛ IV-V. ПОРЯДОК ДЕЙСТВИЙ, НАПРАВЛЕННЫХ НА ИСПОЛНЕНИЕ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ.....</b>	<b>214</b>

Статья 44. Порядок действий, направленных на исполнение обязательств, в случае наличия Итоговых нетто-обязательств, для исполнения которых недостаточно денежных средств / драгоценных металлов / ценных бумаг .....	214
Статья 45. Порядок заключения и условия сделок своп / сделки купли-продажи с иностранной валютой / драгоценным металлом, заключаемых с Недобросовестными участниками клиринга.....	218
Статья 46. Порядок заключения и условия сделок РЕПО и сделок / сделки купли-продажи ценных бумаг, заключаемых с Недобросовестным участником клиринга ..	224
Статья 47. Порядок заключения и условия сделок своп с иностранной валютой / драгоценным металлом, заключаемых с Добросовестным участником клиринга .....	231
Статья 48. Условия Сделок РЕПО Клирингового центра, порядок их заключения и исполнения .....	232
Статья 49. Порядок заключения и условия сделок РЕПО и сделок купли-продажи ценных бумаг, заключаемых с Добросовестным участником клиринга.....	234
Статья 50. Порядок использования и возмещения Гарантийных фондов и иных средств в целях погашения Задолженностей Участников клиринга (процедура кросс-дефолта).....	236
Статья 51. Порядок действий, направленных на исполнение обязательств Участника торгов перед Участником клиринга.....	247
<b>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.....</b>	<b>249</b>
Статья 52. Порядок взаимодействия с Расчетной организацией, в которой открыты торговые или клиринговые банковские счета для учета денежных средств .....	249
Статья 53. Порядок действий в случае обращения взыскания или наложения ареста на имущество Участника клиринга, находящееся на торговом банковском счете в драгоценном металле.....	250
Статья 54. Порядок взаимодействия с Расчетным депозитарием и иными депозитариями.....	251
<b>РАЗДЕЛ V. ОБЩИЙ ПОРЯДОК ОПЛАТЫ УСЛУГ.....</b>	<b>255</b>
Статья 55. Общий порядок оплаты услуг Клирингового центра, Биржи Технического центра, а также порядок начисления и выплаты процентов на денежные средства, составляющие индивидуальное или коллективное клиринговое обеспечение... ..	255
Статья 56. Общий порядок представления отчетов по итогам клиринга.....	265
<b>РАЗДЕЛ VI. ПРОЧИЕ УСЛОВИЯ .....</b>	<b>267</b>
Статья 57. Перевод обязательств и Обеспечения одного Участника клиринга другому Участнику клиринга .....	267
Статья 58. 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 .....	274

Статья 59. Порядок урегулирования обязательств в случае прекращения допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию (ликвидационный неттинг в отношении Участника клиринга) .....	276
Статья 60. Порядок урегулирования обязательств в случае банкротства клиента Участника клиринга (ликвидационный неттинг в отношении клиента Участника клиринга).....	309
Статья 61. Порядок урегулирования обязательств в случае неисполнения Клиринговым центром обязательств по возврату Участнику клиринга денежных средств / ценных бумаг / драгоценных металлов, учитываемых в качестве Обеспечения / Обеспечения под стресс / взносов в Гарантйные фонды (дефолт Клирингового центра в отношении Участника клиринга) .....	313
Статья 62. Порядок урегулирования обязательств в случае отзыва (аннулирования) лицензии на осуществление банковских операций у Клирингового центра (ликвидационный неттинг в отношении Клирингового центра) .....	315
Статья 63. Возникновение обстоятельств, которые могут повлиять на возможность проведения Торгов и (или) клиринга .....	324
Статья 64. Чрезвычайные ситуации .....	325
Статья 65. Порядок разрешения споров .....	334
Приложение № 1. Договор об оказании клиринговых услуг №_____ .....	336
Приложение № 2. Договор о ведении клиринговых регистров №_____ .....	337
Приложение № 3. Порядок проведения технической экспертизы .....	339
Приложение № 4. Документы, предоставляемые юридическим лицом для заключения Договора об оказании клиринговых услуг .....	341
Приложение № 5. Отчетность, представляемая Участниками клиринга Клиринговому центру.....	362
Приложение № 6. Временной регламент .....	375

## **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 простой электронной подписи;
    - общие требования к Участникам клиринга;
    - перечень общих мер, направленных на управление рисками при осуществлении клиринга;
    - 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 о ведении клиринговых регистров с Участником торгов, не совпадающим в одном лице с Участником клиринга;
    - 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, рынке депозитов и рынке кредитов», содержащие особенности исполнения сделок купли-продажи ценных бумаг, заключаемых на торгах в Секции Фондового рынка ПАО Московская Биржа или не на организованных торгах в соответствии с Правилами клиринга, сделок РЕПО, заключаемых в Секции рынка РЕПО ПАО Московская Биржа, кредитных договоров, заключаемых на Рынке кредитов ПАО Московская Биржа, порядок заключения и исполнения депозитных договоров на Рынке депозитов ПАО Московская Биржа, порядок заключения Внебиржевых сделок с ценными бумагами с Участниками клиринга, и определяющие условия договора об имущественном пуле (далее – «Правила клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов»);
- 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 правила заключения Внебиржевых сделок с иностранной валютой, Внебиржевых сделок с драгоценным металлом 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»);
- 7) «Правила клиринга Небанковской кредитной организации-центрального контрагента «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество). Часть VII. Уровни защиты центрального контрагента и меры, направленные на

ограничение размера ответственности Клирингового центра, содержащие особенности использования мер и средств, направленных на ограничение размера ответственности Клирингового центра за неисполнение или ненадлежащее исполнение обязательств перед Участниками клиринга, включенных в клиринговый пул на соответствующем Рынке, в случае наличия Недобросовестных участников клиринга и/или в случае неисполнения / ненадлежащего исполнения Провайдером(-ами) ликвидности обязательств перед Клиринговым центром по Внебиржевым сделкам с иностранной валютой и Внебиржевым сделкам с драгоценными металлами, а также устанавливающие существенные условия договора страхования ответственности Клирингового центра (далее – Правила клиринга об ограничении размера ответственности Клирингового центра).

Правила клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, 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, Правила клиринга об ограничении размера ответственности Клирингового центра далее совместно именуется «специальные части Правил клиринга», а в отдельности – «специальная часть Правил клиринга».

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

- 1.2. В случае внесения изменений и дополнений в любую из частей Правил клиринга, в том числе путем принятия части Правил клиринга в новой редакции, соответствующие изменения и дополнения с даты введения их в действие распространяются на отношения по вышеуказанным Сделкам (договорам), заключенным до введения в действие соответствующих изменений и дополнений (новой редакции), и не исполненным (не прекращенным) на дату введения в действие изменений и дополнений в часть Правил клиринга (новой редакции части Правил клиринга).
- 1.3. В случае если в общей части Правил клиринга установлены положения, отличные от положений, содержащихся в соответствующей специальной части Правил клиринга, применяются положения специальной части Правил клиринга.

## Статья 2. Термины и определения

<b>Анкета для целей выявления иностранных налогоплательщиков -</b>	Анкета в соответствии с нормами и положениями FATCA, Закона об особенностях осуществления финансовых операций с иностранными гражданами и юридическими лицами и требованиями российского законодательства по реализации международного автоматического обмена финансовой информацией в налоговых целях.
<b>Аутентификация -</b>	процедура подтверждения принадлежности ПЭП Участнику клиринга / Участнику торгов / Клиринговому центру.
<b>Банк ЕврАзЭС/ЕАЭС -</b>	Банк-нерезидент, зарегистрированный на территории государства, являющегося стороной Соглашения о сотрудничестве в области организации интегрированного валютного рынка государств - членов Евразийского



	экономического сообщества от 25.01.2006 (далее – Соглашение о сотрудничестве) и/или государства – стороны по Договору о Евразийском экономическом союзе от 29.05.2014 (далее – Договор ЕАЭС).
<b>Банк-нерезидент -</b>	юридическое лицо, являющееся Нерезидентом, которое на основании специального разрешения (лицензии или иного основания) компетентного органа государства учреждения имеет право осуществлять банковские операции, предусмотренные личным законом Банка-нерезидента.
<b>Биржа -</b>	биржа, заключившая договор о взаимодействии с Клиринговым центром.
<b>Биржевой рынок -</b>	одна из торговых (биржевых) секций ПАО Московская Биржа, на которой ПАО Московская Биржа является организатором торговли, организованные торги на товарном рынке АО НТБ, осуществление клиринга по которым регулируется Правилами клиринга.
<b>Внебиржевая сделка -</b>	Внебиржевая сделка с ценными бумагами, заключаемая не на организованных торгах в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, или Внебиржевая сделка с иностранной валютой / Внебиржевая сделка с драгоценным металлом, заключаемая не на организованных торгах в соответствии с Правилами клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, или Внебиржевой Договор СПФИ, заключаемый не на организованных торгах в соответствии с Правилами клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ.
<b>Внебиржевой Рынок -</b>	заключение Внебиржевых сделок, осуществление клиринга по которым регулируется Правилами клиринга.
<b>Выделенный капитал центрального контрагента -</b>	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.
<b>Выплата, эквивалентная дивидендам или процентам -</b>	выплата Дохода Участнику клиринга по Сделке с центральным контрагентом, подпадающая под налогообложение в рамках Глав 3 и 4 Налогового кодекса США в соответствии с требованиями секции 871(m).
<b>Гарантийный фонд -</b>	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 Рынке.
<b>Дата исполнения -</b>	дата, в которую Участник клиринга и/или Клиринговый центр обязан исполнить свои обязательства в соответствии с

	условиями заключенной Сделки или иные обязательства в порядке, определенном Правилами клиринга. В 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.
<b>Добросовестный участник клиринга -</b>	Участник клиринга, не имеющий неисполненных обязательств перед Клиринговым центром.
<b>Договор о взаимодействии -</b>	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.
<b>Единый клиринговый пул -</b>	клиринговый пул, формируемый в Клиринговой системе фондового рынка, рынка депозитов и рынка кредитов (далее – Клиринговая система фондового рынка), состоящий из всех (если Правилами клиринга не установлено иное) следующих обязательств с одной, наступившей Датой исполнения: (1) обязательств по Сделкам T+; (2) иных определенных Правилами клиринга обязательств; (3) обязательств, учитываемых по Расчетным кодам Единого пула, переданных на исполнение в Клиринговую систему фондового рынка из Клиринговых систем других Рынков.
<b>Единый лимит по Расчетному коду -</b>	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.
<b>Единый лимит по Расчетному коду для уплаты налогов -</b>	величина, рассчитываемая Клиринговым центром в российских рублях для каждого Участника клиринга в целях контроля достаточности Обеспечения для: 1) обеспечения исполнения обязательств Участника клиринга по уплате сумм, соответствующих суммам налога на прибыль организаций с доходов иностранных организаций от источников в Российской Федерации; и 2) исполнения таких обязательств.
<b>Единый лимит по рискам концентрации на эмитентов -</b>	величина, рассчитываемая Клиринговым центром в российских рублях для каждого Участника клиринга в целях контроля за рисками концентрации на эмитентов (группы ценных бумаг эмитентов).
<b>Единый лимит по Гарантийным фондам -</b>	величина, рассчитываемая Клиринговым центром в российских рублях для каждого Участника клиринга в целях проверки исполнения Участником клиринга обязательств по внесению взносов в Гарантийные фонды.
<b>Единый лимит по</b>	величина, рассчитываемая Клиринговым центром в российских рублях для каждого Участника клиринга в целях проверки

<b>Обеспечению под стресс -</b>	исполнения Участником клиринга обязательств по внесению Обеспечения под стресс.
<b>Задолженность -</b>	денежное обязательство Участника клиринга, возникшее в связи с прекращением не исполненных им обязательств, в том числе, обязательств по Сделкам, обязательств по уплате комиссионных вознаграждений, Задолженности по уплате налога и/или иных обязательств, указанных в Правилах клиринга.
<b>Задолженность по уплате налога -</b>	часть Задолженности, возникающая при наличии обязательства Участника клиринга по уплате суммы, соответствующей сумме рассчитанного налога на прибыль организаций с доходов иностранных организаций от источников в Российской Федерации и/или обязательства Участника клиринга по уплате суммы, соответствующей сумме рассчитанного налога на доход от источника в США и/или приравненный к нему доход.
<b>Закон о клиринге -</b>	Федеральный закон от 07.02.2011 № 7-ФЗ «О клиринге, клиринговой деятельности и центральном контрагенте».
<b>Закон об особенностях осуществления финансовых операций с иностранными гражданами и юридическими лицами -</b>	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».
<b>Идентификатор (Идентификатор Участника клиринга) -</b>	уникальный буквенно-цифровой код, присваиваемый Клиринговым центром Участнику клиринга и однозначно определяющий Участника клиринга.
<b>Индивидуальный Участник клиринга -</b>	Участник клиринга, 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).
<b>Итоговое нетто-обязательство Участника клиринга -</b>	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.
<b>Итоговое нетто-требование Участника клиринга -</b>	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.
<b>Клиринг без предварительного обеспечения -</b>	клиринг по Сделке, при заключении которой не проверяется наличие Обеспечения Участника клиринга.
<b>Клиринг с полным обеспечением -</b>	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.
<b>Клиринг с частичным обеспечением -</b>	клиринг по Сделке, условием заключения которой является достаточность Обеспечения Участника клиринга, контролируемая Клиринговым центром в порядке, установленном Правилами клиринга.
<b>Клиринговая система -</b>	совокупность программно-технических средств, баз данных, телекоммуникационных средств, иного оборудования и программного обеспечения Клирингового центра, предназначенных для осуществления клиринговой деятельности в соответствии с Правилами клиринга.
<b>Клиринговый брокер -</b>	Участник клиринга, исполняющий функции клирингового брокера в соответствии с Законом о клиринге и Правилами клиринга. Клиринговым брокером может становиться Участник клиринга категории «О», «Б» или «Б2».
<b>Клиринговый идентификатор -</b>	уникальный буквенно-цифровой код, присваиваемый Техническим центром Участнику клиринга / Участнику торгов / Клиринговому центру в целях совершения операций в Клиринговой системе, если это предусмотрено соответствующей специальной частью Правил клиринга.
<b>Клиринговый терминал, Web-клиринг -</b>	web-сервисы, предназначенные для осуществления электронного документооборота между Участником клиринга и Клиринговым центром.
<b>Клиринговый центр -</b>	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.
<b>Конечный контрагент -</b>	Участник клиринга, являющийся стороной по парной Сделке с центральным контрагентом.
<b>Кредитная организация -</b>	кредитная организация, являющаяся Резидентом.

<b>Маржинальное требование -</b>	требование Клирингового центра к Участнику клиринга об обеспечении обязательств по Сделкам с частичным обеспечением, заключенным Клиринговым центром с Участником клиринга, предъявляемое в порядке и случае, определенных Правилами клиринга.
<b>Маржинальное требование по рискам концентрации на эмитентов -</b>	требование Клирингового центра к Участнику клиринга о внесении Обеспечения под риски концентрации на эмитентов.
<b>Маржинальное требование по обеспечению под стресс -</b>	требование о приведении размера средств, внесенных Участником клиринга в качестве Обеспечения под стресс, в соответствие установленному Клиринговым центром для Участника клиринга размеру Обеспечения под стресс.
<b>Маржинальное требование по Расчетному коду для уплаты налогов -</b>	требование Клирингового центра к Участнику клиринга об обеспечении исполнения обязательств Участника клиринга по уплате сумм, соответствующих суммам налога на прибыль организаций с доходов иностранных организаций от источников в Российской Федерации.
<b>Маржинальное требование по фондам -</b>	требование о приведении взносов Участника клиринга в Гарантийные фонды в соответствие установленным Клиринговым центром размерам взносов в Гарантийные фонды.
<b>Международная организация -</b>	юридическое лицо, учрежденное в соответствии с международным договором Российской Федерации и имеющее право осуществлять банковские операции, в том числе валютные операции, и/или право размещать средства в депозиты на территории Российской Федерации в соответствии с международными договорами Российской Федерации и законодательством Российской Федерации.
<b>Методика выбора ценных бумаг, принимаемых в обеспечение -</b>	внутренний документ Клирингового центра, определяющий критерии выбора ценных бумаг, принимаемых в качестве обеспечения исполнения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением.
<b>Методика контроля лимитов концентрации на эмитентов -</b>	внутренний документ Клирингового центра, устанавливающий порядок определения величин, используемых Клиринговым центром для проверки возможности возврата Обеспечения.
<b>Методика определения лимитов налогового риска -</b>	внутренний документ Клирингового центра, устанавливающий правила определения лимитов налогового риска в отношении Участника клиринга-Нерезидента / Участника клиринга-Международной организации в рамках исполнения Клиринговым центром функций налогового агента в соответствии с законодательством Российской Федерации о налогах и сборах и Правилами клиринга.
<b>Методика определения размера Обеспечения под</b>	внутренний документ Клирингового центра, устанавливающий порядок определения минимального размера Обеспечения под стресс Участников клиринга на соответствующих Рынках.

<b>стресс -</b>	Методика определения размера Обеспечения под стресс раскрывается на Сайте Клирингового центра.
<b>Методика определения риск-параметров валютного рынка и рынка драгоценных металлов -</b>	внутренний документ Клирингового центра, устанавливающий порядок определения риск-параметров валютного рынка и рынка драгоценных металлов ПАО Московская Биржа. Методика определения риск-параметров валютного рынка и рынка драгоценных металлов раскрывается на Сайте Клирингового центра.
<b>Методика определения риск-параметров товарного рынка -</b>	внутренний документ Клирингового центра, устанавливающий порядок определения риск-параметров товарного рынка ПАО Московская Биржа. Методика определения риск-параметров товарного рынка раскрывается на Сайте Клирингового центра.
<b>Методика определения риск-параметров фондового рынка -</b>	внутренний документ Клирингового центра, устанавливающий порядок определения риск-параметров фондового рынка и рынка депозитов ПАО Московская Биржа. Методика определения риск-параметров фондового рынка и рынка депозитов раскрывается на Сайте Клирингового центра.
<b>Методика определения выделенного капитала центрального контрагента -</b>	внутренний документ Клирингового центра, устанавливающий порядок определения размера выделенного капитала Клирингового центра для всех Рынков и порядок распределения выделенного капитала центрального контрагента по Рынкам. Методика определения выделенного капитала центрального контрагента раскрывается на Сайте Клирингового центра.
<b>Недобросовестный участник клиринга -</b>	Участник клиринга, не исполнивший или ненадлежащим образом исполнивший свои обязательства перед Клиринговым центром, срок исполнения которых наступил, в том числе, Маржинальное требование, и/или имеющий Задолженность перед Клиринговым центром.
<b>Некредитная организация -</b>	юридическое лицо, являющееся Резидентом и не являющееся кредитной организацией.
<b>Некредитная организация – нерезидент -</b>	юридическое лицо, являющееся Нерезидентом и не имеющее права осуществлять банковские операции.
<b>Некредитная организация ЕвразЭС/ЕАЭС -</b>	юридическое лицо, являющееся Некредитной организацией – нерезидентом, зарегистрированное на территории государства, являющегося стороной Соглашения о сотрудничестве / Договора ЕАЭС.
<b>Нерезидент -</b>	лицо, являющееся нерезидентом в соответствии с законодательством Российской Федерации о валютном регулировании и валютном контроле.
<b>Нерезидент из перечня -</b>	нерезидент, являющийся резидентом иностранного государства (включая Международную организацию, имеющую штаб-квартиру в иностранном государстве), входящего в утверждаемый решением Клирингового центра перечень, либо лицом, подконтрольным такому нерезиденту, иное лицо, на которое распространяются временные меры экономического характера в соответствии с положениями нормативных актов

	<p>Российской Федерации. Перечень утверждается Клиринговым центром на основании утвержденных Президентом РФ, Правительством РФ, Банком России документов и/или выпущенных указанными органами разъяснений, устанавливающих временные меры экономического характера и порядок их применения в отношении лиц иностранных государств и территорий, в том числе совершающих в отношении Российской Федерации, российских юридических лиц и физических лиц недружественные действия.</p>
<p><b>Нетто-обязательство Участника клиринга -</b></p>	<p>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.</p>
<p><b>Нетто-требование Участника клиринга -</b></p>	<p>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.</p>
<p><b>Обеспечение -</b></p>	<p>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, которое используется для обеспечения исполнения обязательств Участника клиринга по Сделкам с центральным контрагентом, обязательств Участника клиринга по уплате сумм, соответствующих суммам налога на прибыль организаций с доходов иностранных организаций от источников в Российской Федерации, а также суммам налога на доход от источников в США и/или приравненный к нему доход. 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</p>

	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, рынке депозитов и рынке кредитов.
<b>Обеспечение под риски концентрации на эмитентов -</b>	Обеспечение, вносимое в целях снижения рисков концентрации на эмитентов (группы ценных бумаг эмитентов). Если иное не вытекает из существа положений Правил клиринга, положения Правил клиринга, применимые для Обеспечения, применяются также в отношении Обеспечения под риски концентрации на эмитентов.
<b>Обеспечение под стресс -</b>	индивидуальное клиринговое обеспечение определенных Правилами клиринга Участников клиринга в российских рублях и/или иностранной валюте и/или ценных бумагах, и/или иное обеспечение Участника клиринга в иностранной валюте, которое используется для обеспечения исполнения обязательств Участника клиринга по Сделкам с частичным обеспечением на соответствующем Рынке. Если иное не вытекает из существа положений Правил клиринга, положения Правил клиринга, применимые для Обеспечения, применяются также в отношении Обеспечения под стресс.
<b>Обособленный клиент -</b>	клиент Участника клиринга, в том числе Участник торгов или клиент Участника торгов, зарегистрированный Участником клиринга в качестве Обособленного клиента в порядке, предусмотренном Статьей 23 общей части Правил клиринга, для получения возможности воспользоваться Переводом обязательств и Обеспечения на условиях, определенных в Статье 57 общей части Правил клиринга.
<b>Общий Участник клиринга -</b>	Участник клиринга, имеющий право становиться стороной по Сделкам (в т.ч. действуя в качестве Клирингового брокера), заключаемым на торгах более, чем двумя Участниками торгов.
<b>Обязательство с отложенным исполнением -</b>	сумма денежных средств, на которую могут быть погашены обязательства Клирингового центра по возврату Обеспечения в денежных средствах Участникам клиринга / Доверенным владельцам счетов, рассчитываемая Клиринговым центром по итогам каждой клиринговой сессии mark-to-market на каждом Рынке в порядке, установленном Правилами клиринга об ограничении размера ответственности Клирингового центра.
<b>Ограничительный лимит -</b>	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.
<b>Оператор товарных поставок -</b>	НКО НКЦ (АО), осуществляющая функции оператора товарных поставок, выполняющего операции, связанные с исполнением обязательств по передаче товаров по итогам клиринга,



	осуществленного Клиринговым центром.
<b>Парная сделка (Парный договор) -</b>	каждая из двух Сделок, заключенных с центральным контрагентом на основании двух допустимых встречных заявок / Предложений / Предложений «Стратегия» / на основании допустимых встречных заявки и подтверждения на заключение сделки (в случае подачи Котировки участника торгов), в порядке и на условиях, определенных правилами торгов на соответствующем Рынке или специальной частью Правил клиринга.
<b>Пароль -</b>	последовательность символов, используемая для аутентификации Участника клиринга, Участника торгов или Клирингового центра в Клиринговой системе.
<b>Порядок предоставления информации и отчетности -</b>	внутренний документ Клирингового центра, устанавливающий состав, сроки и форматы предоставления информации и отчетности Участниками клиринга Клиринговому центру. Порядок предоставления информации и отчетности раскрывается на Сайте Клирингового центра.
<b>Порядок ЭДО -</b>	Порядок организации электронного документооборота Небанковской кредитной организации-центрального контрагента «Национальный Клиринговый Центр» (Акционерное общество).
<b>Правила торгов -</b>	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, рынке депозитов и рынке кредитов.
<b>Правила торгов на валютном рынке -</b>	правила организованных торгов ПАО Московская Биржа, регламентирующие проведение организованных торгов на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.
<b>Правила торгов на рынке Стандартизированных ПФИ -</b>	правила организованных торгов ПАО Московская Биржа, регламентирующие проведение организованных торгов на рынке Стандартизированных ПФИ.
<b>Правила торгов на срочном рынке -</b>	правила организованных торгов ПАО Московская Биржа, регламентирующие проведение организованных торгов на Срочном рынке.
<b>Правила торгов на товарном рынке -</b>	правила организованных торгов Акционерного общества «Национальная товарная биржа», регламентирующие проведение организованных торгов на товарном рынке.
<b>Правила торгов на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов -</b>	правила организованных торгов ПАО Московская Биржа, регламентирующие проведение организованных торгов, на которых заключаются Сделки с ценными бумагами, депозитные договоры и кредитные договоры.
<b>Предложение -</b>	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.
<b>Простая электронная подпись / ПЭП -</b>	информация в электронной форме, содержащаяся в Предложении или ином электронном сообщении, направляемом с использованием Клиринговой системы, которая посредством использования Клирингового идентификатора Участника клиринга и пароля подтверждает формирование электронной подписи определенным лицом – представителем Участника клиринга.
<b>Профиль актива -</b>	информация об Обеспечении, учитываемая по Расчетному коду / Торгово-клиринговому счету с признаком «Единый пул» в Клиринговой системе соответствующего Рынка, переданная в Клиринговую систему другого Рынка / полученная из Клиринговой системы другого Рынка.
<b>Рабочее место Участника клиринга -</b>	совокупность программно-технических средств, предназначенных для использования Участником клиринга в целях получения технического доступа к Клиринговой системе. Существуют следующие виды Рабочих мест Участника клиринга: <ul style="list-style-type: none"> <li>• Рабочее место УРМ - Рабочее место Участника клиринга, получающего технический доступ к Клиринговой системе с использованием удаленного рабочего места;</li> <li>• 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.</li> </ul>
<b>Раздел -</b>	торговый раздел торгового счета депо, открытого в Расчетном депозитарии с указанием Клирингового центра в качестве клиринговой организации, которая вправе давать распоряжения по этому торговому счету, а также торговые разделы счетов депо, открытых в Расчетном депозитарии и указанных в Правилах клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.
<b>Расчетная организация -</b>	НКО АО НРД, и/или Банк России, и/или иная кредитная организация, являющаяся Резидентом, в которой (-ом) Клиринговым центром открыт клиринговый банковский счет и/или в которой (-ом) Участником клиринга открыт торговый банковский счет в драгоценном металле для учета индивидуального и/или коллективного клирингового обеспечения.
<b>Расчетный банк -</b>	банк или небанковская кредитная организация, в том числе иностранная кредитная организация, в которой Клиринговым

	<p>центром открыт корреспондентский счет для учета Обеспечения, Обеспечения под стресс в иностранной валюте / драгоценных металлах.</p>
<b>Расчетный день -</b>	<p>день, в том числе выходной или нерабочий (праздничный) день по законодательству Российской Федерации, в который Расчетная организация осуществляет платежи в российских рублях, или день, в который Расчетная организация осуществляет платежи в российских рублях только по банковским счетам, открытым в этой Расчетной организации (далее также - Расчетный день по российским рублям).</p> <p>Расчетным днем по соответствующей иностранной валюте является Расчетный день по российским рублям, одновременно являющийся рабочим днем в банковской системе страны / группы стран-эмитентов такой иностранной валюты, за исключением рабочих дней, являющихся сокращенными рабочими днями по информации, полученной Клиринговым центром от Расчетного банка по соответствующей иностранной валюте.</p> <p>Расчетным днем по драгоценным металлам является Расчетный день по российским рублям.</p> <p>Расчетным днем для целей определения Даты исполнения обязательств по уплате вариационной маржи / депозитной маржи в российских рублях является Расчетный день по российским рублям, за исключением дней, в которые Клиринговый центр не проводит клиринговую сессию.</p> <p>Расчетным днем для целей определения Даты исполнения обязательств по уплате вариационной маржи / депозитной маржи в иностранной валюте является Расчетный день по такой иностранной валюте, за исключением дней, в которые Клиринговый центр не проводит клиринговую сессию.</p> <p>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.</p> <p>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.</p> <p>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</p>

	<p>обязательств в день проведения торгов.</p> <p>Расчетным днем для целей определения Даты исполнения обязательств по Сделкам с драгоценным металлом с расчетами в иностранной валюте является Расчетный день, в который на Бирже допускается заключение сделок с такой иностранной валютой и сделок с таким драгоценным металлом с Датой исполнения обязательств в день проведения торгов.</p> <p>Особенности определения Расчетного (Рабочего) дня для целей определения Даты исполнения иных обязательств могут быть установлены Спецификацией соответствующего Договора СПФИ.</p>
<b>Расчетный депозитарий -</b>	расчетный депозитарий, осуществляющий операции, связанные с исполнением обязательств по передаче ценных бумаг по итогам клиринга, осуществленного Клиринговым центром.
<b>Расчетный код -</b>	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, или Расчетный код для учета Обеспечения под риски концентрации на эмитентов или Расчетный код для уплаты налогов.
<b>Расчетный код Участника клиринга / Расчетный код 1-го уровня -</b>	<p>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.</p> <p>Если иное не вытекает из существа положений Правил клиринга, или не установлено решением Клирингового центра, положения Правил клиринга, применимые для Расчетного кода Участника клиринга / Расчетного кода 1-го уровня, применяются также в отношении Расчетного кода нерезидента.</p>
<b>Расчетный код 2-го уровня -</b>	<p>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.</p> <p>Если иное не вытекает из существа положений Правил клиринга, или не установлено решением Клирингового центра, положения Правил клиринга, применимые для Расчетного кода 2-го уровня, применяются также в отношении Расчетного кода нерезидента 2-го уровня.</p>
<b>Расчетный код 3-го уровня -</b>	<p>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.</p> <p>Если иное не вытекает из существа положений Правил</p>

	клиринга, или не установлено решением Клирингового центра, положения Правил клиринга, применимые для Расчетного кода 3-го уровня, применяются также в отношении Расчетного кода нерезидента 3-го уровня.
<b>Расчетный код для уплаты налогов -</b>	клиринговый регистр, предназначенный для учета информации о денежных средствах, внесенных Участником клиринга для обеспечения исполнения обязательств Участника клиринга по уплате сумм, соответствующих суммам налога на прибыль организаций с доходов иностранных организаций от источников в Российской Федерации и исполнения таких обязательств, а также иных обязательств в соответствии с Правилами клиринга, а также для учета указанных обязательств.
<b>Расчетный код для учета взносов в Гарантийные фонды -</b>	клиринговый регистр, предназначенный для учета информации о денежных средствах, внесенных Участником клиринга в качестве взносов в Гарантийные фонды.
<b>Расчетный код для учета Обеспечения под риски концентрации на эмитентов -</b>	клиринговый регистр, предназначенный для учета информации о денежных средствах, внесенных Участником клиринга в качестве Обеспечения под риски концентрации на эмитентов.
<b>Расчетный код для учета Обеспечения под стресс -</b>	клиринговый регистр, предназначенный для учета информации о денежных средствах, внесенных Участником клиринга в качестве Обеспечения под стресс.
<b>Расчетный код имущественного пула -</b>	клиринговый регистр, предназначенный для учета иностранной валюты, драгоценных металлов и российских рублей, внесенных в имущественный пул.
<b>Расчетный код нерезидента -</b>	клиринговый регистр 1-го уровня, предназначенный для учета информации об Обеспечении Участника клиринга в денежных средствах / драгоценных металлах и/или обязательств по Сделкам, заключенным в интересах и (или) за счет Нерезидента из перечня или Нерезидентом из перечня.
<b>Расчетный код нерезидента 2-го уровня -</b>	клиринговый регистр 2-го уровня, предназначенный для учета информации об Обеспечении в денежных средствах / драгоценных металлах, внесенном с указанием данного Расчетного кода нерезидента 2-го уровня и/или информации об обязательствах по Сделкам, заключенным с указанием Торгово-клирингового счета нерезидента 2-го уровня, по Сделкам, заключенным в интересах и (или) за счет Нерезидента из перечня или Нерезидентом из перечня.
<b>Расчетный код нерезидента 3-го уровня -</b>	клиринговый регистр 3-го уровня, предназначенный для учета информации об Обеспечении в денежных средствах / драгоценных металлах, внесенном с указанием данного Расчетного кода нерезидента 3-го уровня и/или информации об обязательствах по Сделкам, заключенным с указанием Торгово-

	клирингового счета нерезидента 3-го уровня, по Сделкам, заключенным в интересах и (или) за счет Нерезидента из перечня или Нерезидентом из перечня.
<b>Региональный орган власти</b>	исполнительный орган государственной власти субъекта Российской Федерации, осуществляющий составление и организацию исполнения бюджета субъекта Российской Федерации (министерство финансов, департамент финансов, управление финансов и др.).
<b>Режим урегулирования -</b>	установленные Правилами клиринга ограничения, действующие для Расчетного кода. Режим урегулирования устанавливается и снимается Клиринговым центром в порядке и случаях, определенных Правилами клиринга.
<b>Резидент -</b>	юридическое лицо, являющееся резидентом в соответствии с законодательством Российской Федерации о валютном регулировании и валютном контроле.
<b>Рынок -</b>	Биржевой и Внебиржевой рынок совместно, или один из рынков. В Правилах клиринга Рынками называются: (1) фондовый рынок, рынок депозитов и рынок кредитов, (2) валютный рынок и рынок драгоценных металлов, (3) срочный рынок, (4) товарный рынок, (5) рынок Стандартизированных ПФИ.
<b>Сайт Клирингового центра -</b>	сайт в сети Интернет по адресу <a href="http://www.nationalclearingcentre.ru">www.nationalclearingcentre.ru</a> , на котором Клиринговым центром осуществляется раскрытие информации как клиринговой организацией и центральным контрагентом.
<b>Сделка -</b>	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.
<b>Сделка РЕПО Клирингового центра -</b>	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.
<b>Сделка с частичным обеспечением -</b>	Сделка, по которой Клиринговый центр осуществляет клиринг с частичным обеспечением, в том числе Срочная сделка и Договор СПФИ.
<b>Сделка T+ -</b>	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, рынке депозитов и рынке кредитов и/или Правилами клиринга, а также Сделка РЕПО Клирингового центра.
<b>Спецификация -</b>	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.

<b>Счет для возврата обеспечения -</b>	<p>зарегистрированный в Клиринговом центре счет, предназначенный для перечисления на него денежных средств / драгоценных металлов с целью исполнения обязательств Клирингового центра по возврату Обеспечения / Обеспечения под стресс / взносов в Гарантийные фонды / имущества из имущественного пула.</p> <p>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 (если иное не установлено нормативными правовыми актами Российской Федерации, нормативными актами Банка России и не противоречит требованиям внутреннего контроля / комплаенс-процедур Клирингового центра).</p> <p>В качестве Счета для возврата обеспечения в драгоценных металлах может выступать открытый в Клиринговом центре банковский счет в драгоценных металлах Участника клиринга.</p>
<b>СЭД ПАО Московская Биржа -</b>	Система электронного документооборота ПАО Московская Биржа.
<b>Тарифы Клирингового центра -</b>	внутренний документ Клирингового центра, устанавливающий размер оплаты клиринговых услуг, оказываемых Клиринговым центром Участникам клиринга и иным лицам в соответствии с Правилами клиринга.
<b>Технический центр -</b>	организация, указанная в специальной части Правил клиринга, обеспечивающая Участникам клиринга технический доступ к Клиринговой системе на соответствующем Рынке на основании соответствующего договора.
<b>Торгово-клиринговый счет -</b>	Торгово-клиринговый счет Участника клиринга / Торгово-клиринговый счет 1-го уровня, или Торгово-клиринговый счет Гарантийных фондов, или Торгово-клиринговый счет Обеспечения под стресс, или Торгово-клиринговый счет имущественного пула, или Торгово-клиринговый счет для учета Обеспечения под риски концентрации на эмитентов или Торгово-клиринговый счет для уплаты налогов.
<b>Торгово-клиринговый счет Участника клиринга / Торгово-клиринговый счет 1-го уровня -</b>	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 T0, Раздел, торговый раздел торгового товарного счета. К Торгово-клиринговым счетам Участника клиринга / Торгово-клиринговым счетам 1-го уровня

	<p>относятся Торгово-клиринговый счет на фондовом рынке, Торгово-клиринговый счет для заключения депозитных договоров, Торгово-клиринговый счет на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, а также Торгово-клиринговый счет, используемый на товарном рынке.</p> <p>Если иное не вытекает из существа положений Правил клиринга, или не установлено решением Клирингового центра, положения Правил клиринга, применимые для Торгово-клирингового счета Участника клиринга / Торгово-клирингового счета 1-го уровня, применяются также в отношении Торгово-клирингового счета нерезидента.</p>
<b>Торгово-клиринговый счет 2-го уровня -</b>	<p>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.</p> <p>Если иное не вытекает из существа положений Правил клиринга, или не установлено решением Клирингового центра, положения Правил клиринга, применимые для Торгово-клирингового счета 2-го уровня, применяются также в отношении Торгово-клирингового счета нерезидента 2-го уровня.</p>
<b>Торгово-клиринговый счет 3-го уровня -</b>	<p>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.</p> <p>Если иное не вытекает из существа положений Правил клиринга, или не установлено решением Клирингового центра, положения Правил клиринга, применимые для Торгово-клирингового счета 3-го уровня, применяются также в отношении Торгово-клирингового счета 3-го уровня нерезидента.</p>
<b>Торгово-клиринговый счет Гарантийных фондов -</b>	<p>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.</p>
<b>Торгово-клиринговый счет для уплаты налогов -</b>	<p>клиринговый регистр, определяющий набор счетов, на которых учитываются денежные средства / ценные бумаги, внесенные Участником клиринга для обеспечения исполнения обязательств Участника клиринга по уплате сумм, соответствующих суммам налога на прибыль организаций с доходов иностранных организаций от источников в Российской Федерации и исполнения таких обязательств, а также иных</p>



	обязательств в соответствии с Правилами клиринга, и/или предназначенный для учета информации о ценных бумагах, внесенных Участником клиринга для обеспечения таких обязательств.
<b>Торгово-клиринговый счет для учета Обеспечения под риски концентрации на эмитентов -</b>	клиринговый регистр, определяющий набор счетов, на которых учитываются денежные средства / ценные бумаги, внесенные Участником клиринга в качестве Обеспечения под риски концентрации на эмитентов, и/или предназначенный для учета информации о ценных бумагах, внесенных Участником клиринга в качестве Обеспечения под риски концентрации на эмитентов.
<b>Торгово-клиринговый счет имущественного пула -</b>	клиринговый регистр 1-го уровня, определяющий набор счетов, на которых учитываются денежные средства / драгоценные металлы / ценные бумаги, внесенные Участником клиринга в соответствующий имущественный пул.
<b>Торгово-клиринговый счет нерезидента -</b>	клиринговый регистр 1-го уровня, определяющий набор счетов, по которым должны исполняться обязательства по Сделке, заключенной в интересах и (или) за счет Нерезидента из перечня, либо Нерезидентом из перечня, и/или предназначенный для учета информации об Обеспечении Участника клиринга в ценных бумагах. В состав Торгово-клирингового счета нерезидента могут входить Расчетный код нерезидента, Раздел.
<b>Торгово-клиринговый счет нерезидента 2-го уровня -</b>	клиринговый регистр 2-го уровня, открываемый по требованию Участника клиринга, связанный с Торгово-клиринговым счетом нерезидента. В состав Торгово-клирингового счета нерезидента 2-го уровня входит Расчетный код нерезидента 2-го уровня.
<b>Торгово-клиринговый счет нерезидента 3-го уровня -</b>	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 нерезидента 2-го уровня. В состав Торгово-клирингового счета нерезидента 3-го уровня входит Расчетный код нерезидента 3-го уровня.
<b>Торгово-клиринговый счет Обеспечения под стресс -</b>	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.
<b>Уполномоченный участник клиринга -</b>	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 Рынках, на которых Клиринговый центр осуществляет функции клиринговой организации и

	центрального контрагента.
<b>Участник клиринга -</b>	юридическое лицо, которому Клиринговый центр оказывает клиринговые услуги на основании заключенного с ним Договора об оказании клиринговых услуг.
<b>Участник клиринга – поставщик ликвидности -</b>	Участник клиринга – нерезидент, не являющийся Нерезидентом из перечня, целью получения допуска к клиринговому обслуживанию на соответствующем Рынке которого является поддержание и повышение ликвидности инструментов в одной или нескольких валютах.
<b>Участник торгов, совпадающий в одном лице с Участником клиринга -</b>	Участник торгов, являющийся стороной по Сделке, заключенной им на торгах.
<b>Участник торгов, не совпадающий в одном лице с Участником клиринга -</b>	Участник торгов, не являющийся стороной по Сделке, заключенной им на торгах.
<b>Ценные бумаги -</b>	акции / облигации (в том числе структурные) / инвестиционные паи / депозитарные расписки / клиринговые сертификаты участия как они определены законодательством Российской Федерации.
<b>ЭДО -</b>	электронный документооборот, организуемый ПАО Московская Биржа и Клиринговым центром, используемый Клиринговым центром для взаимодействия с участниками СЭД ПАО Московская Биржа и Организатором СЭД.
<b>FATCA -</b>	закон США «О налогообложении иностранных счетов», целью которого является противодействие уклонению от налогообложения в США доходов американских налогоплательщиков, полученных через финансовые институты за пределами США.

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 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, а также иные способы, определенные Правилами клиринга и/или Законом о клиринге. Условия формирования Обеспечения, Обеспечения под стресс и Гарантийных фондов устанавливаются Правилами клиринга.

Удовлетворение требований Клирингового центра осуществляется способами, установленными Правилами клиринга и (или) Законом о клиринге за счет имущества, внесенного на Расчетные коды (Счета обеспечения) / Торгового-клиринговые счета Участника клиринга.

- 3.5.1. Обеспечение / Обеспечение под стресс в российских рублях, ценных бумагах, драгоценных металлах и товарах является индивидуальным клиринговым обеспечением.
- 3.5.2. Обеспечение / Обеспечение под стресс в иностранной валюте может являться индивидуальным клиринговым обеспечением или иным обеспечением.
- 3.5.3. Иным обеспечением является Обеспечение Участника клиринга в иностранной валюте, не являющееся индивидуальным клиринговым обеспечением, которое является имуществом, переданным Участником клиринга Клиринговому центру и используется для обеспечения исполнения обязательств Участника клиринга перед Клиринговым центром по Сделкам с центральным контрагентом в соответствии с Правилами клиринга и для исполнения обязательств Участника клиринга перед Клиринговым центром по Сделкам, а также для обеспечения исполнения иных обязательств, в том числе нетто-обязательств Участника клиринга, определяемых в порядке и случаях, установленных статьями 58-62 общей части Правил клиринга, и для исполнения указанных иных обязательств.
- 3.5.4. Клиринговый центр вправе своим решением установить перечень иностранных валют, Обеспечение / Обеспечение под стресс в которых являются только индивидуальным клиринговым обеспечением, информация о котором раскрывается на Сайте Клирингового центра.
- 3.5.5. Клиринговый центр вправе принять решение о том, что Обеспечение в иностранной валюте, учитываемое по всем Расчетным кодам на одном или нескольких Рынках, включая Обеспечение под стресс, является иным обеспечением. Информация об указанном решении раскрывается на Сайте Клирингового центра.
- 3.5.6. Обеспечение / Обеспечение под стресс в иностранной валюте, являющееся индивидуальным клиринговым обеспечением, вносится на клиринговые банковские счета Клирингового центра, открытые в Расчетной организации, Обеспечение / Обеспечение под стресс в иностранной валюте, являющееся иным обеспечением, - на корреспондентские счета Клирингового центра, открытые в Расчетном банке, или на клиринговые банковские счета Клирингового центра, открытые в Расчетной организации.

- 3.5.7. Обеспечение Участника клиринга на одном Рынке во всех иностранных валютах, за исключением иностранных валют, указанных в решении Клирингового центра, принятом в соответствии с подпунктом 3.5.4 общей части Правил клиринга, и иностранных валют, учитываемых по Расчетному коду Единого пула, определенному в статье 21 общей части Правил клиринга, может являться либо индивидуальным клиринговым обеспечением, либо иным обеспечением.

Правилами клиринга установлен порядок перехода с использования Обеспечения / Обеспечение под стресс в иностранной валюте, являющегося индивидуальным клиринговым обеспечением, на Обеспечение / Обеспечение под стресс 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 3.5.4 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 16 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 17 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 59 общей части Правил клиринга), ликвидационного неттинга в отношении Клирингового центра (в соответствии со статьей 62 общей части Правил клиринга), расчета нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга в случае дефолта Клирингового центра в отношении Участника клиринга (в соответствии со статьей 61 общей части Правил клиринга), расчета нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга 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 (в соответствии со статьей 58 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 50 общей части Правил клиринга), ликвидационного неттинга в отношении Участника клиринга (в соответствии со статьей 59 общей части Правил клиринга), ликвидационного неттинга в отношении Клирингового центра (в соответствии со статьей 62 общей части Правил клиринга), расчета нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга в случае дефолта Клирингового центра в отношении Участника клиринга (в соответствии со статьей 61 общей части Правил клиринга), расчета нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга 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 (в соответствии со статьей 58 общей части Правил клиринга), случаев неисполнения Участником клиринга Маржинальных требований по фондам / обеспечению под стресс (в соответствии со статьей Статья 36 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 внесенные в качестве Обеспечения ценные бумаги / товары, учитываемые 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 50 общей части Правил клиринга), ликвидационного неттинга в отношении Участника клиринга (в соответствии со статьей 59 общей части Правил клиринга), ликвидационного неттинга в отношении Клирингового центра (в соответствии со статьей 62 общей части Правил клиринга), расчета нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга в случае дефолта Клирингового центра в отношении Участника клиринга (в соответствии со статьей 61 общей части Правил клиринга), расчета нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга 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 (в соответствии со статьей 58 общей части Правил клиринга), случаев неисполнения Участником клиринга Маржинальных требований по фондам / обеспечению под стресс (в соответствии со статьей Статья 36 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 57 общей части Правил клиринга.
- 3.8. Перечень видов используемых торговых и клиринговых счетов приведен в статье 10 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 и/или путем направления Участникам клиринга в форме электронного документа посредством ЭДО.
- Об изменениях реквизитов указанных счетов Клиринговый центр извещает Участников клиринга способами, аналогичными способам размещения информации о реквизитах счетов, указанным выше в настоящем пункте общей части Правил клиринга, 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 (другого) 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 и драгоценных металлов, 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 Рынков, в отношении которых Клиринговый центр взимает комиссионное вознаграждение за учет Обеспечения.

- 3.11. Клиринговый центр вправе использовать в своих интересах денежные средства и драгоценные металлы, составляющие индивидуальное и/или коллективное клиринговое обеспечение, а также иное обеспечение Участников клиринга в иностранной валюте, 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 и/или иное 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 и/или иное обеспечение.
- 3.12.1. Решение Клирингового центра о начислении и выплате Участникам клиринга процентов на денежные средства, составляющие индивидуальное и/или коллективное клиринговое обеспечение и/или иное обеспечение, должно содержать перечень видов индивидуального и/или коллективного клирингового обеспечения и/или иного 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 Рынков.
- 3.12.3. Проценты на денежные средства, составляющие индивидуальное и/или коллективное клиринговое обеспечение и/или иное обеспечение, включаются в состав соответствующего индивидуального или коллективного клирингового обеспечения или иного 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, и/или Клирингового терминала, и/или Web-клиринга, и/или системы S.W.I.F.T. и/или через систему передачи финансовых сообщений Банка России (далее – СПФС Банка России).

- 3.14.1. Порядок формирования и передачи электронных документов посредством ЭДО, Клирингового терминала, Web-клиринга предусмотрен Правилами электронного документооборота Московской Биржи и Порядком ЭДО.
- 3.14.2. Электронные документы, направляемые посредством ЭДО, в том числе с использованием Web-клиринга, формируются в форматах, предусмотренных 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 Клирингового терминала. Документ, содержащий описание форматов, поддерживаемых программным обеспечением Клирингового терминала, 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. или через СПФС Банка России, формируются в форматах, установленных стандартами S.W.I.F.T., с учетом особенностей, предусмотренных документом Клирингового центра. Указанный документ раскрывается Клиринговым центром путем размещения на Сайте Клирингового центра.
- 3.15. Предложения и иные электронные сообщения, документы, подписанные ПЭП Участника клиринга и направляемые Участником клиринга Клиринговому центру с использованием Клиринговой системы, признаются электронными документами, равнозначными документам, совершенным в письменной форме на бумажном носителе, и подписанными собственноручной подписью представителя Участника клиринга.

Документы, электронные сообщения, и информация, получаемые Участником клиринга из Клиринговой системы, признаются электронными документами, равнозначными документам, совершенным в письменной форме на бумажном носителе, и подписанными собственноручной подписью уполномоченного лица Клирингового центра.

Порядок использования ПЭП определен в статье 9 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, по системе S.W.I.F.T., через СПФС Банка России или в бумажной форме, а также формы и форматы предоставляемых документов, установлены соответствующими документами Клирингового центра (соответствующими частями документов Клирингового центра), если Правилами клиринга не установлен иной порядок. 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.



- 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 Временным регламентом или временными регламентами, являющимися приложениями к соответствующим специальным частям Правил клиринга, 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. Клиринговый центр вправе извещать Участников клиринга об изменении времени (сроков) проведения отдельных операций в более короткий срок в случае наступления обстоятельств, не позволяющих известить Участников клиринга в срок не менее, чем за 2 (два) Расчетных дня до даты такого изменения, в том числе, в случае изменения сроков проведения операций Расчетными организациями, Расчетными банками, Расчетным депозитарием.

- 3.18. Клиринговый центр вправе принять решение об ограничении проведения отдельных операций в определенный Расчетный день (определенные Расчетные дни). 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 (начиная с которого) указанные ограничения будут действовать, если иной срок извещения Участников клиринга не определен решением Клирингового центра.
- 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 и иных обязательств, определенных Правилами клиринга, 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. Заверения Участников клиринга / Участников торгов, заключивших договор о ведении клиринговых регистров**

- 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 присоединяется к Порядку ЭДО и соглашается с его условиями.

Заключая Договор об оказании клиринговых услуг, Участник клиринга дает согласие на обмен электронными документами, предусмотренными настоящими Правилами клиринга, в том числе при подаче и отзыве Предложений. Указанное соглашение заключается во исполнение ч. 2 ст. 6 Федерального закона «Об электронной подписи», в соответствии с которой, электронный документ, подписанный простой электронной подписью, признается равнозначным документу на бумажном носителе, подписанному собственноручной подписью.

- 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 55 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, в том числе обязательств по Сделкам и обязательств из Правил клиринга, срок исполнения которых не наступил, 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 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 Рынков в связи с приостановлением 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 Рынках, на которых Участник клиринга был допущен к клиринговому обслуживанию. Действие Договора об оказании клиринговых услуг прекращается с даты прекращения допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию на последнем Рынке;
  - 2) ликвидации Участника клиринга или прекращения его деятельности в случае реорганизации (за исключением реорганизации в форме преобразования). Действие Договора об оказании клиринговых услуг прекращается с даты ликвидации / реорганизации (за исключением реорганизации в форме преобразования) Участника клиринга.
- 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 или торговый счет депо владельца типа «С» 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 статей 58, 59 и 62 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 59 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. О прекращении действия Договора об оказании клиринговых услуг Клиринговый центр уведомляет Участника клиринга не позднее рабочего дня, следующего за днем прекращения указанного договора.
- 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. Такое лицо дает также заверения в том, что заключение каких-либо Сделок в рамках Правил клиринга или в связи с ними, как с таким лицом, так и в отношении этого лица (включая, но не ограничиваясь, совершение закрывающих или балансирующих сделок), а также совершение каких-либо иных действий в рамках Правил клиринга как самим этим лицом, так и в отношении этого лица, не приведет ни при каких обстоятельствах к нарушению какого-либо положения законодательства, нормативных актов, в том числе устанавливающих временные меры экономического характера (специальные экономические меры), ни в отношении этого лица, ни в отношении лица, за счет которого заключаются Сделки, в том числе, если такое лицо является Нерезидентом из перечня, ни в

отношении какого-либо имущества, являющегося предметом таких сделок. Заверения, указанные в настоящем пункте общей части Правил клиринга, даются лицом, обращающимся за допуском к клиринговому обслуживанию / Участником клиринга / Участником торгов, заключившим договор о ведении клиринговых регистров, каждый из которых может действовать как в своих собственных интересах / за свой счет, так и в интересах / за счет иных лиц – брокер, доверительный управляющий, управляющая компания либо иной статус, предполагающий действие в интересах и/или за счет другого лица, в том числе статус, определяемый в соответствии с применимым личным законом. Указанные заверения имеют существенное значение для сторон Договора об оказании клиринговых услуг / договора о ведении клиринговых регистров.

В случае если Участник клиринга / Участник торгов, заключивший договор о ведении клиринговых регистров, осуществляет предусмотренные Правилами клиринга действия, в том числе иницируя проведение Клиринговым центром каких-либо процедур, предусмотренных Правилами клиринга, в результате исполнения которых, по оценке Клирингового центра, могут быть нарушены указанные заверения, Клиринговый центр вправе приостановить указанные действия, в том числе отказав в осуществлении каких-либо процедур, предусмотренных Правилами клиринга, инициированных таким Участником клиринга / Участником торгов. 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 приостановить допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию и/или прекратить действие договора о ведении клиринговых регистров, заключенного с Участником торгов, 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.

Участник клиринга / Участник торгов, заключивший договор о ведении клиринговых регистров, обязан уведомить Клиринговый центр об отмене доверенности, выданной Участником клиринга / Участником торгов, заключившим договор о ведении клиринговых регистров, для представления его интересов перед Клиринговым центром путем направления соответствующего сообщения Клиринговому центру не позднее 1 (одного) рабочего дня с даты принятия решения об отмене доверенности, но не позднее рабочего дня, следующего за днём отмены такой доверенности.

Участник клиринга / Участник торгов, заключивший договор о ведении клиринговых регистров, заверяет, что лицо, действующее от его имени, в том числе, подписавшее Договор об оказании клиринговых услуг / договор о ведении клиринговых регистров и иные документы, предусмотренные Правилами клиринга, обладает достаточными полномочиями для заключения соответствующего договора и подписания соответствующих документов. Указанные заверения имеют существенное значение для сторон Договора об оказании клиринговых услуг / договора о ведении клиринговых регистров.

Участник клиринга / Участник торгов, заключивший договор о ведении клиринговых регистров, заверяет, что принимает все меры, необходимые для предотвращения любого несанкционированного доступа к ЭДО, Клиринговой системе и/или Клиринговому терминалу и/или Web-клирингу и/или системе S.W.I.F.T. и/или системе передачи финансовых сообщений Банка России и/или Рабочему месту Участника клиринга. Участник клиринга / Участник торгов, заключивший договор о ведении клиринговых регистров, заверяет, что обеспечивает надлежащее использование этих средств, оборудования, программного обеспечения, сервисов и контроль над ними. Если лицо получило доступ к указанным выше средствам, оборудованию, программному обеспечению, сервисам, полномочия этого лица на осуществление действий от имени Участника клиринга / Участника торгов, заключившего договор о ведении клиринговых регистров, считаются явствующими из обстановки, в которой действует это лицо. К числу обстоятельств, свидетельствующих о наличии у лица необходимых полномочий, относится среди прочего отправление сообщений и документов по указанным средствам связи, используемым сторонами при совершении Сделок и операций и/или обмене документами и сообщениями. Заключение Сделки и/ или проведение операции в результате действий такого лица создает для стороны Договора о клиринговом обслуживании / договора о ведении клиринговых регистров гражданские права и обязанности по данной Сделке / операции в соответствии с ее условиями и Правилами клиринга с момента ее заключения / проведения.

## **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 20 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, внесенном с указанием соответствующего клирингового регистра 3-го уровня, и об Обеспечении в ценных бумагах и драгоценных металлах, информация о котором учитывается по соответствующему клиринговому регистру 3-го уровня, а также о возникновении и прекращении обязательств по Сделкам, заключенным Участником торгов с указанием соответствующего клирингового регистра 3-го уровня (порядок определен в

- статье 41 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 25 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. Договор о ведении клиринговых регистров предоставляется Участником торгов в Клиринговый центр в бумажной форме, подписанный уполномоченным лицом юридического лица и скрепленный печатью юридического лица (при наличии), и/или в форме электронного документа. Договор о ведении клиринговых регистров в форме электронного документа предоставляется посредством ЭДО. Электронный документ имеет ту же юридическую силу, что и документ в бумажной форме, подписанный собственноручной подписью уполномоченного лица юридического лица и скрепленный печатью юридического лица.
- 5.4.2. Права и обязанности сторон по Договору о ведении клиринговых регистров возникают с даты его заключения. Датой заключения Договора о ведении клиринговых регистров является дата присвоения Клиринговым центром такому договору номера. Клиринговый центр в срок не позднее следующего рабочего дня информирует Участника торгов о присвоении Договору о ведении клиринговых регистров номера путем направления соответствующего уведомления. Присвоение Клиринговым центром номера Договору о ведении клиринговых регистров осуществляется не позднее 10 (десяти) рабочих дней с даты предоставления Участником торгов полного комплекта документов и сведений, предусмотренных подпунктом 5.4.3 общей части Правил клиринга. В случае если Участником торгов Клиринговому центру был представлен неполный комплект требуемых документов и сведений, и/или Клиринговым центром затребованы дополнительные документы и сведения, указанный срок исчисляется с даты получения Клиринговым центром всех истребованных документов и сведений, необходимых для заключения Договора о ведении клиринговых регистров.
- 5.4.3. 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.

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 Участник торгов по предварительному согласованию с Клиринговым центром может быть освобожден от обязанности повторного предоставления этого документа.

- 5.4.4. 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 присоединяется к Порядку ЭДО и соглашается с его условиями.

Заключая договор о ведении клиринговых регистров, Участник торгов дает согласие на обмен электронными документами, предусмотренными настоящими Правилами клиринга. Указанное соглашение заключается во исполнение ч. 2 ст. 6 Федерального закона «Об электронной подписи», в соответствии с которой, электронный документ, подписанный простой электронной подписью, признается равнозначным документу на бумажном носителе, подписанному собственноручной подписью.

Электронные сообщения, документы, подписанные ПЭП Участника торгов и направляемые Участником торгов Клиринговому центру с использованием Клиринговой системы, признаются электронными документами, равнозначными документам, совершенным в письменной форме на бумажном носителе, и подписанными собственноручной подписью представителя Участника клиринга.

Документы, электронные сообщения, и информация, получаемые Участником торгов из Клиринговой системы, признаются электронными документами, равнозначными документам, совершенным в письменной форме на бумажном носителе, и подписанными собственноручной подписью уполномоченного лица Клирингового центра.

Порядок использования ПЭП определен в статье 9 общей части Правил клиринга.

- 5.7. Клиринговые услуги по открытию клиринговых регистров 3-го уровня оказываются Клиринговым центром Участнику торгов.
- 5.8. Участник торгов, получающий в рамках исполнения Договора о ведении клиринговых регистров доступ к инсайдерской информации Клирингового центра о возникновении и прекращении обязательств по Сделкам, заключенным Участником торгов с указанием соответствующего клирингового регистра 3-го уровня, и информации об Обеспечении в денежных средствах, внесенном с указанием соответствующего клирингового регистра 3-го уровня, и об Обеспечении в ценных бумагах и драгоценных металлах, информация о котором учитывается по соответствующему клиринговому регистру 3-го уровня, подтверждает, что при заключении Договора о ведении клиринговых регистров, был проинформирован:
- 1) о требованиях Федерального закона от 27 июля 2010 г. № 224-ФЗ «О противодействии неправомерному использованию инсайдерской информации и манипулированию рынком и о внесении изменений в отдельные



законодательные акты Российской Федерации» (далее – Закон № 224-ФЗ) и принятых в соответствии с ним нормативных актах Банка России;

- 2) об ответственности за неправомерное использование инсайдерской информации;
- 3) о том, что он будет включен в список инсайдеров Клирингового центра в соответствии с требованиями Закона № 224-ФЗ и в порядке, предусмотренном нормативными актами Банка России;
- 4) о том, что инсайдерская информация может быть передана Участнику торгов на основании Договора о ведении клиринговых регистров только после включения его в список инсайдеров Клирингового центра.

5.9. В случае непредоставления Участником торгов Клиринговому центру запроса, предусмотренного подпунктом 18.3.2 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 18.3.2 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 18.3.3 общей части Правил клиринга, услуги по ведению соответствующих клиринговых регистров 3-го уровня оказываются Клиринговым центром Участнику торгов.

5.10. 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.

5.11. Общий порядок оплаты услуг Клирингового центра по договору о ведении клиринговых регистров определен в статье 55 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.

5.12. 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.

- 5.13. 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.
- 5.14. 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.
- 5.15. Действие договора о ведении клиринговых регистров, приостановленное на основании пункта 5.14 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.
- 5.16. Плата за предоставление услуг по договору о ведении клиринговых регистров в период приостановления действия указанного договора не взимается.
- 5.17. Действие договора о ведении клиринговых регистров прекращается в следующих случаях:
- 1) в случае прекращения допуска Участника торгов к торгам на всех Рынках, на которых Участник торгов был допущен к торгам;
  - 2) в случае, если действие договора о ведении клиринговых регистров, приостановленное на основании пункта 5.14 общей части Правил клиринга, не было возобновлено в течение 6 (шести) месяцев с момента приостановления.
- Действие договора о ведении клиринговых регистров может быть прекращено в связи с нарушением Участником торгов, предусмотренных Правилами клиринга заверений, а также неоднократным нарушением Участником торгов положений Правил клиринга, в том числе неисполнением им условий договора о ведении клиринговых регистров.
- 5.18. Прекращение действия договора о ведении клиринговых регистров не освобождает Участника торгов и Клиринговый центр от исполнения обязательств, возникших до прекращения действия указанного договора. О прекращении действия договора о ведении клиринговых регистров Клиринговый центр уведомляет Участника торгов не позднее рабочего дня, следующего за днем прекращения указанного договора.
- 5.19. 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 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 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 Бирже становится доступной информация об обязательствах и обеспечении Участника клиринга.
- 6.6. Клиринговый центр вправе передавать компаниям Группы «Московская Биржа» (ПАО Московская Биржа и (или) НКО АО НРД, и (или) АО НТБ) документы и информацию, предоставленные юридическим лицом для заключения Договора об оказании клиринговых услуг/Участником клиринга в Клиринговый центр в соответствии с Правилами клиринга. Документы и информация в отношении юридических лиц, обратившихся в Клиринговый центр для заключения Договора об оказании клиринговых услуг/Участников клиринга передаются в компании Группы «Московская Биржа» в случае осуществления такой компанией процесса допуска/ обслуживания или наличия действующего договора с юридическим лицом, обратившимся в Клиринговый центр для заключения Договора об оказании клиринговых услуг/Участником клиринга с соответствующей компанией Группы «Московская Биржа» в объеме, необходимом такой компании в соответствии с установленными ею требованиями в целях принятия и дальнейшего обслуживания указанного юридического лица/Участника клиринга, в том числе, в целях выполнения требований законодательства по противодействию легализации (отмыванию) доходов, полученных преступным путем и финансированию терроризма в порядке, установленном целевыми правилами внутреннего контроля, а также в целях недопущения нарушения указанного законодательства, в том числе в результате подачи заявок и заключении сделок на организованных торгах.
- 6.7. 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 необходимым 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.

- 6.8. В случае если в составе документов, предоставляемых Клиринговому центру для целей, указанных в Статье 12 и Статья 23 общей части Правил клиринга, а также для целей выполнения Клиринговым центром иных возложенных на него законодательством Российской Федерации функций, полномочий и обязанностей, содержатся сведения о персональных данных физических лиц, то их обработка осуществляется Клиринговым центром без согласия субъекта персональных данных в соответствии с законодательством Российской Федерации в области персональных данных.

В отношении иных предоставляемых в Клиринговый центр документов и сведений, в которых содержатся персональные данные физических лиц, Клиринговый центр руководствуется установленными в Правилах клиринга и заявлениях (запросах) Участника клиринга заверениями о получении юридическими лицами / Участниками клиринга необходимых письменных согласий указанных физических лиц на обработку их персональных данных Клиринговым центром.

Юридическое лицо / Участник клиринга обязуется предоставить в Клиринговый центр по первому требованию (в том числе в связи с поступлением в Клиринговый центр запроса от уполномоченных государственных органов) полученные им от указанных субъектов персональных данных согласия на обработку персональных данных, предусматривающие обработку персональных данных в целях осуществления Клиринговым центром любых прав и обязанностей, связанных с исполнением договора об оказании клиринговых услуг. Юридическое лицо / Участник клиринга подтверждает, что предоставил субъектам персональных данных информацию, предусмотренную пунктом 3 статьи 18 Федерального закона от 27.07.2006 г. № 152-ФЗ «О персональных данных».

- 6.9. Указанные в настоящей статье положения, определяющие режим конфиденциальности, применяются в течение 5 (пяти) лет с момента прекращения действия Договора об оказании клиринговых услуг / договора о ведении клиринговых регистров.
- 6.10. Особенности применения настоящей статьи общей части Правил клиринга могут быть установлены в соответствующей специальной части Правил клиринга.

**Статья 7. Выполнение Клиринговым центром функций налогового агента в отношении доходов иностранных организаций от источников в Российской Федерации**

- 7.1. Клиринговый центр в установленных российским налоговым законодательством случаях как налоговый агент удерживает и уплачивает в бюджет Российской Федерации сумму налога на прибыль организаций с доходов иностранных организаций от источников в Российской Федерации.
- 7.2. В целях выполнения Клиринговым центром функций налогового агента Участник клиринга – Нерезидент и Участник клиринга – Международная организация обязаны предоставить в отношении себя и каждого лица, в том числе иностранной структуры без образования юридического лица, которое имеет фактическое право на получаемый доход (доходы) в соответствии с положениями статьи 7 Налогового кодекса Российской Федерации (далее - фактический получатель дохода), в интересах которого они будут становиться стороной по Сделкам, заключаемым с Клиринговым центром, документы, предусмотренные приложением № 4 к общей части Правил клиринга.
- 7.2.1. Клиринговый центр осуществляет регистрацию фактических получателей дохода таких Участников клиринга на основании предоставленных документов. Для целей регистрации иностранные структуры без образования юридического лица могут быть приравнены к фактическим получателям дохода.
- 7.2.2. В качестве фактического получателя дохода Участника клиринга не может быть зарегистрировано физическое лицо, российская организация (так как она определяется в статье 11 Налогового кодекса Российской Федерации) и иностранная организация, если получаемый доход (доходы), указанный (указанные) в Правилах клиринга, будет относиться к постоянному представительству такой иностранной организации в Российской Федерации.
- 7.2.3. Клиринговый центр вправе отказать Участнику клиринга в регистрации лица в качестве фактического получателя дохода Участника клиринга или аннулировать регистрацию фактического получателя дохода Участника клиринга в случае предоставления Участником клиринга недостоверных / неполных сведений или сведений, не позволяющих идентифицировать однозначно фактического получателя дохода, а также при наличии риска потери деловой репутации Клирингового центра в случае заключения сделок с Участником клиринга в интересах такого лица.
- 7.3. В связи с выполнением функций налогового агента в отношении доходов Участников клиринга – Нерезидентов или Участников клиринга – Международных организаций или зарегистрированных такими Участниками клиринга фактических получателей дохода Клиринговый центр вправе своим решением ограничить инструменты, по которым Участники клиринга – Нерезиденты или Участники клиринга – Международные организации вправе становиться сторонами по Сделкам, в том числе в интересах фактических получателей дохода. Информация о принятых Клиринговым центром решениях об ограничении инструментов, по которым Участники клиринга – Нерезиденты или Участники клиринга – Международные организации вправе становиться сторонами по Сделкам, в том числе в интересах фактических получателей дохода, размещается на Сайте

- Клирингового центра. Такое решение Клирингового центра вступает в силу через 3 (три) рабочих дня с даты размещения соответствующей информации, если в самом решении не указан иной срок вступления его в силу.
- 7.4. При получении Клиринговым центром от Биржи информации о поданной заявке / Котировке участника торгов/ при подаче Участником клиринга Предложения на заключение сделки, стороной по которым будет являться Участник клиринга – Нерезидент или Участник клиринга – Международная организация в интересах лица, не зарегистрированного Клиринговым центром в качестве фактического получателя дохода такого Участника клиринга, или в интересах лица и по инструменту, по которым Клиринговым центром принято решение в соответствии с пунктом 7.3 общей части Правил клиринга, за исключением заявок / Предложений на заключение сделок спот и сделок своп с иностранной валютой, Клиринговый центр направляет Бирже информацию (отчет) о невозможности регистрации заявки / Котировки участника торгов / Клиринговый центр направляет Участнику клиринга отказ в регистрации Предложения.
- 7.5. Клиринговый центр рассчитывает сумму налога на прибыль организаций с доходов иностранных организаций от источников в Российской Федерации, подлежащую удержанию с Участника клиринга – Нерезидента или Участника клиринга – Международной организации, в том числе с доходов фактического получателя дохода таких Участников клиринга, в порядке и сроки, установленные Налоговым кодексом Российской Федерации.
- 7.6. Обязательство Участника клиринга по уплате суммы, соответствующей сумме налога на прибыль организаций с доходов иностранных организаций от источников в Российской Федерации, учитывается по Расчетному коду Участника клиринга, по которому учтен доход по Сделке или иной доход иностранной организации от источников в Российской Федерации.
- 7.7. Участник клиринга вправе заменить Расчетный код, по которому должны учитываться и исполняться обязательства по уплате суммы, соответствующей сумме налога на прибыль организаций с доходов иностранных организаций от источников в Российской Федерации.
- 7.8. Для осуществления замены, указанной в пункте 7.7 общей части Правил клиринга, Участник клиринга обязан:
- 7.8.1. предоставить Клиринговому центру Запрос на открытие Торгово-клирингового счета для уплаты налогов (если Торгово-клиринговый счет для уплаты налогов не открыт).
- 7.8.2. предоставить Клиринговому центру Заявление на включение (исключение) Расчетного кода в список (из списка) Расчетных кодов, по которым обязательства по уплате сумм, соответствующих суммам налога на прибыль организаций с доходов иностранных организаций от источников в Российской Федерации, учитываются и исполняются с Расчетного кода для уплаты налогов, в котором указан Расчетный код, предусмотренный в пункте 7.6 общей части Правил клиринга.

- 7.9. Заявление, указанное в подпункте 7.8.2 общей части Правил клиринга, содержащее указание на включение Расчетного кода в список Расчетных кодов, по которым обязательства по уплате сумм, соответствующих суммам налога на прибыль организаций с доходов иностранных организаций от источников в Российской Федерации учитываются и исполняются с Расчетного кода для уплаты налогов (далее – список Расчетных кодов, связанных с Расчетным кодом для уплаты налогов) исполняется при соблюдении следующего условия:

Расчетный код, который необходимо включить в список Расчетных кодов, связанных с Расчетным кодом для уплаты налогов, является Расчетным кодом нерезидента и не может являться Расчетным кодом, открытым для Обособленного клиента или Расчетным кодом, с которым связана Обособленная Брокерская фирма.

- 7.10. Заявление, указанное в подпункте 7.8.2 общей части Правил клиринга, содержащее указание на исключение Расчетного кода из списка Расчетных кодов, связанных с Расчетным кодом для уплаты налогов, исполняется при соблюдении следующего условия:

По Расчетному коду для уплаты налогов не учитываются обязательства по уплате сумм, соответствующих суммам налога на прибыль организаций с доходов иностранных организаций от источников в Российской Федерации, которые учитываются на Расчетном коде, который необходимо исключить из списка Расчетных кодов, связанных с Расчетным кодом для уплаты налогов.

- 7.11. Заявление, указанное в подпункте 7.8.2 общей части Правил клиринга, исполняется не позднее следующего Расчетного дня.

- 7.12. После исполнения заявления, указанного в подпункте 7.8.2 общей части Правил клиринга и содержащего указание на Расчетный код, который необходимо включить в список Расчетных кодов, связанных с Расчетным кодом для уплаты налогов, Клиринговый центр перестает учитывать обязательства по уплате сумм, соответствующих суммам налога на прибыль организаций с доходов иностранных организаций от источников в Российской Федерации, на Расчетном коде, указанном в заявлении, и начинает учитывать указанные обязательства на Расчетном коде для уплаты налогов.

- 7.13. После исполнения заявления, указанного в подпункте 7.8.2 общей части Правил клиринга и содержащего указание на Расчетный код, который необходимо исключить из списка Расчетных кодов, связанных с Расчетным кодом для уплаты налогов, обязательства по уплате сумм, соответствующих суммам налога на прибыль организаций с доходов иностранных организаций от источников в Российской Федерации, возникшие после исполнения указанного заявления, будут учитываться на Расчетном коде, указанном в заявлении.

- 7.14. Клиринговый центр исключает все Расчетные коды из списка Расчетных кодов, связанных с Расчетным кодом для уплаты налогов, в случае приостановления или прекращения допуска к клиринговому обслуживанию Участника клиринга. При этом обязательства по уплате сумм, соответствующих суммам налога на прибыль организаций с доходов иностранных организаций от источников в Российской Федерации, прекращают учитываться на Расчетном коде для уплаты налогов и

- начинают учитываться на Расчетных кодах, указанных в пункте 7.6 общей части Правил клиринга.
- 7.14.1. В случае возобновления допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию для осуществления замены, указанной в пункте 7.7 общей части Правил клиринга, такой Участник клиринга должен повторно осуществить действия, предусмотренные пунктом 7.8 общей части Правил клиринга.
- 7.15. Если после осуществления действий, указанных в пункте 7.14 общей части Правил клиринга значение Единого лимита на Расчетных кодах, указанных в пункте 7.6 общей части Правил клиринга отрицательно, Клиринговый центр устанавливает для Расчетного кода для уплаты налогов 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 принятию Единого лимита на указанных Расчетных кодах неотрицательного значения):
- 7.15.1. осуществляет перевод Обеспечения Участника клиринга (за исключением клиринговых сертификатов участия) в размере, для которого выполняются условия возврата Обеспечения, предусмотренные соответствующей частью Правил клиринга, учитываемого по собственным Расчетным кодам / Торгово-клиринговым счетам, в состав которых входит собственный Расчетный код, Участника клиринга (по выбору Клирингового центра) и имущества Участника клиринга из имущественного пула в размере, для которого соблюдаются условия погашения клиринговых сертификатов участия при выдаче соответствующего имущества из имущественного пула, учитываемого по собственным Расчетным кодам имущественного пула / Торгово-клиринговым счетам имущественного пула, в состав которых входит собственный Расчетный код имущественного пула, Участника клиринга (по выбору Клирингового центра), на Расчетный код имеющий отрицательное значение Единого лимита / Торгово-клиринговый счет в состав которого входит Расчетный код имеющий отрицательное значение Единого лимита;
- 7.15.2. осуществляет продажу иностранной валюты / ценных бумаг, учитываемых на Расчетном коде для уплаты налогов / Торгово-клиринговом счете для уплаты налогов Участника клиринга, в объеме, необходимом для принятия Единого лимита на Расчетных кодах неотрицательного значения;
- 7.15.3. осуществляет перевод Обеспечения в российских рублях с Расчетного кода для уплаты налогов на Расчетный код Участника клиринга, имеющий отрицательное значение Единого лимита, в таком размере, при котором значение Единого лимита станет неотрицательным.
- 7.16. Если после совершения действий, указанных в пункте 7.15 общей части Правил клиринга, значения Единых лимитов по всем Расчетным кодам, на которых, в соответствии с пунктом 7.14 общей части Правил клиринга начали учитываться обязательства по уплате сумм, соответствующих суммам налога на прибыль организаций с доходов иностранных организаций от источников в Российской Федерации, неотрицательны, Клиринговый центр снимает Режим урегулирования для Расчетного кода для уплаты налогов, если отсутствуют иные основания для установления Режима урегулирования, предусмотренные Правилами клиринга.



- 7.17. Обязательство Участника клиринга по уплате суммы, соответствующей сумме налога на прибыль организаций с доходов иностранных организаций от источников в Российской Федерации, допускается к клирингу с даты заключения Сделки (при получении Участником клиринга дохода по Сделке) / даты получения Участником клиринга дохода (при получении Участником клиринга иного дохода в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга). Исполнение указанного обязательства осуществляется в порядке, установленном общей частью Правил клиринга и/или соответствующей специальной частью Правил клиринга.
- 7.18. При расчете Единого лимита по Расчетному коду (для Расчетных кодов Единого пула, для Расчетных кодов на валютном рынке и рынке драгоценных металлов) или значения величины  $SZ_{SC}$  (свободного Обеспечения) (на срочном рынке) Клиринговый центр учитывает сумму, соответствующую сумме налога на прибыль организаций с доходов иностранных организаций от источников в Российской Федерации по Сделкам, являющимся производными финансовыми инструментами, подлежащую в соответствии с российским налоговым законодательством удержанию с Участника клиринга, которая была бы удержана Клиринговым центром в случае, если бы дата расчета Единого лимита по Расчетному коду или значения величины  $SZ_{SC}$  являлась датой уплаты налогов, с даты получения Участником клиринга дохода по Сделкам, являющимся производными финансовыми инструментами, до даты уплаты Участником клиринга налога на прибыль организаций с доходов иностранных организаций от источников в Российской Федерации (указанная сумма учитывается со знаком «минус»).
- 7.19. С 1 января и до даты предоставления Участником клиринга – Нерезидентом (по себе и по своим клиентам) и Участником клиринга – Международной организацией (по своим клиентам) документа, предусмотренного статьей 312 Налогового кодекса Российской Федерации для подтверждения постоянного местонахождения в государстве, с которым Российская Федерация имеет международный договор Российской Федерации по вопросам налогообложения (далее - сертификат налогового резидентства), установленной приложением № 4 к общей части Правил клиринга, или до фактической даты предоставления Участником клиринга – Нерезидентом или Участником клиринга – Международной организацией сертификата налогового резидентства на текущий календарный год (в зависимости от того, какое из этих событий наступит раньше) (за исключением банков, постоянное местонахождение которых подтверждается сведениями общедоступных информационных справочников), Клиринговый центр рассчитывает и удерживает налог на прибыль организаций с доходов иностранных организаций от источников в Российской Федерации по Сделкам, заключаемым в интересах Участника клиринга – Нерезидента, или фактического получателя дохода Участника клиринга – Нерезидента, или фактического получателя дохода Участника клиринга – Международной организации, по которому не получен сертификат налогового резидентства, с 1 января текущего календарного года по действующим в текущем календарном году налоговым ставкам, установленным применимым соглашением об избежании двойного налогообложения, заключенным с государством, налоговым резидентом которого являлся Участник клиринга – Нерезидент, фактический получатель дохода Участника клиринга –

Нерезидента или Международной организации в предыдущем календарном году (налоговом периоде).

7.20. В случае непредоставления Участником клиринга – Нерезидентом сертификата налогового резидентства Участника клиринга – Нерезидента и/или сертификата налогового резидентства фактического получателя дохода Участника клиринга – Нерезидента или в случае непредоставления Участником клиринга – Международной организацией сертификата налогового резидентства фактического получателя дохода Участника клиринга – Международной организации на очередной налоговый период (календарный год) в срок, указанный в приложении № 4 к общей части Правил клиринга (за исключением банков, постоянное местонахождение которых подтверждается сведениями общедоступных информационных справочников), Клиринговый центр как налоговый агент производит удержание (доудержание) налога на прибыль организаций с доходов иностранных организаций от источников в Российской Федерации без применения положений соответствующего договора (соглашения) об избежании двойного налогообложения по налоговым ставкам, предусмотренным Налоговым кодексом Российской Федерации, с дохода, выплаченного начиная с 1 января текущего года.

7.20.1. За несвоевременное предоставление сертификата налогового резидентства, в том числе, по фактическому получателю дохода, Участник клиринга – Нерезидент / Участник клиринга – Международная организация обязан уплатить Клиринговому центру штраф, рассчитываемый по формуле:

$Penalty = 1,2 \times S$ , где

S – сумма денежных средств, рассчитанная в порядке, предусмотренном Налоговым кодексом Российской Федерации для расчета пени за несвоевременную уплату налога в отношении операций лица, по которому не предоставлен сертификат налогового резидентства, начиная с 1 января текущего года.

7.21. Участник клиринга – Нерезидент / Участник клиринга – Международная организация обязуется возместить имущественные потери Клирингового центра (включая все применимые налоги, штрафы и пени) в случае, если налоговые органы предъявят к Клиринговому центру требования из-за неуплаты (неудержания) налогов и/или удержания (уплаты) налогов в меньшем размере при выполнении Клиринговым центром функций налогового агента в отношении доходов такого Участника клиринга – Нерезидента, Участника клиринга – Международной организации и/или фактических получателей дохода таких Участников клиринга. Участник клиринга освобождается от указанной обязанности (за исключением обязанности возместить сумму, соответствующую сумме налога (доначисленного налога) на прибыль организаций с доходов иностранных организаций от источников в Российской Федерации) в случае, если эти обстоятельства были вызваны ненадлежащим исполнением Клиринговым центром функций налогового агента. К ненадлежащему исполнению Клиринговым центром функций налогового агента не относится следование Клиринговым центром разъяснениям налоговых органов Российских Федерации (в частности, адресным ответам на запросы в налоговые органы, мотивированному мнению налогового органа).

7.22. В случае предоставления недостоверных сведений, повлекших неуплату (неудержание) налогов и/или удержание (уплату) налогов в меньшем размере при

выполнении Клиринговым центром функций налогового агента, Участник клиринга – Нерезидент / Участник клиринга – Международная организация, предоставивший такие сведения в отношении себя и/или иного лица, являющегося фактическим получателем дохода, обязан уплатить Клиринговому центру штраф, рассчитываемый по формуле:

$Penalty = 1,2 \times S$ , где

S – сумма денежных средств, состоящая из:

- суммы денежных средств, составляющей разницу между суммой налога, рассчитанной по максимальной ставке, установленной российским налоговым законодательством, и суммой налога, рассчитанной по ставке, соответствующей ранее предоставленным документам, в отношении операций лица, по которому предоставлены недостоверные сведения;
- суммы денежных средств, рассчитанной в порядке, предусмотренном Налоговым кодексом Российской Федерации для расчета пени и штрафа за несвоевременную уплату налога в отношении операций лица, по которому предоставлены недостоверные сведения.

7.23. Если иное прямо не предусмотрено Правилами клиринга, размер комиссионных вознаграждений Клирингового центра, подлежащих уплате Участником клиринга – Нерезидентом/ Участником клиринга – Международной организацией, платежей и списаний, производимых в отношении Участника клиринга – Нерезидента / Участника клиринга – Международной организации на основании и в соответствии с Правилами клиринга в пользу Клирингового центра, размер обязательств/требований Участника клиринга – Нерезидента / Участника клиринга – Международной организации, определенных по итогам клиринга сделок, заключенных с Клиринговым центром, не уменьшается на сумму налогов и сборов, включая, но не ограничиваясь налогом на доходы от источника выплаты и НДС, возникающих в стране налогового резидентства Участника клиринга – Нерезидента / Участника клиринга – Международной организацией / фактического получателя дохода таких Участников клиринга (вне зависимости от того, обязан ли соответствующий Участник клиринга / фактический получатель дохода Участника клиринга исполнить обязательство по уплате налогов и сборов в бюджет государства, налоговым резидентом которого он является, в качестве налогоплательщика либо в качестве налогового агента). Налоги и сборы, иные платежи, предусмотренные законодательством страны налогового резидентства Участника клиринга – Нерезидента / Участника клиринга – Международной организацией / фактического получателя дохода таких Участников клиринга, а также дополнительные расходы уплачиваются без участия Клирингового центра.

7.24. Положения Правил клиринга, определяющие права и обязанности Участников клиринга и Клирингового центра при выполнении Клиринговым центром функций налогового агента, не распространяются на Участников клиринга-Нерезидентов, признаваемых таковыми в соответствии со статьей 2 общей части Правил клиринга, осуществляющих свою деятельность в Российской Федерации через постоянное представительство в Российской Федерации и предоставившие Клиринговому центру следующие документы (подпункт 1 пункта 2 статьи 310 Налогового кодекса Российской Федерации):

- копию свидетельства о постановке на учет в налоговых органах Российской Федерации, оформленное не ранее чем в предшествующем налоговом периоде;
- письмо-заявление, составленное по форме Клирингового центра, о том, что получаемый доход (доходы), указанный (указанные) в Правилах клиринга, относятся к постоянному представительству в Российской Федерации, и постоянное представительство такого лица будет исполнять обязанности налогоплательщика в отношении полученных доходов, а также выполнять функции налогового агента в отношении доходов фактических получателей дохода;
- положение о филиале или представительстве юридического лица в Российской Федерации.

## **Статья 8. Выполнение Клиринговым центром функций Квалифицированного дилера деривативов (QDD) в отношении дохода от источника в США**

- 8.1. При осуществлении Выплат, эквивалентных дивидендам или процентам, Клиринговый центр в установленных налоговым законодательством США случаях исполняет функции Квалифицированного дилера деривативов (QDD) и уплачивает в бюджет США налог на доход от источника в США и/или приравненный к нему доход в рамках Глав 3 и 4 Налогового кодекса США в соответствии с требованиями секции 871(m).
- 8.2. Участник клиринга обязан уплатить Клиринговому центру сумму, соответствующую сумме налога, подлежащего уплате Клиринговым центром в бюджет США в соответствии с пунктом 8.3 общей части Правил клиринга.
- 8.3. Клиринговый центр рассчитывает сумму налога на доход от источника в США и/или приравненный к нему доход, подлежащую уплате в бюджет США Клиринговым центром в связи с выполнением функций Квалифицированного дилера деривативов (QDD), в том числе на доходы лиц, имеющих фактическое право на получение дохода и являющихся непосредственными выгодоприобретателями такого дохода (далее – бенефициар дохода), в порядке, установленном специальными частями Правил клиринга, с учетом требований налогового законодательства США.
- 8.4. Обязательство Участника клиринга по уплате суммы, соответствующей сумме налога на доход от источника в США и/или приравненный к нему доход, допускается к клирингу с даты, определенной специальными частями Правил клиринга (если применимо). Исполнение указанного обязательства осуществляется в порядке, установленном общей частью Правил клиринга и специальными частями Правил клиринга.
- 8.5. Участник клиринга обязуется возместить имущественные потери Клирингового центра (включая все применимые налоги, штрафы и пени) в случае, если налоговые органы США предъявят к Клиринговому центру требования из-за неуплаты (неудержания) налогов и/или удержания (уплаты) налогов в меньшем размере при выполнении Клиринговым центром функций налогового агента в отношении

доходов от источника в США и/или приравненных к ним доходов таких Участников клиринга и/или бенефициаров дохода таких Участников клиринга. Участник клиринга освобождается от указанной обязанности (за исключением обязанности возместить сумму, соответствующую сумме налога (доначисленного налога) на доход от источника в США и/или приравненный к нему доходы) в случае, если эти обстоятельства были вызваны виновными действиями Расчетного депозитария или ненадлежащим исполнением Клиринговым центром функций налогового агента в отношении доходов от источника в США и/или приравненных к ним доходов. К ненадлежащему исполнению Клиринговым центром функций налогового агента не относится следование Клиринговым центром разъяснениям налоговых органов (в частности, адресным ответам на запросы в налоговые органы, мотивированному мнению налогового органа).

- 8.6. В случае предоставления недостоверных сведений, повлекших неудержание (неуплату) налогов и/или удержание (уплату) налогов в меньшем размере при выполнении Клиринговым центром функций налогового агента в отношении доходов от источника в США и/или приравненных к ним доходов таких Участников клиринга и/или бенефициаров дохода таких Участников клиринга, Участник клиринга, предоставивший такие сведения в отношении себя и/или бенефициаров дохода, обязан уплатить Клиринговому центру штраф, рассчитываемый по формуле:

$Penalty = 1,2 \times S$ , где

S – сумма денежных средств, состоящая из:

- суммы денежных средств, составляющей разницу между суммой налога, рассчитанной по максимальной налоговой ставке, указанной в пункте 8.8 общей части Правил клиринга, и суммой налога, рассчитанной по ставке, информацию о которой на дату осуществления Выплаты, эквивалентной дивидендам или процентам, предоставил Расчетный депозитарий, входящий в одну консолидированную комплаенс группу Квалифицированных посредников (QI CCG) с Клиринговым центром, соответствующей ранее предоставленным документам, в отношении операций лица, по которому предоставлены недостоверные сведения;
- суммы денежных средств, рассчитанной в порядке, предусмотренном требованиями налогового законодательства США для расчета пени и штрафа за несвоевременную уплату налога в отношении операций лица, по которому предоставлены недостоверные сведения.

- 8.7. Сумма налога на доход от источника в США и/или приравненный к нему доход рассчитывается Клиринговым центром исходя из налоговой ставки, информацию о которой на дату осуществления Выплаты, эквивалентной дивидендам или процентам, предоставляет Расчетный депозитарий, входящий в одну консолидированную комплаенс группу Квалифицированных посредников (QI CCG) с Клиринговым центром. Расчетный депозитарий осуществляет сбор и анализ форм налоговой идентификации Участников клиринга, посредников в последовательности передачи Выплат, эквивалентных дивидендам или процентам, и бенефициаров дохода (далее для целей настоящей статьи – формы налоговой идентификации). Информация о применимой налоговой ставке и иная информация, необходимая для удержания налога и формирования соответствующей отчетности

в Налоговую службу США, передается Расчетным депозитарием Клиринговому центру в порядке и сроки, предусмотренные договором Клирингового центра с Расчетным депозитарием. Участник клиринга, заключая Сделку с центральным контрагентом, по условиям которой в пользу Участника клиринга может быть осуществлена Выплата, эквивалентная дивидендам или процентам, или Срочный контракт, по базисному активу которого может быть осуществлена Выплата, эквивалентная дивидендам или процентам, соглашается на передачу Клиринговым центром и/или Расчетным депозитарием в Налоговую службу США информации, в том числе конфиденциальной, предусмотренной формами отчетности. Участник клиринга обязан получить согласие бенефициара дохода и посредника (при его наличии) на предоставление Клиринговым центром в иностранный налоговый орган, включая Налоговую службу США, и (или) профессиональным консультантам или аудиторам, осуществляющим периодическую проверку деятельности Клирингового центра и\ или Расчетного депозитария в качестве Квалифицированного Дилера Деривативов (QDD) информации и данных, необходимых для заполнения требуемых форм отчетности.

- 8.8. В целях выполнения Клиринговым центром функций Квалифицированного дилера деривативов (QDD) Участники клиринга обязаны предоставить Расчетному депозитарию формы налоговой идентификации. Состав форм налоговой идентификации, порядок их заполнения, а также порядок и сроки их предоставления определяются Порядком предоставления Участником клиринга информации для выполнения Клиринговым центром функций Квалифицированного дилера деривативов (QDD) (далее в настоящей статье 8 – Порядок) и/или Регламентом налогового администрирования доходов от источника в США и/или приравненных к ним доходов по Срочным контрактам (далее в настоящей статье 8 – Регламент), раскрываемыми на Сайте Клирингового центра. В случае некорректного заполнения/непредоставления Участником клиринга форм налоговой идентификации в сроки, установленные в Порядке / Регламенте, а также в случае невозможности идентификации Расчетным депозитарием бенефициара дохода налоговая ставка считается равной максимальной ставке соответствующего налога у источника, установленной в отношении соответствующей Выплаты, эквивалентной дивидендам или процентам. Процедура идентификации Расчетным депозитарием бенефициара дохода определяется указанными в настоящем пункте Порядком / Регламенте.
- 8.9. Обеспечение наличия в Расчетном депозитории акцептованных им форм налоговой идентификации Участника клиринга, бенефициара дохода и клиента Участника клиринга, не являющегося бенефициаром дохода (при необходимости), является обязанностью Участника клиринга. Клиринговый центр не направляет Участникам клиринга запросов или уведомлений о необходимости предоставления форм налоговой идентификации и иной информации, предусмотренных Порядком / Регламентом в отношении каждой отдельной сделки, по условиям которой в пользу Участника клиринга может быть осуществлена Выплата, эквивалентная дивидендам или процентам, или Срочного контракта, по базисному активу которого может быть осуществлена Выплата, эквивалентная дивидендам или процентам.
- 8.10. Клиринговый центр не осуществляет возврат излишне удержанной суммы, соответствующей сумме налога на доход от источника в США и/или приравненный

к нему доход и корректировку соответствующей отчетности, если причиной такого удержания в большем размере является некорректное заполнение Участником клиринга форм налоговой идентификации либо их непредоставление в установленные Порядком / Регламентом сроки, а также предоставление Участником торгов некорректной информации в Анкете клиента, предусмотренной Порядком / Регламентом, либо непредоставление информации в указанной Анкете в сроки, установленные Порядком / Регламентом, в отношении лица, являющегося клиентом Участника клиринга.

## **Статья 9. Порядок использования Простой электронной подписи**

- 9.1. Простая электронная подпись (ПЭП) используется при подаче (направлении) с использованием Клиринговой системы Предложений и иных электронных сообщений, предусмотренных Правилами клиринга. Предложение или электронное сообщение, подписанное ПЭП, признается электронным документом, равнозначным документу на бумажном носителе, подписанному собственноручной подписью представителя Участника клиринга / Участника торгов / Клирингового центра.
- 9.2. Идентификация лица, подписывающего электронный документ, по его ПЭП устанавливаются Техническим центром в соответствии с договором о предоставлении интегрированного технологического сервиса.
- 9.3. Простой электронной подписью 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 представителя Участника клиринга, Участника торгов или Клирингового центра, которому присвоен данный Клиринговый идентификатор.  
Порядок присвоения Клирингового идентификатора Участнику клиринга / Участнику торгов определен статьей 22 общей части Правил клиринга.
- 9.4. 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.
- 9.5. Предложение или электронное сообщение считается подписанным ПЭП, 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.
- 9.6. 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 ПЭП, 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 ПЭП, паролю и IP-адресу удаленного рабочего места / ВПТС Участника клиринга / Участника торгов / Клирингового центра, информация о которых содержится в базе данных Клиринговой системы.

- 9.7. В случае успешного прохождения процедуры аутентификации Участник клиринга / Участник торгов / Клиринговый центр получает возможность осуществления операций в Клиринговой системе.
- 9.8. При подаче (направлении) Предложений и иных электронных сообщений, подписанных ПЭП, Технический центр с использованием Клиринговой системы осуществляет аутентификацию лица, подписавшего электронное сообщение, путем сопоставления ПЭП, содержащегося в электронном сообщении, реквизиту, являющемуся ПЭП, 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 ПЭП) 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.

- 9.9. 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.

- 9.10. Электронное взаимодействие осуществляется в соответствии с положениями Гражданского кодекса РФ, Федерального закона «Об электронной подписи» №63-ФЗ от 06.04.2011 года, а также с учетом требований об обеспечении защиты информации, установленных Положением Банка России от 20.04.2021 г. №757-П «Об установлении обязательных для некредитных финансовых организаций требований к обеспечению защиты информации при осуществлении деятельности в сфере финансовых рынков в целях противодействия осуществлению незаконных финансовых операций».



- 9.11. В соответствии со статьей 431.2 Гражданского кодекса РФ Участник клиринга / Участник торгов заверяет Клиринговый центр о следующих обстоятельствах, имеющих существенное значение: лицо, подписывающее Предложение и/или иное электронное сообщение ПЭП Участника клиринга / Участника торгов, является надлежащим образом уполномоченным представителем Участника клиринга / Участника торгов и имеет все необходимые полномочия для подписания Предложений (для Участника клиринга) и/или иных электронных сообщений, а также (для Участника клиринга) на заключение сделок путем подачи Предложений, подписываемых данным лицом.
- 9.12. В случае если указанные выше заверения были нарушены Участником клиринга / Участником торгов, или оказались недействительными, или недостоверными на момент подписания Предложения Участником клиринга и/или иного электронного сообщения ПЭП Участника клиринга / Участника торгов, Клиринговый центр вправе приостановить допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию и/или взыскать убытки Клирингового центра, возникшие вследствие такого нарушения, или недействительности, и/или недостоверности указанного заверения.
- 9.13. В случае если указанные заверения были нарушены Участником клиринга / Участником торгов, или оказались недействительными, или недостоверными на момент подписания Предложения Участником клиринга и/или иного электронного сообщения ПЭП Участника клиринга / Участника торгов и повлекли за собой претензии третьих лиц и/или государственных органов, включая, но не ограничиваясь, предписания Банка России, Участник клиринга / Участник торгов, 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.
- 9.14. Участник клиринга / Участник торгов и Клиринговый центр соглашаются с тем, что все возникшие конфликтные ситуации, связанные с использованием ПЭП, будут стремиться решить в досудебном порядке.
- 9.15. В случае возникновения конфликтных ситуаций в связи с использованием ПЭП проводится техническая экспертиза в соответствии с приложением № 3 к общей части Правил клиринга.
- 9.16. 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 65 общей части Правил клиринга.

## **Статья 10. Торговые и клиринговые счета**

- 10.1. 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 типа «С», предназначенный для внесения индивидуального клирингового обеспечения в российских рублях, предназначенного для обеспечения исполнения и исполнения обязательств по Сделкам, заключенным Участником клиринга, являющимся Нерезидентом из перечня, либо иным Участником клиринга, но в интересах и (или) за счет Нерезидента из перечня и иных обязательств, предусмотренных Правилами клиринга;
- клиринговый банковский счет, предназначенный для внесения коллективного клирингового обеспечения (Гарантийных фондов).

10.2. 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);
- клиринговые счета депо, предназначенные для внесения индивидуального клирингового обеспечения;
- 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) / индивидуального клирингового обеспечения, для каждого Участника клиринга, обязанного вносить средства в Гарантийные фонды / Обеспечение под стресс / Обеспечение под риски концентрации на эмитентов и предоставившего в Расчетный депозитарий комплект документов, предусмотренный Условиями осуществления депозитарной деятельности Расчетного депозитария, необходимый для открытия субсчета депо соответствующего типа, открывается субсчет депо гарантийных фондов / субсчет депо обеспечения под стресс / субсчет депо для учета Обеспечения под риски концентрации на эмитентов.

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, субсчета депо для учета Обеспечения под риски концентрации на эмитентов по тексту Правил клиринга совместно называются субсчетами депо.

10.3. 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.

10.4. При осуществлении клиринга в соответствии с Правилами клиринга Клиринговый центр использует следующие виды торговых банковских счетов в драгоценных металлах, открытых в Клиринговом центре:

- торговый банковский счет в драгоценном металле, предназначенный для внесения индивидуального клирингового обеспечения;
- торговый банковский счет в драгоценном металле, предназначенный для внесения имущества в имущественный пул.

Торговый банковский счет в драгоценном металле может быть открыт Участнику клиринга.

10.4.1. Торговый банковский счет в драгоценном металле открывается на основании договора банковского счета, заключенного Участником клиринга с Клиринговым центром, в порядке, установленном указанным договором.

10.4.2. При открытии торгового банковского счета в драгоценном металле, предназначенного для внесения индивидуального клирингового обеспечения, Участник клиринга в заявлении на открытие торгового счета указывает Расчетный код Участника клиринга (далее – Расчетный код, соответствующий торговому банковскому счету в драгоценном металле).

10.4.3. При открытии торгового банковского счета в драгоценном металле, предназначенного для внесения имущества в имущественный пул, Участник клиринга в заявлении на открытие торгового счета указывает Расчетный код имущественного пула (далее – Расчетный код имущественного пула, соответствующий торговому банковскому счету в драгоценном металле).

10.4.4. При открытии торгового банковского счета в драгоценном металле для учета драгоценных металлов, находящихся в доверительном управлении Участника клиринга, Участник клиринга в заявлении на открытие торгового счета указывает Расчетный код ДУ.

10.4.5. Учет драгоценного металла на торговом банковском счете осуществляется в граммах.

10.4.6. Операции по торговому банковскому счету в драгоценном металле, 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.

10.4.7. Согласие Клирингового центра на совершение операций по торговому банковскому счету в драгоценном металле на основании распоряжения Участника клиринга дается посредством направления Расчетной организации уведомления с использованием Клиринговой системы.

10.5. 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 владельца типа «С»;
- торговый счет депо номинального держателя;
- торговый счет депо иностранного номинального держателя типа «С»;
- торговый счет депо иностранного номинального держателя типа «С» ICSD;
- торговый счет депо доверительного управляющего;
- счет брокера;
- эмиссионный счет;
- казначейский счет депо.

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

10.6. 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.

10.7. Торговые банковские счета в российских рублях / иностранных валютах, торговые счета депо, торговые товарные счета, используемые при осуществлении клиринга, предназначены для внесения индивидуального клирингового обеспечения. Торговые банковские счета в драгоценных металлах, используемые при осуществлении клиринга, предназначены для внесения индивидуального клирингового обеспечения или для внесения имущества в имущественный пул.

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

10.8. Порядок совершения операций по клиринговым счетам в связи с внесением и возвратом взносов в Гарантийные фонды и Обеспечения под стресс указан в статьях 31, 33 общей части Правил клиринга.

Порядок совершения операций по клиринговым и/или торговым счетам в связи с внесением и возвратом Обеспечения указан в статьях 27, 30 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 Статья 41 общей части Правил клиринга и/или в соответствующих специальных частях Правил клиринга.

## **Статья 11. Клиринговые регистры**

- 11.1. Клиринговый центр осуществляет внутренний учет, предусмотренный Законом о клиринге, на клиринговых регистрах. Клиринговые регистры ведутся Клиринговым центром в Клиринговой системе.
- 11.2. На клиринговых регистрах 1-го уровня Клиринговый центр учитывает:
- информацию о сумме денежных средств / количестве драгоценных металлов, учитываемых в качестве Обеспечения в разрезе кодов валют / драгоценных металлов, Расчетных кодов Участника клиринга или информацию о Задолженности Участника клиринга перед Клиринговым центром в разрезе кодов валют, Расчетных кодов (положительное значение клирингового регистра означает информацию об Обеспечении, отрицательное – о Задолженности);
  - информацию о количестве ценных бумаг, учитываемых 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);
  - Профили активов в разрезе Расчетных кодов / Торгово-клиринговых счетов Участников клиринга, кодов валют / драгоценных металлов / ценных бумаг, Клиринговых систем соответствующих 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 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;
  - 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 Рынка (только в Клиринговой системе фондового рынка, по Расчетным кодам Единого пула);
  - информацию о Маржинальном требовании по Расчетному коду для уплаты налогов (только по Расчетному коду для уплаты налогов в случае наличия);
  - информацию о сумме, соответствующей сумме налога на прибыль организаций с доходов иностранных организаций от источников в Российской Федерации, подлежащей удержанию с Участника клиринга;
  - иную информацию, предусмотренную специальными частями Правил клиринга.
- 11.3. На клиринговых регистрах, предназначенных для учета Обеспечения под стресс / взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под риски концентрации на эмитентов, Клиринговый центр учитывает:

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

11.4. **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.

11.5. **Счет обеспечения нерезидента** – 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 российских рублях, являющегося индивидуальным клиринговым обеспечением и учитываемого на клиринговом банковском счете типа «С».

- 11.5.1. Счета обеспечения/Счет обеспечения нерезидента, предназначенные для учета Обеспечения в российских рублях и иностранной валюте, открываются при открытии соответствующего Расчетного кода Участника клиринга в соответствии со статьей 16 общей части Правил клиринга.
- 11.5.2. Порядок открытия Счетов обеспечения, предназначенных для учета денежных средств в имущественном пуле, определен Правилами клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.
- Обеспечение Участника клиринга в российских рублях и иностранной валюте, учитываемое по Расчетному коду Участника клиринга, также учитывается на Счете обеспечения в соответствующей валюте, соответствующем Расчетному коду Участника клиринга. Обеспечение Участника клиринга в российских рублях, учитываемое по Расчетному коду нерезидента, также учитывается на Счете обеспечения нерезидента, соответствующем Расчетному коду нерезидента.
- 11.6. **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.
- 11.6.1. Счета гарантийных фондов открываются Клиринговым центром всем Участникам клиринга категории «Б», «Б2», «О» или «В», имеющим действующий Договор об оказании клиринговых услуг, в соответствии с пунктом 16.7 общей части Правил клиринга.
- 11.6.2. 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.
- 11.6.3. 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.
- 11.7. **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, являющегося индивидуальным клиринговым обеспечением, 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 под стресс Участника клиринга в иностранной валюте, не являющегося индивидуальным клиринговым обеспечением.
- 11.7.1. Счета обеспечения под стресс открываются Клиринговым центром всем Участникам клиринга категории «Б», «Б2», «О» или «В», имеющим действующий

- Договор об оказании клиринговых услуг, в соответствии с пунктом 16.8 общей части Правил клиринга.
- 11.7.2. 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.
- 11.7.3. 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.
- 11.8. 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.
- 11.8.1. Порядок и случаи изменения значений клиринговых регистров в связи с внесением и возвратом взносов в Гарантийные фонды и Обеспечения под стресс указаны в статьях 31, 33 общей части Правил клиринга.
- 11.9. По требованию Участника клиринга, предъявленному Клиринговому центру путем предоставления Запроса на открытие Расчетного кода 2-го уровня в соответствии со статьей 19 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, внесенном с указанием клирингового регистра 2-го уровня (если применимо);
  - информацию об Обеспечении в ценных бумагах или драгоценном металле, учитываемую на клиринговом регистре 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).



- 11.10. 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 Расчетного кода 3-го уровня в соответствии со статьей 20 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, внесенном с указанием клирингового регистра 3-го уровня (если применимо);
  - информацию об Обеспечении в ценных бумагах или драгоценном металле, учитываемую на клиринговом регистре 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).
- 11.11. Перечень иных клиринговых регистров, используемых при осуществлении клиринга на соответствующих Рынках, определен в соответствующих специальных частях Правил клиринга.
- 11.12. На клиринговых регистрах обязательства и информация об обязательствах учитываются со знаком «минус», требования и информация о требованиях – со знаком «плюс».
- 11.13. Учет информации об Обеспечении в драгоценном металле на клиринговых регистрах, соответствующих торговым банковским счетам с признаком Локо Москва, осуществляется в граммах.
- 11.13.1. Учет информации об Обеспечении в драгоценном металле на клиринговых регистрах, соответствующих торговым банковским счетам с признаком Локо Лондон, осуществляется в тройских унциях.

Для целей такого учета количество Обеспечения в драгоценном металле, учитываемого на торговом банковском счете, пересчитывается из граммов в тройские унции в порядке, аналогичном порядку, установленному нормативным актом Банка России, устанавливающим правила учета и хранения слитков драгоценных металлов в кредитных организациях на территории Российской Федерации при осуществлении операций с драгоценными металлами.

- 11.13.2. Учет на клиринговых регистрах обязательств в драгоценных металлах осуществляется в граммах или в тройских унциях в зависимости от валюты лота Сделок с драгоценными металлами.
- 11.14. Порядок ведения клиринговых регистров, предусмотренных Правилами клиринга и используемых при осуществлении клиринга на соответствующих Рынках, определен в общей части Правил клиринга и/или соответствующих специальных частях Правил клиринга.

## **РАЗДЕЛ II. ТРЕБОВАНИЯ К УЧАСТНИКАМ КЛИРИНГА**

### **Статья 12. Требования к Участникам клиринга**

12.1. 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, в бумажной форме, подписанный уполномоченным лицом юридического лица и скрепленный печатью юридического лица (при наличии), и/или в форме электронного документа. Договор об оказании клиринговых услуг в форме электронного документа предоставляется посредством ЭДО. Электронный документ имеет ту же юридическую силу, что и документ в бумажной форме, подписанный собственноручной подписью уполномоченного лица юридического лица и скрепленный печатью юридического лица;
- 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.

Клиринговый центр вправе отказать юридическому лицу, в заключении Договора об оказании клиринговых услуг, в том числе, при наличии в деятельности такого юридического лица фактов, аналогичных фактам, являющимся основаниями для приостановления или прекращения допуска к клиринговому обслуживанию, указанных в статье 15 общей части Правил клиринга.

Клиринговый центр отказывает юридическому лицу в заключении Договора об оказании клиринговых услуг в случаях, предусмотренных законодательством Российской Федерации.

Права и обязанности сторон по Договору об оказании клиринговых услуг возникают с даты его заключения. Датой заключения Договора об оказании клиринговых услуг является дата присвоения Клиринговым центром такому договору номера. Клиринговый центр в срок не позднее следующего рабочего дня информирует Участника клиринга о присвоении Договору об оказании клиринговых услуг номера путем направления соответствующего уведомления.

12.2. 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.

12.3. 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.

- 12.4. 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.
- 12.5. Участник клиринга не реже одного раза в год по запросу Клирингового центра предоставляет Клиринговому центру Анкету юридического лица, сведения (документы), необходимые для целей выявления Клиринговым центром лиц, на которых распространяются временные меры экономического характера, в форме электронного документа или Письмо, содержащее информацию об изменениях сведений, содержащихся в Анкете юридического лица, и документах, ранее представленных Клиринговому центру, включая сведения о представителях, выгодоприобретателях и бенефициарных владельцах (далее – Письмо о наличии изменений) при наличии изменений в сведениях, содержащихся в Анкете юридического лица или в иных представленных ранее Клиринговому центру документах.

Форматы предоставления Участником клиринга Анкеты юридического лица, Письма о наличии изменений – определены Порядком предоставления информации и отчетности.

- 12.6. В случае изменения сведений, содержащихся в Анкете юридического лица или в иных представленных ранее Клиринговому центру документах, в том числе представленных для целей выявления Клиринговым центром лиц, на которых распространяются временные меры экономического характера, Участник клиринга обязан в течение 5 (пяти) рабочих дней с даты вступления в силу указанных изменений предоставить Клиринговому центру Анкету юридического лица с обновленной информацией или Письмо о наличии изменений с приложением документов, подтверждающих изменения, в форме электронного документа или документа в бумажной форме.
- 12.7. Переданные Участниками клиринга документы, указанные в приложении № 4 к общей части Правил клиринга, обрабатываются Клиринговым центром в срок, не превышающий 3 (трех) рабочих дней со дня получения указанных документов.
- 12.8. 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 и Порядком предоставления информации и отчетности.
- Участники клиринга-Некредитные организации, не являющиеся профессиональными участниками рынка ценных бумаг или лицами, осуществляющими иную лицензируемую деятельность на финансовом рынке, являющиеся эмитентами ценных бумаг, не имеющие специального разрешения (лицензии) на право осуществления операций на финансовых рынках, выданного компетентным органом государства учреждения Участника клиринга, вправе предоставлять финансовую отчетность путем ее обязательного публичного раскрытия. В случае если объемы и/или сроки обязательного публичного раскрытия информации не соответствует требованиям, которые установлены общей частью Правил клиринга в отношении предоставления Клиринговому центру отчетности Участников клиринга, по запросу Клирингового центра такой Участник клиринга

обязан предоставить отчетность путем ее направления в адрес Клирингового центра в соответствии с приложением № 5 к общей части Правил клиринга и Порядком предоставления информации и отчетности.

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. Клиринговый центр проводит оценку финансового состояния Участника клиринга, основываясь в совокупности на отчетности в соответствии с приложением № 5 к общей части Правил клиринга и дополнительных документах и информации, представленных в Клиринговый центр.

В случае изменения установленных законами, нормативными актами Банка России и иными нормативными актами Российской Федерации сроков подготовки форм отчетности, указанных в приложении № 5 к общей части Правил клиринга, Участник клиринга вправе предоставить отчетность в сроки, отличные от перечисленных в приложении № 5 к общей части Правил клиринга, предварительно уведомив Клиринговый центр о соответствующих изменениях.

- 12.9. 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 FATCA, необходимость предоставления которых следует из Анкеты для целей выявления иностранных налогоплательщиков и (или) применимого законодательства.

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

- 12.9.1. 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.

- 12.9.2. 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.
- 12.10. Обязанность по предоставлению Участником клиринга отчетности, указанной в приложении № 5 к общей части Правил клиринга, 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.
- 12.11. Участник клиринга несет риск отрицательных последствий, вызванных непредоставлением или несвоевременным предоставлением Клиринговому центру информации (документов) в соответствии с требованиями Правил клиринга.
- 12.12. 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 13. Категории Участников клиринга**

- 13.1. Существуют следующие категории Участников клиринга:
- Участники клиринга категории «А»;
  - Участники клиринга категории «К»;
  - Участники клиринга категории «О»;
  - Участники клиринга категории «Б»;
  - Участники клиринга категории «Б2»;
  - Участники клиринга категории «В».
- 13.2. 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.

- 13.3. 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 законодательством Российской Федерации, 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 законодательством Российской Федерации.

- 13.4. Участниками клиринга категории «О» являются Общие Участники клиринга.
- 13.4.1. 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 18.1 и/или 18.2 общей части Правил клиринга, стороной по Сделкам, заключенным им как Участником торгов от своего имени, и/или стороной по Сделкам, заключенным им как Участником клиринга от своего имени не на организованных торгах в соответствии с Правилами клиринга.
- 13.4.2. Участник клиринга категории «О» имеет допуск к клирингу с частичным обеспечением, за исключением случаев, установленных Правилами клиринга.
- 13.5. Участниками клиринга категории «Б» и «Б2» являются Индивидуальные Участники клиринга, имеющие допуск к клирингу с частичным обеспечением.
- 13.5.1. Участник клиринга категории «Б» и «Б2» 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 18.1 и/или 18.2 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.
- 13.6. Участниками клиринга категории «В» являются Индивидуальные Участники клиринга, не имеющие допуска к клирингу с частичным обеспечением.
- 13.6.1. 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 18.2 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.

13.7. Правилами клиринга могут быть установлены ограничения в отношении видов сделок, сторонами по которым могут являться Участники клиринга определенной категории, предусмотренной пунктом 13.1 общей части Правил клиринга.

Клиринговым центром может быть принято решение об установлении ограничений в отношении отдельных видов Сделок, сторонами по которым могут являться Участники клиринга определенной категории, предусмотренной пунктом 13.1 общей части Правил клиринга, если Биржей и/или Клиринговым центром применены особые условия Спецификации, в том числе принято решение об изменении способа исполнения обязательств. В случае принятия такого решения информация о нем размещается на Сайте Клирингового центра или направляется Участникам клиринга, в отношении которых принято указанное решение, посредством ЭДО. Такое решение Клирингового центра вступает в силу через 3 (три) рабочих дня с даты размещения / направления соответствующей информации, если в самом решении не указан иной срок вступления его в силу.

13.8. Специальной частью Правил клиринга устанавливается перечень категорий Участников клиринга, предусмотренных пунктом 13.1 общей части Правил клиринга, применимых для соответствующего Рынка.

13.9. Кроме категорий Участников клиринга, предусмотренных пунктом 13.1 общей части Правил клиринга, существуют следующие категории Участников клиринга, являющихся Участниками клиринга категории «О», «Б», «Б2» или «В»:

13.9.1. Резиденты, в том числе:

- Кредитные организации;
- Некредитные организации, в том числе:
  - Государственные корпорации, государственные компании, публично-правовые компании;
  - Некредитные организации, осуществляющие лицензируемую деятельность на финансовом рынке, в том числе:
    - Некредитные организации, являющиеся профессиональными участниками рынка ценных бумаг;
    - Некредитные организации, являющиеся страховыми организациями и обществами взаимного страхования;
    - Некредитные организации, осуществляющие деятельность на основании лицензии на осуществление деятельности по пенсионному обеспечению и пенсионному страхованию;
    - Некредитные организации, являющиеся акционерными инвестиционными фондами;
    - Некредитные организации, осуществляющие деятельность на основании лицензии на осуществление деятельности по управлению инвестиционными фондами, паевыми инвестиционными фондами и негосударственными пенсионными фондами;
    - Некредитные организации, не являющиеся профессиональными участниками рынка ценных бумаг или лицами, осуществляющими иную лицензируемую деятельность на финансовом рынке, в том числе:



- Региональные органы власти;
- Некредитные организации, являющиеся микрофинансовыми организациями;
- Некредитные организации, являющиеся Биржами;
- Некредитные организации, являющиеся Клиринговыми организациями, не являющиеся кредитными организациями или биржами;
- Некредитные организации, являющиеся Кредитными рейтинговыми агентствами.

13.9.2. Международные организации;

13.9.3. Нерезиденты, в том числе:

- Банки-нерезиденты, в том числе:
  - Банки ЕврАзЭс/ЕАЭС, в том числе:
    - национальные (центральные) банки стран – членов ЕврАзЭс/ЕАЭС;
- Участник клиринга – поставщик ликвидности;
- Некредитные организации – нерезиденты, в том числе:
  - Некредитные организации – нерезиденты, имеющие действующее специальное разрешение на осуществление операций на финансовых рынках, выданное компетентным органом государства учреждения Участника клиринга;
  - Некредитные организации – нерезиденты, не имеющие действующего специального разрешения на осуществление операций на финансовых рынках, выданного компетентным органом государства учреждения Участника клиринга;
  - Некредитные организации ЕврАзЭс/ЕАЭС – Некредитные организации ЕврАзЭс/ЕАЭС, не имеющие действующего специального разрешения на осуществление операций на финансовых рынках, выданного компетентным органом государства учреждения Участника клиринга.

13.10. Кроме категорий Участников клиринга, предусмотренных пунктами 13.1 и 13.9 общей части Правил клиринга, существуют следующие категории Участников клиринга, являющихся Участниками клиринга категории «О», «Б», «Б2» или «В»:

- Участники клиринга, которым открыты Торгово-клиринговые счета нерезидентов;
  - Участники клиринга, которым не открыты Торгово-клиринговые счета нерезидентов.

13.11. Правилами клиринга могут быть установлены отдельные и (или) специальные требования по допуску к клиринговому обслуживанию и особенности клирингового обслуживания Участников клиринга определенной категории, предусмотренной пунктом 13.9 и 13.10 общей части Правил клиринга.

13.12. В случае получения разрешения Банка России и (или) Правительственной комиссии по контролю за осуществлением иностранных инвестиций в Российской Федерации и (или) Президента Российской Федерации и (или) иного органа

государственной власти РФ Участником клиринга, которому открыт Торгово-клиринговый счет нерезидента или Клиринговым центром или Нерезидентом из перечня / российским лицом, подконтрольным Нерезиденту из перечня, в интересах и (или) за счет которого действует Участник клиринга, Клиринговый центр в соответствии с таким разрешением вправе не применять ограничения / особенности, установленные в соответствии с Правилами клиринга для Нерезидентов из перечня / российского лица, подконтрольного Нерезиденту из перечня, для получившего разрешение Нерезидента из перечня / российского лица, подконтрольного Нерезиденту из перечня, или Участника клиринга, действующего в интересах и (или) за счет такого Нерезидента из перечня / российского лица, подконтрольного Нерезиденту из перечня, или применять соответствующие ограничения / особенности с учетом указанного выше разрешения.

- 13.13. В связи с выполнением функций центрального контрагента по Сделкам, стороной которых являются Участники клиринга, являющиеся Нерезидентами из перечня, или иные Участники клиринга, являющиеся российскими лицами, подконтрольными Нерезидентам из перечня (за исключением случаев, предусмотренных пунктом 13.12 Общей части Правил клиринга) и/или действующими в интересах Нерезидентов из перечня и/ или в интересах российских лиц, подконтрольных Нерезидентам из перечня, Клиринговый центр вправе своим решением ограничить инструменты, по которым указанные Участники клиринга вправе становиться сторонами по Сделкам, а также иные клиринговые операции, в том числе прекратить учет отдельных ценных бумаг в качестве обеспечения у такого Участника клиринга (таких Участников клиринга). В случае принятия такого решения информация о нем размещается на Сайте Клирингового центра или направляется Участникам клиринга (Участнику клиринга), в отношении которых (которого) принято указанное решение посредством ЭДО. Такое решение Клирингового центра вступает в силу через 3 (три) рабочих дня с даты размещения / направления соответствующей информации, если в самом решении не указан иной срок вступления его в силу.

#### **Статья 14. Условия клирингового обслуживания. Порядок предоставления допуска к клиринговому обслуживанию**

- 14.1. Допуск к клиринговому обслуживанию на каждом из Рынков предоставляется Участнику клиринга, соответствующему требованиям, установленным пунктами 14.2, и/или 14.3, и/или 14.4 и/или 0, и/или 14.6 общей части Правил клиринга, на основании Заявления о предоставлении допуска к клиринговому обслуживанию на соответствующем Рынке.

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

- 14.2. Для допуска к клиринговому обслуживанию на любом из Рынков Участник клиринга категории «В» (за исключением Участника клиринга - поставщика ликвидности) должен соответствовать следующим требованиям:

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

- 14.2.2. иметь действующий договор о предоставлении интегрированного технологического сервиса с Техническим центром;
- 14.2.3. иметь действующую лицензию на осуществление банковских операций, выданную Банком России (для Кредитных организаций);
- 14.2.4. иметь действующую лицензию, выданную Банком России на осуществление вида(ов) деятельности некредитных финансовых организаций (для Некредитных организаций, осуществляющих лицензируемую деятельность на финансовом рынке), или являться юридическим лицом, сведения о котором внесены Банком России в государственный реестр микрофинансовых организаций (для Некредитных организаций, осуществляющих микрофинансовую деятельность), или являться Региональным органом власти, или являться юридическим лицом, сведения о котором внесены Банком России в реестр кредитных рейтинговых агентств (для Некредитных организаций, осуществляющих деятельность кредитных рейтинговых агентств);
- 14.2.5. 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);
- 14.2.6. иметь действующее специальное разрешение на осуществление операций на финансовых рынках, выданное компетентным органом государства учреждения Участника клиринга, либо иметь собственные средства (капитал) не менее, чем 500 000 000 (пятьсот миллионов) российских рублей (для Участников клиринга, являющихся Некредитной организацией, не указанной в пункте 14.2.4 общей части Правил клиринга, или Некредитной организацией – Нерезидентом);
- 14.2.7. являться участником СЭД ПАО Московская Биржа;
- 14.2.8. выполнять требования Клирингового центра по предоставлению информации и отчетности, предусмотренные пунктами 12.5-12.9 общей части Правил клиринга;
- 14.2.9. иметь действующую лицензию на осуществление брокерской деятельности, и/или дилерской деятельности, и/или деятельности по управлению ценными бумагами (для Участников клиринга - Некредитных организаций, являющихся профессиональным участником рынка ценных бумаг).
- 14.3. Для допуска к клиринговому обслуживанию на любом из Рынков Участник клиринга категории «Б», за исключением национальных (центральных) банков стран – членов ЕврАзЭС/ЕАЭС и Участников клиринга - поставщиков ликвидности, помимо требований, установленных пунктом 14.2 общей части Правил клиринга, должен соответствовать следующим требованиям:
  - 14.3.1. внести взнос в Гарантийный фонд соответствующего Рынка в размере, установленном в соответствующей специальной части Правил клиринга;
  - 14.3.2. 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;

- 14.3.3. кредитные организации, созданные в соответствии с законодательством Российской Федерации, помимо требований, установленных подпунктами 14.3.1-14.3.2 общей части Правил клиринга, обязаны соответствовать следующим требованиям:
- 14.3.3.1. иметь собственные средства (капитал) в размере, превышающем минимальный размер собственных средств (капитала), установленный для кредитной организации соответствующего статуса в соответствии с Федеральным законом «О банках и банковской деятельности» в зависимости от вида полученной лицензии, с запасом в размере не менее 50% от минимального размера собственных средств (капитала);
- 14.3.3.2. соблюдать установленные нормативными актами Банка России обязательные нормативы достаточности капитала с учетом надбавки на поддержание достаточности капитала в размере не менее 2,5 процентных пунктов в течение 12 (двенадцати) отчётных месяцев, предшествующих последней отчётной дате;
- 14.3.3.3. соблюдать установленные нормативными актами Банка России обязательные нормативы мгновенной и текущей ликвидности с запасом не менее 15 процентных пунктов относительно минимально установленных в нормативных актах Банка России регуляторных уровней в течение 12 (двенадцати) отчётных месяцев, предшествующих последней отчётной дате;
- 14.3.4. профессиональные участники рынка ценных бумаг, созданные в соответствии с законодательством Российской Федерации, помимо требований, установленных подпунктами 14.3.1-14.3.2 общей части Правил клиринга, обязаны соответствовать следующим требованиям:
- 14.3.4.1. иметь размер собственных средств, превышающий минимальный размер собственных средств, определенный в соответствии с нормативными актами Банка России, с запасом в размере не менее 50% от минимального размера собственных средств;
- 14.3.4.2. соблюдать установленный нормативным актом Банка России обязательный норматив достаточности капитала с запасом не менее 2,5 процентных пунктов относительно минимально установленного в нормативном акте Банка России уровня в течение 4-х (четырёх) отчётных кварталов, предшествующих последней отчётной дате;
- 14.3.4.3. соблюдать установленный нормативным актом Банка России показатель краткосрочной ликвидности (для профессиональных участников рынка ценных бумаг, осуществляющих брокерскую деятельность) с запасом не менее 15 процентных пунктов. относительно минимально установленного в нормативном акте Банка России уровня в течение 4-х (четырёх) отчётных кварталов, предшествующих последней отчётной дате;
- 14.3.5. страховые компании и общества взаимного страхования, созданные в соответствии с законодательством Российской Федерации, помимо требований, установленных подпунктами 14.3.1-14.3.2 общей части Правил клиринга, обязаны соответствовать следующим требованиям:

- 14.3.5.1. значение нормативного соотношения собственных средств (капитала) и принятых обязательств должно составлять не менее 1,05 в течение 4-х (четырёх) отчётных кварталов, предшествующих последней отчётной дате;
- 14.3.6. Банки-нерезиденты, в том числе Банки ЕврАзЭС/ЕАЭС, а также Некредитные организации-нерезиденты, имеющие специальное разрешение на осуществление операций на финансовых рынках помимо требований, установленных подпунктами 14.3.1-14.3.2 общей части Правил клиринга, обязаны соответствовать следующим требованиям:
  - 14.3.6.1. иметь собственные средства (капитал) в размере, превышающем минимальный размер собственных средств (капитала) не менее чем на 50%, в случае если минимальный размер собственных средств (капитала) устанавливается компетентным органом государства учреждения;
  - 14.3.6.2. соблюдать обязательные нормативы достаточности капитала с запасом не менее 2,5 процентных пунктов относительно минимального установленного уровня в течение 4-х (четырёх) отчётных кварталов, предшествующих последней отчётной дате, в случае если обязательные нормативы достаточности капитала установлены компетентным органом государства учреждения;
  - 14.3.6.3. соблюдать обязательные нормативы ликвидности с запасом не менее 15 процентных пунктов относительно минимально установленного уровня в течение 4-х (четырёх) отчётных кварталов, предшествующих последней отчётной дате, в случае если обязательные нормативы ликвидности установлены компетентным органом государства учреждения;
- 14.3.7. Биржи, созданные в соответствии с законодательством Российской Федерации помимо требований, установленных подпунктами 14.3.1-14.3.2 общей части Правил клиринга, обязаны соответствовать следующим требованиям:
  - 14.3.7.1. иметь размер собственных средств, превышающий минимальный размер собственных средств, определенный в соответствии с нормативными актами Банка России, с запасом в размере не менее 50% от минимального размера собственных средств;
  - 14.3.7.2. соблюдать установленный нормативным актом Банка России обязательный норматив достаточности капитала организатора торговли с запасом не менее 2,5 процентных пунктов относительно минимально установленного в нормативном акте Банка России уровня в течение последних двенадцати месяцев;
- 14.3.8. Клиринговые организации, не являющиеся кредитными организациями или биржами, созданные в соответствии с законодательством Российской Федерации помимо требований, установленных подпунктами 14.3.1-14.3.2 общей части Правил клиринга, обязаны соответствовать следующим требованиям:
  - 14.3.8.1. иметь размер собственных средств, превышающий минимальный размер собственных средств, определенный в соответствии с нормативными актами Банка России, с запасом в размере не менее 50% от минимального размера собственных средств;
- 14.3.9. Кредитные рейтинговые агентства, созданные в соответствии с законодательством Российской Федерации помимо требований, установленных подпунктами 14.3.1-14.3.2 общей части Правил клиринга, обязаны соответствовать следующим требованиям:

- 14.3.9.1. иметь размер собственных средств, превышающий минимальный размер собственных средств, определенный в соответствии с нормативными актами Банка России, с запасом в размере не менее 50% от минимального размера собственных средств;
- 14.3.10. иметь финансовую отчетность, подготовленную в соответствии с требованиями к основному виду деятельности, не менее, чем за 5 (пять) квартальных отчетных периодов, или
- в случае если вновь созданное юридическое лицо образовано в результате реорганизации (за исключением преобразования) менее, чем за 5 (пять) последних квартальных отчетных периодов, иметь и по требованию Клирингового центра предоставить имеющуюся квартальную отчетность такого вновь созданного юридического лица и квартальную отчетность за 5 (пять) последних отчетных дат юридического лица-правопреемника, или
- иной Участник клиринга, прямо владеющий более 50% акций (долей) в уставном капитале вновь созданного юридического лица, имеет
- рейтинг по международной шкале долгосрочной кредитоспособности по обязательствам в российских рублях или в иностранной валюте не ниже ВВ- по классификации рейтинговых агентств "Standard & Poor's" или "Fitch Ratings" либо "Ba3" по классификации рейтингового агентства "Moody's Investors Service", либо
  - кредитный рейтинг по национальной шкале не менее А- по классификации Аналитического Кредитного Рейтингового Агентства (АКРА) или рейтингового агентства «Эксперт РА».
- 14.4. Для допуска к клиринговому обслуживанию на любом из Рынков Участник клиринга категории «Б2», за исключением Участника клиринга - поставщика ликвидности, помимо требований, установленных пунктом 14.2 и подпунктом 14.3.1 общей части Правил клиринга, должен соответствовать следующим требованиям:
- 14.4.1. кредитные организации, созданные в соответствии с законодательством Российской Федерации, обязаны соответствовать следующим требованиям:
- 14.4.1.1. иметь собственные средства (капитал) в размере, превышающем минимальный размер собственных средств (капитала), установленный для кредитной организации соответствующего статуса в соответствии с Федеральным законом «О банках и банковской деятельности» в зависимости от вида полученной лицензии;
- 14.4.1.2. соблюдать обязательные нормативы, установленные нормативными актами Банка России, в течение 12 (двенадцати) отчетных месяцев, предшествующих последней отчетной дате;
- 14.4.2. профессиональные участники рынка ценных бумаг, созданные в соответствии с законодательством Российской Федерации, обязаны соответствовать следующим требованиям:
- 14.4.2.1. иметь размер собственных средств, превышающий минимальный размер собственных средств, определенный в соответствии с нормативными актами Банка России;

- 14.4.2.2. соблюдать обязательные нормативы, установленные нормативными актами Банка России, в течение 4-х (четырёх) отчётных кварталов, предшествующих последней отчётной дате.
- 14.4.3. страховые компании, созданные в соответствии с законодательством Российской Федерации, обязаны соответствовать следующим требованиям:
  - 14.4.3.1. соблюдать нормативное соотношение собственных средств (капитала) и принятых обязательств на уровне, установленном нормативными актами Банка России, в течение 12 (двенадцати) отчётных месяцев, предшествующих последней отчётной дате.
- 14.4.4. Биржи, созданные в соответствии с законодательством Российской Федерации обязаны соответствовать следующим требованиям:
  - 14.4.4.1. иметь размер собственных средств, превышающий минимальный размер собственных средств, определенный в соответствии с нормативными актами Банка России;
  - 14.4.4.2. соблюдать установленный нормативным актом Банка России обязательный норматив достаточности капитала организатора торговли в течение последних двенадцати месяцев.
- 14.4.5. Клиринговые организации, не являющиеся кредитными организациями или биржами, созданные в соответствии с законодательством Российской Федерации обязаны соответствовать следующим требованиям:
  - 14.4.5.1. иметь размер собственных средств, превышающий минимальный размер собственных средств, определенный в соответствии с нормативными актами Банка России;
- 14.4.6. Кредитные рейтинговые агентства, созданные в соответствии с законодательством Российской Федерации обязаны соответствовать следующим требованиям:
  - 14.4.6.1. иметь размер собственных средств, превышающий минимальный размер собственных средств, определенный в соответствии с нормативными актами Банка России;
- 14.4.7. Банки-нерезиденты, в том числе Банки ЕврАзЭС/ЕАЭС, а также Некредитные организации-нерезиденты, имеющие специальное разрешение на осуществление операций на финансовых рынках обязаны соответствовать следующим требованиям:
  - 14.4.7.1. иметь собственные средства (капитал) в размере, превышающем минимальный размер собственных средств (капитала), в случае если минимальный размер собственных средств (капитала) устанавливается компетентным органом государства учреждения;
  - 14.4.7.2. соблюдать обязательные нормативы достаточности капитала в течение 4-х (четырёх) отчётных кварталов, предшествующих последней отчётной дате, в случае если обязательные нормативы достаточности капитала установлены компетентным органом государства учреждения;
  - 14.4.7.3. соблюдать обязательные нормативы ликвидности в течение 4-х (четырёх) отчётных кварталов, предшествующих последней отчётной дате, в случае если обязательные

нормативы ликвидности установлены компетентным органом государства учреждения;

- 14.4.7.4. соблюдать иные обязательные нормативы, не указанные в пп. 14.3.3.1-14.3.3.3 в течение 4-х (четырёх) отчётных кварталов, предшествующих последней отчётной дате, в случае если нормативы установлены компетентным органом государства учреждения.
- 14.4.8. иметь финансовую отчётность, подготовленную в соответствии с требованиями к основному виду деятельности, не менее, чем за 5 (пять) квартальных отчётных периодов;
- 14.4.8.1. в случае отсутствия у новообразованного Участника клиринга финансовой отчётности, соответствующей требованию подпункта 14.4.8 общей части Правил клиринга в силу длительности работы менее 1 календарного года по основному виду деятельности, такой Участник клиринга предоставляет Клиринговому центру гарантийное письмо от организации, имеющей право прямо или косвенно осуществлять контроль за деятельностью Участника клиринга (далее в целях настоящей статьи – Контролирующее лицо), подготовленное по форме Клирингового центра.

Контролирующее лицо должно соответствовать следующим требованиям:

- в деятельности Контролирующего лица отсутствуют факты ухудшения его финансового состояния и/или отсутствует информация, дающая основания считать возможными ухудшение финансового состояния Контролирующего лица;
- Контролирующее лицо является Участником клиринга, либо если Контролирующее лицо не является Участником клиринга, то Контролирующее лицо должно соответствовать требованиям к финансовому положению, предъявляемым к Участникам клиринга категории «Б» или «Б2». Если Контролирующее лицо не является Участником клиринга, то Контролирующее лицо предоставляет Клиринговому центру финансовую отчетность в тех же объемах и те же сроки, которые установлены общей частью Правил клиринга, до тех пор, пока Участник клиринга не будет иметь финансовую отчётность, соответствующую требованию подпункта 14.4.5 общей части Правил клиринга;
- одновременно с гарантийным письмом, предоставил в Клиринговый центр комплект документов в соответствии с Порядком предоставления информации и отчетности.

- 14.5. Для допуска к клиринговому обслуживанию на любом из Рынков Участник клиринга категории «Б» или «Б2», являющийся национальным (центральным) банком стран – членов ЕврАзЭС/ЕАЭС, помимо требований, установленных пунктом 14.2 общей части Правил клиринга, должен соответствовать следующим требованиям:
- 14.5.1. внести взнос в Гарантийный фонд соответствующего Рынка в размере, установленном в соответствующей специальной части Правил клиринга.
- 14.6. Для допуска к клиринговому обслуживанию на валютный рынок и рынок драгоценных металлов, и/или срочный рынок, и/или рынок Стандартизированных ПФИ Участник клиринга - поставщик ликвидности категории «В» должен



- соответствовать требованиям, изложенным в пунктах 14.2.1-14.2.2, 14.2.7-14.2.8 общей части Правил клиринга, а также;
- 14.6.1. не являться Нерезидентом из перечня;
- 14.6.2. направить в Клиринговый центр заверение об исключительной цели совершения Сделок на Рынках и Внебиржевых сделок - поддержание и повышение ликвидности инструментами в одной или нескольких валютах;
- 14.6.3. иметь действующее специальное разрешение на осуществление операций на финансовых рынках, выданное компетентным органом государства учреждения Участника клиринга или иметь собственные средства (капитал) не менее 250 000 000 (двести пятьдесят миллионов) российских рублей.
- 14.7. Для допуска к клиринговому обслуживанию на любом из Рынков Участник клиринга категории «О» помимо требований, установленных пунктами 14.2-14.3 общей части Правил клиринга, должен соответствовать следующим требованиям:
- 14.7.1. иметь собственные средства (капитал) не менее, чем 50 000 000 000 (пятьдесят миллиардов) российских рублей, либо
- 14.7.2. 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 А- по классификации Аналитического Кредитного Рейтингового Агентства (АКРА) или рейтингового агентства «Эксперт РА»,
- либо
- 14.7.3. 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 А- по классификации Аналитического Кредитного Рейтингового Агентства (АКРА) или рейтингового агентства «Эксперт РА»;
- 14.7.4. 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);
- 14.7.5. иметь действующее специальное разрешение на осуществление операций на финансовых рынках, выданное компетентным органом государства учреждения

- Участника клиринга (для Участников клиринга, являющихся Некредитной организацией – Нерезидентом).
- 14.8. Для допуска к клиринговому обслуживанию на любом из Рынков Участник клиринга категории «А» или «К» должен соответствовать следующим требованиям:
- 14.8.1. иметь действующий Договор об оказании клиринговых услуг, заключенный с Клиринговым центром;
- 14.8.2. иметь действующий договор о предоставлении интегрированного технологического сервиса и обеспечивающий(-ие) технический доступ к Клиринговой системе, и установить необходимое для клирингового обслуживания программно-техническое обеспечение, соответствующее требованиям, установленным Техническим центром;
- 14.8.3. являться участником СЭД ПАО Московская Биржа.
- 14.9. Для проверки соответствия собственных средств (капитала) Участника клиринга – Нерезидента требованиям, установленным подпунктами 14.2.6, 14.6.3, 14.7.1-14.7.3 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.
- 14.10. 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 14.7.2-14.7.3 общей части Правил клиринга, а также специальными частями Правил клиринга, могут быть изменены решением Клирингового центра, раскрываемом на Сайте Клирингового центра.
- 14.11. 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.
- 14.12. Клиринговый центр вправе запросить у Участника клиринга, соответствующего требованиям подпункта 14.7.3 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 (владеющей более 50 % акций (долей) в уставном капитале) 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.

- 14.13. По результатам анализа информации и/или документов, полученных Клиринговым центром от Участника клиринга в соответствии с пунктами 14.11 и 14.12 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».
- 14.14. Клиринговый центр не предоставляет Участнику клиринга категории «О», «Б», «Б2» 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 участвующим в применении FATCA и/или утратившим статус лица, признанного соблюдающим требования FATCA.
- 14.15. Участники клиринга должны соответствовать следующим требованиям к финансовой устойчивости:
  - 14.15.1. Участники клиринга - Кредитные организации - соблюдать обязательные нормативы и требования к минимальному размеру собственных средств (капитала), установленные Банком России для кредитных организаций;
  - 14.15.2. в деятельности Участников клиринга – Кредитных организаций должны отсутствовать основания для отзыва или аннулирования Банком России лицензии на осуществление банковских операций в соответствии с законодательством Российской Федерации о банковской деятельности;
  - 14.15.3. 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;
  - 14.15.4. соблюдать обязательные нормативы и/или требования к минимальному размеру собственных средств (капитала), установленные компетентным органом государства учреждения, в случае если в соответствии с национальным законодательством государства учреждения Участника клиринга такие обязательные нормативы / требования устанавливаются;

- 14.15.5. 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.
- 14.16. Участники клиринга категории «Б» и «О», за исключением Участников клиринга, в отношении которых реализуются мероприятия по финансовому оздоровлению, предусмотренные подпунктом 14.24.1 общей части Правил клиринга, должны соответствовать требованиям к финансовой устойчивости, приведенным в пункте 14.15 общей части Правил клиринга, в течение всего времени допуска к клиринговому обслуживанию.
- 14.17. Участники клиринга обязаны незамедлительно уведомлять Клиринговый центр о своем несоответствии требованиям к финансовой устойчивости, приведенным в пункте 14.15 общей части Правил клиринга.
- 14.18. Участники клиринга обязаны уведомлять Клиринговый центр о подаче в Банк России (иной уполномоченный орган) ходатайства (если применимо):
- об аннулировании лицензии на осуществление банковских операций;
  - об аннулировании лицензии на осуществление вида(ов) деятельности некредитных финансовых организаций, в том числе, об аннулировании лицензии на осуществление профессиональной деятельности на рынке ценных бумаг или лицензии управляющей компании инвестиционных фондов, паевых инвестиционных фондов и негосударственных пенсионных фондов, или лицензии на осуществление страховой деятельности;
  - об аннулировании лицензии (иного вида разрешения) на осуществление соответствующего вида деятельности в соответствии с законодательством Российской Федерации,
- не позднее дня, следующего за днем принятия такого решения.
- 14.19. Участники клиринга – Нерезиденты обязаны уведомлять Клиринговый центр о подаче в компетентный орган государства учреждения Участника клиринга ходатайства об аннулировании 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, не позднее дня, следующего за днем принятия такого решения.
- 14.20. Участники клиринга обязаны уведомлять Клиринговый центр о принятии решения о ликвидации или реорганизации Участника клиринга не позднее дня, следующего за днем принятия такого решения.
- 14.21. Клиринговый центр вправе не предоставлять допуск к клиринговому обслуживанию на одном или нескольких Рынках лицу, направившему Заявление о предоставлении допуска к клиринговому обслуживанию в категории «О», «Б»,

- «Б2» и «В», а также не изменять категорию Участника клиринга с категории «В» на категорию «Б», «Б2» или «О» на соответствующем Рынке в следующих случаях:
- 14.21.1. в случае несоответствия Участника клиринга требованиям по допуску к клиринговому обслуживанию, определенным пунктами 14.2-14.6 общей части Правил клиринга;
  - 14.21.2. в случае однократного и более невыполнения требований Клирингового центра к финансовой устойчивости Участника клиринга, предусмотренных пунктом 14.15 общей части Правил клиринга в течение последнего календарного года;
  - 14.21.3. в случае наличия риска потери деловой репутации Клирингового центра в связи с осуществлением клирингового обслуживания Участника клиринга;
  - 14.21.4. в случае наличия в деятельности лица, направившего Заявление о предоставлении допуска к клиринговому обслуживанию/Участника клиринга оснований для приостановки или прекращения допуска к клиринговому обслуживанию, предусмотренных пунктами 15.1, 15.18-15.21 общей части Правил клиринга, в течение года, предшествующего дате подачи им Заявления о предоставлении допуска к клиринговому обслуживанию/Заявления об изменении категории Участника клиринга с категории «В» на категорию «Б», «Б2» или «О»;
  - 14.21.5. в случае получения Заявления о предоставлении допуска к клиринговому обслуживанию от лица, допуск которого к клиринговому обслуживанию был прекращен по решению Клирингового центра в течение 3 (трех) лет, предшествующих дате подачи лицом указанного заявления, а также при сохранении, по оценке Клирингового центра, в деятельности лица на дату подачи такого заявления факторов, явившихся основанием для принятия Клиринговым центром решения о прекращении допуска такого лица к клиринговому обслуживанию или наличии оснований полагать, что предоставление допуска к клиринговому обслуживанию приведет к возникновению / повышению рисков Клирингового центра и (или) Участников клиринга.
    - 14.21.5.1. Для целей подтверждения устранения факторов, приведших к прекращению клирингового обслуживания лица, указанного в п. 14.21.5 общей части Правил клиринга, Клиринговый центр совместно с Заявлением о предоставлении допуска к клиринговому обслуживанию, вправе запросить у лица, указанного в п. 14.21.5 общей части Правил клиринга, дополнительную информацию, в том числе:
      - о мерах и фактах, позволяющих подтвердить устранение ранее выявленных негативных факторов;
      - об изменениях в системе риск-менеджмента, направленных на недопущение возникновения в его деятельности оснований, повлекших прекращение клирингового обслуживания;
      - о действующей системе риск-менеджмента;
      - о квалификации ключевых сотрудников, отвечающих за реализацию процедур риск-менеджмента лица.
  - 14.22. Участнику клиринга, которому предоставлен допуск к клиринговому обслуживанию на одном из Рынков с категорией «Б», не может быть предоставлен допуск к клиринговому обслуживанию на другом Рынке с категорией «Б2» и наоборот.

- 14.23. 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, для Нерезидентов из перечня или Участников клиринга, действующих в интересах и (или) за счет Нерезидентов из перечня – с учетом положений нормативных правовых актов Российской Федерации, а также нормативных актов Банка России, в том числе адресных нормативных актов и разъяснений Банка России.
- 14.24. Клиринговый центр вправе предоставить допуск к клиринговому обслуживанию с категорией «Б» или «Б2» лицу, не соответствующему требованиям, предъявляемым к Участнику клиринга соответствующей категории, в течение срока осуществления в отношении него мероприятий по предупреждению банкротства (далее – Санируемая организация) в случае выполнения следующего условия:
- 14.24.1. Банк России и/или Общество с ограниченной ответственностью «Управляющая компания Фонда консолидации банковского сектора» и/или иная специализированная организация, созданная в соответствии с Федеральным законом от 10.07.2002 №86-ФЗ «О Центральном банке Российской Федерации» в целях осуществления мероприятий по предупреждению банкротства, принимает непосредственное участие в процедуре предупреждения банкротства Санируемой организации, либо в отношении Санируемой организации Советом директоров Банка России принято решение о гарантировании непрерывности деятельности в течение срока реализации плана участия Банка России в осуществлении мер по предупреждению банкротства.
- 14.25. Клиринговый центр вправе предоставить допуск к клиринговому обслуживанию с категорией «Б» или «Б2» лицу, не соответствующему требованиям, предъявляемым к Участнику клиринга соответствующей категории, в течение срока осуществления в отношении него мероприятий по предупреждению банкротства в случае выполнения следующего условия:
- 14.25.1. инвестор, осуществляющий мероприятия по предупреждению банкротства Санируемой организации в соответствии с Федеральным законом от 26.10.2002 №127-ФЗ «О несостоятельности (банкротстве)» и/или Федеральным законом от 10.07.2002 №86-ФЗ «О Центральном банке Российской Федерации» и не являющийся лицом, описанным в пункте 14.24.1 общей части Правил клиринга (далее – Инвестор), удовлетворяет следующим требованиям:
- 14.25.1.1. Инвестор предоставил Гарантию от своего имени в пользу Клирингового центра, по форме и содержанию удовлетворяющую требованиям п. 14.26 общей части Правил клиринга;
- 14.25.1.2. в деятельности Инвестора отсутствуют факты ухудшения его финансового состояния и/или отсутствует информация, дающая основания считать возможными ухудшение финансового состояния Инвестора;
- 14.25.1.3. Инвестор должен являться Участником клиринга, либо если Инвестор не является Участником клиринга, то Инвестор предоставляет Клиринговому центру финансовую отчетность в тех же объемах и те же сроки, которые установлены общей частью Правил клиринга;

14.25.1.4. Инвестор, одновременно с Гарантией, предоставил в Клиринговый центр комплект документов в соответствии с Порядком предоставления информации и отчетности.

14.26. Гарантия должна содержать ничем не обусловленное обязательство Инвестора заплатить по требованию Клирингового центра сумму (в пределах суммы Гарантии), равную размеру неисполненных перед Клиринговым центром обязательств Участника клиринга.

Гарантия должна содержать условие о подсудности, в соответствии с которым все споры по Гарантии подлежат рассмотрению в Арбитражном суде г. Москвы или Арбитражном центре при Общероссийской общественной организации «Российский союз промышленников и предпринимателей», если иное не будет согласовано с Клиринговым центром.

Сумма Гарантии в отношении участника клиринга должна быть не меньше суммы, определенной решением Клирингового центра.

Срок действия Гарантии должен быть не менее 1 (одного) года. Гарантия в пользу Клирингового центра предоставляется по форме и содержанию удовлетворяющую требованиям Клирингового центра.

Если по прекращении Гарантии Участник клиринга продолжает не соответствовать требованиям, предъявляемым к Участнику клиринга категории «Б» или «Б2», такой Участник клиринга обязан предоставить новую Гарантию, соответствующую указанным требованиям. В случае непредоставления Участником клиринга Гарантии на новый срок не позднее, чем за 3 (три) рабочих дня до истечения срока ранее представленной Гарантии, Клиринговый центр по истечении срока Гарантии вправе приостановить допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию или изменить категорию Участника клиринга в соответствии с пунктами 15.1, 15.5, 15.6.

В случае если Инвестор перестает соответствовать требованиям, установленным п. 14.25.1 общей части Правил клиринга, и/или в отношении Инвестора выявлены факты, являющиеся в соответствии с общей частью Правил клиринга основаниями для приостановления или прекращения допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию, а также в случае непредоставления Гарантом финансовой отчетности в объеме и сроки, установленные общей частью Правил клиринга для Участников клиринга, Клиринговый центр по истечении срока Гарантии вправе приостановить допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию или изменить категорию Участника клиринга в соответствии с пунктами 15.1, 15.5, 15.6.

14.27. При предоставлении Гарантии в соответствии с пунктом 14.25 общей части Правил клиринга, Клиринговый центр вправе предоставить допуск к клиринговому обслуживанию лицу, не соответствующему требованиям, предъявляемым к Участнику клиринга соответствующей категории, с учетом следующих особенностей:

- 1) Лицу, соответствующему требованиям, предъявляемым к Участнику клиринга категории «В», Клиринговый центр вправе предоставить допуск к клиринговому обслуживанию в категории «Б2»;

- 2) Лицу, соответствующему требованиям, предъявляемым к Участнику клиринга категории «Б2», Клиринговый центр вправе предоставить допуск к клиринговому обслуживанию в категории «Б».
- 14.28. Допуск к клиринговому обслуживанию на соответствующем 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.
- 14.29. Участник клиринга вправе предоставить Клиринговому центру Заявление об изменении категории Участника клиринга.
- 14.29.1. Заявление об изменении категории Участника клиринга с категории «Б» или категории «Б2» на категорию «В» на соответствующем Рынке исполняется Клиринговым центром безусловно.
- 14.29.2. Заявление об изменении категории Участника клиринга с категории «О» на категорию «Б», «Б2» или «В» на соответствующем Рынке исполняется Клиринговым центром 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 неисполненные Маржинальные требования по Расчетным кодам для учета Обеспечения под стресс / для учета взносов в Гарантийные фонды / для учета Обеспечения под риски концентрации на эмитентов, а также по Расчетным кодам имущественного пула / Расчетным кодам для уплаты налогов, и
  - 3) у Участника клиринга отсутствуют непогашенные Задолженности по всем Расчетным кодам, учитываемые в соответствии с Правилами клиринга,
  - 4) отсутствие у Участника клиринга неисполненных обязательств по Сделкам, заключенным на соответствующем Рынке более, чем двумя Участниками торгов, не совпадающими в одном лице с таким Участником клиринга, с указанием соответствующего Участника клиринга категории «О» в качестве Клирингового брокера (при изменении категории Участника клиринга с категории «О» на категорию «Б» или «Б2»), или
  - 5) отсутствие у Участника клиринга неисполненных обязательств по Сделкам, заключенным на соответствующем Рынке Участниками торгов с указанием соответствующего Участника клиринга категории «О» в качестве Клирингового брокера (при изменении категории Участника клиринга с категории «О» на категорию «В»).
- 14.29.3. Клиринговый центр вправе изменить категорию Участника клиринга с категории «В» на категорию «Б», «Б2» или «О» на соответствующем Рынке без подачи заявления при выполнении Участником клиринга требований, установленных для Участников клиринга категории «Б», «Б2» или «О» на соответствующем Рынке.



- 14.29.4. Клиринговый центр извещает Участника клиринга и Биржу об изменении категории Участника клиринга не позднее рабочего дня, следующего за днем установления Участнику клиринга новой категории.
- 14.29.5. Клиринговый центр вправе изменить категорию Участника клиринга с категории «Б2» на категорию «Б» или «О», на одном или нескольких Рынках без подачи заявления при выполнении Участником клиринга требований, установленных для Участников клиринга категории «Б» или «О» на соответствующих Рынках. Положения указанного подпункта общей части Правил клиринга не распространяются на случаи изменения категории Участника клиринга с «Б2» на «Б», если на иных Рынках у Участника клиринга остается категория «Б2».

- 14.30. При изменении категории Участника клиринга с категории «Б», «Б2» или «О» на категорию «В» на соответствующем Рынке или при прекращении допуска к клиринговому обслуживанию Участника клиринга с категорией «Б», «Б2» или «О» на соответствующем Рынке Клиринговый центр прекращает учет обязательств Участника клиринга по внесению вклада в Гарантийный фонд такого Рынка при соблюдении условия для возврата Участнику клиринга денежных средств и/или ценных бумаг, учитываемых в качестве вклада Участника клиринга в Гарантийный фонд, установленных подпунктом 33.1.1 общей части Правил клиринга.

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

- 14.31. 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.

- 14.31.1. Депонент Расчетного депозитария, указанный в пункте 14.31 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.

- 14.32. 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 15. Порядок приостановления и прекращения допуска к клиринговому обслуживанию**

- 15.1. Клиринговый центр вправе приостановить допуск к клиринговому обслуживанию Участника клиринга категории «О», «Б», «Б2» или «В» на одном или нескольких Рынках по всем Сделкам, или по отдельным видам Сделок, или по Сделкам с отдельной ценной бумагой / иностранной валютой / драгоценным металлом / инструментом / Срочным контрактом / Договором СПФИ / Договором, базисным активом которых является товар, а также по отдельным Режимам торгов, по любому из следующих оснований:
- 15.1.1. на основании полученной от Биржи информации о приостановлении или прекращении допуска Участника клиринга к участию в торгах на Бирже на соответствующем Рынке в связи с аннулированием лицензии на осуществление профессиональной деятельности на рынке ценных бумаг или аннулированием лицензии управляющей компании инвестиционных фондов, паевых инвестиционных фондов и негосударственных пенсионных фондов (для Участника клиринга, являющегося Участником торгов);
- 15.1.2. на основании полученной от Биржи информации о приостановлении или прекращении допуска Участника клиринга к участию в торгах на Бирже на соответствующем Рынке за исключением приостановления или прекращения допуска Участника клиринга к участию в торгах на Бирже в связи с аннулированием лицензии на осуществление профессиональной деятельности на рынке ценных бумаг или аннулированием лицензии управляющей компании инвестиционных фондов, паевых инвестиционных фондов и негосударственных пенсионных фондов (для Участника клиринга, являющегося Участником торгов);
- 15.1.3. при возникновении обстоятельств, препятствующих, в соответствии с законодательством Российской Федерации или национальным законодательством государства учреждения Нерезидента, исполнению Участником клиринга сделок (за исключением чрезвычайных ситуаций), ставших известными Клиринговому центру;
- 15.1.4. при нарушении Участником клиринга установленных Правилами клиринга требований;
- 15.1.5. 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;
- 15.1.6. при применении к Участнику клиринга санкций уполномоченных органов за нарушение законодательства Российской Федерации, в том числе при применении административных наказаний;

- 15.1.7. при применении к Участнику клиринга – Нерезиденту санкций уполномоченных органов за нарушение национального законодательства государства учреждения Нерезидента;
- 15.1.8. 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;
- 15.1.9. 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;
- 15.1.10. 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;
- 15.1.11. наличие в деятельности Участника клиринга оснований для осуществления мер по предупреждению банкротства в соответствии с законодательством Российской Федерации о несостоятельности (банкротстве);
- 15.1.12. наличие в деятельности Участника клиринга оснований для отзыва (аннулирования) / принятие решения об отзыве (аннулировании) уполномоченным органом / Банком России лицензии (иного вида разрешения) на осуществление соответствующего вида деятельности в соответствии с законодательством Российской Федерации;
- 15.1.13. 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;
- 15.1.14. 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;
- 15.1.15. в случае непредоставления Участником клиринга информации и документов в соответствии с пунктами 12.5-12.8 общей части Правил клиринга в установленный Правилами клиринга срок, или в случае представления Участником клиринга недостоверных документов или сведений;
- 15.1.16. 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;

- 15.1.17. при наличии фактов неисполнения или ненадлежащего исполнения Участником клиринга обязательств перед Клиринговым центром, возникших из Договора об оказании клиринговых услуг;
- 15.1.18. в случае непредоставления Участником клиринга Анкеты для целей выявления иностранных налогоплательщиков в соответствии с пунктом 12.9 общей части Правил клиринга;
- 15.1.19. в случае получения от иностранного налогового органа уведомления о невыполнении Участником клиринга требований законодательства иностранного государства;
- 15.1.20. в случае наличия риска потери деловой репутации Клирингового центра в связи с продолжением клирингового обслуживания Участника клиринга;
- 15.1.21. 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 90 (девяноста) дней после наступления обстоятельства, с которого документ, удостоверяющий личность Руководителя, копия которого была ранее предоставлена Клиринговому центру, подлежит замене;
- 15.1.22. в случае возникновения у Клирингового центра подозрения, что какие-либо операции осуществляются (совершаются) Участником клиринга или клиентом Участника клиринга в целях легализации (отмывания) доходов, полученных преступным путем, или финансирования терроризма, или являются сомнительными, или каким бы то ни было иным образом связаны с легализацией (отмыванием) доходов, полученных преступным путем, или финансирования терроризма;
- 15.1.23. в случае предоставления Участником клиринга в Клиринговый центр Заявления о приостановлении допуска к клиринговому обслуживанию Участника клиринга (далее – Заявление о приостановлении допуска).

В Заявлении о приостановлении допуска указывается дата, с которой необходимо приостановить допуск к клиринговому обслуживанию Участника клиринга, при этом Заявление о приостановлении допуска исполняется не позднее следующего рабочего дня после получения указанного Заявления, если более поздняя дата не указана в самом Заявлении о приостановлении допуска, при условии, что Заявление о приостановлении допуска получено Клиринговым центром до 15:00 (по московскому времени). Если Заявление о приостановлении допуска получено Клиринговым центром после 15:00 (по московскому времени), то Заявление о приостановлении допуска исполняется не позднее, чем на 2 (второй) рабочий день, следующий за датой получения указанного Заявления, если более поздняя дата не указана в самом Заявлении о приостановлении допуска. В случае принятия Клиринговым центром решения о приостановлении допуска к клиринговому обслуживанию Участника клиринга допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию приостанавливается с даты, указанной в Заявлении о приостановлении допуска, если иная дата не указана в решении Клирингового центра;

- 15.1.24. в случае нарушения заверений Участника клиринга, представленных в соответствии с Правилами клиринга;

- 15.1.25. в случае непредоставления Участником клиринга Гарантии на новый срок, если по прекращении Гарантии Участник клиринга продолжает не соответствовать требованиям, предъявляемым к Участнику клиринга категории «Б» или «Б2», в соответствии с пунктом 14.26 общей части Правил клиринга;
- 15.1.26. в случае если Инвестор перестает соответствовать требованиям, установленным п. 14.25.1 общей части Правил клиринга, и/или в отношении Инвестора выявлены факты, являющиеся в соответствии с общей частью Правил клиринга основаниями для приостановления или прекращения допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию, а также в случае непредоставления Гарантом финансовой отчетности в объеме и сроки, установленные общей частью Правил клиринга для Участников клиринга;
- 15.1.27. в случае принятия решения о реорганизации Участника клиринга, влекущей прекращение юридического лица (за исключением реорганизации в форме преобразования);
- 15.1.28. в случае отзыва Банком России лицензии на осуществление страховой деятельности у Участника клиринга – Некредитной организации, являющейся страховой организацией или обществом взаимного страхования, в связи с отказом такого Участника клиринга от осуществления предусмотренной лицензиями деятельности;
- 15.1.29. в случае поступления в Клиринговый центр информации от Банка России о необходимости приостановления допуска Участника клиринга, в том числе при возникновении чрезвычайной ситуации.
- 15.2. При наличии нескольких оснований для приостановления допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию Клиринговый центр вправе приостановить допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию на основании одного или нескольких таких оснований.
- 15.3. Клиринговый центр приостанавливает допуск Участника клиринга категории «О» к клиринговому обслуживанию в случае отзыва (аннулирования) Банком России лицензии на осуществление клиринговой деятельности у Участника клиринга - Резидента, не имеющего лицензии Банка России на осуществление банковских операций.
- 15.4. Клиринговый центр вправе приостановить допуск к клиринговому обслуживанию Участника клиринга категории «О», «Б», «Б2» 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 участвующим 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.

- 15.5. Клиринговый центр вправе установить Участнику клиринга категории «Б» категорию «Б2» на одном или нескольких Рынках по основаниям, предусмотренным пунктом 15.1 общей части Правил клиринга, а также:
- 15.5.1. при несоответствии размера Обеспечения под стресс Участника клиринга на соответствующем Рынке размеру, установленному в соответствии с Правилами клиринга;
- 15.5.2. при выполнении условия, указанного в подпункте 45.2.3, 46.4.5 или 46.4.6 общей части Правил клиринга;
- 15.5.3. для кредитных организаций, созданных в соответствии с законодательством Российской Федерации, в случае возникновения в деятельности такой кредитной организации в течение 12 (двенадцати) отчётных месяцев, предшествующих последней отчётной дате следующих фактов:
- 15.5.3.1. снижения запаса, определенного подпунктом 14.3.3.1 общей части Правил клиринга, собственных средств (капитала) над минимальным размером собственных средств (капитала), установленным для кредитной организации соответствующего статуса в соответствии с Федеральным законом «О банках и банковской деятельности» в зависимости от вида полученной лицензии, менее, чем на 50% от минимального размера собственных средств (капитала) при соблюдении требования к минимальному размеру собственных средств (капитала), установленного для кредитной организации соответствующего статуса в соответствии с Федеральным законом «О банках и банковской деятельности» - однократное и более в течение 12 (двенадцати) отчётных месяцев, предшествующих последней отчётной дате;
- 15.5.3.2. снижения собственных средств (капитала) менее минимального размера собственных средств (капитала), установленного для кредитной организации соответствующего статуса в соответствии с Федеральным законом «О банках и банковской деятельности» в зависимости от вида полученной лицензии - однократное и более в течение 12 (двенадцати) отчётных месяцев, предшествующих последней отчётной дате, а также при отсутствии в деятельности Участника клиринга оснований, определенных подпунктами 15.6.4.1-15.6.4.2 общей части Правил клиринга;
- 15.5.3.3. несоблюдения установленной нормативными актами Банка России, надбавки на поддержание достаточности капитала в размере 2,5 процентных пункта при соблюдении обязательных нормативов достаточности капитала, установленных Банком России - однократное и более в течение 12 (двенадцати) отчётных месяцев, предшествующих последней отчётной дате;
- 15.5.3.4. несоблюдения запаса по обязательным нормативам мгновенной и текущей ликвидности в размере 15 процентных пунктов, определенного подпунктом 14.3.3.3 общей части Правил клиринга при соблюдении обязательных нормативов мгновенной и текущей ликвидности, установленных Банком России - однократное и более в течение 12 (двенадцати) отчётных месяцев, предшествующих последней отчётной дате;
- 15.5.3.5. нарушение любого обязательного норматива, установленного нормативными актами Банка России, в том числе в случае принятия Банком России решения о том, что указанное нарушение не будет рассматриваться в качестве основания для применения мер надзорного реагирования - однократное и более в течение 12

- (двенадцати) отчётных месяцев, предшествующих последней отчётной дате, а также при отсутствии в деятельности Участника клиринга оснований, определенных подпунктом 15.6.4.3 общей части Правил клиринга;
- 15.5.4. для профессиональных участников рынка ценных бумаг, созданных в соответствии с законодательством Российской Федерации, в случае возникновения в их деятельности в течение 12 (двенадцати) отчётных месяцев, предшествующих последней отчётной дате следующих фактов:
- 15.5.4.1. снижение запаса, определенного подпунктом 14.3.4.1 общей части Правил клиринга, по показателю размер собственных средств над минимальным размером собственных средств, определенным в соответствии с нормативными актами Банка России, менее, чем на 50% от минимального размера собственных средств при соблюдении требования к минимальному размеру собственных средств (капитала) - однократное и более в течение 12 (двенадцати) отчётных месяцев, предшествующих последней отчётной дате;
- 15.5.4.2. снижение размера собственных средств менее минимального размера собственных средств, определенного в соответствии с нормативными актами Банка России - однократное и более в течение 12 (двенадцати) отчётных месяцев, предшествующих последней отчётной дате, а также при отсутствии в деятельности Участника клиринга оснований, определенных подпунктом 15.6.5.1 общей части Правил клиринга;
- 15.5.4.3. несоблюдение запаса, определенного подпунктом 14.3.4.2 общей части Правил клиринга, по обязательному нормативу достаточности капитала в размере 2,5 процентных пунктов при соблюдении обязательного норматива достаточности капитала, установленного Банком России - однократное и более в течение 4 (четырёх) отчётных кварталов, предшествующих последней отчётной дате;
- 15.5.4.4. несоблюдение запаса, определенного подпунктом 14.3.4.3 общей части Правил клиринга, по нормативу краткосрочной ликвидности (для профессиональных участников рынка ценных бумаг, осуществляющих брокерскую деятельность) в размере 15 процентных пунктов при соблюдении обязательного норматива краткосрочной ликвидности, установленного Банком России - однократное и более в течение 4 (четырёх) отчётных кварталов, предшествующих последней отчётной дате;
- 15.5.4.5. нарушение любого обязательного норматива, установленного нормативными актами Банка России - однократное и более в течение 4 (четырёх) отчётных кварталов, предшествующих последней отчётной дате, а также при отсутствии в деятельности Участника клиринга оснований, определенных подпунктом 15.6.5.2 общей части Правил клиринга;
- 15.5.5. для страховых компаний и обществ взаимного страхования, созданных в соответствии с законодательством Российской Федерации, в случае возникновения в деятельности таких организаций в течение 4 (четырёх) отчётных кварталов, предшествующих последней отчётной дате, следующих фактов:
- 15.5.5.1. снижение значения нормативного соотношения собственных средств (капитала) и принятых обязательств менее порогового значения, установленного в размере 1,05, при соблюдении минимально допустимого значения нормативного соотношения собственных средств (капитала) и принятых обязательств, установленного в

- размере 1, - однократное и более в течение 4 (четырёх) отчётных кварталов, предшествующих последней отчётной дате;
- 15.5.5.2. снижение значения нормативного соотношения собственных средств (капитала) и принятых обязательств менее минимально допустимого значения, установленного в размере 1, - однократное и более в течение 4 (четырёх) отчётных кварталов, предшествующих последней отчётной дате, а также при отсутствии в деятельности Участника клиринга оснований, определенных подпунктом 15.6.6.1 общей части Правил клиринга.
- 15.5.6. для Банков-нерезидентов, в том числе Банков ЕврАзЭС/ЕАЭС, а также Некредитных организаций-нерезидентов, имеющих специальное разрешение на осуществление операций на финансовых рынках, в случае наличия в деятельности в течение 4 (четырёх) отчётных кварталов, предшествующих последней отчётной дате, следующих фактов:
- 15.5.6.1. снижения запаса, определенного подпунктом 14.3.6.1 общей части Правил клиринга, собственных средств (капитала) над минимальным размером собственных средств (капитала), в случае если минимальный размер собственных средств (капитала) устанавливается компетентным органом государства учреждения, менее чем на 50% при соблюдении требования к минимальному размеру собственных средств (капитала) – однократное и более в течение 4-х (четырёх) отчётных кварталов, предшествующих последней отчётной дате;
- 15.5.6.2. несоблюдения запаса, определенного подпунктом 14.3.6.2 общей части Правил клиринга, нормативов достаточности капитала, в размере 2,5 процентных пункта относительно минимального установленного уровня, при соблюдении обязательных нормативов достаточности капитала, в случае если обязательные нормативы достаточности капитала установлены компетентным органом государства учреждения – однократное и более в течение 4-х (четырёх) отчётных кварталов, предшествующих последней отчётной дате;
- 15.5.6.3. несоблюдения запаса, определенного подпунктом 14.3.6.3 общей части Правил клиринга, нормативов ликвидности, в размере 15 процентных пунктов относительно минимального установленного уровня, при соблюдении обязательных нормативов ликвидности, в случае если обязательные нормативы ликвидности установлены компетентным органом государства учреждения – однократное и более в течение 4-х (четырёх) отчётных кварталов, предшествующих последней отчётной дате.
- 15.6. Клиринговый центр вправе установить Участнику клиринга категории «Б» или «Б2» категорию «В» на одном или нескольких Рынках по основаниям, предусмотренным пунктом 15.1 общей части Правил клиринга, а также:
- 15.6.1. при несоответствии размера взноса Участника клиринга категории «Б» или «Б2» в Гарантийный фонд соответствующего Рынка размеру, установленному в соответствующей специальной части Правил клиринга;
- 15.6.2. при несоответствии размера Обеспечения под стресс Участника клиринга на соответствующем Рынке размеру, установленному в соответствии с Правилами клиринга;
- 15.6.3. при несоответствии требованиям пункта 14.15 общей части Правил клиринга с учётом положений подпунктов 15.6.4 -15.6.6 общей части Правил клиринга;



- 15.6.4. для кредитных организаций, созданных в соответствии с законодательством Российской Федерации, в случае возникновения в деятельности такой кредитной организации в течение 12 (двенадцати) отчётных месяцев, предшествующих последней отчётной дате, следующих фактов:
- 15.6.4.1. снижения собственных средств (капитала) менее минимального размера собственных средств (капитала), установленного для кредитной организации соответствующего статуса в соответствии с Федеральным законом «О банках и банковской деятельности» в зависимости от вида полученной лицензии, в течение 3-х (трёх) отчётных месяцев подряд в случае отсутствия у Клирингового центра информации о планах изменения статуса кредитной организации в течение 10-ти (десяти) отчётных месяцев с момента допущения первичного нарушения;
- 15.6.4.2. снижения собственных средств (капитала) менее минимального размера собственных средств (капитала), установленного для кредитной организации соответствующего статуса в соответствии с Федеральным законом «О банках и банковской деятельности» в зависимости от вида полученной лицензии, в течение не менее 9-ти (девяти) отчётных месяцев подряд в случае наличия у Клирингового центра информации о планах изменения статуса кредитной организации в течение 10-ти (десяти) отчётных месяцев с момента допущения первичного нарушения;
- 15.6.4.3. неустранимое нарушение любого обязательного норматива, установленного нормативными актами Банка России, в течение 2-х (двух) отчётных месяцев подряд и более при непредоставлении в Клиринговый центр информации о принятии Банком России решения о том, что указанное нарушение не будет рассматриваться в качестве основания для применения мер надзорного реагирования;
- 15.6.5. для профессиональных участников рынка ценных бумаг, созданных в соответствии с законодательством Российской Федерации, в случае возникновения в деятельности таких организаций в течение 12 (двенадцати) отчётных месяцев, предшествующих последней отчётной дате, следующих фактов:
- 15.6.5.1. снижение размера собственных средств менее минимального размера собственных средств, определенного в соответствии с нормативными актами Банка России, в течение 3-х (трёх) отчётных месяцев и более;
- 15.6.5.2. неустранимое нарушение обязательного норматива достаточности капитала и/или норматива краткосрочной ликвидности (для профессиональных участников рынка ценных бумаг, осуществляющих брокерскую деятельность) в течение 2-х (двух) последовательных отчётных кварталов и более;
- 15.6.6. для страховых компаний и обществ взаимного страхования, созданных в соответствии с законодательством Российской Федерации, в случае возникновения в деятельности таких организаций следующих фактов:
- 15.6.6.1. снижение значения нормативного соотношения собственных средств (капитала) и принятых обязательств менее минимально допустимого значения, установленного в размере 1, в течение 2-х (двух) последовательных отчётных кварталов и более;
- 15.6.7. для Банков-нерезидентов, в том числе Банков ЕврАзЭС/ЕАЭС, а также Некредитных организаций-нерезидентов, имеющих специальное разрешение на осуществление операций на финансовых рынках, в случае наличия в деятельности в течение 4 (четырёх) отчётных кварталов, предшествующих последней отчётной дате, следующих фактов:

- 15.6.7.1. снижения собственных средств (капитала) менее минимального размера собственных средств (капитала), в случае если минимальный размер собственных средств (капитала) устанавливается компетентным органом государства учреждения – однократное и более в течение 4-х (четырёх) отчётных кварталов, предшествующих последней отчётной дате;
- 15.6.7.2. несоблюдения обязательных нормативов, в случае если нормативы установлены компетентным органом государства учреждения – однократное и более в течение 4-х (четырёх) отчётных кварталов, предшествующих последней отчётной дате.
- 15.6.8. при выполнении условия, указанного в подпункте 45.2.3, 46.4.5 или 46.4.6 общей части Правил клиринга.
- 15.7. Клиринговый центр вправе установить по всем Торгово-клиринговым счетам и Расчетным кодам Участника клиринга категории «О» на одном или нескольких Рынках признак «запрет коротких продаж» и признак «запрет необеспеченных покупок» или предпринять иные меры, предусмотренные соответствующей специальной частью Правил клиринга, по основаниям, предусмотренным пунктом 15.5 общей части Правил клиринга, а также:
- 15.7.1. при несоответствии Участника клиринга требованиям, установленным подпунктом 14.7.1, или подпунктом 14.7.2, или подпунктом 14.7.3 общей части Правил клиринга.
- При этом в целях проверки соответствия собственных средств (капитала) Участника клиринга – Нерезидента требованиям, установленным подпунктами 14.7.1-14.7.3 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.
- 15.8. В случае если действие указанных в подпункте 15.7.1 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 (трех) Расчетных 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 (четвертого) Расчетного дня с даты установления указанного признака (принятия указанных мер).
- 15.9. Клиринговый центр вправе установить Участнику клиринга категории «О» категорию «Б» или «Б2» в случае, если в течение 2 (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.

- 15.10. При отсутствии на Рынке категории «В» Клиринговый центр вправе приостановить допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию на таком Рынке по основаниям, указанным в подпунктах 15.5.1, 15.5.2 общей части Правил клиринга.
- 15.11. При установлении Клиринговым центром Участнику клиринга категории «Б» или «Б2» 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 30.19 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.
- 15.12. Приостановление допуска к клиринговому обслуживанию Участника клиринга на одном или нескольких Рынках означает невозможность Участнику клиринга становиться стороной по Сделкам, заключаемым на таком (таких) Рынках Участниками торгов (за исключением Клирингового центра), а также невозможность подачи таким Участником клиринга Предложений на заключение Внебиржевых сделок в соответствии с Правилами клиринга Рынка, клиринговое обслуживание Участника клиринга на котором приостановлено.
- В случае приостановления допуска к клиринговому обслуживанию на одном или нескольких 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 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.
- 15.13. В случае приостановления допуска к клиринговому обслуживанию на Рынке Клиринговый центр устанавливает признак «запрет коротких продаж» и признак «запрет необеспеченных покупок» по всем Торгово-клиринговым счетам и Расчетным кодам Участника клиринга категории «О», «Б» или «Б2» на таком Рынке (если применимо).
- 15.14. В случае приостановления допуска к клиринговому обслуживанию на Рынке Клиринговый центр вправе:
- 15.14.1. установить по всем Торгово-клиринговым счетам Участника клиринга категории «О», «Б» или «Б2» на одном или нескольких Рынках признак «запрет коротких продаж» и признак «запрет необеспеченных покупок»;

- 15.14.2. в случае неисполнения или ненадлежащего исполнения Участником клиринга обязательств, допущенных к клирингу, на одном Рынке принять решение не осуществлять возврат Участнику клиринга взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс на одном или нескольких других Рынках. В случае принятия такого решения возврат Участнику клиринга взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс не осуществляется до урегулирования неисполненных обязательств Участника клиринга;
- 15.14.3. аннулировать Профили активов по одному или нескольким активам на одном или нескольких Рынках;
- 15.14.4. в случае неисполнения или ненадлежащего исполнения Участником клиринга обязательств, допущенных к клирингу, принять решение о заключении от имени Участника клиринга закрывающих сделок, направленных на прекращение обязательств Участника клиринга по всем Расчетным кодам / Торгово-клиринговым счетам на Рынке, на котором допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию приостановлен и/или на одном или нескольких других Рынках.
- При принятии указанного решения Клиринговый центр также заключает балансирующие сделки.
- Порядок заключения закрывающих и балансирующих сделок определен статьей 26 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.
- 15.14.5. О всех решениях, принятых в соответствии с настоящим пунктом общей части Правил клиринга, а также об отмене указанных решений, Участник клиринга, в отношении которого приняты указанные решения, уведомляется Клиринговым центром посредством ЭДО не позднее Расчетного дня, следующего за днем принятия соответствующего решения.
- 15.15. После получения информации о прекращении действия оснований для приостановления допуска к клиринговому обслуживанию на одном или нескольких Рынках и на основании соответствующего письма Участника клиринга Клиринговый центр вправе принять решение о возобновлении допуска к клиринговому обслуживанию Участника клиринга.
- 15.15.1. Для возобновления допуска к клиринговому обслуживанию, приостановленного на основании подпункта 15.1.2 общей части Правил клиринга, предоставление соответствующего письма Участника клиринга не требуется.
- 15.15.2. Клиринговый центр вправе принять решение о возобновлении допуска к клиринговому обслуживанию, приостановленного на основании подпунктов 15.5.1, 15.5.2 общей части Правил клиринга, без предоставления соответствующего письма Участника клиринга.
- 15.16. Клиринговый центр вправе принять решение о возобновлении допуска к клиринговому обслуживанию, приостановленного на основании подпункта 15.1.23 общей части Правил клиринга, в случае предоставления Участником клиринга в Клиринговый центр Заявления о возобновлении допуска к клиринговому обслуживанию Участника клиринга (далее – Заявление о возобновлении допуска),

при условии, что Участник клиринга соответствует всем требованиям к Участникам клиринга соответствующей категории, предусмотренным Правилами клиринга.

- 15.17. В Заявлении о возобновлении допуска указывается дата, с которой необходимо возобновить доступ к клиринговому обслуживанию Участника клиринга, при этом в случае, если Участник клиринга на момент подачи Заявления о возобновлении допуска соответствует всем требованиям к Участникам клиринга соответствующей категории, предусмотренным Правилами клиринга, указанное Заявление исполняется не позднее следующего рабочего дня после получения указанного Заявления, если более поздняя дата не указана в самом Заявлении о возобновлении допуска, при условии, что Заявление о возобновлении допуска получено Клиринговым центром до 15:00 (по московскому времени). Если Заявление о возобновлении допуска получено Клиринговым центром после 15:00 (по московскому времени), то Заявление о возобновлении допуска исполняется не позднее, чем на 2 (второй) рабочий день, следующий за датой получения указанного Заявления, если более поздняя дата не указана в самом Заявлении о возобновлении допуска. В том случае, если Участник клиринга на момент подачи Заявления о возобновлении допуска не соответствует всем требованиям к Участникам клиринга соответствующей категории, предусмотренным Правилами клиринга, заявление исполняется не позднее следующего рабочего дня после того, как Участник клиринга подтвердил свое соответствие всем указанным требованиям.
- 15.18. Клиринговый центр прекращает доступ Участника клиринга к клиринговому обслуживанию (независимо от его категории) на всех Рынках (с учетом особенностей, установленных статьей 59 общей части Правил клиринга) по любому из следующих оснований:
- 15.18.1. прекращение действия Договора об оказании клиринговых услуг;
- 15.18.2. отзыв Банком России лицензии на осуществление банковских операций у Участника клиринга – Кредитной организации;
- 15.18.3. назначение временной администрации в отношении Участника клиринга – Некредитной организации или Участника клиринга – Нерезидента – некредитной организации и (или) назначение лица, которое в силу примененного к такому Участнику клиринга права вправе осуществлять процедуры банкротства в отношении этого Участника клиринга (ликвидатора, администратора, управляющего и т.п.);
- 15.18.4. принятие арбитражным судом (уполномоченным органом государства учреждения Участника клиринга – Нерезидента) решения о введении в отношении Участника клиринга – Некредитной организации или Участника клиринга – Нерезидента – некредитной организации одной из процедур банкротства;
- 15.18.5. назначение временной администрации по управлению Участником клиринга – Кредитной организацией в рамках мер по предупреждению банкротства кредитной организации и введение моратория на удовлетворение требований кредиторов Участника клиринга – Кредитной организации;
- 15.18.6. отзыв (аннулирование) 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;
- 15.18.7. прекращение 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;
- 15.18.8. прекращение международного договора, в соответствии с которым учрежден Участник клиринга - Международная организация, для Российской Федерации либо принятие решения уполномоченными лицами сторон указанного международного договора о прекращении деятельности Участника клиринга - Международной организации;
- 15.18.9. размещение в сети Интернет на официальном сайте уполномоченного органа информации о включении Участника клиринга в перечень организаций, в отношении которых имеются сведения об их причастности к экстремистской деятельности или терроризму, 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);
- 15.18.10. принятие решения о ликвидации Участника клиринга;
- 15.18.11. вступление в силу федерального закона о ликвидации государственной корпорации, государственной компании;
- 15.18.12. вступление в силу федерального закона / Указа Президента Российской Федерации о ликвидации публично-правовой компании;
- 15.18.13. в случае отзыва Банком России лицензии на осуществление страховой деятельности у Участника клиринга – Некредитной организации, являющейся страховой организацией или обществом взаимного страхования, в связи с нарушением таким Участником клиринга законодательства Российской Федерации, включая требования, установленные Банком России.
- 15.19. Клиринговый центр прекращает допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию на одном или нескольких Рынках в случае предоставления Участником клиринга Заявления о прекращении допуска к клиринговому обслуживанию.
- 15.19.1. Клиринговый центр прекращает допуск Участника клиринга на основании Заявления о прекращении допуска к клиринговому обслуживанию на Рынке, указанном в заявлении, при отсутствии у Участника клиринга на дату получения Клиринговым центром такого заявления обязательств, учитываемых по всем Расчетным кодам и Торгово-клиринговым счетам Участника клиринга, открытым Участнику клиринга на таком Рынке, включая обязательства по Сделкам, Задолженности, обязательства из Правил клиринга, обязательства по передаче /

- требования по получению Дохода, определенные Клиринговым центром в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов и учтенные при расчете Единого лимита по Расчетному коду, обязанности по уплате комиссионных вознаграждений, в том числе комиссионного вознаграждения за учет индивидуального клирингового и иного обеспечения в месяц предоставления Участником клиринга Заявления о прекращении допуска к клиринговому обслуживанию или за месяц, предшествующий месяцу предоставления Участником клиринга Заявления о прекращении допуска к клиринговому обслуживанию.
- 15.19.2. При выполнении условий, указанных в подпункте 15.19.1 общей части Правил клиринга, Клиринговый центр прекращает допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию на основании Заявления о прекращении допуска к клиринговому обслуживанию, в том числе при наличии у Участника клиринга требования по возврату Обеспечения, Обеспечения под стресс, взносов в Гарантийные фонды.
- 15.20. Клиринговый центр вправе прекратить допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию на всех Рынках:
- 15.20.1. при назначении временной администрации по управлению Участником клиринга - Кредитной организацией в рамках мер по предупреждению банкротства кредитной организации, за исключением случая публичного заявления Банка России об оказании финансовой поддержки такому Участнику клиринга – Кредитной организации в целях обеспечения непрерывности его деятельности, а также при назначении временной администрации по управлению Участником клиринга – Банком-нерезидентом или при введении иной аналогичной процедуры в отношении Участника клиринга – Банка-нерезидента, предусмотренной законодательством государства учреждения Участника клиринга – Банка-нерезидента;
- 15.20.2. в случае неисполнения или ненадлежащего исполнения Участником клиринга, допуск к клиринговому обслуживанию которого приостановлен, обязательств по Сделкам, Маржинального требования и/или иных обязательств Участника клиринга, возникших из Правил клиринга, или в случае, если в отношении Участника клиринга, допуск к клиринговому обслуживанию которого приостановлен, имеется информация о наступлении события, которое не позволит Участнику клиринга исполнять указанные обязательства;
- 15.20.3. в случае получения информации Банка России или уполномоченного государственного органа об отнесении какой-либо операции Участника клиринга или клиента Участника клиринга к подозрительной и/или применению к Участнику клиринга и к клиенту Участника клиринга органом, уполномоченным в сфере противодействия легализации (отмыванию) доходов, полученных преступным путем, и финансированию терроризма, мер воздействия за нарушение законодательства в сфере противодействия легализации (отмыванию) доходов, полученных преступным путем, и финансированию терроризма;
- 15.20.4. в случае направления Участником клиринга ходатайства об аннулировании лицензии на осуществление банковских операций, не связанном с прекращением деятельности Участника клиринга.

- 15.21. Клиринговый центр вправе прекратить допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию на одном или нескольких Рынках:
- 15.21.1. 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);
- 15.21.2. в случае 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;
- 15.21.3. в случае неоднократного (два и более раза) в течение одного года нарушения Участником клиринга установленных Правилами клиринга требований;
- 15.21.4. в случае поступления в Клиринговый центр информации от Банка России о необходимости прекращения допуска Участника клиринга, в том числе при возникновении чрезвычайной ситуации.
- 15.22. Прекращение допуска к клиринговому обслуживанию Участника клиринга на одном или нескольких Рынках означает прекращение оказания Клиринговым центром Участнику клиринга клиринговых услуг в соответствии с Правилами клиринга на таком (таких) Рынках, за исключением клиринговых услуг, указанных в статье 59 общей части Правил клиринга и клиринговых услуг, связанных с учетом и возвратом Обеспечения, Обеспечения под стресс, взносов в Гарантийные фонды.
- 15.23. 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 16. Порядок регистрации Участников клиринга, клиентов Участника клиринга, порядок открытия и закрытия Расчетных кодов**

- 16.1. Клиринговый центр осуществляет регистрацию Участников клиринга.
- 16.1.1. Процедура регистрации Участника клиринга, проводимая после заключения Клиринговым центром с Участником клиринга Договора об оказании клиринговых услуг, предусматривает присвоение (открытие) Участнику клиринга следующих кодов / идентификаторов:
- кода Участника клиринга в соответствии с требованиями нормативных актов Банка России;
  - Идентификатора (присваивается Клиринговым центром). Если Участник клиринга является Участником торгов, Идентификатор присваивается на основании данных, полученных от Биржи;
  - собственного Расчетного кода Участника клиринга для фондового рынка, рынка депозитов и рынка кредитов (открывается без заявления Участника клиринга).



- 16.1.2. Изменение кода Участника клиринга осуществляется на основании информации, предоставляемой Участником клиринга в соответствии со статьей 12 общей части Правил клиринга и / или на основании сведений (информации) о юридическом лице из официальных источников, в том числе электронного сервиса Федеральной налоговой службы.
- 16.1.3. Клиринговый центр извещает Участника клиринга о присвоенном/измененном коде Участника клиринга путем направления уведомления в форме электронного документа.
- 16.1.4. 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).
- 16.2. Клиринговый центр осуществляет регистрацию клиентов Участника клиринга по требованию Участника клиринга.
- Регистрация Обособленных клиентов осуществляется в соответствии со статьей 23 общей части Правил клиринга.
- 16.3. Открытие Расчетного кода Участника клиринга осуществляется для каждого Рынка или для всех Рынков, включенных в единый пул обеспечения, определенных в пункте 21.1 общей части Правил клиринга, в порядке и случаях, установленных настоящей статьей общей части Правил клиринга.
- 16.3.1. 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.
- 16.3.2. Для допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию на любом Рынке Клиринговый центр открывает собственный Расчетный код Участника клиринга для соответствующего Рынка без заявления Участника клиринга.
- 16.4. Для одного Расчетного кода нерезидента открывается 1) один Счет обеспечения нерезидента, 2) один Счет обеспечения в российских рублях и 3) 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. Перечень видов Сделок, по которым должны исполняться обязательства по Расчетным кодам нерезидента (нерезидентов), и (или) режимов, и (или) Рынков, в рамках которых они заключаются, перечень видов имущества, которое может учитываться в качестве Обеспечения по Расчетным кодам нерезидента (нерезидентов), может быть установлен (ограничен / изменен) решением Клирингового центра.
- 16.4.1. Специальными частями Правил клиринга могут быть установлены особенности / иной порядок открытия Расчетных кодов / Счетов обеспечения Участника клиринга для соответствующего Рынка.
- 16.5. Участнику клиринга могут быть открыты Расчетные коды Участника клиринга следующих типов:
- собственный – для учета денежных средств Участника клиринга;

- клиентский – для учета денежных средств, находящихся в обеспечении Участника клиринга и предназначенных для исполнения обязательств по Сделкам, заключенным в интересах и (или) за счет клиента (клиентов) Участника клиринга, иных обязательств, указанных в Правилах клиринга, а также обеспечения исполнения указанных обязательств;
  - ДУ – для учета денежных средств, находящихся в доверительном управлении Участника клиринга, или для учета денежных средств негосударственного пенсионного фонда, имеющего лицензию на осуществление деятельности по пенсионному обеспечению и пенсионному страхованию, при размещении средств пенсионных резервов негосударственного пенсионного фонда или при размещении средств пенсионных накоплений негосударственного пенсионного фонда.
- 16.5.1. Участнику клиринга может быть открыто неограниченное количество Расчетных кодов Участника клиринга каждого из типов.
- 16.5.2. Участник клиринга – Нерезидент вправе изменить тип Расчетного кода (за исключением Расчетного кода, открытого для Обособленного клиента и Расчетного кода, с которым связана Обособленная Брокерская фирма) с клиентского на собственный в случае перехода права собственности на Обеспечение, учитываемое по Расчетному коду, на основании заключенного между Участником клиринга - Нерезидентом и его клиентом соглашения о передаче прав собственности на имущество, составляющее предмет обеспечения, предоставив в Клиринговый центр Заявление об изменении типа Расчетного кода.
- 16.6. Расчетный код Участника клиринга имеет один из следующих признаков, указывающих на модель использования Расчетного кода:
- Расчетный код для заключения сделок Участником клиринга, совпадающим в одном лице с Участником торгов, и/или для заключения внебиржевых сделок Участником клиринга (устанавливается по умолчанию);
  - Расчетный код для заключения сделок от имени и в интересах Участника клиринга на основании заявок Участника торгов / Котировок участника торгов, не совпадающего в одном лице с таким Участником клиринга (далее – Расчетный код для заключения сделок от имени и в интересах Участника клиринга);
  - Расчетный код для заключения сделок на основании заявок / Котировок участника торгов, в которых Участник клиринга будет указан в качестве Клирингового брокера (далее – Расчетный код Клирингового брокера).
- Изменение указанного признака осуществляется на основании Запроса на изменение модели использования Расчетного кода.
- Участник клиринга – Нерезидент одновременно с подачей в соответствии с пунктом 16.5.2 общей части Правил клиринга Заявления об изменении типа Расчетного кода обязан подать Запрос на изменение модели использования Расчетного кода, согласно которому Расчетному коду устанавливается признак Расчетный код для заключения сделок от имени и в интересах Участника клиринга, если текущий признак Расчетного кода является иным.
- 16.7. Клиринговый центр без заявления Участника клиринга открывает Участнику клиринга Расчетный код для учета взносов в Гарантийные фонды.

- Одному Участнику клиринга категории «Б», «Б2», или «О» или «В» открывается один Расчетный код для учета взносов в Гарантийные фонды.
- 16.8. Участнику клиринга категории «В», «Б», «Б2» или «О» Клиринговый центр без заявления Участника клиринга открывает Расчетный код для учета Обеспечения под стресс.
- 16.8.1. Одному Участнику клиринга категории «Б», «Б2», или «О» или «В» открывается один Расчетный код для учета Обеспечения под стресс.
- 16.9. Участнику клиринга категории «Б», «Б2», «В» или «О», Клиринговый центр без заявления Участника клиринга открывает Расчетный код для учета Обеспечения под риски концентрации на эмитентов.
- 16.9.1. Одному Участнику клиринга категории «Б», «Б2», «В» или «О» открывается один Расчетный код для учета Обеспечения под риски концентрации на эмитентов.
- 16.10. 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).
- 16.10.1. Участник клиринга несет ответственность за соблюдение режима учета денежных средств, переданных ему клиентом, и / или находящихся в доверительном управлении Участника клиринга, в том числе в отношении которых у такого Участника клиринга в соответствии с законодательством Российской Федерации и нормативными актами Банка России отсутствует право использования в собственных интересах переданных ему, в том числе его клиентом, действующим в качестве доверительного управляющего, денежных средств клиента / учредителя (учредителей) доверительного управления, и (или) использования указанных денежных средств для обеспечения исполнения собственных обязательств или обязательств третьих лиц.
- 16.10.2. Правила не регулируют отношения между Клиринговым центром и клиентами Участников клиринга, иными лицами в интересах и (или) за счет которых действуют Участники клиринга, за исключением случаев, прямо предусмотренных в Правилах клиринга. Ссылка на Правила клиринга в правоотношениях между третьими лицами не влечет возникновение прав и обязанностей Клирингового центра в отношении каких-либо третьих лиц. Клиринговый центр не несет ответственность перед клиентами Участников клиринга, иными лицами в интересах и (или) за счет которых действуют Участники клиринга, в том числе за действия Участников клиринга.
- 16.11. 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 Рынках, условием допуска к клиринговому обслуживанию на которых является открытие Торгово-клиринговых счетов Участника клиринга).

- 16.12. Открытие Расчетных кодов Участника клиринга осуществляется на основании Запроса на открытие Расчетного кода 1-го уровня, предоставленного Участником клиринга Клиринговому центру или Запроса на открытие Торгово-клирингового счета для заключения депозитных договоров, а также без заявления Участника клиринга в случаях, установленных специальными частями Правил клиринга.
- 16.12.1. Запрос на открытие Расчетного кода 1-го уровня может содержать идентификационные данные клиента Участника клиринга, формируемые в соответствии с требованиями, предъявляемыми Биржей при регистрации клиентов Участников торгов.
- 16.13. На основании Запроса на открытие Расчетного кода 1-го уровня или Запроса на изменение идентификационных данных клиента, соответствующих Расчетному коду, Клиринговый центр устанавливает соответствие между Расчетным кодом Участника клиринга и идентификационными данными клиента Участника клиринга, указанными в запросе.
- 16.14. Открытие Расчетного кода для уплаты налогов осуществляется на основании Запроса на открытие Торгово-клирингового счета для уплаты налогов, указанного в пункте 7.8.1 общей части Правил клиринга, предоставленного Участником клиринга Клиринговому центру. Расчетный код для уплаты налогов имеет тип собственный. Участник клиринга вправе открыть один Расчетный код для уплаты налогов.
- 16.15. Участник клиринга вправе зарегистрировать в Клиринговом центре Счета для возврата обеспечения и установить соответствие между Расчетным кодом Участника клиринга и Счетом для возврата обеспечения.
- 16.15.1. 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.
- 16.16. Регистрация Счетов для возврата обеспечения осуществляется на основании Запроса на регистрацию реквизитов Счета для возврата обеспечения.
- 16.16.1. В случае если владельцем Счета для возврата обеспечения является клиент Участника клиринга, Участник клиринга обязан предоставить Клиринговому центру в форме электронного документа:
- Письмо об идентификации клиента (в случае, если Участник клиринга обязан осуществлять идентификацию клиента в соответствии с требованиями

- законодательства по противодействию легализации (отмыванию) доходов, полученных преступным 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, или выписку из договора, заверенную подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии);
  - Анкету выгодоприобретателя (в случаях, когда Клиринговый центр осуществляет идентификацию выгодоприобретателя в соответствии с требованиями законодательства по противодействию легализации (отмыванию) доходов, полученных преступным путем и финансированию терроризма);
  - иные документы (по требованию Клирингового центра).
- 16.16.2. Клиринговый центр вправе отказать в регистрации Счета для возврата обеспечения, в случае, если Участник клиринга не предоставил документы, указанные в подпункте 16.16.1 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).
- 16.16.3. 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, а также приостановить проведение операций в отношении ранее зарегистрированных Счетов 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, в том числе 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.
- 16.17. 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.
- 16.17.1. Клиринговый центр отказывает Участнику клиринга в установлении соответствия между Расчетным кодом, открытым для Обособленного клиента с указанием на необходимость защиты денежных средств, и Счетом для возврата обеспечения, владельцем которого не является такой Обособленный клиент.
- 16.18. 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.

- 16.18.1. Клиринговый центр вправе отказать в регистрации новых реквизитов Счета для возврата обеспечения по основанию, указанному в подпункте 16.16.3 общей части Правил клиринга.
- 16.18.2. 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.
- 16.19. Аннулирование регистрации Счетов для возврата обеспечения осуществляется Клиринговым центром на основании предоставленного Участником клиринга Запроса на аннулирование регистрации реквизитов Счета для возврата обеспечения.
- Общей частью Правил клиринга и специальными частями Правил клиринга могут быть установлены случаи и особенности аннулирования Счетов для возврата обеспечения.
- 16.20. 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.
- 16.21. Для заключения Сделок, стороной по которым является Участник клиринга - Нерезидент, действующий от своего имени по поручению клиента и за счет обеспечения, переданного такому Участнику клиринга – Нерезиденту его клиентом в собственность на основании заключенного между Участником клиринга - Нерезидентом и его клиентом соглашения о передаче прав собственности на имущество, составляющее предмет обеспечения, Участник клиринга – Нерезидент обязан подать в Клиринговый центр заявление об использовании Расчетного кода для заключения сделок за счет обеспечения, переданного клиентом в собственность на основании соглашения о передаче прав собственности на имущество, составляющее предмет обеспечения.
- 16.22. Клиринговый центр вправе закрыть все или отдельные Расчетные коды (Счета обеспечения) Участника клиринга, открытые Участнику клиринга для соответствующего Рынка, при прекращении допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию на таком Рынке.
- 16.23. Закрытие Расчетного кода Участника клиринга осуществляется на основании Запроса на закрытие Расчетного кода, предоставленного Участником клиринга Клиринговому центру.
- 16.24. Закрытие Расчетного кода Участника клиринга осуществляется при условии отсутствия у Участника клиринга неисполненных обязательств, учитываемых по такому Расчетному коду, а также Обеспечения, учитываемого по такому Расчетному коду.

- 16.24.1. При закрытии Расчетного кода Участника клиринга также закрываются все Расчетные коды 2-го и 3-го уровней, соответствующие такому Расчетному коду Участника клиринга.
- 16.25. В случае если условия закрытия Расчетного кода Участника клиринга, указанные в пункте 16.24 общей части Правил клиринга, при подаче Участником клиринга Запроса на закрытие Расчетного кода не соблюдаются, для закрытия Расчетного кода Участник клиринга обязан предоставить новый Запрос на закрытие Расчетного кода после выполнения указанных условий, необходимых для его закрытия.
- 16.26. 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 17.      Общий порядок открытия и закрытия Торгово-клиринговых счетов**

- 17.1. В случае если в соответствии с Правилами торгов соответствующего Биржевого рынка Торгово-клиринговый счет является одним из реквизитов заявки / Котировки участника торгов, 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.
- 17.2. Открытие Торгово-клирингового счета Участника клиринга осуществляется на основании Запроса на открытие Торгово-клирингового счета, или Запроса на открытие Торгово-клирингового счета для заключения депозитных договоров, или Запроса на открытие Расчетного кода 1-го уровня.
- 17.2.1. Торгово-клиринговый счет на фондовом рынке и Торгово-клиринговый счет, используемый на товарном рынке, открываются на основании Запроса на открытие Торгово-клирингового счета, Торгово-клиринговый счет для заключения депозитных договоров открывается на основании Запроса на открытие Торгово-клирингового счета для заключения депозитных договоров, Торгово-клиринговый счет на валютном рынке и рынке драгоценных металлов – на основании Запроса на открытие Расчетного кода 1-го уровня.
- 17.3. В случае если в соответствии с Правилами торгов соответствующего 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.
- 17.4. Участнику клиринга может быть открыто неограниченное количество Торгово-клиринговых счетов Участника клиринга.
- 17.5. Специальной частью Правил клиринга могут быть установлены особенности открытия Торгово-клиринговых счетов Участника клиринга.

- 17.6. Порядок закрытия Торгово-клиринговых счетов Участника клиринга установлен соответствующими специальными частями Правил клиринга.
- 17.6.1. 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.
- 17.7. Участнику клиринга, являющемуся участником имущественного пула, Клиринговый центр открывает Торгово-клиринговый счет имущественного пула. Открытие Торгово-клирингового счета имущественного пула осуществляется на основании Запроса на открытие Торгово-клирингового счета имущественного пула, предоставляемого Участником клиринга Клиринговому центру.
- 17.8. Открытие Торгово-клирингового счета для уплаты налогов осуществляется на основании Запроса на открытие Торгово-клирингового счета для уплаты налогов, указанного в пункте 7.8.1 общей части Правил клиринга, предоставленного Участником клиринга Клиринговому центру.
- 17.9. На основании Запроса на открытие Торгово-клирингового счета для уплаты налогов Клиринговый центр:
- 17.9.1. открывает Участнику клиринга Расчетный код для уплаты налогов;
- 17.9.2. для открытого в соответствии с подпунктом 17.9.1 общей части Правил клиринга Расчетного кода для уплаты налогов открывает один Счет обеспечения в российских рублях и по одному Счету обеспечения в каждой иностранной валюте, принимаемой в качестве обеспечения исполнения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением;
- 17.9.3. открывает Торгово-клиринговый счет для уплаты налогов, в состав которого входит открытый в соответствии с подпунктом 17.9.1 общей части Правил клиринга Расчетный код для уплаты налогов;
- 17.9.4. направляет Расчетному депозитарию поручение на открытие субсчета депо для Участника клиринга, подавшего Запрос на открытие Торгово-клирингового счета для уплаты налогов. Для открытия субсчета депо Участник клиринга, которому открывается субсчет депо, должен являться депонентом Расчетного депозитария, а также выполнить иные действия, предусмотренные внутренними документами Расчетного депозитария;
- 17.9.5. после получения от Расчетного депозитария информации об открытии субсчета депо в составе списка Разделов / субсчетов депо включает в состав Торгово-клирингового счета для уплаты налогов указанный субсчет депо.
- 17.10. Участник клиринга вправе открыть один Торгово-клиринговый счет для уплаты налогов.
- 17.11. Торгово-клиринговый счет для уплаты налогов может указываться Участником торгов или Клиринговым центром в заявке на продажу ценных бумаг. По такой сделке будет осуществляться клиринг с полным обеспечением по ценным бумагам. Торгово-клиринговый счет для уплаты налогов может указываться Клиринговым центром в заявке на продажу иностранной валюты. По такой сделке будет осуществляться клиринг с полным обеспечением по иностранной валюте.



- 17.12. Клиринговый центр информирует Участника клиринга об открытии / закрытии Торгово-клирингового счета Участника клиринга не позднее рабочего дня, следующего за днем исполнения соответствующей операции.
- 17.13. Если это предусмотрено Специальной частью Правил клиринга, Участник клиринга, являющийся Нерезидентом из перечня или лицом, подконтрольным такому Нерезиденту из перечня, для получения возможности становиться стороной по сделкам, или иной Участник клиринга, для получения возможности становиться стороной по сделкам, заключаемым в интересах и (или) за счет Нерезидента из перечня, должен открыть Торгово-клиринговый счет нерезидента и Расчетный код нерезидента.

Участник клиринга несет ответственность за определение того, является ли Нерезидентом из перечня лицо, в интересах и (или) за счет которого заключаются сделки, стороной по которым становится такой Участник клиринга, а также за соответствие совершаемых в интересах и (или) за счет такого лица операций и сделок, требованиям нормативных актов, и выбор типа Торгово-клирингового счета и Расчетного кода, открываемого для возможности становиться стороной по сделкам, заключаемым в интересах и (или) за счет такого лица.

- 17.14. Указание Торгово-клирингового счета нерезидента в заявках возможно только для заключения сделок в интересах и (или) за счет Нерезидента из перечня, либо лица, подконтрольного такому Нерезиденту из перечня, или для заключения сделок Участником клиринга, являющимся Нерезидентом из перечня.
- 17.15. Если иное не установлено специальной частью Правил клиринга, по умолчанию Клиринговый центр устанавливает по Торгово-клиринговому счету нерезидента на одном или нескольких Рынках признак «запрет коротких продаж» и признак «запрет необеспеченных покупок». Клиринговый центр вправе принять решение о снятии такого предустановленного признака (таких предустановленных признаков) в отношении Торгово-клиринговых счетов нерезидентов.
- 17.16. Перечень видов Сделок, по которым должны исполняться обязательства по Торгово-клиринговым счетам нерезидента (нерезидентов), и (или) режимов, и (или) Рынков, в рамках которых они заключаются, перечень ценных бумаг, которые могут учитываться в качестве Обеспечения по Торгово-клиринговым счетам нерезидента (нерезидентов), устанавливается (ограничивается / изменяется) решением Клирингового центра.

## **Статья 18. Порядок предоставления информации об Участнике торгов, не совпадающем в одном лице с Участником клиринга**

- 18.1. Для заключения сделок на основании заявок / Котировок участника торгов, в которых Участник клиринга будет указан в качестве Клирингового брокера, такой Участник клиринга категории «Б», «Б2» или «О» предоставляет Клиринговому центру информацию о коде Участника торгов, который будет подавать соответствующие заявки / Котировки участника торгов.

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

Порядок предоставления и исполнения указанного запроса определен в статье 19 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 / Котировках 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».

18.2. Для заключения сделок от имени и в интересах Участника клиринга на основании заявок Участника торгов / Котировок участника торгов, не совпадающего в одном лице с таким Участником клиринга, Участник клиринга категории «Б», «Б2», «В» или «О» предоставляет Клиринговому центру:

18.2.1. информацию о коде Участника торгов, который будет подавать соответствующие заявки / Котировки участника торгов.

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

Порядок предоставления и исполнения указанного запроса определен в статье 19 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 / Котировках 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 и в интересах Участника клиринга».

18.3. На клиринговом регистре 2-го уровня 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.

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

18.3.2. По запросу Участника торгов на клиринговом регистре 2-го уровня может быть установлен признак, означающий, что клиринговые услуги по ведению клиринговых регистров 3-го уровня Клиринговый центр оказывает Участнику клирингу.

18.3.3. Участник клиринга вправе отказаться от предоставления ему Клиринговым центром клиринговых услуг по ведению клиринговых регистров 3-го уровня путем предоставления соответствующего запроса Клиринговому центру.

- 18.4. В случае если услуги по ведению клиринговых регистров 3-го уровня оказываются Участнику торгов, Участнику клиринга не доступна информация о кодах и идентификационных данных клиентов Участника торгов, за исключением случая, предусмотренного подпунктом 18.4.2 общей части Правил клиринга.
- 18.4.1. Участник торгов вправе направить Клиринговому центру запрос о предоставлении Участнику клиринга доступа к информации о кодах клиентов Участников торгов, указываемых Участником торгов при подаче заявок / Котировок участника торгов с указанием клиринговых регистров 2-го и/или 3-го уровня, и идентификационных данных таких клиентов Участника торгов.
- 18.4.2. Если Участнику клиринга, не совпадающему в одном лице с Участником торгов, открыт Расчетный код для заключения сделок от имени и в интересах Участника клиринга, Участнику клиринга доступна информация о кодах и идентификационных данных клиентов Участника торгов, указываемых Участником торгов при подаче заявок / Котировок участника торгов с указанием клиринговых регистров 2-го и/или 3-го уровня, связанного с таким Расчетным кодом Участника клиринга.
- 18.4.3. Участник клиринга вправе предоставить Клиринговому центру информацию об идентификационных данных клиентов, за счет которых Участники торгов не вправе заключать Сделки, стороной по которым должен стать Участник клиринга (далее – список запрещенных клиентов).

Запрет на подачу Участником торгов заявок / Котировок участника торгов и заключение сделок, стороной по которым является Участник клиринга, за счет клиентов из списка запрещенных клиентов действует в случае, если услуги по ведению клиринговых регистров 3-го уровня оказываются Участнику клиринга или Участнику клиринга доступна информация о кодах и идентификационных данных клиентов Участника торгов.

Участник клиринга вправе вносить изменения в список запрещенных клиентов.

## **Статья 19. Порядок открытия Расчетных кодов 2-го уровня и Торгово-клиринговых счетов 2-го уровня**

- 19.1. В случае если в соответствии с Правилами торгов соответствующего Биржевого рынка Торгово-клиринговый счет является одним из реквизитов заявки / Котировки участника торгов, для заключения сделок Участником торгов, не совпадающим в одном лице с Участником клиринга, Участник клиринга обязан открыть Торгово-клиринговый счет 2-го уровня.
- 19.2. 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.
- 19.3. Открытие Торгово-клирингового счета 2-го уровня осуществляется на основании Запроса на открытие Расчетного кода 2-го уровня, предоставляемого Участником клиринга Клиринговому центру.
- 19.4. Запрос на открытие Расчетного кода 2-го уровня должен содержать указание на Торгово-клиринговый счет Участника клиринга.

- 19.4.1. Запрос на открытие Расчетного кода 2-го уровня может содержать идентификационные данные клиента Участника клиринга в соответствии с требованиями, предъявляемыми Биржей при регистрации клиентов Участников торгов.
- 19.4.2. Запрос на открытие Расчетного кода 2-го уровня может содержать иную информацию, состав которой установлен формой/форматом Запроса на открытие Расчетного кода 2-го уровня и/или специальной частью Правил клиринга.
- 19.5. На основании полученного от Участника клиринга Запроса на открытие Расчетного кода 2-го уровня Клиринговый центр:
- открывает отдельный Расчетный код 2-го уровня, связанный с Расчетным кодом Участника клиринга, входящим в состав Торгово-клирингового счета Участника клиринга, указанного 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 о коде 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.
- 19.6. Если в соответствии с Правилами торгов соответствующего Биржевого рынка Торгово-клиринговый счет является одним из реквизитов заявки / Котировки участника торгов, Торгово-клиринговый счет 2-го уровня может указываться в качестве Торгово-клирингового счета в заявке / Котировке участника торгов на заключение Сделки:
- а) в случае подачи Участником торгов заявки / Котировки участника торгов с указанием Участника клиринга в качестве Клирингового брокера, или
  - б) в случае подачи Участником торгов заявки / Котировки участника торгов, не совпадающим в одном лице с Участником клиринга, от имени и в интересах такого Участника клиринга, или
  - в) в случае подачи Участником торгов заявки / Котировки участника торгов, совпадающим в одном лице с Участником клиринга.
- 19.7. По запросу Участника клиринга может быть открыто неограниченное количество Расчетных кодов 2-го уровня.
- 19.7.1. Один Расчетный код 2-го уровня соответствует одному Расчетному коду 1-го уровня.
- 19.7.2. Одному Расчетному коду 1-го уровня могут соответствовать несколько Расчетных кодов 2-го уровня (в т.ч. открытых для одного или нескольких Участников торгов).

- 19.7.3. 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).
- 19.8. Закрытие Расчетного кода 2-го уровня и Торгово-клирингового счета 2-го уровня осуществляется на основании Запроса на закрытие Расчетного кода.
- 19.8.1. При закрытии Расчетного кода 2-го уровня также закрываются все Расчетные коды 3-го уровня, соответствующие такому Расчетному коду 2-го уровня.
- 19.8.2. 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.
- 19.9. 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 20. Порядок открытия Расчетных кодов 3-го уровня и Торгово-клиринговых счетов 3-го уровня**

- 20.1. 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.
- 20.2. Открытие Торгово-клирингового счета 3-го уровня осуществляется на основании Запроса на открытие Расчетного кода 3-го уровня, предоставляемого Участником торгов / Участником клиринга Клиринговому центру.
- 20.3. 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.
- 20.4. Запрос на открытие Расчетного кода 3-го уровня должен содержать указание на Торгово-клиринговый счет 2-го уровня.
- 20.4.1. Запрос на открытие Расчетного кода 3-го уровня может содержать идентификационные данные клиента Участника торгов / клиента Участника клиринга в соответствии с требованиями, предъявляемыми Биржей при регистрации клиентов Участников торгов.
- 20.4.2. Запрос на открытие Расчетного кода 3-го уровня может содержать иную информацию, состав которой установлен формой / форматом Запроса на открытие Расчетного кода 3-го уровня и/или специальной частью Правил клиринга.
- 20.5. На основании полученного от Участника торгов / Участника клиринга Запроса на открытие Расчетного кода 3-го уровня Клиринговый центр:

- открывает отдельный Расчетный код 3-го уровня, связанный с Расчетным кодом 2-го уровня, входящим в состав Торгово-клирингового счета 2-го уровня, указанного 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.

- 20.5.1. Запрос на открытие Расчетного кода 3-го уровня, предоставленный Участником торгов, исполняется при условии, что указанный запрос предоставлен Участником торгов, которому открыт Торгово-клиринговый счет 2-го уровня, с которым должен быть связан открываемый Торгово-клиринговый счет 3-го уровня.
- 20.6. В случае если в соответствии с Правилами торгов соответствующего Биржевого рынка Торгово-клиринговый счет является одним из реквизитов заявки / Котировки участника торгов, Торгово-клиринговый счет 3-го уровня может указываться в качестве Торгово-клирингового счета в заявке / Котировке участника торгов на заключение Сделки.
- 20.7. По запросу Участника торгов / Участника клиринга может быть открыто неограниченное количество Расчетных кодов 3-го уровня.
- 20.7.1. Один Расчетный код 3-го уровня соответствует одному Расчетному коду 2-го уровня.
- 20.7.2. Одному Расчетному коду 2-го уровня могут соответствовать несколько Расчетных кодов 3-го уровня.
- 20.8. Закрытие Расчетного кода 3-го уровня и Торгово-клирингового счета 3-го уровня осуществляется на основании Запроса на закрытие Расчетного кода.
- 20.9. 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 21. Порядок присвоения Расчетному коду признака «Единый пул»**

- 21.1. Расчетному коду 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 или рынке депозитов, и/или валютном рынке и рынке драгоценных металлов, и/или срочном рынке, и/или

- рынке Стандартизированных ПФИ (далее – Рынки, включенные в единый пул обеспечения);
- исполнения обязательств Участника клиринга по Сделкам, заключенным на Рынках, включенных в единый пул обеспечения, а также иных обязательств Участника клиринга, указанных в соответствующих частях Правил клиринга.
- 21.2. Присвоение Расчетному коду признака «Единый пул» осуществляется на основании Запроса на присвоение Расчетному коду признака «Единый пул», предоставленного Участником клиринга Клиринговому центру, или на основании решения Клирингового центра, предусмотренного соответствующей специальной частью Правил клиринга.
- 21.2.1. Признак «Единый пул» на основании Запроса на присвоение Расчетному коду признака «Единый пул», предоставленного Участником клиринга Клиринговому центру, может быть присвоен только Расчетному коду, открытому для фондового рынка, рынка депозитов и рынка кредитов.
- 21.3. В случае, если Обеспечение Участника клиринга в иностранной валюте, учитываемое по Расчетному коду Участника клиринга, открытому для фондового рынка, рынка депозитов и рынка кредитов, 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 27.14.1-27.14.2 общей части Правил клиринга.
- 21.4. Расчетному коду для уплаты налогов и Расчетному коду нерезидента не может быть присвоен признак «Единый пул».
- 21.5. Для использования Расчетного кода, которому присвоен признак «Единый пул» (далее – Расчетный код Единого пула), на определенном Рынке Участник клиринга обязан предоставить Клиринговому центру Запрос на изменение области действия Расчетного кода Единого пула.
- 21.5.1. Запрос на изменение области действия Расчетного кода Единого пула должен содержать указание на Расчетный код Единого пула.
- 21.5.2. 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 Рынок без использования Расчетных кодов, ранее открытых для указанного Рынка, или
  - указание на рынок Стандартизированных ПФИ – в случае распространения области действия Расчетного кода Единого пула на указанный Рынок без использования Расчетных кодов, ранее открытых для указанного 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, или на Расчетный код Участника клиринга,

- открытый для рынка Стандартизированных ПФИ, - в случае распространения области действия Расчетного кода Единого пула на указанный Рынок с использованием Расчетного кода, ранее открытого для указанного Рынка. При этом указанный Расчетный код, открытый для соответствующего Рынка, должен иметь:
- такой же тип (собственный, клиентский или ДУ), как и указанный в запросе Расчетный код Единого пула;
  - такой же признак, указывающий на модель использования Расчетного кода.
- 21.5.3. Расчетный код Единого пула имеет область действия фондовый рынок и рынок депозитов по умолчанию.
- 21.6. 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 / рынка Стандартизированных ПФИ, начиная со следующего Расчетного дня после получения такого запроса.
- 21.7. 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, или на Расчетный код Участника клиринга, открытый для рынка Стандартизированных ПФИ, Клиринговый центр после учета всех клиринговых и иных операций текущего Расчетного дня:
- 21.7.1. 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 19.5 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;
- 21.7.2. 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 20.5 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;
- 21.7.3. 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;



- 21.7.4. прекращает учитывать соответствующую информацию:
- об обязательствах / требованиях и Обеспечении по Расчетному коду Участника клиринга, открытому для соответствующего 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 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 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).
- 21.7.5. начинает учитывать соответствующую информацию об обязательствах / требованиях и Обеспечении, указанную в подпункте 21.7.4 общей части Правил клиринга:
- 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 21.7.1 общей части Правил клиринга;
  - по Расчетным кодам 3-го уровня, открытым в соответствии с подпунктом 21.7.2 общей части Правил клиринга;
- 21.7.6. начинает учитывать в Клиринговой системе фондового рынка по Расчетному коду Единого пула, указанному в Запросе на изменение области действия Расчетного кода Единого пула, Профили активов, переданные в Клиринговую систему соответствующего Рынка, в сумме / количестве, равной / равном сумме / количеству Обеспечения, указанного в подпункте 21.7.5 общей части Правил клиринга (учитываются со знаком «минус»);
- 21.7.7. начинает учитывать в Клиринговой системе соответствующего Рынка по Расчетному коду Единого пула, указанному в Запросе на изменение области действия Расчетного кода Единого пула, Профили активов, полученные Клиринговой системой соответствующего Рынка, в сумме / количестве, равной / равном сумме / количеству Обеспечения, указанного в подпункте 21.7.5 общей части Правил клиринга (учитываются со знаком «плюс»);
- 21.7.8. начинает учитывать в Клиринговой системе срочного рынка по разделам клиринговых регистров, указанным в подпункте 21.7.4 общей части Правил клиринга, Профили активов по денежным средствам, полученные Клиринговой системой срочного рынка, в сумме, равной сумме Обеспечения, указанного в подпункте 21.7.5 общей части Правил клиринга (учитываются со знаком «плюс»);
- 21.7.9. осуществляет закрытие Расчетных кодов 3-го уровня, связанных с Расчетным кодом 2-го уровня, указанным в подпункте 21.7.10 общей части Правил клиринга;

- 21.7.10. осуществляет закрытие Расчетных кодов 2-го уровня, связанных с Расчетным кодом Участника клиринга, указанным в подпункте 21.7.11 общей части Правил клиринга;
- 21.7.11. осуществляет закрытие Расчетного кода Участника клиринга, открытого для соответствующего Рынка и указанного в Запросе на изменение области действия Расчетного кода Единого пула;
- 21.7.12. 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);
- 21.7.13. 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).
- 21.8. Запрос на изменение области действия Расчетного кода Единого пула, содержащий указание на Расчетный код Участника клиринга, по которому учитываются обязательства с отложенным исполнением, не исполняется Клиринговым центром.
- 21.9. 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 любое из следующих условий:
- 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 T+ с Датой исполнения указанных контрактов в Расчетный день, следующий за днем исполнения такого запроса;
  - указанный в запросе Расчетный код, открытый для срочного рынка, является Расчетным кодом, связанным с Обособленной Брокерской фирмой;
  - указанный в запросе Расчетный код, открытый для срочного рынка, открыт в случае, если в соответствии с нормативными актами Российской Федерации Участник клиринга не имеет права использовать в собственных интересах переданные ему, в том числе его клиентом, действующим в качестве доверительного управляющего, средства учредителя (учредителей) доверительного управления, и (или) использовать указанные средства для обеспечения исполнения собственных обязательств или обязательств третьих лиц.

Наличие / отсутствие у Участника клиринга указанного права определяется с учетом информации, указанной Участником клиринга в соответствии с подпунктом 5.8.1 Правил клиринга на срочном рынке, в Запросе на изменение области действия Расчетного кода Единого пула.

В случае если ранее поданный Запрос на изменение области действия Расчетного кода Единого пула, содержащий указание на Расчетный код Участника клиринга, открытый для срочного рынка, не содержало такого указания, Участник клиринга вправе предоставить письмо, содержащее заверения, имеющие существенное значение, о том, что Участник клиринга имеет право использовать в собственных интересах переданные ему, в том

числе его клиентом, действующим в качестве доверительного управляющего, средства учредителя (учредителей) доверительного управления, и (или) использовать указанные средства для обеспечения исполнения собственных обязательств или обязательств третьих лиц, относительно чего получены все необходимые решения и согласия, получение которых регламентировано применимым законодательством, учредительными документами, иными документами, регулирующими деятельность такого Участника клиринга / клиента Участника клиринга, и что совершение каких-либо иных действий в рамках Правил клиринга как самим Участником клиринга, клиентом Участника клиринга, так и в отношении этих лиц, ни при каких обстоятельствах не приведет к нарушению применимого законодательства ни в отношении этих лиц, ни в отношении какого-либо имущества, являющегося объектом таких сделок.

## **Статья 22. Порядок присвоения Клиринговых идентификаторов**

22.1. Участнику клиринга, получившему допуск к клиринговому обслуживанию / Участнику торгов, заключившему с Клиринговым центром договор о ведении клиринговых регистров, Техническим центром присваиваются Клиринговые идентификаторы в соответствии с договором о предоставлении интегрированного технологического сервиса.

Суммарное количество Клиринговых идентификаторов, присваиваемых Участнику клиринга, может быть ограничено по решению Клирингового центра.

Рекомендуемая форма заявления о Клиринговых идентификаторах раскрывается на Сайте Клирингового центра.

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

22.3. 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 22.2 общей части Правил клиринга, путем включения информации о Клиринговом идентификаторе в состав Отчета о Клиринговых идентификаторах.

Включение информации о Клиринговом идентификаторе Участника клиринга / Участника торгов в состав 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.

22.4. 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 23. Порядок регистрации Обособленных клиентов Участников клиринга**

23.1. Для регистрации Обособленного клиента Участник клиринга должен открыть для такого клиента Участника клиринга отдельный клиентский Расчетный код или Расчетный код ДУ 1-го уровня (отдельные клиентские Расчетные коды / Расчетные коды ДУ 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) полное наименование / фамилию, имя и отчество Обособленного клиента в соответствии с его учредительными документами / документами, идентифицирующими личность;
- 3) идентификационные данные Обособленного клиента, аналогичные идентификационным данным, указываемым в соответствии с требованиями, предъявляемыми Биржей при регистрации клиентов Участников торгов;
- 4) в случае если Обособленный клиент является Нерезидентом, следующие реквизиты, которые указываются при регистрации Счетов для возврата обеспечения Обособленного клиента: SWIFT BIC-code (при наличии) или наименование / фамилия, имя и отчество (при наличии) и адрес Обособленного клиента;
- 5) 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 и актуальность информации об Обособленном клиенте, предоставленной Клиринговому центру в соответствии с настоящим пунктом общей части Правил клиринга. В случае изменения сведений об Обособленном клиенте, ранее предоставленных Участником клиринга, Участник клиринга обязан предоставить Клиринговому центру актуальные сведения путем направления Запроса на изменение данных Обособленного клиента не позднее 10 рабочих дней с даты, когда Участник клиринга узнал или должен был узнать о таком изменении сведений об Обособленном клиенте.

В случаях, когда Клиринговый центр осуществляет идентификацию выгодоприобретателя в соответствии с требованиями законодательства по противодействию легализации (отмыванию) доходов, полученных преступным путем, и финансированию терроризма для регистрации Обособленного клиента Участник клиринга должен предоставить Анкету выгодоприобретателя в отношении

регистрируемого Обособленного клиента. В случае непредоставления Анкеты выгодоприобретателя в отношении регистрируемого Обособленного клиента Клиринговый центр не регистрирует Обособленного клиента.

- 23.1.1. В Запросе на регистрацию Обособленного клиента Участник клиринга вправе указать на необходимость защиты денежных средств Обособленного клиента. Указанный признак присваивается для идентификационных данных, указанных в Запросе на регистрацию 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, и
- 2) 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, с учетом идентификационных данных, указанных в Запросе на регистрацию Обособленного клиента, на Расчетные коды, открытые для иных лиц.

- 23.1.2. Запрос на регистрацию Обособленного клиента, в котором указан Расчетный код, входящий в состав Торгово-клирингового счета для заключения депозитных договоров, не исполняется Клиринговым центром.

- 23.2. 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.

- 23.3. 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.

- 23.4. 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 24. Перечень мер, направленных на управление рисками при осуществлении клиринга**

24.1. 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», «Б2», «В» и «О» требование о внесении Обеспечения под стресс, рассчитываемого в соответствии с Методикой определения размера 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 с Правилами клиринга об ограничении размера ответственности Клирингового центра.

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

24.2.1. Признак «запрет коротких продаж» по иностранной валюте / драгоценному металлу означает, что по Сделкам с такой иностранной валютой / драгоценным металлом и по сделкам с расчетами в такой иностранной валюте осуществляется

- клиринг с полным обеспечением по такой иностранной валюте / драгоценному металлу.
- 24.2.2. 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.
- 24.2.3. 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.
- 24.2.4. 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 30.19 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.
- 24.2.5. Клиринговый центр вправе установить период действия признака «запрет коротких продаж» по ценной бумаге.
- Период действия признака «запрет коротких продаж» определяется датой начала периода действия и датой окончания периода действий признака или только датой начала периода действия признака. Если определена только дата начала действия признака, это означает, что признак «запрет коротких продаж» действует, начиная с этой даты и бессрочно или до его отмены.
- В случае установления Клиринговым центром периода действия признака «запрет коротких продаж» по ценной бумаге на период, в котором определены дата начала периода действия и дата окончания периода действий признака, в дату окончания периода действия признака по Сделкам с такой ценной бумагой для Даты исполнения, приходящейся на дату окончания периода действия признака, осуществляется клиринг с полным обеспечением по такой ценной бумаге; проверка возможности исполнения иных операций, проводимая при наличии признака «запрет коротких продаж» по такой ценной бумаге, проводится только для Даты исполнения, приходящейся на дату окончания периода действия признака.
- В случае установления Клиринговым центром периода действия признака «запрет коротких продаж» по ценной бумаге на период, в котором определена только дата начала действия признака, начиная с 5 (пятого) Расчетного дня периода по Сделкам с такой ценной бумагой осуществляется клиринг с полным обеспечением по такой ценной бумаге; проверка возможности исполнения иных операций, проводимая при наличии признака «запрет коротких продаж» по такой ценной бумаге, проводится для всех Дат исполнения, начиная с 5 (пятого) Расчетного дня периода.
- 24.3. Перечень иностранных валют / драгоценных металлов и/или перечень товаров, принимаемых в качестве обеспечения исполнения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением, устанавливается решением Клирингового центра. Информация об иностранных валютах / драгоценных металлах, включенных в перечень, а также о включенных в перечень товарах, раскрывается на Сайте Клирингового центра.

- 24.3.1. Российские рубли принимаются в качестве обеспечения исполнения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением.
- 24.3.2. Для отдельных Рынков Клиринговым центром может быть установлен отдельный перечень иностранных валют и/или товаров, принимаемых в качестве обеспечения исполнения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением.
- 24.3.3. Клиринговый центр вправе принять решение о прекращении учета иностранных валют / драгоценных металлов и/или товаров, определенных таким решением, в качестве обеспечения исполнения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением одного или нескольких Участников клиринга.
- 24.4. Перечень ценных бумаг, принимаемых в качестве обеспечения исполнения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением, формируется в соответствии с Методикой выбора ценных бумаг, принимаемых в обеспечение. Для отдельных Рынков Методикой выбора ценных бумаг, принимаемых в обеспечение, может быть определено формирование отдельного перечня ценных бумаг, принимаемых в качестве обеспечения исполнения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением. Информация о ценных бумагах, включенных в перечень, раскрывается на Сайте Клирингового центра.
- 24.4.1. 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.
- 24.4.2. 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.
- 24.4.3. Облигации Банка России не учитываются в качестве Обеспечения Участника клиринга, не являющегося Кредитной организацией.
- 24.4.4. Клиринговый центр вправе принять решение о прекращении учета ценных бумаг, определенных таким решением, в качестве обеспечения исполнения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением одного или нескольких Участников клиринга.
- 24.5. Гарантийный фонд каждого Рынка формируется Клиринговым центром за счет взносов всех Участников клиринга категорий «Б», «Б2» и «О».  
Минимальный размер взноса в Гарантийный фонд соответствующего Рынка каждого Участника клиринга категорий «Б», «Б2» и/или «О» устанавливается соответствующей специальной частью Правил клиринга.
- 24.6. Обеспечение под стресс на каждом Рынке обязаны вносить Участники клиринга категорий «Б», «Б2», «В» и «О».
- 24.7. Порядок определения минимального размера Обеспечения под стресс Участника клиринга на соответствующем Рынке установлен Методикой определения размера Обеспечения под стресс.



- 24.8. В качестве вноса в Гарантийные фонды, Обеспечения под стресс и/или Обеспечения под риски концентрации на эмитентов Участники клиринга могут вносить денежные средства в российских рублях и иностранной валюте, а также ценные бумаги.
- 24.8.1. Перечень иностранных валют и ценных бумаг, принимаемых Клиринговым центром в качестве взносов в Гарантийные фонды и/или Обеспечения под стресс, а также Перечень иностранных валют и ценных бумаг, принимаемых Клиринговым центром в качестве Обеспечения под риски концентрации на эмитентов, устанавливается решением Клирингового центра. Информация об иностранных валютах и ценных бумагах, включенных в указанные перечни, раскрывается на Сайте Клирингового центра.
- 24.8.2. Ценная бумага исключается из Перечня ценных бумаг, принимаемых Клиринговым центром в качестве взносов в Гарантийные фонды и/или Обеспечения под стресс, и Перечня ценных бумаг, принимаемых Клиринговым центром в качестве Обеспечения под риски концентрации на эмитентов, одновременно с исключением такой ценной бумаги из перечня ценных бумаг, принимаемых в качестве обеспечения исполнения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением, в порядке, установленном пунктом 24.3 общей части Правил клиринга, без дополнительного 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, Обеспечения под риски концентрации на эмитентов, с даты погашения без решения Клирингового центра.
- 24.8.3. Ценные бумаги, эмитентом которых является Участник клиринга или связанное с ним лицо, не учитываются в качестве взносов в Гарантийные фонды и Обеспечения под стресс, Обеспечения под риски концентрации на эмитентов такого Участника клиринга.
- 24.8.4. Облигации Банка России не учитываются в качестве взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс, Обеспечения под риски концентрации на эмитентов Участника клиринга, не являющегося Кредитной организацией.

## **Статья 25. Единый лимит по Расчетному коду и риск-параметры**

- 25.1. 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 подаче Участником клиринга Предложений, при регистрации заявки, являющейся в соответствии с Правилами торгов на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов допустимой встречной по отношению к Котировке участника торгов, поданной Участником торгов с целью заключения Сделки, стороной по которой будет являться Участник клиринга, (далее – заявка, являющаяся допустимой встречной к Котировке участника торгов), при заключении сделок или исполнении / прекращении обязательств по Сделкам, стороной по которым является Участник клиринга, изменении риск-параметров, при передаче Профиля актива.

- 25.2. 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, при подаче Участником клиринга Предложений, при регистрации заявки, являющейся допустимой встречной к Котировке участника торгов, 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 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.
- 25.2.1. 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 становиться меньше, чем значение Единого лимита по Расчетному коду, учитываемое до установки Ограничительного лимита.
- 25.3. Единый лимит по Расчетному коду рассчитывается с учетом:
- Обеспечения Участника клиринга в российских рублях, иностранной валюте и драгоценных металлах, 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 Правилах клиринга об ограничении размера ответственности Клирингового центра;
  - Обеспечения Участника клиринга в ценных бумагах, учитываемого по всем Торгово-клиринговым счетам T+, в состав которых входит Расчетный код;
  - Нетто-обязательств / Нетто-требований Участника клиринга по Сделкам в российских рублях / иностранной валюте / драгоценных металлах, 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 T+, в состав которых входит Расчетный код, по всем Датам исполнения;
  - 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 T+, 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 / Предложений / Котировок участника торгов при наличии зарегистрированной заявки, являющейся допустимой встречной к Котировке участника торгов, Сделок, стороной по которым будет являться Участник клиринга, в том числе обязательств по уплате комиссионных вознаграждений;
- суммы, соответствующей сумме налога на прибыль организаций с доходов иностранных организаций от источников в Российской Федерации, подлежащей удержанию с Участника клиринга, с даты заключения Сделки / даты получения Участником клиринга дохода, до даты, следующей за днем получения доходов Участником клиринга – Нерезидентом (в т.ч. в пользу фактического получателя дохода Участника клиринга – Нерезидента)/ Участником клиринга – Международной организацией (в пользу фактического получателя дохода Участника клиринга – Международной организации) (включая эту дату) (учитывается со знаком «минус»);
- суммы, соответствующей сумме налога на прибыль организаций с доходов иностранных организаций от источников в Российской Федерации, подлежащей удержанию с Участника клиринга, с даты заключения Сделки / даты получения Участником клиринга дохода, до даты, следующей за днем получения доходов Участником клиринга – Нерезидентом (в т.ч. в пользу фактического получателя дохода Участника клиринга – Нерезидента) / Участником клиринга – Международной организацией (в пользу фактического получателя дохода Участника клиринга – Международной организации) рассчитанной по максимальной ставке, установленной российским законодательством (учитывается со знаком «минус» в период, с 1 января до даты, следующей за днем получения доходов Участником клиринга – Нерезидентом (в т.ч. в пользу фактического получателя дохода Участника клиринга – Нерезидента) / Участником клиринга – Международной организацией (в пользу фактического получателя дохода Участника клиринга – Международной организации) или до даты предоставления Участником клиринга – Нерезидентом (по себе и по фактическим получателям дохода) или Участником клиринга – Международной организацией (по фактическим получателям дохода) сертификата налогового резидентства, установленной приложением № 4 к общей части Правил клиринга, или до фактической даты предоставления Участником клиринга – Нерезидентом (по себе и по фактическим получателям дохода) или Участником клиринга – Международной организацией (по фактическим получателям дохода) сертификата налогового резидентства на текущий календарный год в зависимости от того, какое из этих событий наступит раньше) (за исключением банков, постоянное местонахождение которых подтверждается сведениями общедоступных информационных справочников));
- разницы между суммой, соответствующей сумме налога на прибыль организаций с доходов иностранных организаций от источников в Российской Федерации, рассчитанной по максимальной ставке, установленной российским законодательством, и суммой, соответствующей сумме налога, рассчитанной по действующей в текущем календарном году налоговой ставке, установленной применимым соглашением об избежании двойного налогообложения, заключенным с государством, налоговым резидентом которого являлся Участник клиринга – Нерезидент, фактический получатель дохода

Участника клиринга – Нерезидента или фактический получатель дохода Участника клиринга – Международной организации в предыдущем календарном году (налоговом периоде) (учитывается со знаком «минус» в период с 1 января текущего календарного года, с даты, следующей за днем получения доходов (в т.ч. в пользу фактического получателя дохода Участника клиринга – Нерезидента) / Участником клиринга – Международной организацией (в пользу фактического получателя дохода Участника клиринга – Международной организации) до даты предоставления Участником клиринга – Нерезидентом (по себе и по фактическим получателям дохода) или Участником клиринга – Международной организацией (по фактическим получателям дохода) сертификата налогового резидентства, установленной приложением № 4 к общей части Правил клиринга, или до фактической даты предоставления Участником клиринга – Нерезидентом (по себе и по фактическим получателям дохода) или Участником клиринга – Международной организацией (по фактическим получателям дохода) сертификата налогового резидентства на текущий календарный год в зависимости от того, какое из этих событий наступит раньше) (за исключением банков, постоянное местонахождение которых подтверждается сведениями общедоступных информационных справочников);

- обязательств Участника клиринга по уплате сумм, соответствующих суммам налога на доход от источника в США и/или приравненный к нему доход, учитываемых по Расчетному коду (учитываются со знаком «минус»).

25.4. При расчете Единого лимита по Расчетному коду Единого пула кроме величин, указанных в пункте 25.3 общей части Правил клиринга, также учитываются:

25.4.1. в Клиринговой системе фондового рынка:

- 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, драгоценного металла), переданный в Клиринговую систему / полученный из Клиринговой системы срочного рынка;
- Профиль актива с учетом знака (российских рублей, иностранной валюты), переданный в Клиринговую систему / полученный из Клиринговой системы рынка Стандартизированных ПФИ;
- обязательства и требования с наступившей Датой исполнения, полученные из Клиринговой системы валютного рынка и рынка драгоценных металлов, Клиринговой системы срочного рынка, Клиринговой системы рынка Стандартизированных ПФИ.

25.4.2. 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.

25.4.3. в Клиринговой системе рынка Стандартизированных ПФИ:

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

- 25.5. При расчете Единого лимита по Расчетному коду для уплаты налогов кроме величин, указанных в пункте 25.3 общей части Правил клиринга, также учитывается лимит налогового риска - величина, рассчитываемая Клиринговым центром в соответствии с Методикой определения лимитов налогового риска НКО НКЦ (АО), исходя из единых критериев оценки, в том числе с учетом размера собственных средств (капитала) Участника клиринга, финансового состояния Участника клиринга (учитывается со знаком «плюс»).
- 25.6. В случаях, установленных Правилами клиринга, проводится дополнительная проверка Единого лимита: величина Единого лимита по Расчетному коду Единого пула, рассчитанного в Клиринговой системе фондового рынка, после проведения операции, для которой проводится указанная дополнительная проверка, должна превышать или быть равной сумме абсолютного значения отрицательного Единого лимита по Расчетному коду Единого пула, рассчитанного в Клиринговой системе валютного рынка и рынка драгоценных металлов, абсолютного значения величины  $SZ_{sc}$  (свободного Обеспечения), имеющей отрицательное значение, рассчитанного в Клиринговой системе срочного рынка, и абсолютного значения отрицательного Единого лимита по Расчетному коду Единого пула, рассчитанного в Клиринговой системе рынка Стандартизированных ПФИ.
- 25.7. Обязательства по передаче / требования по получению Дохода, определенные Клиринговым центром в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, 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.
- 25.8. Правила расчета Единого лимита по Расчетному коду определены в документах Принципы расчета Единого лимита на соответствующих Рынках, раскрываемых на Сайте Клирингового центра.
- 25.9. Перечень, порядок расчета и изменения риск-параметров, используемых Клиринговым центром для контроля и управления рисками, определены в методиках определения риск-параметров соответствующих Рынков.
- 25.10. Участник клиринга категории «О», «Б» или «Б2» / 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 Рынках.
- 25.11. 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).

25.12. Участник торгов / Участник клиринга, которому оказываются услуги по ведению клиринговых регистров 3-го уровня, 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 26. Порядок заключения закрывающих и/или балансирующих сделок**

26.1. 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 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 (оферте), являющейся допустимой встречной по отношению к заявке (оферте), поданной Клиринговым центром от имени Недобросовестного участника клиринга, или с Участником клиринга, определенным в соответствии с пунктом 26.4 общей части Правил клиринга.

В случае проведения ликвидационного неттинга в отношении Участника клиринга / клиента Участника клиринга в соответствии со статьями 59, 60 общей части Правил клиринга, или в случае неисполнения Провайдером(-ами) ликвидности обязательств перед Клиринговым центром, или в случае непредоставления Участником клиринга Обеспечения в сумме депозита, указанной в заявке на заключение депозитного договора, или в случае досрочного прекращения депозитного договора Участником клиринга, являющимся государственной корпорацией, Участником клиринга, являющимся государственной компанией, Участником клиринга, являющимся публично-правовой компанией в связи с тем, что Клиринговый центр перестал удовлетворять требованиям, предусмотренным Постановлением (Постановлениями) Правительства в отношении кредитных организаций, в депозиты в которых могут быть инвестированы временно свободные средства государственной корпорации / государственной компании / публично-правовой компании, 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 / Предложениях, являющихся допустимыми встречными по отношению к заявке, поданной Клиринговым центром от своего имени, или с Участниками клиринга, определенными в соответствии с пунктом 26.4 общей части Правил клиринга.

- 26.2. Закрывающие и/или балансирующие сделки заключаются на соответствующих Рынках на основании пункта 3.20 общей части Правил клиринга на основании хотя бы одной безадресной заявки / Предложения, информация о которой / котором раскрывается всем Участникам клиринга, а в случае невозможности или нецелесообразности заключения закрывающих и/или балансирующих сделок на основании хотя бы одной безадресной заявки / Предложения, информация о которой / котором раскрывается всем Участникам клиринга, (в том числе в случае отсутствия справедливой рыночной цены или необходимой ликвидности на момент возникновения основания заключения закрывающей/балансирующей сделки) – на основании адресных заявок / Предложений, информация о которых раскрывается определенному Участнику клиринга. Условия указанных закрывающих и/или балансирующих сделок соответствуют условиям сделок, определенным Правилами торгов на соответствующем Биржевом рынке.

В случае невозможности или нецелесообразности заключения закрывающих и/или балансирующих сделок на соответствующих Рынках (в том числе в случае отсутствия справедливой рыночной цены на момент возникновения основания заключения закрывающей/балансирующей сделки), в том числе в соответствии с законодательством Российской Федерации, закрывающие и/или балансирующие сделки заключаются на внебиржевых ОТС-рынках. Закрывающие и/или балансирующие сделки на внебиржевых ОТС-рынках заключаются на условиях, аналогичных (в отношении объекта и направленности сделки) условиям сделок с иностранной валютой / драгоценными металлами / ценными бумагами / товарами / Срочных контрактов / Договоров СПФИ, которые могли бы быть заключены на соответствующих Рынках.

- 26.3. Закрывающие и/или балансирующие сделки заключаются по текущим рыночным ценам.
- 26.4. Если заключение закрывающих и/или балансирующих сделок на соответствующих Рынках и внебиржевых ОТС-рынках в соответствии с пунктом 26.2 общей части Правил клиринга невозможно или нецелесообразно, балансирующие сделки заключаются без подачи заявок / Предложений 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 Рынка, закрывающие сделки – без подачи заявок / Предложений между Клиринговым центром и Недобросовестными участниками клиринга по ценам, соответствующим ценам балансирующих сделок.

В целях настоящего пункта общей части Правил клиринга под Добросовестным участником клиринга понимается Участник клиринга, не имеющий перед Клиринговым центром неисполненных обязательств по денежным средствам в валюте / по ценной бумаге / по драгоценному металлу / по товару, с которой (-ым) заключается балансирующая сделка.

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 подпунктом 59.16.10 общей части Правил клиринга при проведении ликвидационного неттинга в отношении Участника клиринга / клиента Участника клиринга, а также в иных случаях, установленных Правилами клиринга.

26.4.1. 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.

26.4.2. 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 26.4.1 общей части Правил клиринга, при условии наличия на таком Расчетном коде обязательств, являющихся встречными к указанным обязательствам, на момент времени, установленный Временным регламентом, а в случае отсутствия на таком Расчетном коде обязательств, являющихся встречными к указанным обязательствам, на указанный момент времени, - по Расчетным кодам, по которым учитывались Нетто-обязательства / Нетто-требования / позиции Добросовестного участника клиринга, пропорционально объему которых были заключены указанные балансирующие сделки.

26.4.3. 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 26.4.2 общей части Правил клиринга.

26.4.4. Временем заключения балансирующих сделок в соответствии с настоящим пунктом общей части Правил клиринга считается момент времени, установленный Временным регламентом, если иное не следует из Правил торгов и (или) Правил клиринга.

26.5. Специальной частью Правил клиринга может быть установлен особый порядок заключения закрывающих и/или балансирующих сделок, отличный от порядка, определенного пунктом 26.3 общей части Правил клиринга.



- 26.6. 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.
- 26.7. Клиринговый центр допускает к клирингу обязательства по закрывающим и балансирующим сделкам, заключенным на Рынках в соответствии с настоящей статьей общей части Правил клиринга.
- 26.8. С Участника клиринга любой категории, кроме категории «К», являющегося Недобросовестным участником клиринга, от имени которого Клиринговым центром заключена закрывающая сделка, взимается штраф, рассчитываемый в соответствии с пунктом 26.8.1 общей части Правил клиринга.
- 26.8.1. Сумма штрафа при заключении закрывающей сделки рассчитывается по формуле:  
$$\text{Penalty} = \text{ROUND} (\text{Amount} \times \text{C} \times \text{T} \times \text{R}; 2), \text{ где}$$
  
Penalty – сумма штрафа при заключении закрывающей сделки, в российских рублях;  
Amount – сумма закрывающей сделки, заключенной Клиринговым центром от имени Недобросовестного Участника клиринга в валюте расчетов для Недобросовестного участника клиринга (сумма закрывающей сделки включает НКД при условии его расчета по ценным бумагам);  
C – курс иностранной валюты к российскому рублю, установленный Банком России на дату заключения закрывающей сделки. C = 1 для закрывающих сделок, валютой расчета которых для Недобросовестного участника клиринга являются российские рубли;  
T – срок для сделок / 365 (применяется для сделок РЕПО / СВОП; для сделок купли-продажи T=1);  
R – ставка, равная ставке РЕПО, устанавливаемая решением Клирингового центра (по умолчанию R = 0,1%).  
Сумма штрафа, рассчитанная в соответствии с настоящим подпунктом общей части Правил клиринга, не облагается НДС.
- 26.8.2. Обязательство по уплате штрафа при заключении закрывающей сделки учитывается по основному Расчетному коду для списания комиссионных вознаграждений на соответствующем Рынке.
- 26.8.3. Обязательство по уплате штрафа при заключении закрывающей сделки должно быть исполнено в Расчетный день, следующий за днем возникновения оснований для взимания штрафа.
- 26.8.4. Штраф при заключении закрывающей сделки не взимается с Участника клиринга, допуск к клиринговому обслуживанию которого приостановлен на основании подпункта 15.1.1 общей части Правил клиринга или подпункта 15.1.12 общей части Правил клиринга в связи с аннулированием лицензии на осуществление профессиональной деятельности на рынке ценных бумаг.

- 26.8.5. Правилами клиринга могут быть установлены случаи, в которых штраф при заключении закрывающей сделки не взимается.
- 26.8.6. Специальной частью Правил клиринга может быть установлен особый порядок определения суммы штрафа при заключении закрывающей сделки.

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

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

#### **Статья 27. Порядок внесения Обеспечения**

27.1. 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.

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

27.2.1. Обеспечение Участника клиринга в иностранной валюте, являющееся иным обеспечением, перечисляется на корреспондентский счет Клирингового центра в Расчетном банке или на клиринговый банковский счет Клирингового центра в Расчетной организации.

27.3. 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 / иного клирингового регистра 3-го уровня.

Специальной частью Правил клиринга могут быть предусмотрены особенности заполнения назначения платежа и учета денежных средств при внесении Обеспечения в российских рублях и иностранной валюте.

27.4. Внесение Обеспечения в драгоценных металлах возможно следующими способами:

- 1) путем зачисления драгоценных металлов на торговый банковский счет в соответствующем драгоценном металле;
- 2) путем исполнения распоряжения на перевод драгоценных металлов, поданного Участником клиринга с использованием Клиринговой системы (при наличии такой возможности);
- 3) путем исполнения Запроса на перевод обеспечения.

27.5. 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.

27.6. Внесение Обеспечения в ценных бумагах для учета на Торгово-клиринговом счете для уплаты налогов 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.

27.7. Порядок подачи и исполнения распоряжений на перевод ценных бумаг определен пунктом 27.16 общей части Правил клиринга.

27.7.1. В распоряжении на перевод ценных бумаг, поданном с целью внесения ценных бумаг в качестве Обеспечения для учета на Торгово-клиринговом счете для уплаты налогов, 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.

27.8. Порядок подачи и исполнения Запросов на подбор ценных бумаг определен статьей 29 общей части Правил клиринга.

27.9. Клиринговый центр учитывает в Клиринговой системе денежные средства / драгоценные металлы, перечисленные / зачисленные на соответствующий клиринговый банковский счет или корреспондентский счет Клирингового центра / торговый банковский счет в соответствующем драгоценном металле, в качестве Обеспечения Участника клиринга по Расчетному коду Участника клиринга, указанному в назначении платежа / Расчетному коду, соответствующему торговому банковскому счету в драгоценном металле, на который зачислен драгоценный металл, увеличивает сумму денежных средств / количество драгоценного металла, учитываемых по Расчетному коду Участника клиринга, указанному в назначении платежа / Расчетному коду, соответствующему торговому банковскому счету, на который зачислен драгоценный металл, на сумму перечисленных денежных средств / количество зачисленного драгоценного металла, а также увеличивает Единый лимит по такому Расчетному коду (для Расчетных кодов Единого пула, для Расчетных кодов на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, на товарном рынке), или значение величины  $SZ_{SC}$  (свободного Обеспечения) (на срочном рынке) с учетом суммы перечисленных денежных средств / количества зачисленного драгоценного металла.

27.9.1. Денежные средства, 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.
- 27.9.2. Денежные средства, перечисленные с указанием в назначении платежа Расчетного кода / иного клирингового регистра 3-го уровня, учитываются Клиринговым центром в качестве Обеспечения по Расчетному коду Участника клиринга, соответствующему Расчетному коду / иному клиринговому регистру 3-го уровня, указанному в назначении платежа, информация о таком Обеспечении также учитывается по Расчетному коду / иному клиринговому регистру 2-го уровня, соответствующему Расчетному коду / иному клиринговому регистру 3-го уровня, указанному в назначении платежа, и по Расчетному коду / иному клиринговому регистру 3-го уровня, указанному в назначении платежа.
- 27.10. Если Расчетный код / иной клиринговый регистр 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 в качестве Обеспечения Участника клиринга в соответствии с пунктом 27.6 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.
- 27.10.1. 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.
- 27.11. Денежные средства, зачисленные на соответствующий клиринговый банковский или корреспондентский счет Клирингового центра позднее времени, установленного Временным регламентом, учитываются Клиринговым центром в следующем Расчетном дне.
- 27.12. Денежные средства, перечисленные с указанием в назначении платежа Расчетного кода Единого пула, драгоценные металлы, зачисленные на торговый банковский счет в соответствующем драгоценном металле, соответствующий Расчетному коду Единого пула, учитываются в качестве Обеспечения Участника клиринга по Расчетному коду Участника клиринга, указанному в назначении платежа / Расчетному коду Участника клиринга, соответствующему торговому банковскому счету в драгоценном металле, на который зачислен драгоценный металл, в Клиринговой системе фондового рынка.
- 27.12.1. При перечислении денежных средств на соответствующий клиринговый банковский или корреспондентский счет Клирингового центра 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 / Клиринговую систему рынка Стандартизированных ПФИ, необходимо передать Профиль актива в размере перечисляемой суммы денежных средств.

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 Клиринговой системой валютного рынка и рынка драгоценных металлов / Клиринговой системой срочного рынка / Клиринговой системой рынка Стандартизированных ПФИ, устанавливается соответствующей специальной частью Правил клиринга.

27.12.2. В случае указания в назначении платежа кодового слова / кода раздела клиринговых регистров в соответствии с подпунктом 27.12.1 общей части Правил клиринга, Клиринговый центр при соблюдении условий, указанных в пункте 28.3 общей части Правил клиринга, также:

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

При несоблюдении условий, указанных в пункте 28.3 общей части Правил клиринга, действия, указанные в настоящем подпункте общей части Правил клиринга, не осуществляются.

27.13. 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.

27.14. Участник клиринга вправе предоставить Клиринговому центру Заявление об изменении статуса Обеспечения в иностранной валюте на соответствующем Рынке.

27.14.1. 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, рынке депозитов и рынке кредитов.
- 27.14.2. Начиная с Расчетного дня по соответствующей валюте, следующего за днем исполнения указанного заявления, внесение Обеспечения в иностранной валюте осуществляется в соответствии с подпунктом 27.2.1 общей части Правил клиринга.
- 27.14.3. В случае предоставления Участником клиринга Клиринговому центру Заявления об изменении статуса Обеспечения в иностранной валюте на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, действия, указанные в подпункте 27.14.1 общей части Правил клиринга, также осуществляются в отношении Обеспечения под стресс.
- 27.15. Распоряжение на перевод денежных средств / драгоценного металла, 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, сумму денежных средств / количество драгоценного металла, которые необходимо перевести.
- 27.15.1. Распоряжение на перевод денежных средств / драгоценного металла исполняется за счет денежных средств / драгоценных металлов, учитываемых по Расчетному коду / Счету обеспечения Т0, входящему в состав Торгово-клирингового счета, указанного в распоряжении в качестве Торгово-клирингового счета, по которому осуществляется уменьшение суммы денежных средств / количества драгоценного металла, при выполнении условий для возврата денежных средств / драгоценного металла, установленных пунктом 30.12 общей части Правил клиринга, в отношении такого Расчетного кода / Счета обеспечения Т0 и суммы денежных средств / количества драгоценного металла, указанной / указанного в распоряжении.
- 27.15.2. Частичное исполнение распоряжения на перевод денежных средств / драгоценного металла невозможно.
- 27.15.3. В случае положительного результата проверки возможности исполнения распоряжения на перевод денежных средств / драгоценного металла, в Клиринговой системе незамедлительно уменьшается сумма денежных средств / количество драгоценного металла, учитываемых по Расчетному коду / Счету обеспечения Т0, по которому осуществляется уменьшение суммы денежных средств / количества драгоценного металла, и увеличивается сумма денежных средств / количество драгоценного металла, учитываемых по Расчетному коду / Счету обеспечения Т0, по которому осуществляется увеличение суммы денежных средств / количества драгоценного металла.

- 27.15.4. Обязательства по списанию / зачислению денежных средств / драгоценного металла по распоряжениям на перевод денежных средств, прошедшим проверку возможности их исполнения в соответствии с подпунктом 27.15.1 общей части Правил клиринга, включаются в соответствующий клиринговый пул в порядке, предусмотренном соответствующей специальной частью Правил клиринга.
- 27.15.5. Распоряжение на перевод денежных средств, приводящий к уменьшению суммы денежных средств в российских рублях на Счете обеспечения нерезидента и увеличению суммы денежных средств в российских рублях на Счете обеспечения, не являющемся Счетом обеспечения нерезидента, а также распоряжение на перевод денежных средств, приводящий к уменьшению суммы денежных средств в российских рублях на Счете обеспечения, не являющемся Счетом обеспечения нерезидента и увеличению суммы денежных средств в российских рублях на Счете обеспечения нерезидента, не исполняется Клиринговым центром.
- 27.16. Распоряжение на перевод 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 ценных бумаг, количество 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.
- 27.16.1. Распоряжение на перевод ценных бумаг исполняется в следующих случаях:
- Разделы, входящие в состав Торгово-клиринговых счетов, указанных в распоряжении на перевод ценных бумаг, открыты одному Участнику клиринга на одном счете депо / эмиссионном счете / счете брокера, или
  - Разделы, входящие в состав Торгово-клиринговых счетов, указанных в распоряжении на перевод ценных бумаг, открыты на торговых счетах депо владельца одного Участника клиринга;
  - Оба Торгово-клиринговых счета, указанных в распоряжении на перевод ценных бумаг, не являются Торгово-клиринговыми счетами нерезидента, или оба Торгово-клиринговых счета, указанных в распоряжении на перевод ценных бумаг, являются Торгово-клиринговыми счетами нерезидента.
- В иных случаях распоряжение на перевод ценных бумаг не исполняется.
- 27.16.2. 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 30.16 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 T0 или Разделе T+ по



информации, полученной от Расчетного депозитария (только для немедленного перевода ценных бумаг).

- 27.16.3. Частичное исполнение распоряжения на перевод ценных бумаг невозможно.
- 27.16.4. В случае положительного результата проверки возможности исполнения распоряжения на перевод ценных бумаг, в Клиринговой системе незамедлительно уменьшается количество ценных бумаг, учитываемых по Торгово-клиринговому счету, по которому осуществляется уменьшение количества ценных бумаг, и увеличивается количество ценных бумаг, учитываемых по Торгово-клиринговому счету, по которому осуществляется увеличение количества ценных бумаг.
- 27.16.5. 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 27.16.2 общей части Правил клиринга, включаются в соответствующий Клиринговый пул для расчетов по итогам торгов в порядке, предусмотренном Правилами клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.

Обязательства по списанию / зачислению ценных бумаг по распоряжениям на немедленный перевод ценных бумаг, прошедшим проверку возможности их исполнения в соответствии с подпунктом 27.16.2 общей части Правил клиринга, включаются в распоряжение на проведение операций по Разделам, направляемое Клиринговым центром Расчетному депозитарию в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.

- 27.17. Участник клиринга может подать в Клиринговый центр Запрос на перевод обеспечения для перевода денежных средств / драгоценных металлов, учитываемых в качестве Обеспечения / Обеспечения под стресс / взносов в Гарантийные фонды, между Расчетными кодами, в том числе, Расчетными кодами, открытыми для разных Рынков, и Расчетными кодами Единого пула.

- 27.18. В Запросе на перевод обеспечения Участник клиринга указывает:
- первый Расчетный код, по которому осуществляется уменьшение суммы денежных средств / количества драгоценного металла;
  - второй Расчетный код, по которому осуществляется увеличение суммы денежных средств / количества драгоценного металла;
  - код валюты / драгоценного металла;
  - сумма денежных средств / количество драгоценного металла, подлежащие переводу;
  - Клиринговая система первого Рынка;
  - список изменений по клиринговым регистрам в Клиринговой системе первого 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 / Клиринговой системы валютного рынка и рынка драгоценных металлов);

- изменение (со знаком «плюс») суммы денежных средств / количества драгоценных металлов в Клиринговой системе первого Рынка;
  - Клиринговая система второго Рынка;
  - список изменений по клиринговым регистрам в Клиринговой системе второго 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 / Клиринговой системы валютного рынка и рынка драгоценных металлов);
    - изменение (со знаком «плюс») суммы денежных средств / количества драгоценных металлов в Клиринговой системе второго Рынка.
- 27.18.1. Подача Участником клиринга Запроса на перевод обеспечения является подтверждением Участником клиринга совершения им финансовой операции.
- 27.18.2. 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 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 Рынка; обе указанные суммы должны быть равны сумме денежных средств / количеству драгоценного металла, подлежащих переводу.
- 27.18.3. Запросы на перевод обеспечения принимаются Клиринговым центром в Расчетные дни в период времени, установленный Временным регламентом.
- 27.18.4. Запрос на перевод обеспечения исполняется Клиринговым центром при выполнении условий для возврата денежных средств, установленных пунктом 30.12 общей части Правил клиринга или соответствующей специальной частью Правил клиринга, в отношении Расчетного кода, по которому осуществляется уменьшение суммы денежных средств / количества драгоценного металла, и суммы денежных средств / количества драгоценного металла, подлежащих переводу.
- 27.18.5. 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 драгоценного металла, 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 27.22, 27.23 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 Рынка указана Клиринговая система валютного рынка и рынка драгоценных металлов, или Клиринговая система срочного рынка, или Клиринговая система рынка Стандартизированных ПФИ, осуществляет передачу Профилей активов по денежным средствам / драгоценным металлам, аналогичную переводу денежных средств / драгоценных металлов, между Клиринговой системой фондового рынка и Клиринговой системой указанного Рынка.

27.19. Запрос на перевод обеспечения, приводящий к уменьшению суммы денежных средств в российских рублях на Счете обеспечения нерезидента и увеличению суммы денежных средств в российских рублях на Счете обеспечения, не являющемся Счетом обеспечения нерезидента, а также Запрос на перевод обеспечения, приводящий к уменьшению суммы денежных средств в российских рублях на Счете обеспечения, не являющемся Счетом обеспечения нерезидента и увеличению суммы денежных средств в российских рублях на Счете обеспечения нерезидента, не исполняется Клиринговым центром.

27.20. В случае если в Запросе на перевод обеспечения, соответствующем требованиям, установленным пунктом 27.18 общей части Правил клиринга, Расчетный код, по которому осуществляется уменьшение суммы денежных средств / количества драгоценного металла или Расчетный код, по которому осуществляется увеличение суммы денежных средств / количества драгоценного металла, не является Расчетным кодом Участника клиринга, направившего Запрос, Клиринговый центр вправе исполнить такой Запрос, при условии, что:

27.20.1. исполнение такого Запроса направлено на защиту законных интересов Клирингового центра, Участника клиринга и/или его клиентов и (или) на уменьшение рисков Клирингового центра, Участника клиринга и/или его клиентов, связанных с действиями (бездействиями) расчётных банков/ расчётных организаций, по причинам, не зависящим от Клирингового центра;

27.20.2. Участником клиринга представлена информация, подтверждающая необходимость исполнения такого Запроса на перевод обеспечения с учетом факторов, указанных в пункте 27.20.1 общей части Правил клиринга.

Клиринговый центр вправе отказать в исполнении указанного в настоящем пункте Запроса на перевод обеспечения, если информация, представленная Участником клиринга в соответствии с пунктом 27.20.2 общей части Правил клиринга, по заключению Клирингового центра, является недостаточной для подтверждения необходимости осуществления такого перевода.

27.21. Порядок подачи и исполнения Запросов на подбор ценных бумаг определен статьей 29 общей части Правил клиринга.

- 27.22. Участник клиринга вправе с использованием Клиринговой системы изменить информацию об Обеспечении, учитываемую по Расчетному коду 2-го уровня.
- 27.22.1. Изменение информации об Обеспечении, учитываемой по Расчетному коду 2-го уровня, осуществляется вне зависимости от наличия или отсутствия Обеспечения Участника клиринга, учитываемого по соответствующему Расчетному коду Участника клиринга.
- 27.22.2. Если по Расчетному коду 2-го уровня установлен признак, указывающий на необходимость контроля Единого лимита по Расчетному коду 2-го уровня, при изменении информации об Обеспечении, учитываемой по Расчетному коду 2-го уровня, осуществляется контроль Единого лимита по Расчетному коду 2-го уровня в порядке, определенном соответствующей специальной частью Правил клиринга. Участник клиринга вправе с использованием Клиринговой системы указать, что изменение информации об Обеспечении, учитываемой по Расчетному коду 2-го уровня, должно быть выполнено безусловно.
- 27.22.3. 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.
- 27.23. Участник торгов / Участник клиринга, которому оказываются услуги по ведению клиринговых регистров 3-го уровня, вправе с использованием Клиринговой системы изменить информацию об Обеспечении, учитываемую по Расчетному коду 3-го уровня.
- 27.23.1. Изменение информации об Обеспечении, учитываемой по Расчетному коду 3-го уровня, осуществляется 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.
- 27.23.2. Если по Расчетному коду 3-го уровня установлен признак, указывающий на необходимость контроля Единого лимита по Расчетному коду 3-го уровня, при изменении информации об Обеспечении, учитываемой по Расчетному коду 3-го уровня, осуществляется контроль Единого лимита по Расчетному коду 3-го уровня в порядке, определенном соответствующей специальной частью Правил клиринга. Участник торгов / Участник клиринга, которому оказываются услуги по ведению клиринговых регистров 3-го уровня, вправе с использованием Клиринговой системы указать, что изменение информации об Обеспечении, учитываемой по Расчетному коду 3-го уровня, должно быть выполнено безусловно.
- 27.23.3. 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.
- 27.24. После зачисления 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 30.12 общей части Правил клиринга, или условий, установленных соответствующей специальной частью Правил клиринга.

## **Статья 28. Порядок передачи Профилей активов**

28.1. 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.

28.2. 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 Рынка;
- список изменений Профилей активов по клиринговым регистрам в Клиринговой системе первого 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 / 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 Рынка;
- Клиринговая система второго Рынка;
- список изменений Профилей активов по клиринговым регистрам в Клиринговой системе второго 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 / 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 Рынка.

28.2.1. Общая сумма / общее количество изменений Профилей по каждому активу, рассчитанные по списку изменений Профилей активов по клиринговым регистрам в Клиринговой системе первого 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 Рынка, и иметь противоположные знаки.

- 28.2.2. Не допускается указание в одном Запросе на передачу Профилей активов Клиринговой системы фондового рынка в качестве Клиринговой системы и первого, и второго Рынка.
- 28.3. 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 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 Рынка (для 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 Рынка (для 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 30.19 общей части Правил клиринга для каждой Даты исполнения, не станут отрицательными;
  - исполнение Запроса на передачу Профилей активов в ценных бумагах, эмитентом которых является лицо, связанное с Участником клиринга, по собственным Торгово-клиринговым счетам, в состав которых входит Расчетный код Единого пула / Расчетным кодам Единого пула, открытым для срочного рынка, если его исполнение не приведет к увеличению по модулю количества ценных бумаг по Торгово-клиринговому счету / Профилю активов первого и/или второго Рынка и изменению знака Профиля активов (направления). Определение связанных с Участником клиринга лиц осуществляется в соответствии с Критериями по выявлению связанных с контрагентом лиц, раскрываемыми на Сайте Клирингового центра.
- 28.4. Для исполнения Запроса на передачу Профилей активов Клиринговый центр:
- учитывает изменения Профилей активов в Клиринговой системе первого и второго 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 Рынка, рассчитанные с учетом изменений Профилей активов в Клиринговой системе первого и второго Рынков (для 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 27.22, 27.23 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.
- 28.5. Специальной частью Правил клиринга могут быть установлены особенности исполнения Запроса на передачу Профилей активов в Клиринговой системе соответствующего Рынка.
- 28.6. Клиринговый центр вправе принять решение об аннулировании Профилей активов по одному или нескольким активам на одном или нескольких Рынках. 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 если иной срок извещения Участников клиринга не определен решением Клирингового центра.

## **Статья 29. Порядок подачи и исполнения Запросов на подбор ценных бумаг**

- 29.1. Участник клиринга, соответствующий требованиям, установленным пунктом 14.31 общей части Правил клиринга, вправе с использованием WEB-сервиса Расчетного депозитария подавать Запросы на подбор ценных бумаг.
- 29.2. 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.
- 29.3. 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.
- 29.3.1. 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.
- 29.3.2. 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.
- 29.4. 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.
- 29.5. В случаях, установленных Правилами клиринга, Клиринговый центр с использованием WEB-сервиса Расчетного депозитария направляет Расчетному депозитарию Запрос на подбор ценных бумаг в отношении Участника клиринга, соответствующего требованиям, установленным пунктом 14.31 общей части Правил клиринга.
- 29.6. 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).
- 29.6.1. 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 54.5 общей части Правил клиринга.
- 29.7. 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 54.8 общей части Правил клиринга.

### **Статья 30. Порядок возврата Обеспечения**

- 30.1. Возврат Клиринговым центром Участнику клиринга денежных средств / драгоценных металлов, учитываемых, в том числе ранее, в качестве Обеспечения (далее - денежные средства / драгоценные металлы, учитываемые 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 / драгоценного металла, поданного Участником клиринга с использованием Клиринговой системы;
  - 5) Запроса на получение денежных средств, поданного НКО АО НРД.



- 30.2. 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) распоряжения на перевод ценных бумаг, поданного Клиринговым центром на основании запроса на изменение параметров Торгово-клирингового счета;
  - 3) распоряжения лица, которому открыт торговый счет депо, поданного в Расчетный депозитарий, с согласия Клирингового центра.
- 30.3. 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 16.16 общей части Правил клиринга.
- 30.4. Запрос на возврат обеспечения / Постоянное поручение на возврат обеспечения должны содержать:
- а) Расчетный код Участника клиринга;
  - б) реквизиты Счета для возврата обеспечения.
- 30.5. Запрос на возврат обеспечения / Постоянное поручение на возврат обеспечения могут содержать указание на Расчетный код 2-го или 3-го уровня.
- 30.5.1. 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.
- 30.6. 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 / Клиринговой системы рынка Стандартизированных ПФИ 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).
- 30.6.1. Подача Участником клиринга Запроса на возврат обеспечения является подтверждением Участником клиринга совершения им финансовой операции.
- 30.6.2. 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.

- 30.6.3. При предоставлении Запроса на возврат обеспечения позднее времени, указанного во Временном регламенте, Клиринговый центр вправе не исполнять Запрос на возврат обеспечения.
- 30.6.4. Запрос на возврат обеспечения действует в день его предоставления.
- 30.6.5. Запрос на возврат обеспечения исполняется после его получения при соблюдении условий его исполнения.
- 30.6.6. Запрос на возврат обеспечения, содержащий сумму денежных средств / количество драгоценного металла, исполняется при соблюдении условий, указанных в пункте 30.12 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.
- 30.6.7. 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 30.8 общей части Правил клиринга), для которой(-ого) условия, указанные в пункте 30.12 общей части Правил клиринга, будут выполняться.
- 30.6.8. Запрос на возврат обеспечения, содержащий сумму денежных средств / количество драгоценного металла и не содержащий информации, указывающей на необходимость одновременной передачи Профиля актива, не исполненный сразу после его получения по причине несоблюдения условий, указанных в пункте 30.12 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 30.12 общей части Правил клиринга.
- 30.6.9. Запрос на возврат обеспечения, содержащий сумму денежных средств / количество драгоценного металла и содержащий информацию, указывающую на необходимость одновременной передачи Профиля актива, не исполненный сразу после его получения по причине несоблюдения условий, указанных в пункте 30.12 общей части Правил клиринга, не выполняется и аннулируется.
- 30.6.10. 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 30.12 общей части Правил клиринга, не выполняются ни для какой суммы денежных средств / количества драгоценного металла, аннулируется.
- 30.7. 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 нетто-требования, или;
- в) признак, указывающий на необходимость возврата денежных средств в российских рублях в размере нетто-требования Участника клиринга без учета обязательств по уплате комиссионных вознаграждений.

30.7.1. 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.

Постоянное поручение на возврат обеспечения, поданное Участником клиринга в отношении всех иностранных валют / драгоценных металлов исполняется Клиринговым центром в отношении иностранных валют / драгоценных металлов, в которых Клиринговый центр открывал Счета обеспечения на момент подачи данного Поручения.

30.7.2. 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 30.8 общей части Правил клиринга), для которой(-ого) условия, указанные в пункте 30.12 общей части Правил клиринга, будут выполняться.

30.7.3. Исполнение Клиринговым центром Постоянного поручения на возврат обеспечения, содержащего признак, указывающий на необходимость возврата денежных средств в иностранной валюте / драгоценного металла в размере нетто-требования / Постоянного поручения на возврат обеспечения, содержащего признак, указывающий на необходимость возврата денежных средств в российских рублях в размере 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 нетто-требования Участника клиринга в соответствующей валюте, рассчитанного в соответствии с подпунктом 30.7.4 общей части Правил клиринга, при соблюдении условий, указанных в пункте 30.12 общей части Правил клиринга, при этом проверка указанных условий осуществляется в отношении указанного нетто-требования.

Для Постоянного поручения на возврат обеспечения, содержащего признак, указывающий на необходимость возврата денежных средств в российских рублях в размере 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 отношении нетто-требования Участника клиринга в российских рублях, рассчитанного в соответствии с подпунктом 30.7.4 общей части Правил клиринга и уменьшенного на сумму обязательств по уплате комиссионных вознаграждений с наступившей Датой исполнения.

Исполнение Клиринговым центром Постоянного поручения на возврат обеспечения, содержащего признак, указывающий на необходимость возврата денежных средств в российских рублях в размере нетто-требования, осуществляется после определения обязательств по уплате оборотных частей комиссионных вознаграждений.

30.7.4. Нетто-требование Участника клиринга в соответствующей валюте / соответствующем драгоценном металле, в размере которого исполняется Постоянное поручение на возврат обеспечения, содержащее признак, указывающий на необходимость возврата денежных средств в иностранной валюте / драгоценного металла в размере нетто-требования, рассчитывается как:

- Итоговое нетто-требование Участника клиринга в такой валюте – при возврате Обеспечения в денежных средствах, учитываемого по Расчетным кодам, открытым для валютного рынка и рынка драгоценных металлов и Расчетным кодам, открытым для срочного рынка и не являющимся Расчетными кодами Единого пула;
- Итоговое нетто-требование Участника клиринга в таком драгоценном металле – при возврате Обеспечения в драгоценном металле;
- сумма (с учетом знака) Нетто-обязательств / Нетто-требований Участника клиринга по денежным средствам в такой валюте по сделкам клирингового пула, определенных в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, обязательств / требований по оплате ценных бумаг по сделкам купли-продажи с кодом расчетов Z0, X0 и первым частям сделок РЕПО с кодом расчетов Z0, указанных в Правилах клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, обязательств по возврату депозитов и сумм депозитов, указанных в заявках на заключение депозитного договора, внесенных в реестр предложений, - при возврате Обеспечения в денежных средствах, учитываемого по Расчетным кодам Единого пула или по Расчетным кодам, открытым для фондового рынка, рынка депозитов и рынка кредитов и не являющимся Расчетными кодами Единого пула.

30.7.5. Постоянное поручение на возврат обеспечения, содержащее признак, указывающий на необходимость возврата денежных средств / драгоценного металла в размере 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 30.12 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 30.12 общей части Правил клиринга.

- 30.7.6. Постоянное поручение на возврат обеспечения, содержащее признак, указывающий на необходимость возврата денежных средств / драгоценного металла в размере 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 30.12 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.
- 30.7.7. 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, либо в случае если исполнение Постоянных поручений на возврат обеспечения по не зависящим от Клирингового центра обстоятельствам, в том числе связанным с недружественными действиями иностранных государств и иностранных лиц, приведет к повышению принимаемых Клиринговым центром / Участником клиринга рисков. 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.
- 30.7.8. 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.
- 30.8. Подача Участником клиринга Постоянного поручения на возврат обеспечения является подтверждением Участником клиринга совершения им финансовой операции.
- 30.9. 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.

- 30.9.1. 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.
- 30.9.2. 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.
- 30.9.3. Запрос на депонирование действует в день его предоставления.
- 30.9.4. 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.
- 30.9.5. Постоянное поручение на депонирование действует до его отмены Участником клиринга.
- 30.9.6. 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 30.6.7, 30.7.2 общей части Правил клиринга.
- 30.10. 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.
- 30.10.1. 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.
- 30.10.2. 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».

- 30.11. 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.
- 30.11.1. Запросы на получение денежных средств в соответствующей валюте принимаются Клиринговым центром в Расчетные дни по соответствующей валюте в период времени, установленный Временным регламентом.
- 30.11.2. При предоставлении Запроса на получение денежных средств позднее времени, установленного Временным регламентом, Клиринговый центр не исполняет Запрос на получение денежных средств.
- 30.11.3. Запрос на получение денежных средств действует в день его предоставления.
- 30.11.4. Запрос на получение денежных средств исполняется после его получения при соблюдении условий его исполнения.
- 30.11.5. Запрос на получение денежных средств исполняется для Расчетного кода Участника клиринга с признаком «Единый счет с НРД» при соблюдении условий, указанных в пункте 30.12 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.
- 30.11.6. Запрос на получение денежных средств, не исполненный сразу после его получения по причине несоблюдения условий, указанных в подпункте 30.11.5 общей части Правил клиринга, не исполняется.
- 30.12. 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 не является отрицательным и Единый лимит по Расчетному коду, рассчитанный без учета возвращаемой суммы денежных средств / количества драгоценного металла, не станет отрицательным (для Расчетных кодов Единого пула, для Расчетных кодов на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, на рынке Стандартизированных ПФИ, на товарном рынке);
  - величина  $SZ_{SC}$  по Расчетному коду, рассчитанная без учета возвращаемой суммы денежных средств, не станет отрицательной (для Расчетных кодов на срочном рынке);
  - возвращаемая сумма денежных средств / количество драгоценного металла не превышает суммы (с учетом знака) значения Обеспечения, уменьшенного на сумму обязательства с отложенным исполнением в такой валюте, определенного в соответствии с Правилами клиринга об ограничении размера ответственности Клирингового центра, и Нетто-обязательства / Нетто-требования в соответствующей валюте / драгоценном металле с текущей Датой исполнения,

учитываемых по Расчетному коду, - для Постоянных поручений на возврат обеспечения, содержащих признак, указывающий на необходимость возврата денежных средств в иностранной валюте / драгоценного металла в размере нетто-требования;

- 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 с Правилами клиринга об ограничении размера ответственности Клирингового центра (2) суммы (с учетом знака) значения Обеспечения, уменьшенного на сумму обязательства с отложенным исполнением в такой валюте, определенного в соответствии с Правилами клиринга об ограничении размера ответственности Клирингового центра, и Нетто-обязательства / Нетто-требования в соответствующей валюте / драгоценном металле с текущей Датой исполнения, учитываемых по Расчетному коду (если применимо), - для возврата Обеспечения в денежных средствах / драгоценном металле по иным основаниям, кроме возврата Обеспечения на основании Постоянных поручений на возврат обеспечения, содержащих признак, указывающий на необходимость возврата денежных средств в иностранной валюте / драгоценного металла в размере нетто-требования;

- в случае возврата денежных средств с Расчетного кода Участника клиринга с признаком «запрет необеспеченных покупок» и/или при возврате иностранной валюты / драгоценного металла с Расчетного кода, входящего в состав Торгово-клирингового счета, 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 30.19 общей части Правил клиринга для каждой Даты исполнения (с учетом периода действия признака «запрет коротких продаж» по иностранной валюте / драгоценному металлу, установленному Клиринговым центром в соответствии с подпунктом 24.2.5 общей части Правил клиринга), не станут отрицательными;

- в случае возврата денежных средств с собственного Расчетного кода - в отношении Участника клиринга не проводится процедура кросс-дефолта;

- в случае возврата денежных средств с Расчетного кода Единого пула - в случае положительного результата дополнительной проверки Единого лимита, указанной в пункте 25.5 общей части Правил клиринга.

Специальной частью Правил клиринга могут быть установлены иные и/или дополнительные условия возврата Обеспечения в денежных средствах.

30.13. Возврат Клиринговым центром денежных средств, учитываемых по Счету обеспечения T0, осуществляется при условии, что возвращаемая сумма денежных средств не превышает суммы денежных средств, учитываемой по такому Счету обеспечения T0, за вычетом соответствующего Ограничительного лимита.

30.14. Возврат Клиринговым центром Участнику клиринга Обеспечения в денежных средствах / драгоценных металлах, учитываемого по Расчетному коду Участника клиринга, входящего в состав Торгово-клирингового счета T+, не осуществляется, если величина, рассчитываемая в отношении Участника клиринга Клиринговым



центром с целью контроля рисков концентрации на эмитентов, в порядке, установленном Методикой контроля лимитов концентрации на эмитентов, без учета возвращаемой суммы денежных средств / количества драгоценного металла, станет отрицательной, или, если отрицательная величина, указанная в настоящем подпункте и рассчитанная без учета возвращаемой суммы денежных средств / количества драгоценного металла, уменьшится (для Расчетных кодов на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов).

- 30.15. В случае если по Расчетному коду для уплаты налогов, учитываются обязательства по уплате сумм, соответствующих суммам налога на прибыль организаций с доходов иностранных организаций от источников в Российской Федерации, которые учитываются на Расчетном коде, возврат Клиринговым центром Участнику клиринга Обеспечения в денежных средствах, учитываемого по такому Расчетному коду, не осуществляется, если абсолютное значение отрицательного Единого лимита по Расчетному коду для уплаты налогов больше величины, установленной решением Клирингового центра (далее – порог выставления Маржинального требования по налогам).
- 30.16. В случае получения Клиринговым центром от Расчетного депозитария запроса согласия Клирингового центра на списание ценных бумаг с Разделов с указанным признаком возможности частичного исполнения в соответствии с пунктом 54.9 общей части Правил клиринга, количество ценных бумаг, в отношении которого осуществляется проверка возможности возврата Клиринговым центром Участнику клиринга Обеспечения в ценных бумагах в соответствии с пунктом 30.17 общей части Правил клиринга, рассчитывается как минимальное из двух значений: (1) количества ценных бумаг, учитываемых по информации, полученной от Расчетного депозитария, на Разделе, указанном в запросе согласия Клирингового центра на списание ценных бумаг с Разделов; (2) суммы значения Обеспечения в ценной бумаге, учитываемого по Торгово-клиринговому счету Участника клиринга, в состав которого входит Раздел, указанный в запросе согласия Клирингового центра на списание ценных бумаг с Разделов, и Нетто-обязательства в ценной бумаге с наступившей Датой исполнения, учитываемого по такому Торгово-клиринговому счету (со знаком «минус»).
- 30.17. Возврат Клиринговым центром Участнику клиринга Обеспечения в ценных бумагах, учитываемого, в том числе ранее, по Торгово-клиринговому счету Т+ Участника клиринга (далее - Обеспечения в ценных бумагах, учитываемого по Торгово-клиринговому счету Т+ Участника клиринга), осуществляется при соблюдении следующих условий:
- Единый лимит по Расчетному коду не является отрицательным и Единый лимит по Расчетному коду, рассчитанный без учета возвращаемого количества ценных бумаг, не станет отрицательным (для Расчетных кодов Единого пула, для Расчетных кодов на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, на товарном рынке);
  - 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 (условие, указанное в настоящем абзаце, не применяется для возврата Обеспечения в ценных бумагах при получении Клиринговым центром от Расчетного депозитария запроса согласия Клирингового центра на списание ценных бумаг с Разделов с указанным признаком возможности частичного исполнения);

- 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 30.19 общей части Правил клиринга для каждой Даты исполнения (или Дат исполнения, указанных в подпункте 24.2.5 общей части Правил клиринга, при установке периода действия признака «запрет коротких продаж» по ценной бумаге), не станут отрицательными, а в случае, если на конец Расчетного дня, предшествующего дню установления признака «запрет коротких продаж» по ценной бумаге на период, значение, рассчитанное в соответствии с пунктом 30.19 общей части Правил клиринга, для какой-либо из Дат исполнения являлось отрицательным, абсолютное значение отрицательной величины, рассчитанной без учета возвращаемого количества ценных бумаг в соответствии с пунктом 30.19 общей части Правил клиринга, для Дат исполнения, указанных в подпункте 24.2.5 общей части Правил клиринга, при установке периода действия признака «запрет коротких продаж» по ценной бумаге не увеличится;
- 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;
- в случае возврата ценных бумаг с Торгово-клирингового счета Т+, в состав которого входит Расчетный код Единого пула, – в случае положительного результата дополнительной проверки Единого лимита, указанной в пункте 25.5 общей части Правил клиринга.

Специальной частью Правил клиринга могут быть установлены иные и/или дополнительные условия возврата Обеспечения в ценных бумагах.

- 30.17.1. 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.
- 30.17.2. Возврат Клиринговым центром Участнику клиринга Обеспечения в ценных бумагах, учитываемого по Торгово-клиринговому счету Т+ Участника клиринга, не осуществляется, если величина, рассчитываемая в отношении Участника клиринга Клиринговым центром с целью контроля рисков концентрации на эмитентов, в порядке, установленном Методикой контроля лимитов концентрации на эмитентов, без учета возвращаемого количества ценных бумаг, станет отрицательной, или, если отрицательная величина, указанная в настоящем подпункте и рассчитанная без учета возвращаемого количества ценных бумаг, уменьшится (для Расчетных кодов на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов).

- 30.17.3. В случае если по Расчетному коду для уплаты налогов, учитываются обязательства по уплате сумм, соответствующих суммам налога на прибыль организаций с доходов иностранных организаций от источников в Российской Федерации, которые учитываются на Расчетном коде, который входит в состав Торгово-клирингового счета, возврат Клиринговым центром Участнику клиринга Обеспечения в ценных бумагах, учитываемого по такому Торгово-клиринговому счету, не осуществляется, если абсолютное значение отрицательного Единого лимита по Расчетному коду для уплаты налогов больше порога выставления Маржинального требования по налогам.
- 30.18. Если решением Клирингового центра не установлено иное, возврат Клиринговым центром Участнику клиринга категории «К» Обеспечения в ценных бумагах не осуществляется.
- 30.19. Сумма денежных средств / количество драгоценного металла / ценных бумаг, в отношении которой (которого) осуществляется дополнительная проверка возможности исполнения операции, проводимой по Торгово-клиринговому счету / Расчетному коду при наличии признака «запрет коротких продаж» / «запрет необеспеченных покупок», 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:
- 30.19.1. 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 с Правилами клиринга об ограничении размера ответственности Клирингового центра;
  - 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 / Котировок участника торгов при наличии зарегистрированной заявки, являющейся допустимой встречной к Котировке участника торгов, 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 Рынка;
- 30.19.2. 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 Рынка;
- 30.19.3. для ценных бумаг:
- Обеспечения Участника клиринга в ценных бумагах, учитываемых по Торгово-клиринговому счету T+;
  - обязательств и/или требований Участника клиринга по Сделкам, по которым осуществляется клиринг с полным обеспечением по ценным бумагам, в таких ценных бумагах, учитываемых по Торгово-клиринговому счету T+;
  - всех обязательств по ценным бумагам, которые могут возникнуть на основании зарегистрированных заявок / Котировок участника торгов при наличии зарегистрированной заявки, являющейся допустимой встречной к Котировке участника торгов, процедура контроля обеспечения по которым осуществляется по Торгово-клиринговому счету T+, 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 Рынка.
- 30.20. 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.
- 30.20.1. 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.
- Для возврата Обеспечения в драгоценных металлах 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 30.12 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 вознаграждения банков-корреспондентов из суммы Обеспечения в иностранной валюте, подлежащей возврату Участнику клиринга. В случае, если банком-корреспондентом удерживается с Клирингового центра вознаграждение за операции, проводимые с Обеспечением, или так или иначе связанные с Обеспечением, Участник клиринга обязан возместить Клиринговому центру такие расходы. Своим решением Клиринговый центр вправе определить порядок возмещения Участником клиринга понесенных им расходов.

Участник клиринга вправе отозвать Запрос на возврат обеспечения, подав соответствующий запрос по форме / формату, установленной / установленному документом Клирингового центра. Клиринговый центр не несет ответственности за исполнение такого запроса на отзыв, если он был направлен после исполнения Запроса на возврат обеспечения.

30.20.2. 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, Обязательство Клирингового центра по возврату Участнику клиринга Обеспечения в соответствующей валюте прекращается в части, соответствующей сумме возврата.

30.20.3. При исполнении Запроса на возврат обеспечения, содержащего код Клиринговой системы валютного рынка и рынка драгоценных металлов / Клиринговой системы рынка Стандартизированных ПФИ / Клиринговой системы срочного рынка и код раздела клиринговых регистров, указанные в соответствии с пунктом 30.6 общей части Правил клиринга, Клиринговый центр также:

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

30.20.4. 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.

- 30.21. Возврат денежных средств в иностранной валюте на основании Запроса на возврат обеспечения или Постоянного поручения на возврат обеспечения в сумме, превышающей установленное решением Клирингового центра для каждой иностранной валюты значение, осуществляется частями, каждая из которых не превышает такого установленного значения.
- 30.22. Порядок исполнения Запроса на перевод обеспечения определен пунктами 27.17-27.18 общей части Правил клиринга.
- 30.23. Распоряжение на перевод денежных средств / ценных бумаг, поданное Участником клиринга с использованием Клиринговой системы, исполняется в соответствии с пунктом 27.15 общей части Правил клиринга.
- 30.24. Возврат Обеспечения в ценных бумагах на основании запроса на изменение параметров Торгово-клирингового счета осуществляется в Клиринговой системе фондового рынка на Торгово-клиринговый счет T0, связанный с Торгово-клиринговым счетом T+.
- 30.25. Запрос на изменение параметров Торгово-клирингового счета содержит указание Клиринговому центру:
- а) о порядке перечисления ценных бумаг с Торгово-клиринговых счетов T0 на Торгово-клиринговые счета T+ 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 T0 на Торгово-клиринговые счета T+ при исполнении обязательств, включенных в Единый 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 T+ 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 T+ после прекращения обязательств, включенных в Единый клиринговый пул, не возвращаются.

- 30.25.1. Запрос на изменение параметров Торгово-клирингового счета исполняется Клиринговым центром, начиная с Расчетного дня, следующего за датой предоставления указанного запроса.
- 30.25.2. 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 42 общей части Правил клиринга, в размере прекращенного Итогового нетто-требования Участника клиринга по ценным бумагам, учитываемого по Торгово-клиринговому счету T+, но не превышающем количества ценных бумаг, учитываемых в качестве Обеспечения по Торгово-клиринговому счету T+, 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 T+, либо на максимально возможное количество, не превышающее количество ценных бумаг, учитываемых в качестве Обеспечения по Торгово-клиринговому счету T+, возврат которого из Обеспечения не приведет к возникновению у Участника клиринга отрицательного Единого лимита по Расчетному коду, входящему в состав такого Торгово-клирингового счета T+.
- 30.25.3. Сразу после проверки возможности возврата ценных бумаг из Обеспечения, проведенной в соответствии с подпунктом 30.25.2 общей части Правил клиринга, размер Обеспечения, учитываемого по Торгово-клиринговому счету T+ Участника клиринга, уменьшается, а размер Обеспечения, учитываемого по Торгово-клиринговому счету Участника клиринга, в состав которого входит Раздел T0, увеличивается на возвращаемое количество ценных бумаг.
- 30.25.4. Обязательства по списанию / зачислению ценных бумаг по запросам на изменение параметров Торгово-клирингового счета, прошедшим проверку возможности их исполнения в соответствии с подпунктом 30.25.2 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, рынке депозитов и рынке кредитов.
- 30.26. Возврат Обеспечения в ценных бумагах на основании поручения на списание ценных бумаг с Раздела T+, поданного в Расчетный депозитарий, осуществляется на раздел торгового счета депо, указанный в поручении.
- 30.27. 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.

30.28. Особенности возврата Обеспечения Участникам клиринга категории «К» определены в соответствующей специальной части Правил клиринга.



## **ПОДРАЗДЕЛ IV-II. ПОРЯДОК ВНЕСЕНИЯ И ВОЗВРАТА ОБЕСПЕЧЕНИЯ ПОД СТРЕСС, ВЗНОСОВ В ГАРАНТИЙНЫЕ ФОНДЫ, ОБЕСПЕЧЕНИЯ ПОД РИСКИ КОНЦЕНТРАЦИИ НА ЭМИТЕНТОВ**

### **Статья 31. Порядок внесения взносов в Гарантийные фонды, Обеспечения под стресс, Обеспечения под риски концентрации на эмитентов**

- 31.1. Внесение денежных средств в российских рублях и иностранной валюте в качестве взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс / Обеспечения под риски концентрации на эмитентов Участником клиринга возможно следующими способами:
- 1) путем перечисления денежных средств на клиринговый банковский / корреспондентский 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 / Обеспечения под риски концентрации на эмитентов;
  - 2) путем исполнения распоряжения на перевод денежных средств, поданного Участником клиринга с использованием Клиринговой системы;
  - 3) путем исполнения Запроса на перевод обеспечения.
- 31.2. Обеспечение под стресс / Обеспечение под риски концентрации на эмитентов в иностранной валюте, являющееся индивидуальным клиринговым обеспечением, перечисляется на клиринговый банковский счет Клирингового центра в Расчетной организации.
- 31.2.1. Обеспечение под стресс / Обеспечение под риски концентрации на эмитентов в иностранной валюте, являющееся иным обеспечением, перечисляется на корреспондентский счет Клирингового центра в Расчетном банке или на клиринговый банковский счет Клирингового центра в Расчетной организации.
- 31.2.2. Взносы в Гарантийные фонды перечисляются на клиринговый банковский счет Клирингового центра в Расчетной организации.
- 31.3. Клиринговый центр учитывает в Клиринговой системе денежные средства, перечисленные на соответствующий клиринговый банковский / корреспондентский счет Клирингового центра, по Расчетному коду для учета взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс / Обеспечения под риски концентрации на эмитентов, указанному в назначении платежа, и увеличивает Единый лимит по Гарантийным фондам / Единый лимит по Обеспечению под стресс / Единый лимит по рискам концентрации на эмитентов по такому Расчетному коду с учетом перечисленной суммы денежных средств.
- 31.3.1. Если Расчетный код, указанный в назначении платежа, не найден среди зарегистрированных Клиринговым центром Расчетных кодов для учета взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс / Обеспечения под риски концентрации на эмитентов, 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 настоящим пунктом 31.3 общей части Правил клиринга, осуществляется Клиринговым центром после получения от Участника клиринга /

- банка плательщика такого уточнения назначения платежа с правильно указанным Расчетным кодом.
- 31.3.2. Если в течение 5 (пяти) Расчетных дней по соответствующей валюте с даты, следующей за датой зачисления денежных средств в российских рублях / иностранной валюте на соответствующий клиринговый банковский / корреспондентский счет Клирингового центра с не указанным / неправильно указанным Расчетным кодом для учета взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс / Обеспечения под риски концентрации на эмитентов 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 / Обеспечения под риски концентрации на эмитентов, Клиринговый центр возвращает указанные денежные средства по реквизитам плательщика.
- 31.3.3. Денежные средства, зачисленные на соответствующий клиринговый банковский / корреспондентский счет Клирингового центра, позднее времени, установленного Временным регламентом, учитываются Клиринговым центром в следующем Расчетном дне.
- 31.4. Порядок подачи и исполнения распоряжений на перевод денежных средств определен пунктом 27.15 общей части Правил клиринга.
- 31.5. Порядок исполнения Запроса на перевод обеспечения определен пунктами 27.17-27.18 общей части Правил клиринга.
- 31.6. Для внесения ценных бумаг в качестве взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс / Обеспечения под риски концентрации на эмитентов Участник клиринга обязан выполнить действия, необходимые для открытия субсчета депо гарантийных фондов / субсчета депо обеспечения под стресс / субсчета депо для учета Обеспечения под риски концентрации на эмитентов, предусмотренные Условиями осуществления депозитарной деятельности Расчетного депозитария.
- 31.6.1. Клиринговый центр открывает Торгово-клиринговый счет Гарантийных фондов / Торгово-клиринговый счет Обеспечения под стресс / Торгово-клиринговый счет для учета Обеспечения под риски концентрации на эмитентов Участника клиринга при открытии Расчетного кода для учета взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс / Обеспечения под риски концентрации на эмитентов Участника клиринга соответственно.
- 31.6.2. Торгово-клиринговый счет Гарантийных фондов / Торгово-клиринговый счет Обеспечения под стресс / Торгово-клиринговый счет для учета Обеспечения под риски концентрации на эмитентов может указываться в заявках на продажу ценных бумаг. По сделкам, заключенным на основании таких заявок, осуществляется клиринг с полным обеспечением по ценным бумагам.
- 31.7. Внесение ценных бумаг в качестве взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс / Обеспечения под риски концентрации на эмитентов 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.
- 31.8. Порядок подачи и исполнения распоряжений на перевод ценных бумаг определен пунктом 27.16 общей части Правил клиринга.
- 31.8.1. В распоряжении на перевод ценных бумаг, поданного с целью внесения ценных бумаг в качестве взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс / Обеспечения под риски концентрации на эмитентов, 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.
- 31.9. Порядок подачи и исполнения Запросов на подбор ценных бумаг определен статьей 29 общей части Правил клиринга.

**Статья 32. Единый лимит по Гарантийным фондам, Единый лимит по Обеспечению под стресс, Единый лимит по рискам концентрации на эмитентов**

- 32.1. 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»);
  - Нетто-требований Участника клиринга по денежным средствам в российских рублях, учитываемых по Расчетному коду для учета взносов в Гарантийные фонды, по всем Датам исполнения (учитываются со знаком «плюс»);
  - Нетто-требований Участника клиринга по денежным средствам в иностранной валюте, учитываемых по Расчетному коду для учета взносов в Гарантийные фонды, по всем Датам исполнения, пересчитанных 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 (учитываются со знаком «плюс»);
  - Нетто-обязательств Участника клиринга по ценным бумагам, учитываемых по Торгово-клиринговому счету Гарантийных фондов, по всем Датам исполнения,

пересчитанным 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 (учитываются со знаком «минус»);

- суммы установленных соответствующими специальными частями Правил клиринга минимальных размеров взноса в Гарантийные фонды Рынков, на которых Участник клиринга допущен к клиринговому обслуживанию с категорией «О», «Б» или «Б2» (учитываются со знаком «минус»);

- суммы, соответствующей сумме налога на прибыль организаций с доходов иностранных организаций от источников в Российской Федерации, подлежащую удержанию с Участника клиринга, с даты заключения Сделки / даты получения Участником клиринга дохода, до даты, следующей за днем получения доходов Участником клиринга – Нерезидентом (в т.ч. в пользу фактического получателя дохода Участника клиринга – Нерезидента) / Участником клиринга – Международной организацией (в пользу фактического получателя дохода Участника клиринга – Международной организации) (включая эту дату) (учитывается со знаком «минус»);

- суммы, соответствующей сумме налога на прибыль организаций с доходов иностранных организаций от источников в Российской Федерации, подлежащую удержанию с Участника клиринга, с даты заключения Сделки / даты получения Участником клиринга дохода, до даты, следующей за днем получения доходов Участником клиринга – Нерезидентом (в т.ч. в пользу фактического получателя дохода Участника клиринга – Нерезидента) / Участником клиринга – Международной организацией (в пользу фактического получателя дохода Участника клиринга – Международной организации), рассчитанной по максимальной ставке, установленной российским налоговым законодательством (учитывается со знаком «минус» в период, с 1 января до даты, следующей за днем получения доходов Участником клиринга – Нерезидентом (в т.ч. в пользу фактического получателя дохода Участника клиринга – Нерезидента) / Участником клиринга – Международной организацией (в пользу фактического получателя дохода Участника клиринга – Международной организации) или до даты предоставления Участником клиринга – Нерезидентом (по себе и по фактическим получателям дохода) или Участником клиринга – Международной организацией (по фактическим получателям дохода) сертификата налогового резидентства, установленной приложением № 4 к общей части Правил клиринга, или до фактической даты предоставления Участником клиринга – Нерезидентом (по себе и по фактическим получателям дохода) или Участником клиринга – Международной организацией (по фактическим получателям дохода) сертификата налогового резидентства на текущий календарный год в зависимости от того, какое из этих событий наступит раньше) (за исключением банков, постоянное местонахождение которых подтверждается сведениями общедоступных информационных справочников));

- разницы между суммой, соответствующей сумме налога на прибыль организаций с доходов иностранных организаций от источников в Российской Федерации, рассчитанной по максимальной ставке, установленной российским налоговым законодательством, и суммой, соответствующей сумме налога, рассчитанной по действующей в текущем календарном году налоговой ставке, установленной применимым соглашением об избежании двойного

налогообложения, заключенным с государством, налоговым резидентом которого являлся Участник клиринга – Нерезидент, фактический получатель дохода Участника клиринга – Нерезидента или фактический получатель дохода Участника клиринга – Международной организации в предыдущем календарном году (налоговом периоде) (учитывается со знаком «минус» в период с 1 января текущего календарного года, с даты, следующей за днем получения доходов (в т.ч. в пользу фактического получателя дохода Участника клиринга – Нерезидента) / Участником клиринга – Международной организацией (в пользу фактического получателя дохода Участника клиринга – Международной организации) до даты предоставления Участником клиринга – Нерезидентом (по себе и по фактическим получателям дохода) или Участником клиринга – Международной организацией (по фактическим получателям дохода) сертификата налогового резидентства, установленной приложением № 4 к общей части Правил клиринга, или до фактической даты предоставления Участником клиринга – Нерезидентом (по себе и по фактическим получателям дохода) или Участником клиринга – Международной организацией (по фактическим получателям дохода) сертификата налогового резидентства на текущий календарный год в зависимости от того, какое из этих событий наступит раньше) (за исключением банков, постоянное местонахождение которых подтверждается сведениями общедоступных информационных справочников).

32.2. 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»);
- Нетто-требований Участника клиринга по денежным средствам в российских рублях, учитываемых по Расчетному коду для учета Обеспечения под стресс, по всем Датам исполнения (учитываются со знаком «плюс»);
- Нетто-требований Участника клиринга по денежным средствам в иностранной валюте, учитываемых по Расчетному коду для учета Обеспечения под стресс, по всем Датам исполнения, пересчитанных 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 (учитываются со знаком «плюс»);
- Нетто-обязательств Участника клиринга по ценным бумагам, учитываемых по Торгово-клиринговому счету Обеспечения под стресс, по всем Датам исполнения,

пересчитанным 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 (учитываются со знаком «минус»);

- суммы определенных в соответствии с Методикой определения размера Обеспечения под стресс минимальных размеров Обеспечения под стресс Участника клиринга на Рынках, на которых Участник клиринга допущен к клиринговому обслуживанию с категорией «О», «Б», «Б2» или «В» (учитываются со знаком «минус»);

- суммы, соответствующей сумме налога на прибыль организаций с доходов иностранных организаций от источников в Российской Федерации, подлежащую удержанию с Участника клиринга, с даты заключения Сделки / даты получения Участником клиринга дохода, до даты, следующей за днем получения доходов Участником клиринга – Нерезидентом (в т.ч. в пользу фактического получателя дохода Участника клиринга – Нерезидента)/ Участником клиринга – Международной организацией (в пользу фактического получателя дохода Участника клиринга – Международной организации) (включая эту дату) (учитывается со знаком «минус»);

- суммы, соответствующей сумме налога на прибыль организаций с доходов иностранных организаций от источников в Российской Федерации, подлежащую удержанию с Участника клиринга, с даты заключения Сделки / даты получения Участником клиринга дохода, до даты, следующей за днем получения доходов Участником клиринга – Нерезидентом (в т.ч. в пользу фактического получателя дохода Участника клиринга – Нерезидента) / Участником клиринга – Международной организацией (в пользу фактического получателя дохода Участника клиринга – Международной организации), рассчитанной по максимальной ставке, установленной российским налоговым законодательством (учитывается со знаком «минус» в период, с 1 января до даты, следующей за днем получения доходов Участником клиринга – Нерезидентом (в т.ч. в пользу фактического получателя дохода Участника клиринга – Нерезидента) / Участником клиринга – Международной организацией (в пользу фактического получателя дохода Участника клиринга – Международной организации) или до даты предоставления Участником клиринга – Нерезидентом (по себе и по фактическим получателям дохода) или Участником клиринга – Международной организацией (по фактическим получателям дохода) сертификата налогового резидентства, установленной приложением № 4 к общей части Правил клиринга, или до фактической даты предоставления Участником клиринга – Нерезидентом (по себе и по фактическим получателям дохода) или Участником клиринга – Международной организацией (по фактическим получателям дохода) сертификата налогового резидентства на текущий календарный год в зависимости от того, какое из этих событий наступит раньше) (за исключением банков, постоянное местонахождение которых подтверждается сведениями общедоступных информационных справочников));

- разницы между суммой, соответствующей сумме налога на прибыль организаций с доходов иностранных организаций от источников в Российской Федерации, рассчитанной по максимальной ставке, установленной российским налоговым законодательством, и суммой, соответствующей сумме налога, рассчитанной по действующей в текущем календарном году налоговой ставке,

установленной применимым соглашением об избежании двойного налогообложения, заключенным с государством, налоговым резидентом которого являлся Участник клиринга – Нерезидент, фактический получатель дохода Участника клиринга – Нерезидента или фактический получатель дохода Участника клиринга – Международной организации в предыдущем календарном году (налоговом периоде), (учитывается со знаком «минус» в период с 1 января текущего календарного года, с даты, следующей за днем получения доходов Участником клиринга – Нерезидентом (в т.ч. в пользу фактического получателя дохода Участника клиринга – Нерезидента) / Участником клиринга – Международной организацией (в пользу фактического получателя дохода Участника клиринга – Международной организации) до даты предоставления Участником клиринга – Нерезидентом (по себе и по фактическим получателям дохода) или Участником клиринга – Международной организацией (по фактическим получателям дохода) сертификата налогового резидентства, установленной приложением № 4 к общей части Правил клиринга, или до фактической даты предоставления Участником клиринга – Нерезидентом (по себе и по фактическим получателям дохода) или Участником клиринга – Международной организацией (по фактическим получателям дохода) сертификата налогового резидентства на текущий календарный год в зависимости от того, какое из этих событий наступит раньше) (за исключением банков, постоянное местонахождение которых подтверждается сведениями общедоступных информационных справочников).

- 32.3. 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 32.1 / 32.2 общей части Правил клиринга, является неотрицательным.
- 32.4. В случае изменения минимального размера Обеспечения под стресс на соответствующем Рынке в соответствии с Методикой определения размера Обеспечения под стресс, новое значение минимального размера Обеспечения под стресс Участника клиринга используется при расчете Единого лимита Участника клиринга по Обеспечению под стресс, начиная с Расчетного дня направления Участнику клиринга Клиринговым центром уведомления о новом значении минимального размера Обеспечения под стресс.
- 32.5. 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.
- 32.6. Информация о количестве ценных бумаг / сумме денежных средств, внесенных Участником клиринга в Гарантийные фонды / в качестве Обеспечения под стресс, и о минимальных размерах взносов Участника клиринга в Гарантийные фонды соответствующих Рынков / Обеспечения под стресс на соответствующих Рынках

предоставляется Участнику клиринга в составе Отчета о гарантийных фондах / Отчета об Обеспечении под стресс.

32.7. В целях контроля за рисками концентрации на эмитентов, Клиринговый центр рассчитывает Единый лимит по рискам концентрации на эмитентов как сумму с учетом знака:

- суммы денежных средств в российских рублях, учитываемой по Расчетному коду для учета Обеспечения под риски концентрации на эмитентов (учитывается со знаком «плюс»);
- суммы денежных средств в иностранной валюте, учитываемой по Расчетному коду для учета Обеспечения под риски концентрации на эмитентов, 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 для учета Обеспечения под риски концентрации на эмитентов, 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»);
- Нетто-требований Участника клиринга по денежным средствам в российских рублях, учитываемых по Расчетному коду для учета Обеспечения под риски концентрации на эмитентов, по всем Датам исполнения (учитываются со знаком «плюс»);
- Нетто-требований Участника клиринга по денежным средствам в иностранной валюте, учитываемых по Расчетному коду для учета Обеспечения под риски концентрации на эмитентов, по всем Датам исполнения, пересчитанных 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 (учитываются со знаком «плюс»);
- Нетто-обязательств Участника клиринга по ценным бумагам, учитываемых по Торгово-клиринговому счету для учета Обеспечения под риски концентрации на эмитентов, по всем Датам исполнения, пересчитанным 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 (учитываются со знаком «минус»);
- требования по обеспечению риска концентрации на эмитента, предъявленного Участнику клиринга и определенного в соответствии с Методикой контроля лимитов концентрации на эмитентов (учитывается со знаком «минус»).

32.7.1. Информация о значениях лимитов концентрации, установленных Клиринговым центром на каждого эмитента ценных бумаг в соответствии с Методикой выбора ценных бумаг, принимаемых в обеспечение, используемых для расчета требования по обеспечению риска концентрации на эмитента в отношении Участника клиринга, раскрывается на Сайте Клирингового центра.



32.8. Информация о количестве ценных бумаг / сумме денежных средств, внесенных Участником клиринга в качестве Обеспечения под риски концентрации на эмитентов, и о требовании по обеспечению рисков концентрации на эмитентов, предъявленного Участнику клиринга, предоставляется Участнику клиринга в составе Отчета об обеспечении под риски концентрации на эмитентов.

**Статья 33. Порядок возврата взносов в Гарантийные фонды, Обеспечения под стресс, Обеспечения под риски концентрации на эмитентов**

33.1. Возврат Участнику клиринга денежных средств / драгоценных металлов / ценных бумаг, внесенных в качестве взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс (далее – взносы в Гарантийные фонды / Обеспечение под стресс) Участника клиринга на соответствующем Рынке при прекращении допуска к клиринговому обслуживанию Участника клиринга с категорией «Б», «Б2», «В» или «О» на таком Рынке осуществляется после прекращения допуска к клиринговому обслуживанию Участника клиринга с категорией «Б», «Б2», «В» или «О» по основаниям, установленным статьей 15 общей части Правил клиринга, в порядке, предусмотренном пунктом 33.2 общей части Правил клиринга.

33.1.1. Возврат Участнику клиринга взносов в Гарантийные фонды Участника клиринга на соответствующем Рынке в денежных средствах и/или ценных бумагах в размере, соответствующем минимальному размеру взноса в Гарантийный фонд соответствующего Рынка, при изменении категории Участника клиринга с категории «Б», «Б2» или «О» на категорию «В» на таком Рынке осуществляется при соблюдении следующих условий:

- у Участника клиринга отсутствуют непогашенные Задолженности на всех Рынках;
- значения, рассчитанные в соответствии с пунктом 30.19 общей части Правил клиринга для каждой Даты исполнения по каждому Расчетному коду Участника клиринга на соответствующем Рынке, не являются отрицательными. При этом возврат Участнику клиринга взносов в Гарантийные фонды осуществляется в порядке, предусмотренном пунктом 33.2 общей части Правил клиринга.

33.2. Возврат Участнику клиринга взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс / Обеспечения под риски концентрации на эмитентов 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 / Обеспечения под риски концентрации на эмитентов 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 / Обеспечения под риски концентрации на эмитентов, соответствует порядку, определенному пунктом 30.3, подпунктами 30.6.1-30.6.5, 30.6.8 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 / Обеспечения под риски концентрации на эмитентов в денежных средствах осуществляется при соблюдении следующих условий:

- Единый лимит Участника клиринга по Гарантийным фондам / Обеспечению под стресс / Единый лимит по рискам концентрации на эмитентов, 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 / Обеспечения под риски концентрации на эмитентов Участника клиринга.

33.6. Возврат Клиринговым центром Участнику клиринга взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс / Обеспечения под риски концентрации на эмитентов 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 или временным регламентом, являющимся приложением к соответствующей специальной части Правил клиринга, 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 / Обеспечения под риски концентрации на эмитентов 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 / Обеспечения под риски концентрации на эмитентов в денежных средствах на Счет для возврата обеспечения (за исключением возврата взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс / Обеспечения под риски концентрации на эмитентов 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 взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс / Обеспечения под риски концентрации на эмитентов 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 / 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 взносов в Гарантийный фонд / Обеспечения под стресс / Обеспечения под риски концентрации на эмитентов 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 / Обеспечения под риски концентрации на эмитентов Участника клиринга, размер денежных средств, учитываемых по Расчетному коду Участника клиринга для учета взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс / Обеспечения под риски концентрации на эмитентов, в такой валюте уменьшается на сумму возвращаемых денежных средств, Обязательство Клирингового центра по возврату Участнику клиринга взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс / Обеспечения под риски концентрации на эмитентов в соответствующей валюте прекращается в части, соответствующей сумме возврата.
- 33.8. Порядок подачи и исполнения распоряжений на перевод денежных средств / ценных бумаг определен пунктом 27.15 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 / Обеспечения под риски концентрации на эмитентов, 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 27.17-27.18 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 / Обеспечения под риски концентрации на эмитентов с денежными требованиями Клирингового центра к этому Участнику клиринга в соответствующей валюте.

#### **ПОДРАЗДЕЛ IV-III. ПОРЯДОК ВОЗНИКНОВЕНИЯ И ИСПОЛНЕНИЯ МАРЖИНАЛЬНЫХ ТРЕБОВАНИЙ, МАРЖИНАЛЬНЫХ ТРЕБОВАНИЙ ПО ФОНДАМ / ОБЕСПЕЧЕНИЮ ПОД СТРЕСС, МАРЖИНАЛЬНЫХ ТРЕБОВАНИЙ ПО РИСКУ КОНЦЕНТРАЦИИ НА ЭМИТЕНТА, МАРЖИНАЛЬНЫХ ТРЕБОВАНИЙ ПО РАСЧЕТНОМУ КОДУ ДЛЯ УПЛАТЫ НАЛОГОВ**

#### **Статья 34. Порядок проведения клиринговых сессий mark-to-market. Порядок возникновения и исполнения Маржинальных требований**

- 34.1. В срок, установленный Временным регламентом или временным регламентом, являющимся приложением к соответствующей специальной части Правил клиринга, 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 Рынка;
  - для каждого Участника клиринга осуществляет контроль достаточности Обеспечения по обязательствам с наступившей и ненаступившей Датой исполнения;
  - для каждого Участника клиринга категории «Б», «Б2» или «О» рассчитывает значение Единого лимита по Гарантийным фондам;
  - для каждого Участника клиринга категории «Б», «Б2», «В» 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;
  - для каждого Участника клиринга категории «Б», «Б2», «В» или «О», допущенного к клирингу на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, рассчитывает значение Единого лимита по рискам концентрации на эмитентов.
- 34.2. Клиринговый центр с использованием ПТК ТЦ / Системы торгов / Торговой системы передает Бирже информацию об установленных риск-параметрах.
- 34.3. В срок, установленный Временным регламентом, или временным регламентом, являющимся приложением к соответствующей специальной части Правил клиринга, или соответствующей специальной частью Правил клиринга, Клиринговый центр:
- 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.
- 34.4. На фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, на товарном рынке, на рынке Стандартизированных ПФИ Маржинальное требование возникает у Участника клиринга, Единый лимит по Расчетному коду которого на момент времени определения Маржинальных

- требований, установленный Временным регламентом, является отрицательным. Сумма Маржинального требования равна абсолютному значению Единого лимита по Расчетному коду, определенного на указанный момент времени.
- 34.5. На срочном рынке Маржинальное требование возникает у Участника клиринга, если значение величины  $SZ_{sc}$  (свободного Обеспечения), рассчитанное в соответствии с Правилами клиринга на срочном рынке, на момент времени определения Маржинальных требований, установленный Временным регламентом, является отрицательным ( $SZ_{sc} < 0$ ).
- 34.6. Маржинальное требование по Расчетному коду Единого пула может возникнуть у Участника клиринга в Клиринговой системе любого из Рынков, включенных в единый пул обеспечения.
- 34.7. Маржинальное требование, возникшее у Участника клиринга, должно быть исполнено Участником клиринга не позднее времени, установленного Временным регламентом или временным регламентом, являющимся приложением к соответствующей специальной части Правил клиринга.
- 34.8. Маржинальное требование должно быть исполнено Участником клиринга путем внесения в Обеспечение в порядке, установленном статьей 27 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.
- 34.8.1. Маржинальное требование может быть также прекращено полностью или в части:
- путем снятия заявок, Предложений;
  - путем заключения сделок, устраняющих недостаточность Обеспечения по обязательствам с наступившей и ненаступившей Датой исполнения;
  - за счет получения Дохода.
- 34.8.2. 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 Рынка, в которой учитывается неисполненное Маржинальное требование по Расчетному коду Единого пула.
- Передача Профилей активов осуществляется в соответствии со статьей 28 общей части Правил клиринга.
- 34.9. Маржинальное требование, учитываемое по Расчетному коду на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, на товарном рынке, на рынке Стандартизированных ПФИ, возникшее у Участника клиринга, считается прекращенным в момент времени, когда Единый лимит по такому Расчетному коду станет неотрицательным.
- 34.10. После определения Маржинальных требований Клиринговый центр направляет Расчетному депозитарию Запрос на подбор ценных бумаг с целью исполнения Маржинальных требований (только для Участников клиринга, соответствующих требованиям, установленным пунктом 14.31 общей части Правил клиринга).

- 34.10.1. Запрос на подбор ценных бумаг направляется с указанием суммы Маржинального требования и Разделов Т+, входящих в состав Торгово-клиринговых счетов совместно с Расчетным кодом, по которому учитывается Маржинальное требование.
- 34.10.2. Запрос на подбор ценных бумаг направляется в сроки, установленные Временным регламентом.
- 34.11. В случае неисполнения Участником клиринга Маржинального требования, учитываемого по Расчетному коду, в срок, установленный Временным регламентом или временным регламентом, являющимся приложением к соответствующей специальной части Правил клиринга, 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, которая может быть изменена по решению Клирингового центра:
- 34.11.1. вправе передать Профили активов в Клиринговую систему 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 28.3 общей части Правил клиринга;
- 34.11.2. 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 26 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.

Клиринговый центр прекращает подачу заявок на заключение закрывающих сделок от имени Участника клиринга, не исполнившего Маржинальное требование, или выполнение иных действий, направленных на заключение закрывающих сделок от имени Участника клиринга, не исполнившего Маржинальное требование (в случае заключения закрывающих сделок без подачи заявок), после прекращения Маржинального требования, учитываемого по Расчетному коду, или в случае невозможности заключения сделок, в совокупности устраняющих недостаточность Обеспечения по обязательствам с наступившей и ненаступившей Датой исполнения по такому Расчетному коду.

Все сделки, заключенные на основании заявок (оферт), поданных Клиринговым центром от имени Участника клиринга, не исполнившего Маржинальное требование, до указанного момента времени, и все сделки, действия для заключения которых Клиринговым центром от имени Участника клиринга, не исполнившего Маржинальное требование, были начаты до указанного момента времени (в случае заключения закрывающих сделок без подачи заявок), заключаются Клиринговым

центром в связи с неисполнением Участником клиринга Маржинального требования.

Клиринговый центр не несет ответственности за убытки, причиненные Участнику клиринга, не исполнившему Маржинальное требование, в результате заключения закрывающих сделок от имени такого Участника клиринга, в том числе, в случае внесения Участником клиринга Обеспечения после времени исполнения Маржинального требования, установленного Временным регламентом или временным регламентом, являющимся приложением к соответствующей специальной части Правил клиринга.

- 34.11.3. Если Участник клиринга, не исполнивший Маржинальное требование, является Участником пула, Клиринговый центр вправе заключить от имени такого Участника пула закрывающие Сделки, направленные на продажу имущества (ценных бумаг, иностранной валюты или драгоценных металлов) из имущественного пула, при соблюдении условий погашения клиринговых сертификатов участия, установленных Правилами клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов. 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 26 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.

- 34.12. В случае если после заключения Сделок в соответствии с подпунктами 34.11.2-34.11.3 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.

- 34.13. После исполнения Маржинального требования по Расчетному коду Участника клиринга Клиринговый центр снимает Режим урегулирования для такого Расчетного кода, если отсутствуют иные основания для установления Режима урегулирования, предусмотренные Правилами клиринга.

- 34.14. Расчетный депозитарий исполняет Запрос Клирингового центра на подбор ценных бумаг в соответствии с пунктами 29.6-29.7 общей части Правил клиринга.

- 34.15. Специальной частью Правил клиринга могут быть установлены особенности возникновения и исполнения Маржинальных требований.

## **Статья 35. Режим урегулирования**

- 35.1. Режим урегулирования, установленный для Расчетного кода, означает, что для такого Расчетного кода действуют следующие ограничения:
- 35.1.1. приостановление возможности подачи заявок / Котировок участника торгов, заявлений об исполнении опционного контракта, Предложений и иных оферт, предусмотренных Правилами клиринга, с указанием клиринговых регистров / разделов клиринговых регистров, соответствующих такому Расчетному коду / Торгово-клиринговых счетов, в состав которых входит такой Расчетный код, 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, учитываемого по такому Расчетному коду / Торгово-клиринговым счетам, в состав которых входит такой Расчетный код;
  - 35.1.3. не осуществляется перевод Обеспечения с данного Расчетного кода / Торгово-клиринговых счетов, в состав которых входит такой Расчетный код, на другие Расчетные коды / Торгово-клиринговые счета на основании распоряжений Участника клиринга;
  - 35.1.4. не осуществляется перевод Профилей активов на основании распоряжений Участника клиринга;
  - 35.1.5. не применяются индивидуальные риск-параметры по таким Расчетным кодам / Торгово-клиринговым счетам, в состав которых входит такой Расчетный код, не осуществляется установление и изменение индивидуальных риск-параметров по таким Расчетным кодам / Торгово-клиринговым счетам, в состав которых входит такой Расчетный код;
  - 35.1.6. не осуществляется закрытие такого Расчетного кода / Торгово-клирингового счета / иных клиринговых регистров, соответствующих такому Расчетному коду;
  - 35.1.7. не осуществляется открытие, закрытие и изменение параметров Торгово-клиринговых счетов, в состав которых входит такой Расчетный код.
- 35.2. При установлении Режима урегулирования для Расчетного кода Клиринговый центр удаляет из Клиринговой системы все Предложения / Намерения, поданные с указанием клиринговых регистров / разделов клиринговых регистров, соответствующих такому Расчетному коду / Торгово-клиринговых счетов, в состав которых входит такой Расчетный код.
- 35.3. Снятие Режима урегулирования для Расчетного кода означает отмену ограничений, указанных в пункте 35.1 общей части Правил клиринга.
- 35.4. Клиринговый центр посредством Системы торгов / Торговой системы уведомляет Биржу об установлении / снятии Режима урегулирования для Расчетного кода.  
Клиринговый центр посредством Клиринговой системы уведомляет Участника клиринга об установлении / снятии Режима урегулирования для Расчетного кода.



**Статья 36. Порядок возникновения и исполнения Маржинальных требований по фондам / обеспечению под стресс**

- 36.1. В срок, установленный Временным регламентом, Клиринговый центр осуществляет следующие действия:
- определяет Участников клиринга, у которых возникли Маржинальные требования по фондам;
  - определяет Участников клиринга, у которых возникли Маржинальные требования по обеспечению под стресс.

- 36.2. В случае если на момент времени определения Маржинальных требований по фондам, установленный Временным регламентом, 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 34.3 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 31 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 на момент времени определения Маржинальных требований по обеспечению под стресс, установленный Временным регламентом, 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 34.3 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 31 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. После определения Маржинальных требований по фондам и/или Маржинальных требований по обеспечению под стресс Клиринговый центр направляет Расчетному депозитарию Запрос на подбор ценных бумаг с целью исполнения указанных Маржинальных требований (только для Участников клиринга, соответствующих требованиям, установленным пунктом 14.31 общей части Правил клиринга).
- 36.4.1. Запрос на подбор ценных бумаг направляется с указанием суммы соответствующего Маржинального требования и субсчетов депо, входящих в состав Торгово-клирингового счета Гарантийных фондов / Торгово-клирингового счета Обеспечения под стресс, совместно с Расчетным кодом для учета взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс, по которому учитывается Маржинальное требование.
- 36.4.2. Запрос на подбор ценных бумаг направляется в сроки, установленные Временным регламентом.
- 36.5. 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 36.6 общей части Правил клиринга, считается, что Участник клиринга не исполнил обязательства по внесению взносов в Гарантийные фонды всех Рынков, к клирингу на которых Участник клиринга допущен с категорией «Б», «Б2» или «О».
- 36.6. В случае неисполнения Участником клиринга Маржинального требования по фондам, возникшего в связи с изменением минимального размера взноса в Гарантийный фонд на определенном Рынке, считается, что Участник клиринга не исполнил обязательства по внесению взноса в Гарантийный фонд на том Рынке, на котором минимальный размер взноса в Гарантийный фонд был увеличен.
- 36.7. 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 36.8 общей части Правил клиринга считается, что Участник клиринга не исполнил обязательства по внесению Обеспечения под стресс на всех Рынках, на которых согласно соответствующей специальной части Правил клиринга Клиринговым центром к Участнику клиринга предъявлено требование о внесении Обеспечения под стресс.
- 36.8. В случае неисполнения Участником клиринга Маржинального требования по обеспечению под стресс, возникшего в связи с изменением минимального размера Обеспечения под стресс на определенном Рынке, считается, что Участник клиринга не исполнил обязательства по внесению Обеспечения под стресс на том Рынке, на котором размер Обеспечения под стресс был увеличен.
- 36.9. В случае неисполнения Участником клиринга Маржинального требования по фондам / Маржинального требования по обеспечению под стресс в срок, установленный Временным регламентом, Клиринговый центр 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. Клиринговый центр в указанном случае также вправе осуществить перевод Обеспечения с собственного Расчетного кода (Расчетных кодов) Участника клиринга в размере, необходимом для приведения значения Единого лимита Участника клиринга по Гарантийным фондам/ значения Единого лимита Участника клиринга по Обеспечению под стресс к состоянию, при котором указанное значение равно нулю, либо превышает ноль. Осуществление Клиринговым центром указанного в настоящем пункте Общей части Правил клиринга перевода Обеспечения возможно в такой сумме (количестве), что в результате такого перевода Участнику клиринга не будет выставлено Маржинальное требование по Расчетному коду, с которого был осуществлен перевод Обеспечения. Участником клиринга может быть выбран собственный Торгово-клиринговый счет Т+, в состав которого входит Расчетный код, открытый для фондового рынка, рынка депозитов и рынка кредитов, с которого Клиринговым центром в первую очередь будет осуществляться перевод Обеспечения в случае неисполнения Участником клиринга Маржинального требования по обеспечению под стресс.

- 36.10. Если по итогам действий, выполненных Клиринговым центром в соответствии с пунктом 36.9 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.

### **Статья 37. Порядок возникновения и исполнения Маржинальных требований по рискам концентрации на эмитентов**

- 37.1. В срок, установленный Временным регламентом, Клиринговый центр определяет Участников клиринга, у которых возникли Маржинальные требования по рискам концентрации на эмитентов.
- 37.2. Маржинальное требование по рискам концентрации на эмитентов возникает у Участника клиринга, Единый лимит по рискам концентрации на эмитентов которого на момент времени определения Маржинальных требований по риску концентрации на эмитентов, установленный Временным регламентом, является отрицательным. Сумма Маржинального требования равна абсолютному значению Единого лимита по рискам концентрации на эмитентов, определенного на момент времени, установленный Временным регламентом.
- 37.2.1. Информация о Маржинальном требовании по рискам концентрации на эмитентов предоставляется Участнику клиринга в составе Отчета о Маржинальных требованиях, направляемого в соответствии с пунктом 34.3 общей части Правил клиринга.
- 37.2.2. Маржинальное требование по рискам концентрации на эмитентов должно быть исполнено Участником клиринга в срок, установленный Временным регламентом.
- 37.2.3. Маржинальное требование по рискам концентрации на эмитентов считается прекращенным в момент времени, когда Единый лимит Участника клиринга по рискам концентрации на эмитентов станет неотрицательным.

- 37.3. Маржинальное требование по рискам концентрации на эмитентов должно быть исполнено Участником клиринга путем внесения в Обеспечение в порядке, установленном статьей 27 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, по которым у такого Участника клиринга отсутствует риск концентрации на эмитента.
- 37.3.1. Маржинальное требование по рискам концентрации на эмитентов может быть также прекращено полностью или в части:
- путем внесения в качестве Обеспечения под риски концентрации на эмитентов в порядке, установленном статьей 31 общей части Правил клиринга, денежных средств в российских рублях и иностранной валюте и/или ценных бумаг, входящих в перечень иностранных валют и ценных бумаг, принимаемых Клиринговым центром в качестве Обеспечения под риски концентрации на эмитентов, и по которым у такого Участника клиринга отсутствует риск концентрации на эмитента;
  - путем заключения сделок, направленных на продажу иностранной валюты и/или ценных бумаг, учитываемых по Расчетному коду для учета Обеспечения под риски концентрации на эмитентов / Торгово-клиринговому счету для учета Обеспечения под риски концентрации на эмитентов;
  - путем снятия заявок;
  - путем заключения сделок, направленных на уменьшение требования по обеспечению рисков концентрации на эмитентов;
  - за счет получения Дохода, учитываемого по Расчетным кодам Участника клиринга;
  - путем передачи Профилей активов.
- 37.4. После определения Маржинальных требований по рискам концентрации на эмитентов Клиринговый центр вправе направить Расчетному депозитарию Запрос на подбор ценных бумаг с целью исполнения указанных Маржинальных требований (только для Участников клиринга, соответствующих требованиям, установленным пунктом 14.31 общей части Правил клиринга).
- 37.4.1. Запрос на подбор ценных бумаг направляется с указанием суммы соответствующего Маржинального требования и субсчетов депо, входящих в состав Торгово-клирингового счета для учета Обеспечения под риски концентрации на эмитентов, совместно с Расчетным кодом для учета Обеспечения под риски концентрации на эмитентов, по которому учитывается Маржинальное требование.
- 37.4.2. Запрос на подбор ценных бумаг направляется в сроки, установленные Временным регламентом.
- 37.5. В случае неисполнения Участником клиринга Маржинального требования по рискам концентрации на эмитентов в срок, установленный Временным регламентом, Клиринговый центр устанавливает для Расчетного кода для учета Обеспечения под риски концентрации на эмитентов Режим урегулирования, порядок применения которого определен в статье 35 общей части Правил

клиринга, и осуществляет действия в следующей последовательности, которая может быть изменена по решению Клирингового центра:

- 37.5.1. вправе заключить от имени Участника клиринга, не исполнившего Маржинальное требование по рискам концентрации на эмитентов, сделки, направленные на продажу иностранной валюты и/или ценных бумаг, учитываемых по Расчетному коду для учета Обеспечения под риски концентрации на эмитентов / Торгово-клиринговому счету для учета Обеспечения под риски концентрации на эмитентов;
- 37.5.2. вправе передать Профили активов по Расчетным кодам Единого пула Участника клиринга. Передача Профилей активов осуществляется при соблюдении условий, установленных пунктом 28.3 общей части Правил клиринга;
- 37.5.3. вправе установить для собственных Расчетных кодов Режим урегулирования, порядок применения которого определен в статье 35 общей части Правил клиринга, и заключить от имени Участника клиринга, не исполнившего Маржинальное требование по рискам концентрации на эмитентов, сделки с указанием любого собственного Торгово-клирингового счета Участника клиринга, направленные на уменьшение требования по обеспечению рисков концентрации на эмитентов.
- 37.6. После исполнения Маржинального требования по рискам концентрации на эмитентов Клиринговый центр снимает Режим урегулирования для Расчетного кода для учета Обеспечения под риски концентрации на эмитентов и собственных Расчетных кодов Участника клиринга (в случае если Режим урегулирования был установлен Клиринговым центром по собственным Расчетным кодам Участника клиринга в соответствии с пунктом 37.5.3 общей части Правил клиринга), если отсутствуют иные основания для установления Режима урегулирования, предусмотренные Правилами клиринга.

#### **Статья 38. Порядок возникновения и исполнения Маржинальных требований по Расчетному коду для уплаты налогов**

- 38.1. В срок, установленный Временным регламентом, Клиринговый центр определяет Участников клиринга, у которых возникли Маржинальные требования по Расчетному коду для уплаты налогов.
- 38.2. В случае если на момент времени определения Маржинальных требований по Расчетному коду для уплаты налогов, установленный Временным регламентом, абсолютное значение отрицательного Единого лимита по Расчетному коду для уплаты налогов больше порога выставления Маржинального требования по налогам, Клиринговый центр предъявляет Участнику клиринга Маржинальное требование по Расчетному коду для уплаты налогов.

Информация о Маржинальном требовании по Расчетному коду для уплаты налогов предоставляется Участнику клиринга в составе Отчета о Маржинальных требованиях, направляемого в соответствии с пунктом 34.3 общей части Правил клиринга.

Маржинальное требование по Расчетному коду для уплаты налогов должно быть исполнено Участником клиринга в срок, установленный Временным регламентом, путем перечисления денежных средств в российских рублях и/или иностранной

- валюте на Расчетный код для уплаты налогов и/или ценных бумаг для учета на Торгово-клиринговом счете для уплаты налогов в порядке, установленном статьей 27 общей части Правил клиринга.
- 38.3. Маржинальное требование по Расчетному коду для уплаты налогов считается исполненным в момент времени, когда Единый лимит по Расчетному коду для уплаты налогов станет больше либо равен нулю.
- 38.4. После определения Маржинального требования по Расчетному коду для уплаты налогов Клиринговый центр направляет Расчетному депозитарию Запрос на подбор ценных бумаг с целью исполнения указанного Маржинального требования (только для Участников клиринга, соответствующих требованиям, установленным пунктом 14.31 общей части Правил клиринга).
- 38.4.1. Запрос на подбор ценных бумаг направляется с указанием суммы Маржинального требования и субсчетов депо, входящих в состав Торгово-клирингового счета для уплаты налогов, совместно с Расчетным кодом для уплаты налогов, по которому учитывается Маржинальное требование.
- 38.4.2. Запрос на подбор ценных бумаг направляется в сроки, установленные Временным регламентом.
- 38.5. В случае неисполнения Участником клиринга Маржинального требования по Расчетному коду для уплаты налогов в срок, установленный Временным регламентом, Клиринговый центр устанавливает для Расчетного кода для уплаты налогов 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):
- 38.5.1. Осуществляет перевод Обеспечения Участника клиринга (за исключением клиринговых сертификатов участия) в размере, для которого выполняются условия возврата Обеспечения, предусмотренные соответствующей частью Правил клиринга, учитываемого по собственным Расчетным кодам / Торгово-клиринговым счетам, в состав которых входит собственный Расчетный код, Участника клиринга (по выбору Клирингового центра) и имущества Участника клиринга из имущественного пула в размере, для которого соблюдаются условия погашения клиринговых сертификатов участия при выдаче соответствующего имущества из имущественного пула, учитываемого по собственным Расчетным кодам имущественного пула / Торгово-клиринговым счетам имущественного пула, в состав которых входит собственный Расчетный код имущественного пула, Участника клиринга (по выбору Клирингового центра), на Расчетный код для уплаты налогов / Торгово-клиринговый счет для уплаты налогов.
- 38.5.2. Осуществляет продажу иностранной валюты / ценных бумаг, учитываемых на Расчетном коде для уплаты налогов / Торгово-клиринговом счете для уплаты налогов Участника клиринга, в объеме, необходимом для исполнения Маржинального требования по Расчетному коду для уплаты налогов.
- 38.6. После исполнения Маржинального требования по Расчетному коду для уплаты налогов Клиринговый центр снимает Режим урегулирования для Расчетного кода

для уплаты налогов, если отсутствуют иные основания для установления Режима урегулирования, предусмотренные Правилами клиринга.

- 38.7. Если после совершения действий, указанных в пункте 38.5 общей части Правил клиринга Маржинальное требование по Расчетному коду для уплаты налогов не исполнено, Клиринговый центр исключает все Расчетные коды из списка Расчетных кодов, связанных с Расчетным кодом для уплаты налогов. При этом обязательства по уплате сумм, соответствующих суммам налога на прибыль организаций с доходов иностранных организаций от источников в Российской Федерации, прекращают учитываться на Расчетном коде для уплаты налогов и начинают учитываться на Расчетных кодах, указанных в пункте 7.6 общей части Правил клиринга.
- 38.8. Если после совершения действий, указанных в пункте 38.7 общей части Правил клиринга, значения Единых лимитов по всем Расчетным кодам, на которых, в соответствии с пунктом 38.7 общей части Правил клиринга начали учитываться обязательства по уплате сумм, соответствующих суммам налога на прибыль организаций с доходов иностранных организаций от источников в Российской Федерации, неотрицательны, Клиринговый центр снимает Режим урегулирования для Расчетного кода для уплаты налогов, если отсутствуют иные основания для установления Режима урегулирования, предусмотренные Правилами клиринга.
- 38.9. Если после совершения действий, указанных в пункте 38.7 общей части Правил клиринга, значение Единого лимита на каком-либо Расчетном коде Участника клиринга, на котором, в соответствии с пунктом 38.7 общей части Правил клиринга, начали учитываться обязательства по уплате сумм, соответствующих суммам налога на прибыль организаций с доходов иностранных организаций от источников в Российской Федерации, отрицательно, Клиринговый центр осуществляет перевод Обеспечения в российских рублях с Расчетного кода для уплаты налогов на Расчетный код Участника клиринга, имеющий отрицательное значение Единого лимита, в таком размере, при котором значение Единого лимита станет неотрицательным.

## **ПОДРАЗДЕЛ IV-IV. ПОРЯДОК ИСПОЛНЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ ПО ИТОГАМ КЛИРИНГА**

### **Статья 39. Общие требования к порядку включения обязательств в клиринговые пулы и к порядку исполнения обязательств**

39.1. 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 42 общей части Правил клиринга.

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

39.2. 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.

39.3. Участник клиринга категории «А» или «К» может заключать биржевые сделки без предварительного внесения индивидуального клирингового обеспечения в денежных средствах и драгоценных металлах.

39.3.1. 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.

39.3.2. 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 до установленного Временным регламентом времени исполнения Участниками клиринга Итоговых нетто-обязательств по соответствующему драгоценному металлу.

39.4. 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 Временным регламентом или временным регламентом, являющимся приложением к соответствующей специальной части Правил клиринга, 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.

39.5. Правилами клиринга и (или) Спецификацией 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;
- порядок изменения Даты исполнения обязательств по Сделкам и иных условий Сделок в случае принятия нормативного (правового) акта Российской Федерации о переносе нерабочих (праздничных) и выходных дней или об объявлении рабочего дня нерабочим, в соответствии с которым Дата исполнения обязательств по заключенным с Участниками клиринга Сделок станет выходным или нерабочим днем по законодательству Российской Федерации, если такая Дата исполнения не будет являться Расчетным днем.

39.6. В случае принятия в соответствии с Правилами торгов и (или) Спецификацией решения Биржи / Клирингового центра об изменении условий исполнения Сделки Клиринговый центр включает в клиринговый пул в соответствующую Дату исполнения обязательства / требования по Сделке с учетом такого изменения.

39.7. В случаях если между датой заключения Сделки T+ и Датой исполнения обязательств по Сделке T+ в отношении ценных бумаг, с которыми заключена Сделка T+, происходят корпоративные действия, такие как реорганизация эмитента ценных бумаг, конвертация ценных бумаг, проводимая без реорганизации эмитента ценных бумаг, или иные действия (события), влияющие на исполнение обязательств по Сделкам T+, в том числе, которые приводят к изменению предмета Сделки T+, Клиринговый центр вправе принять в отношении таких Сделок T+ одно из следующих решений:

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

- 39.7.2. о том, что Дата исполнения обязательств по Сделкам Т+, в том числе по Сделкам РЕПО с открытой датой, считается наступившей в Расчетный день, определенный таким решением Клирингового центра;
- 39.7.3. о заключении вместо сделки РЕПО, условия которой предусмотрены пунктом 46.3 общей части Правил клиринга, закрывающей сделки / закрывающих сделок купли-продажи ценных бумаг (за исключением клиринговых сертификатов участия) и балансирующей сделки / балансирующих сделок в случаях, установленных пунктами 44.2, 44.4, подпунктом 44.9.6 общей части Правил клиринга.
- 39.8. Порядок исполнения обязательств, включенных в клиринговый пул, определен в статье 41 общей части Правил клиринга, а также в соответствующих специальных частях Правил клиринга.
- 39.9. Если это предусмотрено соответствующей специальной частью Правил клиринга, Участник клиринга вправе заменить Торгово-клиринговый счет 1-го, 2-го и/или 3-го уровня, определяющий клиринговые регистры и набор счетов, по которым учитываются и должны исполняться обязательства по Сделке (Сделкам).
- 39.9.1. Для осуществления указанной замены Участник клиринга должен предоставить Клиринговому центру Запрос на замену Торгово-клирингового счета не позднее Расчетного дня, предшествующего Дате исполнения обязательств в отношении Сделки (Сделок), указанных в Запросе на замену Торгово-клирингового счета.
- 39.9.2. Запрос на замену Торгово-клирингового счета предоставляется до момента времени, установленного Временным регламентом. Запрос на замену Торгово-клирингового счета, предоставленный позже указанного времени, не исполняется.
- 39.9.3. Запрос на замену Торгово-клирингового счета исполняется при соблюдении следующих условий:
- по всем Торгово-клиринговым счетам 1-го уровня, указанным в запросе, и/или всем Торгово-клиринговым счетам 1-го уровня, соответствующим Торгово-клиринговым счетам 2-го и/или 3-го уровня, указанным в запросе, и по всем соответствующим им Расчетным кодам 1-го уровня не установлен Режим урегулирования;
  - Единый лимит по всем Расчетным кодам Участника клиринга, входящим в состав Торгово-клиринговых счетов 1-го уровня, указанных в запросе, или в состав Торгово-клиринговых счетов 1-го уровня, соответствующих Торгово-клиринговым счетам 2-го и 3-го уровня, указанных в запросе, после исполнения запроса не станет отрицательным;
  - в состав Торгово-клиринговых счетов, указанных в запросе, не входит Расчетный код для учета взносов в Гарантийные фонды, или Расчетный код для учета Обеспечения под стресс, или Расчетный код имущественного пула, или Расчетный код для учета Обеспечения под риски концентрации на эмитентов;
  - Расчетные коды, входящие в состав Торгово-клиринговых счетов 1-го уровня, указанных в запросе, или в состав Торгово-клиринговых счетов 1-го уровня, соответствующих Торгово-клиринговым счетам 2-го и 3-го уровня, указанных в запросе, имеют один и тот же признак, указывающий на модель использования Расчетного кода;

- замена Торгово-клирингового счета в сделках не приводит к изменению Участника торгов в Сделках;
- оба Торгово-клирингового счета являются Торгово-клиринговыми счетами нерезидента, либо оба Торгово-клирингового являются иными Торгово-клиринговыми счетами;
- при соблюдении следующих правил замены Торгово-клиринговых счетов:
  - Торгово-клиринговый счет 1-го уровня, указанный в запросе / соответствующий Торгово-клиринговому счету 2-го или 3-го уровня, указанному в запросе, в состав которого входит собственный Расчетный код, может быть заменен только на Торгово-клиринговый счет 1-го уровня / Торгово-клиринговый счет 2-го или 3-го уровня, соответствующий Торгово-клиринговому счету 1-го уровня, в состав которого входит собственный Расчетный код;
  - Торгово-клиринговый счет 1-го уровня, указанный в запросе / соответствующий Торгово-клиринговому счету 2-го или 3-го уровня, указанному в запросе, в состав которого входит клиентский Расчетный код, может быть заменен только на Торгово-клиринговый счет 1-го уровня / Торгово-клиринговый счет 2-го или 3-го уровня, соответствующий Торгово-клиринговому счету 1-го уровня, в состав которого входит клиентский или собственный Расчетный код;
  - Торгово-клиринговый счет 1-го уровня, указанный в запросе / соответствующий Торгово-клиринговому счету 2-го или 3-го уровня, указанному в запросе, в состав которого входит Расчетный код ДУ, может быть заменен только на Торгово-клиринговый счет 1-го уровня / Торгово-клиринговый счет 2-го или 3-го уровня, соответствующий Торгово-клиринговому счету 1-го уровня, в состав которого входит Расчетный код ДУ или собственный Расчетный код;
  - Торгово-клиринговый счет 1-го уровня, указанный в запросе / соответствующий Торгово-клиринговому счету 2-го или 3-го уровня, указанному в запросе, в состав которого входит Расчетный код, открытый для Обособленного клиента, может быть заменен только на Торгово-клиринговый счет 1-го уровня / Торгово-клиринговый счет 2-го или 3-го уровня, соответствующий Торгово-клиринговому счету 1-го уровня, в состав которого входит Расчетный код, открытый для того же Обособленного клиента;
  - Торгово-клиринговый счет 1-го уровня, указанный в запросе / соответствующий Торгово-клиринговому счету 2-го или 3-го уровня, указанному в запросе, в состав которого входит Расчетный код, которому соответствуют идентификационные данные клиента Участника клиринга, может быть заменен только на Торгово-клиринговый счет 1-го уровня / Торгово-клиринговый счет 2-го или 3-го уровня, соответствующий Торгово-клиринговому счету 1-го уровня, в состав которого входит Расчетный код, которому соответствуют те же идентификационные данные клиента Участника клиринга;
  - Торгово-клиринговый счет Т+ может быть заменен только на Торгово-клиринговый счет Т+;

- Торгово-клиринговый счет, указанный в запросе, которому соответствует Торгово-клиринговый счет имущественного пула, может быть заменен только на Торгово-клиринговый счет, которому соответствует Торгово-клиринговый счет имущественного пула, имеющий такой же признак, определяющий соответствующий имущественный пул, как и признак Торгово-клирингового счета имущественного пула, соответствующего Торгово-клиринговому счету, указанному в запросе;
  - Торгово-клиринговый счет 1-го уровня, указанный в запросе / соответствующий Торгово-клиринговому счету 2-го или 3-го уровня, указанному в запросе, в состав которого входит клиентский Расчетный код, в случае если по такому Торгово-клиринговому счету учитываются обязательства по Сделкам с облигациями Банка России, может быть заменен на Торгово-клиринговый счет 1-го уровня / Торгово-клиринговый счет 2-го или 3-го уровня, соответствующий Торгово-клиринговому счету 1-го уровня, в состав которого входит собственный Расчетный код, только в случае, если Участник клиринга является кредитной организацией.
- 39.9.4. Запрос на замену Торгово-клирингового счета исполняется после окончания торгов / после окончания времени (срока) заключения Внебиржевых сделок (для Внебиржевых сделок) на соответствующем Рынке.
- 39.9.5. После замены Торгово-клирингового счета обязательства по Сделке (Сделкам), обязательства по передаче Дохода, обязательства по уплате компенсационных взносов по такой Сделке (таким Сделкам) учитываются по новому Торгово-клиринговому счету 1-го, 2-го или 3-го уровня, указанному в запросе, и по соответствующим ему Расчетному коду 1-го, 2-го или 3-го уровня и Торгово-клиринговым счетам и Расчетным кодам более высокого уровня, и исполняются по Расчетным кодам / Счетам обеспечения Т0 и Разделам, входящим в состав нового Торгово-клирингового счета 1-го уровня / в состав Торгово-клирингового счета 1-го уровня, соответствующего новому Торгово-клиринговому счету 2-го или 3-го уровня, указанного в запросе.
- 39.9.6. Замена Торгово-клирингового счета 1-го, 2-го и/или 3-го уровня, определяющего клиринговые регистры и набор счетов, по которым учитываются и должны исполняться обязательства по Сделке (Сделкам), не приводит к замене лица, за счет и в интересах которого была заключена Сделка (Сделки).

**Статья 40. Сроки включения обязательств в клиринговые пулы (ранние расчеты и ограничение времени заключения Сделок с Клиринговым центром)**

- 40.1. Обязательства и требования Участника клиринга и Клирингового центра с наступившей Датой исполнения включаются в соответствующий клиринговый пул в Дату исполнения в сроки определения соответствующих Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований, установленные Временным регламентом или временным регламентом, являющимся приложением к соответствующей специальной части Правил клиринга.
- 40.2. 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 в сроки определения соответствующих Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований, установленные Временным регламентом, и на основании информации из запроса / поручения Участника клиринга (в случае, если такая возможность предусмотрена соответствующей частью Правил клиринга).

40.2.1. Запрос на проведение ранних расчетов и Постоянное поручение на проведение ранних расчетов подается и действует в отношении Расчетного кода Участника клиринга и соответствующих такому Расчетному коду Участника клиринга клиринговых регистров 2-го и 3-го уровней.

40.2.2. Запрос на проведение ранних расчетов действует в день его предоставления.

40.2.3. 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.

40.2.4. После получения от Участника клиринга Запроса на проведение ранних расчетов без указания времени Клиринговый центр посредством ПТК ТЦ / Системы торгов передает Бирже информацию о Расчетном коде Участника клиринга, в отношении которого предоставлен Запрос на проведение ранних расчетов без указания времени.

Клиринговый центр посредством ПТК ТЦ / Системы торгов ежедневно передает Бирже информацию о Расчетных кодах Участников клиринга, в отношении которых предоставлен Запрос на проведение ранних расчетов с указанием времени или в отношении которых действуют Постоянные поручения на проведение ранних расчетов, и времени ранних расчетов для таких Расчетных кодов.

40.3. Участник клиринга имеет право ограничить для себя время заключения Сделок с Клиринговым центром по сравнению с временем проведения торгов, установленным Биржей (в случае, если такая возможность предусмотрена соответствующей частью Правил клиринга).

40.3.1. Время начала заключения Сделок с Клиринговым центром в случае ограничения Участником клиринга времени начала заключения Сделок с Клиринговым центром установлено Временным регламентом.

40.3.2. Время окончания заключения Сделок с Клиринговым центром в случае ограничения Участником клиринга времени окончания заключения Сделок с Клиринговым центром определяется на основании информации из запроса / поручения Участника клиринга и в соответствии с Временным регламентом.

40.4. Для ограничения времени начала заключения Сделок с Клиринговым центром Участник клиринга должен предоставить Клиринговому центру Постоянное поручение на ограничение времени начала заключения Сделок с Клиринговым центром.

40.4.1. Постоянное поручение на ограничение времени начала заключения Сделок с Клиринговым центром подается и действует в отношении Расчетного кода Участника клиринга и соответствующих такому Расчетному коду Участника клиринга клиринговых регистров 2-го и 3-го уровней, если специальной частью Правил клиринга не установлено иное, и в отношении Рынка, указанного в поручении.

Постоянное поручение на ограничение времени начала 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 ограничение времени начала заключения Сделок с Клиринговым центром действует до его отмены Участником клиринга.

Участник клиринга вправе отменить Постоянное поручение на ограничение времени начала заключения Сделок с Клиринговым центром.

40.4.2. Клиринговый центр посредством ПТК ТЦ / Торговой системы передает Бирже информацию о Расчетных кодах / иных клиринговых регистрах Участников клиринга, в отношении которых действует / отменено Постоянное поручение на ограничение времени начала заключения Сделок с Клиринговым центром.

40.5. Для ограничения времени окончания заключения Сделок с Клиринговым центром с Датой исполнения, отличной от текущей, Участник клиринга должен предоставить Клиринговому центру Запрос на ограничение времени окончания заключения сделок с Клиринговым центром или Постоянное поручение на ограничение времени окончания заключения сделок с Клиринговым центром.

40.5.1. Запрос на ограничение времени окончания заключения сделок с Клиринговым центром и Постоянное поручение на ограничение времени окончания заключения Сделок с Клиринговым центром подается и действует в отношении Расчетного кода Участника клиринга и соответствующих такому Расчетному коду Участника клиринга клиринговых регистров 2-го и 3-го уровней.

40.5.2. Запрос на ограничение времени окончания заключения сделок с Клиринговым центром действует в день его предоставления.

40.5.3. Постоянное поручение на ограничение времени окончания 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 ограничение времени окончания заключения сделок с Клиринговым центром действует до его отмены Участником клиринга.

Участник клиринга вправе отменить Постоянное поручение на ограничение времени окончания заключения сделок с Клиринговым центром.

40.5.4. После получения от Участника клиринга Запроса на ограничение времени окончания заключения сделок с Клиринговым центром без указания времени Клиринговый центр посредством ПТК ТЦ / Системы торгов передает Бирже информацию о Расчетном коде Участника клиринга, в отношении которого предоставлен Запрос на ограничение времени окончания заключения сделок с Клиринговым центром без указания времени.

Клиринговый центр посредством ПТК ТЦ / Системы торгов ежедневно передает Бирже информацию о Расчетных кодах Участников клиринга, в отношении которых предоставлен Запрос на ограничение времени окончания заключения сделок с Клиринговым центром с указанием времени или в отношении которых действует Постоянное поручение на ограничение времени окончания заключения Сделок с Клиринговым центром, и времени окончания заключения сделок с Клиринговым центром для таких Расчетных кодов.

- 40.6. Если Участник клиринга предоставил Запрос или Постоянное поручение на ограничение времени окончания 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 ограничение времени окончания заключения сделок с Клиринговым центром, при исполнении Запроса или Постоянного поручения на ограничение времени окончания заключения сделок с Клиринговым центром в отношении такого Участника клиринга Клиринговый центр осуществляет действия, предусмотренные пунктом 40.2 общей части Правил клиринга.
- 40.7. Для Расчетных кодов Единого пула Запрос на проведение ранних расчетов и Постоянное поручение на проведение ранних расчетов, Запрос на ограничение времени окончания заключения сделок с Клиринговым центром и Постоянное поручение на ограничение времени окончания заключения сделок с Клиринговым центром действуют одновременно в отношении двух Рынков: фондового рынка, рынка депозитов и рынка кредитов, валютного рынка и рынка драгоценных металлов.
- 40.8. Запрос на ограничение времени окончания заключения сделок с Клиринговым центром, Постоянное поручение на ограничение времени окончания заключения сделок с Клиринговым центром не исполняются в отношении Расчетного кода Участника клиринга в случае, если по такому Расчетному коду учитывается неисполненное Маржинальное требование и/или установлен Режим урегулирования.

#### **Статья 41. Порядок исполнения обязательств и требований по денежным средствам / драгоценным металлам Участников клиринга и Клирингового центра**

- 41.1. В срок, установленный Временным регламентом или временным регламентом, являющимся приложением к соответствующей специальной части Правил клиринга, 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 42 общей части Правил клиринга или соответствующей специальной частью Правил клиринга.
- 41.2. Участник клиринга обязан исполнить свои Итоговые нетто-обязательства по денежным средствам / драгоценным металлам, определенные в соответствующем

клиринговом пуле, в срок, установленный Временным регламентом или временным регламентом, являющимся приложением к соответствующей специальной части Правил клиринга.

- 41.3. 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 / драгоценным металлам, учитываемого по Расчетному коду имущественного пула, используется имущество, внесенное в имущественный пул в порядке, определенном Правилами клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, 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.

- 41.3.1. 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.
- 41.3.2. Датой и временем внесения Участником клиринга драгоценных металлов в Обеспечение являются дата и время зачисления драгоценных металлов на соответствующий торговый банковский счет в драгоценном металле Участника клиринга.
- 41.3.3. Перечисление денежных средств позже установленного срока с зачислением их ранее даты перевода (back value) не разрешается.

- 41.4. В случае исполнения Итогового нетто-обязательства по денежным средствам с нарушением срока, установленного Временным регламентом или временным регламентом, являющимся приложением к соответствующей специальной части Правил клиринга, и/или наличия неисполненного Итогового нетто-обязательства по денежным средствам после выполнения Клиринговым центром действий в соответствии со статьей 44 общей части Правил клиринга или Правилами клиринга на товарном рынке, и/или наличия Задолженности Участника клиринга на момент времени, установленный временным регламентом, являющимся приложением к Правилам клиринга 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:

$$\text{Penalty} = D \times C \times R \times n / 365, \text{ где}$$

Penalty – сумма штрафа за ненадлежащее исполнение денежных обязательств, в российских рублях,

D – сумма Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам в соответствующей валюте, исполненного с нарушением срока, установленного Временным регламентом или временным регламентом, являющимся приложением к соответствующей специальной части Правил клиринга, или сумма Итогового нетто-обязательства по денежным средствам в



соответствующей валюте, не исполненного после выполнения Клиринговым центром действий в соответствии со статьей 44 общей части Правил клиринга или Правилами клиринга на товарном рынке, или 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,

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 55.10 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 Расчетный день, следующий за днем возникновения оснований для взимания штрафа, указанных в настоящем пункте общей части Правил клиринга.

Штраф за ненадлежащее исполнение денежных обязательств, предусмотренный настоящим пунктом общей части Правил клиринга, не взимается с Участника клиринга, допуск к клиринговому обслуживанию которого приостановлен на основании полученной от Биржи информации о приостановлении или прекращении допуска Участника клиринга к участию в торгах на Бирже в связи с аннулированием лицензии на осуществление профессиональной деятельности на рынке ценных бумаг.

41.5. 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.

41.6. В срок, установленный Временным регламентом или временным регламентом, являющимся приложением к соответствующей специальной части Правил

клиринга, Клиринговый центр осуществляет исполнение / прекращение Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований по денежным средствам / драгоценным металлам.

Для целей исполнения Итоговое нетто-обязательство / Итоговое нетто-требование по драгоценным металлам в тройских унциях пересчитывается в граммы в порядке, аналогичном порядку, установленному нормативным актом Банка России, устанавливающим правила учета и хранения слитков драгоценных металлов в кредитных организациях на территории Российской Федерации при осуществлении операций с драгоценными металлами.

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 Временным регламентом или временным регламентом, являющимся приложением к соответствующей специальной части Правил клиринга.

- 41.7. 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 и требование участника клиринга по возврату его Обеспечения в соответствующей валюте прекращаются 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 прекращенных Итогового нетто-обязательства / требования по возврату Обеспечения в такой валюте.

- 41.8. 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, с торгового банковского счета 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.

41.9. Итоговое нетто-обязательство Участника клиринга по денежным средствам в соответствующей валюте / по соответствующему драгоценному металлу, для исполнения которого недостаточно денежных средств / драгоценных металлов, урегулируется в порядке, установленном статьей 44 общей части Правил клиринга, в сроки, установленные Временным регламентом или временным регламентом, являющимся приложением к соответствующей специальной части Правил клиринга.

Специальной частью Правил клиринга может быть установлен особый порядок урегулирования неисполненных Итоговых нетто-обязательств по денежным средствам.

41.10. 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, и объем обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга Обеспечения в такой валюте увеличиваются на сумму прекращенного Итогового нетто-требования Участника клиринга в такой валюте.

41.11. 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 торговый банковский счет 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.

41.12. В случае расхождения данных учета информации об Обеспечении в драгоценном металле на клиринговых регистрах, соответствующих торговым банковским счетам с признаком Локо Лондон, в тройских унциях и информации об Обеспечении в драгоценных металлах на таких торговых банковских счетах в граммах, возникающего из-за математических округлений при пересчете Итогового нетто-обязательства / Итогового нетто-требования по драгоценным металлам из тройских унций в граммы, проводимого для целей исполнения указанного Итогового нетто-обязательства / Итогового нетто-требования, Клиринговый центр списывает с торгового банковского счета или зачисляет на торговый банковский счет драгоценный металл в граммах в целях устранения указанного расхождения.

41.13. 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 42. Порядок формирования Единого клирингового пула**

42.1. 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, рынка депозитов и рынка кредитов (за исключением обязательств и требований с наступившей Датой исполнения, учитываемых по Расчетным кодам нерезидента), и Расчетным кодам Единого пула в Клиринговой системе фондового рынка:

- Задолженности Участника клиринга в соответствующей валюте, возникшей в предыдущий Расчетный день и не погашенной на момент определения Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований по денежным средствам в соответствующей валюте (для первого в течение Расчетного дня определения Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований по денежным средствам в соответствующей валюте);
- 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 и

Клиринговой системы рынка Стандартизированных ПФИ (для Расчетных кодов Единого пула);

- обязательства по уплате / требования по получению вариационной / депозитной маржи и премии, определенные в соответствии с Правилами клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, Правилами клиринга на срочном рынке и Правилами клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ (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 T+, заключенным в соответствии со статьями 45-49 общей части Правил клиринга;
- обязательства по передаче / требования по получению Дохода, определенные в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов;
- обязательства Участника клиринга по уплате комиссионных вознаграждений, определенные в соответствии с общей частью Правил клиринга и Правилами клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов;
- обязательства Участника клиринга по уплате комиссионных вознаграждений, определенные в соответствии с Правилами клиринга на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, Правилами клиринга на срочном рынке и Правилами клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ (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, рынке депозитов и рынке кредитов, за исключением штрафов, предусмотренных подпунктом 7.20.1, пунктом 7.22 общей части Правил клиринга;
- 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, рынке депозитов и рынке кредитов;
- обязательство Участника клиринга – Нерезидента / Участника клиринга – Международной организации по уплате суммы, соответствующей сумме налога на прибыль организаций с доходов иностранных организаций от источников в Российской Федерации, определенной в соответствии со статьей 7 общей части Правил клиринга, в Расчетный день, следующий за днем получения доходов Участником клиринга – Нерезидентом (в т.ч. в пользу фактического получателя дохода Участника клиринга – Нерезидента)/ Участником клиринга – Международной организацией (в пользу фактического получателя дохода Участника клиринга – Международной организации);

- в случае непредоставления Участником клиринга – Нерезидентом сертификата налогового резидентства Участника клиринга и/или фактического получателя дохода такого Участника клиринга или в случае непредоставления Участником клиринга – Международной организацией сертификата налогового резидентства фактического получателя дохода такого Участника клиринга (за исключением банков, постоянное местонахождение которых подтверждается сведениями общедоступных информационных справочников) на очередной налоговый период (календарный год) в срок, указанный в приложении № 4 к общей части Правил клиринга, в дату окончания срока предоставления указанных документов, - обязательство Участника клиринга по уплате суммы, равной разнице между суммой, соответствующей сумме налога на прибыль организаций с доходов иностранных организаций от источников в Российской Федерации, рассчитанной по максимальной ставке, установленной российским налоговым законодательством, и суммой, соответствующей сумме налога, рассчитанной по действующей в текущем календарном году налоговой ставке, установленной применимым соглашением об избежании двойного налогообложения, заключенным с государством, налоговым резидентом которого являлся Участник клиринга – Нерезидент, фактический получатель дохода Участника клиринга – Нерезидента или фактический получатель Участника клиринга – Международной организации в предыдущем календарном году (налоговом периоде);
- обязательства Участника клиринга по уплате суммы, соответствующей сумме налога на доход от источника в США и/или приравненный к нему доход, определенной в соответствии с Правилами клиринга в Расчетный день, следующий за днем получения Участником клиринга Дохода, являющегося Выплатой, эквивалентной дивидендам или процентам;
- иные денежные обязательства Участника клиринга, определенные в соответствии с Правилами клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ, полученные из Клиринговой системы рынка Стандартизированных ПФИ (для Расчетных кодов Единого пула);
- иные денежные обязательства Участника клиринга, предусмотренные Правилами клиринга.

42.1.1. Обязательства и требования Участника клиринга и/или Клирингового центра с наступившей Датой исполнения включаются в Единый клиринговый пул в сроки, установленные Временным регламентом.

42.1.2. Участники клиринга вправе подавать Запросы на ограничение времени окончания заключения сделок с Клиринговым центром и Постоянные поручения на ограничение времени окончания заключения сделок с Клиринговым центром с указанием времени 19:00 в отношении Расчетных кодов Единого пула и Расчетных кодов, открытых для фондового рынка, рынка депозитов и рынка кредитов.

Порядок подачи и исполнения указанных запросов и поручений определен статьей 40 общей части Правил клиринга.

42.2. Клиринговый центр формирует отдельный Единый клиринговый пул из обязательств и требований с наступившей Датой исполнения, указанных в пункте 42.1 общей части Правил клиринга, учитываемых по Расчетным кодам нерезидента, открытым для фондового рынка, рынка депозитов и рынка кредитов.

42.3. 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 (один) раз в 5 (пять) минут, передаются в Клиринговую систему фондового рынка.

Обязательства по уплате / требования по получению вариационной / депозитной маржи и премии, определенные в Клиринговой системе валютного рынка и рынка драгоценных металлов, Клиринговой системе рынка Стандартизированных ПФИ и Клиринговой системе срочного рынка, после их определения передаются в Клиринговую систему фондового рынка.

Обязательства Участника клиринга по уплате комиссионных вознаграждений, определенные в Клиринговой системе валютного рынка и рынка драгоценных металлов, Клиринговой системе рынка Стандартизированных ПФИ и Клиринговой системе срочного рынка, в Дату их исполнения передаются в Клиринговую систему фондового рынка.

Обязательства / требования из Договоров СПФИ по уплате денежных сумм, Дата исполнения которых наступила, обязательства / требования из сделок своп и сделок купли-продажи с иностранной валютой, заключенных в соответствии с Правилами клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ, иные обязательства / требования, Дата исполнения которых наступила, учитываемые по Расчетным кодам Единого пула в Клиринговой системе рынка Стандартизированных ПФИ, после их определения передаются в Клиринговую систему фондового рынка.

При этом:

42.3.1. указанные обязательства и требования прекращают учитываться в Клиринговой системе срочного рынка / в Клиринговой системе валютного рынка и рынка драгоценных металлов / Клиринговой системе рынка Стандартизированных ПФИ и начинают учитываться в Клиринговой системе фондового рынка в составе Нетто-обязательства / Нетто-требования в соответствующей валюте / драгоценном металле / ценных бумагах с текущей Датой исполнения, учитываемых по Расчетному коду Единого пула. Прекращение учета Нетто-обязательств / Нетто-требований 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 осуществляется в 20:00 Расчетного дня;

42.3.2. Профили активов, учитываемые по Расчетному коду Единого пула в Клиринговой системе срочного рынка / в Клиринговой системе валютного рынка и рынка драгоценных металлов / Клиринговой системе рынка Стандартизированных ПФИ, изменяются на объем обязательств / требований, переданных в Клиринговую систему фондового рынка: 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;

42.3.3. Профили активов, учитываемые по Расчетному коду Единого пула в Клиринговой системе фондового рынка, изменяются на объем обязательств / требований,

- переданных в такую Клиринговую систему, противоположно изменению Профилей активов в Клиринговой системе срочного рынка / Клиринговой системе валютного рынка и рынка драгоценных металлов / Клиринговой системе рынка Стандартизированных ПФИ;
- 42.3.4. обязательства / требования, полученные из Клиринговой системы срочного рынка / Клиринговой системы валютного рынка и рынка драгоценных металлов Клиринговой системы рынка Стандартизированных ПФИ, 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.
- 42.4. 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/или 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.
- 42.4.1. 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.
- 42.5. 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 43. Порядок прекращения обязательств в Едином клиринговом пуле**

- 43.1. В целях прекращения обязательств в Едином клиринговом пуле Клиринговый центр в сроки, установленные настоящей статьей общей части Правил клиринга и Временным регламентом:
- 43.1.1. формирует распоряжения на перевод ценных бумаг / денежных средств с Торгово-клирингового счета Т0 на Торгово-клиринговый счет Т+ в соответствии с пунктами 43.6-43.7 общей части Правил клиринга;



- 43.1.2. формирует распоряжение на перевод денежных средств / драгоценных металлов / ценных бумаг с Торгово-клирингового счета имущественного пула на Торгово-клиринговый счет Т+ в соответствии с пунктом 43.8 общей части Правил клиринга;
- 43.1.3. направляет Расчетному депозитарию Запрос на подбор ценных бумаг в соответствии с пунктом 43.10 общей части Правил клиринга;
- 43.1.4. проверяет наличие денежных средств / драгоценных металлов / ценных бумаг, необходимых для исполнения Итоговых нетто-обязательств;
- 43.1.5. в случае недостаточности у Участника клиринга денежных средств / драгоценных металлов / ценных бумаг, необходимых для исполнения его Итоговых нетто-обязательств, выполняет действия, предусмотренные статьей 44 общей части Правил клиринга;
- 43.1.6. осуществляет исполнение / прекращение Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований по денежным средствам / драгоценным металлам.
- 43.2. Действия, предусмотренные подпунктами 43.1.1-43.1.3 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.
- 43.3. 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.
- 43.4. Итоговые нетто-обязательства / Итоговые нетто-требования по денежным средствам / драгоценным металлам исполняются в порядке, определенном статьей 41 общей части Правил клиринга, с учетом особенностей, установленных настоящей статьей общей части Правил клиринга.
- 43.5. 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 43.6, 43.8 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, рынке депозитов и рынке кредитов, 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.

- 43.6. 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 30.25 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 27.15.1 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.

- 43.7. 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 30.25 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 27.15.1 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.

- 43.8. Если для исполнения Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам / драгоценным металлам / ценным бумагам, учитываемого по Расчетному коду / Торгово-клиринговому счету Т+, недостаточно денежных средств / драгоценных металлов / 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 / драгоценных металлов / 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 / драгоценным металлам / ценным бумагам.

Указанное в настоящем подпункте общей части Правил клиринга распоряжение на перевод денежных средств / драгоценных металлов / ценных бумаг формируется при выполнении условий, указанных в подпункте 27.15.1 / 27.16.1 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, рынке депозитов и рынке кредитов для выдачи имущества из имущественного пула.

Одновременно с формированием распоряжения на перевод ценных бумаг, драгоценных металлов или денежных средств в иностранной валюте, приводящего к нарушению условий погашения клиринговых сертификатов участия, указанных в Правилах клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов 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, рынке депозитов и рынке кредитов.

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 42 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.

43.9. 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 пунктами 27.15, 27.16 общей части Правил клиринга.

43.10. 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 14.31 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.

43.10.1. Расчетный депозитарий исполняет Запрос Клирингового центра на подбор ценных бумаг в соответствии с пунктами 29.6-29.7 общей части Правил клиринга.

43.11. 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+.

- 43.12. 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, рынке депозитов и рынке кредитов. Выданные клиринговые сертификаты участия используются для исполнения Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по ценной бумаге клиринговый сертификат участия.
- 43.13. Если по итогам действий, предусмотренных подпунктами 43.1.1-43.1.3 общей части Правил клиринга, на момент времени, установленный Временным регламентом или временным регламентом, являющимся приложением к соответствующей специальной части Правил клиринга, 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 44 общей части Правил клиринга.
- 43.14. 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 44 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.
- 43.14.1. 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 30.24-30.25 общей части Правил клиринга.
- 43.15. Итоговые нетто-обязательства / Итоговые нетто-требования по ценным бумагам, в том числе определенные по итогам выполнения действий, предусмотренных статьей 44 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, рынке депозитов и рынке кредитов.

## **ПОДРАЗДЕЛ IV-V. ПОРЯДОК ДЕЙСТВИЙ, НАПРАВЛЕННЫХ НА ИСПОЛНЕНИЕ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ**

Статьи 44-49 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, рынка депозитов и рынка кредитов, и Расчетным кодам Участника клиринга, открытым для валютного рынка и рынка драгоценных металлов, Расчетным кодам Участника клиринга, открытым для рынка Стандартизированных ПФИ.

### **Статья 44. Порядок действий, направленных на исполнение обязательств, в случае наличия Итоговых нетто-обязательств, для исполнения которых недостаточно денежных средств / драгоценных металлов / ценных бумаг**

- 44.1. 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.
- 44.2. 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 46 общей части Правил клиринга.
- 44.3. 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 42 общей части Правил клиринга.

- 44.4. 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 Временным регламентом или временным регламентом, являющимся приложением к соответствующей специальной части Правил клиринга, 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 45 общей части Правил клиринга;
  - 2) заключает с Недобросовестным участником клиринга сделку РЕПО или сделки / сделку купли-продажи ценных бумаг в соответствии со статьей 46 общей части Правил клиринга.
- 44.5. 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 Временным регламентом или временным регламентом, являющимся приложением к соответствующей специальной части Правил клиринга, 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 45 общей части Правил клиринга;
  - 2) заключает с Недобросовестным участником клиринга сделку своп или сделку купли-продажи иностранной валюты за российские рубли в соответствии со статьей 45 общей части Правил клиринга.
- 44.6. В случае если для исполнения Итогового нетто-обязательства Участника клиринга по драгоценным металлам недостаточно соответствующих драгоценных металлов, Клиринговый центр в срок, установленный Временным регламентом, заключает с Недобросовестным участником клиринга сделку своп или сделку / сделки купли-продажи с драгоценным металлом за российские рубли в соответствии со статьей 45 общей части Правил клиринга.
- 44.7. Клиринговый центр вправе своим решением ограничить перечень иностранных валют / драгоценных металлов / ценных бумаг, с которыми могут заключаться сделки своп, сделки РЕПО или сделки купли-продажи иностранной валюты / драгоценного металла / ценных бумаг, предусмотренные пунктами 44.2, 44.4-44.6 общей части Правил клиринга. Информация о принятом решении раскрывается на Сайте Клирингового центра.
- 44.8. 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.

44.8.1. В случае заключения Клиринговым центром от имени Недобросовестного участника клиринга закрывающих сделок, условия которых определены в пунктах 45.4, 46.6 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.

44.9. 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, которая может быть изменена по решению Клирингового центра:

44.9.1. использует свободные собственные денежные средства / драгоценные металлы и/или собственные ценные бумаги по усмотрению Клирингового центра;

44.9.2. 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;

44.9.3. 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;

44.9.4. 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 47 общей части Правил клиринга;

44.9.5. заключает Сделки РЕПО Клирингового центра в соответствии со статьей 48 общей части Правил клиринга;



44.9.6. в случае невозможности заключения Сделок РЕПО Клирингового центра в соответствии со статьей 48 общей части Правил клиринга заключает сделки РЕПО и/или две сделки купли-продажи ценных бумаг с Добросовестными участниками клиринга в соответствии со статьей 49 общей части Правил клиринга.

44.10. 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 41 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, в сумме такого Итогового нетто-обязательства.

Задолженность по уплате налога возникает при наличии у Участника клиринга Итогового нетто-обязательства, не прекращенного по итогам действий, выполненных в соответствии с настоящей статьей общей части Правил клиринга, и: наличия обязательства по уплате суммы, соответствующей сумме налога на прибыль организаций с доходов иностранных организаций от источников в Российской Федерации,

и/или

наличия обязательства по уплате суммы, соответствующей сумме налога на доход от источника в США и/или приравненный к нему доход (за исключением указанных обязательств, возникших в связи с заключением опционных контрактов, базисным активом которых являются ценные бумаги)

и/или

включения в Единый клиринговый пул Задолженности Участника клиринга, возникшей в предыдущий Расчетный день и не погашенной на момент определения Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований по денежным средствам в соответствующей валюте (для первого в течение Расчетного дня определения Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований по денежным средствам в соответствующей валюте), включающей в себя Задолженность по уплате налога. Размер Задолженности по уплате налога рассчитывается как минимальное из двух значений: 1) сумма размера обязательства по уплате суммы, соответствующей сумме

налога на прибыль организаций с доходов иностранных организаций от источников в Российской Федерации, размера обязательства по уплате суммы, соответствующей сумме налога на доход от источника в США и/или приравненный к нему доход, и Задолженности по уплате налога, определенной в предыдущей Расчетный день, и 2) размер Итогового нетто-обязательства, не прекращенного по итогам действий, выполненных в соответствии с настоящей статьей общей части Правил клиринга.

Задолженность Участника клиринга по Расчетному коду Единого пула считается возникшей на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.

- 44.10.1. Задолженность Участника клиринга в соответствующей валюте должна быть погашена до первого в течение Расчетного дня времени определения Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований по денежным средствам в соответствующей валюте.
- 44.10.2. 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.
- 44.11. Информация о наличии у Участника клиринга Задолженности, в том числе Задолженности по уплате налога, и ее размере передается Участнику клиринга в составе Отчета о движении денежных средств.

Задолженность Участника клиринга считается погашенной, если значение клирингового регистра, предназначенного для учета Обеспечения / Задолженности в соответствующей валюте по Расчетному коду Участника клиринга, по которому учитывалась Задолженность, является неотрицательным.

- 44.12. 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, иное имущество в порядке, определенном статьей 50 общей части Правил клиринга (начинает процедуру кросс-дефолта в отношении Участника клиринга).

#### **Статья 45. Порядок заключения и условия сделок своп / сделки купли-продажи с иностранной валютой / драгоценным металлом, заключаемых с Недобросовестными участниками клиринга**

- 45.1. 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 44.4, 44.5 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:
- 45.1.1. 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;

- 45.1.2. 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;
- 45.1.3. 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;
- 45.1.4. Датой исполнения обязательств по первой части сделки своп является день ее заключения;
- 45.1.5. Датой исполнения обязательств по второй части сделки своп является Расчетный день по соответствующей валюте, следующий за датой заключения сделки своп;
- 45.1.6. 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 во Время расчета риск-параметров текущего Торгового дня.

Специальной частью Правил клиринга может быть установлен иной порядок определения базового курса сделки своп.

- 45.1.7. Цена сделки своп для Участника клиринга любой категории, кроме категории «К», рассчитывается по следующей формуле:

$$\text{Swap\_Price} = \text{Rc\_VAL1\_VAL2} \times S \times n / 365, \text{ где}$$

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 во  
Время расчета риск-параметров текущего Торгового дня;

VAL – валюта лота сделки своп;

S – ставка, установленная решением Клирингового центра;

n – количество календарных дней между датой исполнения первой и второй части сделки своп.

Цена сделки своп для Участника клиринга категории «К» равна нулю.

- 45.2. 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 45.4 общей части Правил клиринга, в следующих случаях:

- 45.2.1. допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию на соответствующем Рынке приостановлен;

- 45.2.2. у Клирингового центра имеется информация об обстоятельствах в отношении Участника клиринга, перечисленных в статье 15 общей части Правил клиринга, при наступлении которых допуск к клиринговому обслуживанию Участника клиринга на соответствующем Рынке будет приостановлен в следующий Расчетный день;

- 45.2.3. 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 3 (третий) Расчетный день подряд.

- 45.3. Условие, указанное в подпункте 45.2.3 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 45.7 общей части Правил клиринга.

Участник клиринга обязан предоставить Клиринговому центру документы, подтверждающие действие причин, указанных в настоящем пункте общей части Правил клиринга не позднее 5 (пяти) рабочих дней со дня их возникновения.

- 45.4. Условия закрывающих сделок купли-продажи с иностранной валютой / драгоценным металлом и балансирующих сделок, заключаемых в соответствии с пунктом 45.2 и/или подпунктом 45.5.1 общей части Правил клиринга, соответствуют определенным Правилами торгов на валютном рынке условиям сделок купли-продажи с иностранной валютой / драгоценным металлом с учетом следующих особенностей:
- 45.4.1. 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;
- 45.4.2. 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;
- 45.4.3. 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;
- 45.4.4. Дата исполнения обязательств по закрывающей сделке / закрывающим сделкам соответствует Дате исполнения обязательств по балансирующей сделке / балансирующим сделкам с соответствующей иностранной валютой / драгоценным металлом. В случае невозможности или нецелесообразности заключения закрывающей сделки / закрывающих сделок и балансирующей сделки / балансирующих сделок с одной Датой исполнения обязательств, Клиринговый центр вправе заключить указанные сделки с разными Датой исполнения обязательств;
- 45.4.5. цена закрывающей сделки равна цене балансирующей сделки с соответствующей иностранной валютой / драгоценным металлом;
- 45.4.6. порядок заключения закрывающих и балансирующих сделок определен статьей 26 общей части Правил клиринга.
- 45.5. В случае если заключение закрывающих и балансирующих сделок по основаниям, предусмотренным подпунктами 45.2.1, 45.2.2 общей части Правил клиринга, в текущий Расчетный день с Датой исполнения в дату заключения сделок невозможно в соответствии с временным регламентом проведения торгов / клиринга:
- 45.5.1. в текущий Расчетный день Клиринговый центр заключает с Недобросовестным участником клиринга сделку своп в соответствии с пунктом 45.1 общей части Правил клиринга, и
- в следующий Расчетный день Клиринговый центр 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 45.4 общей части Правил клиринга;
- либо
- в текущий Расчетный день Клиринговый центр заключает с Недобросовестным участником клиринга в отношении себя лично заключает закрывающую сделку / закрывающие сделки купли-продажи с иностранной валютой / драгоценным металлом с Датой исполнения, отличной от даты текущего Расчетного дня, и заключает балансирующую сделку / балансирующие сделки, условия которых определены в пункте 45.4 общей части Правил клиринга;
- начиная с текущего Расчетного дня по Расчетный день, предшествующим Дате исполнения закрывающей сделки Клиринговый центр каждый Расчетный день заключает с Недобросовестным участником клиринга сделку своп в соответствии с пунктом 45.1 общей части Правил клиринга.
- 45.5.2. в случае приостановления допуска к клиринговому обслуживанию на основании подпункта 15.1.1 общей части Правил клиринга или подпункта 15.1.12 общей части

Правил клиринга в связи с аннулированием лицензии на осуществление профессиональной деятельности на рынке ценных бумаг, такая сделка своп заключается с ценой сделки своп, равной нулю, штрафы с Недобросовестного участника клиринга не взимаются.

45.6. После заключения закрывающих и балансирующих сделок в соответствии с пунктами 45.2, 45.4, 45.5 общей части Правил клиринга Клиринговый центр снимает Режим урегулирования для Расчетного кода Участника клиринга, если отсутствуют иные основания для установления Режима урегулирования, предусмотренные Правилами клиринга.

45.7. 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 45.1.7 общей части Правил клиринга, в расчете на количество календарных дней между датой исполнения первой части сделки своп и датой расчета неустойки.

45.8. 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, установленной в размере, меньшем (по модулю), чем

предусмотрено пунктом 45.1.7 общей части Правил клиринга, или равной нулю, при наличии обстоятельств, не указанных в пункте 45.7 общей части Правил клиринга, не зависящих от Недобросовестного участника клиринга и свидетельствующих об отсутствии вины такого Участника клиринга.

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

- 46.1. 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.

- 46.2. 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 46.1 общей части Правил клиринга;
- б) заключения сделок РЕПО по Торгово-клиринговым счетам, указанным в пункте 46.1 общей части Правил клиринга.

В случае предоставления указанного запроса заключение сделок РЕПО / двух сделок купли-продажи в соответствии с настоящей статьей и статьей 49 общей части Правил клиринга осуществляется в соответствии с таким запросом.

- 46.3. 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 44.2, 44.4 общей части Правил клиринга. Условия сделок РЕПО (двух сделок купли-продажи ценных бумаг) соответствуют определенным Правилами торгов на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов 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:

- 46.3.1. 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;
- 46.3.2. 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. Клиринговый центр, осуществляя указанный выбор, может принимать во внимание тип Торгово-клирингового счета, а также иные обстоятельства, имеющие значение;
- 46.3.3. Датой исполнения обязательств по первой части сделки РЕПО (первой сделке купли-продажи ценных бумаг) является день ее заключения;
- 46.3.4. Датой исполнения обязательств по второй части сделки РЕПО (второй сделке купли-продажи ценных бумаг) является Расчетный день, следующий за днем ее заключения;
- 46.3.5. 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;
- 46.3.6. Стоимость обратного выкупа (сумма второй сделки купли-продажи ценных бумаг) для Участника клиринга любой категории, кроме категории «К», определяется по формуле:

$$S = S_1 + S_1 * \left( \frac{R * P}{100} * \left( \frac{T_{365}}{365} + \frac{T_{366}}{366} \right) \right), \text{ где } S - \text{ стоимость обратного выкупа РЕПО (сумма второй сделки купли-продажи ценных бумаг);}$$

$S_1$  - 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;

$P$  - коэффициент, устанавливаемый решением Клирингового центра, по умолчанию;

- в случае наличия у Недобросовестного участника клиринга Итогового нетто-обязательства по денежным средствам в российских рублях  $P = 1$ ;
- в случае наличия у Недобросовестного участника клиринга Итогового нетто-обязательства по ценным бумагам  $P = 1,1$ .

$T_{365}$  - число дней между исполнением первой и второй частей сделки РЕПО, приходящихся на календарный год, состоящий из 365 (трёхсот шестидесяти пяти) дней;

$T_{366}$  - число дней между исполнением первой и второй частей сделки РЕПО, приходящихся на календарный год, состоящий из 366 (трёхсот шестидесяти шести) дней.

Стоимость обратного выкупа (сумма второй сделки купли-продажи ценных бумаг) для Участника клиринга категории «К» равна Сумме РЕПО (сумме первой сделки купли-продажи ценных бумаг).

- 46.4. Клиринговый центр устанавливает для Расчетного кода Участника клиринга, по которому учитывается Итоговое нетто-обязательство, для исполнения которого недостаточно денежных средств / для Расчетного кода, входящего в состав 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 46.6 общей части Правил клиринга, в следующих случаях:
- 46.4.1. допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов приостановлен;
  - 46.4.2. у Клирингового центра имеется 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, рынке депозитов и рынке кредитов будет приостановлен в следующий Расчетный день;
  - 46.4.3. у Клирингового центра имеется информация о прекращении проведения депозитарных операций с ценной бумагой со следующего Расчетного дня;
  - 46.4.4. приостановление / лишение статуса Держателя, по Разделу T+ торгового счета депо которого должны исполняться обязательства по Сделкам T+;
  - 46.4.5. 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 3 (третий) Расчетный день подряд;
  - 46.4.6. Итоговое нетто-обязательство по соответствующей ценной бумаге, учитываемое по одному Торгово-клиринговому счету T+, для исполнения которого недостаточно ценных бумаг, возникает у Участника клиринга 5 (пятый) Расчетный день подряд;

46.4.7. Итоговое нетто-обязательство по соответствующей ценной бумаге, учитываемое по любому Торгово-клиринговому счету T+, для исполнения которого недостаточно ценных бумаг, возникает у Участника клиринга 9 (девятый) Расчетный день подряд.

46.5. Условие, указанное в подпункте 46.4.5 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 46.11 общей части Правил клиринга.

Участник клиринга обязан предоставить Клиринговому центру документы, подтверждающие действие причин, указанных в настоящем пункте общей части Правил клиринга.

46.6. Условия закрывающих сделок купли-продажи ценных бумаг и балансирующих сделок, заключаемых в соответствии с пунктом 46.4 и/или подпунктом 46.7.2 общей части Правил клиринга, соответствуют определенным Правилами торгов на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов условиям Сделок T+, заключаемых в Секции Фондового рынка, с учетом следующих особенностей:

46.6.1. 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 денежных средствах 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;

46.6.2. 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 денежных средствах 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 T+, 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;

- 46.6.3. 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. В случае невозможности или нецелесообразности заключения закрывающей сделки / закрывающих сделок и балансирующей сделки / балансирующих сделок с одной Датой исполнения обязательств, Клиринговый центр вправе заключить указанные сделки с разными Датой исполнения обязательств;
- 46.6.4. цена закрывающей сделки купли-продажи ценных бумаг равна цене балансирующей сделки;
- 46.6.5. порядок заключения закрывающих и балансирующих сделок определен статьей 26 общей части Правил клиринга.
- 46.7. В случае если заключение закрывающих и балансирующих сделок по основаниям, предусмотренным подпунктами 46.4.1, 46.4.2 общей части Правил клиринга, в текущий Расчетный день с Датой исполнения в дату заключения сделок невозможно в соответствии с временным регламентом проведения торгов / клиринга:
- 46.7.1. в текущий Расчетный день Клиринговый центр заключает с Недобросовестным участником клиринга сделку РЕПО (две сделки купли-продажи ценных бумаг) в соответствии с пунктом 46.3 общей части Правил клиринга, и
- в следующий Расчетный день Клиринговый центр 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 46.6 общей части Правил клиринга;
- либо
- в текущий Расчетный день Клиринговый центр заключает с Недобросовестным участником 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 46.6 общей части Правил клиринга закрывающую сделку с Датой исполнения, отличной от даты текущего Расчетного дня,
- и
- начиная с текущего Расчетного дня по Расчетный день, предшествующим Дате исполнения закрывающей сделки Клиринговый центр каждый Расчетный день заключает с Недобросовестным участником клиринга сделку РЕПО (две сделки купли-продажи ценных бумаг) в соответствии с пунктом 46.3 общей части Правил клиринга.
- 46.7.2. в случае приостановления допуска к клиринговому обслуживанию на основании подпункта 15.1.1 общей части Правил клиринга или подпункта 15.1.12 общей части Правил клиринга в связи с аннулированием лицензии на осуществление профессиональной деятельности на рынке ценных бумаг, сделка (сделки) РЕПО (две сделки купли-продажи ценных бумаг) в соответствии с настоящим пунктом

закключаются со ставкой РЕПО, равной нулю, штрафы с Недобросовестного участника клиринга не взимаются.

- 46.8. После заключения закрывающих и балансирующих сделок в соответствии с пунктами 46.4, 46.7 общей части Правил клиринга Клиринговый центр снимает Режим урегулирования для Расчетного кода Участника клиринга, если отсутствуют иные основания для установления Режима урегулирования, предусмотренные Правилами клиринга.
- 46.9. Клиринговый центр вправе принять решение о заключении вместо сделки РЕПО, условия которой предусмотрены пунктом 46.3 общей части Правил клиринга, закрывающей сделки / закрывающих сделок купли-продажи ценных бумаг (за исключением клиринговых сертификатов участия) и балансирующей сделки / балансирующих сделок:
- 46.9.1. 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»;
- 46.9.2. при наличии у Клирингового центра информации о планируемом приостановлении проведения депозитарных операций с ценной бумагой.
- 46.10. Условия и порядок заключения закрывающей сделки / закрывающих сделок купли-продажи ценных бумаг и балансирующей сделки / балансирующих сделок, заключаемых на основании пункта 26.3 общей части Правил клиринга в случаях, установленных подпунктами 39.7.2, 46.4.3, 46.4.4, пунктом 46.9 общей части Правил клиринга, соответствуют условиям и порядку заключения, определенным в пункте 46.6 общей части Правил клиринга, с учетом следующих особенностей:
- 46.10.1. Код расчетов – Y0;
- 46.10.2. закрывающие сделки заключаются Клиринговым центром без подачи заявок от имени Недобросовестного участника клиринга в отношении себя лично;
- 46.10.3. балансирующие сделки заключаются Клиринговым центром без подачи заявок от имени Добросовестного участника клиринга в отношении себя лично;
- 46.10.4. балансирующие сделки заключаются с Добросовестными участниками клиринга, имеющими Итоговые нетто-требования по ценным бумагам, которых недостаточно у Недобросовестного участника клиринга (Недобросовестных участников клиринга) для исполнения их Итоговых нетто-обязательств, в объеме, пропорциональном объему Итоговых нетто-требований Добросовестных участников клиринга по ценным бумагам, учитываемых по Торгово-клиринговым счетам, с учетом округления количества ценных бумаг вниз до ближайшего целого.

Если в результате применения настоящего подпункта общей части Правил клиринга, балансирующие сделки с Добросовестными участниками клиринга будут заключены не на все количество недостающих ценных бумаг, оставшиеся ценные бумаги увеличивают количество ценных бумаг в сделке, заключаемой с указанием Торгово-клирингового счета Добросовестного участника клиринга, по которому учитывается наибольшее Итоговое нетто-требование по таким ценным бумагам. Если Торгово-клиринговых счетов с одинаковым наибольшим Итоговым нетто-требованием по таким ценным бумагам несколько, выбор Торгово-клирингового счета

Добросовестного участника клиринга, с указанием которого будут заключены сделки с количеством, увеличенным на количество оставшихся ценных бумаг, осуществляется Клиринговым центром;

46.10.5. цена сделок равна справедливой рыночной цене ценной бумаги, определенной в соответствии с Методикой определения риск-параметров фондового рынка и рынка депозитов.

46.11. 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 46.3.6 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.

46.12. 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, установленной в размере, меньшем (по модулю), чем предусмотрено пунктом 46.3.6 общей части Правил клиринга, или равной нулю, при наличии обстоятельств, не указанных в пункте 46.11 общей части Правил клиринга, не зависящих от Участника клиринга и свидетельствующих об отсутствии вины такого Участника клиринга.

- 46.13. В случае приостановления / лишения статуса 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 приостановления/лишения статуса Держателя.
- 46.13.1. Обязательства по Сделкам Т+, в отношении которых Клиринговым центром принято решение в соответствии с пунктом 46.13 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 42 общей части Правил клиринга.
- 46.14. 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 47. Порядок заключения и условия сделок своп с иностранной валютой / драгоценным металлом, заключаемых с Добросовестным участником клиринга**

- 47.1. 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 44.9.4 общей части Правил клиринга. Условия сделок своп с иностранной валютой / драгоценным металлом соответствуют определенным Правилами торгов на валютном рынке условиям сделок своп с учетом следующих особенностей:
- 47.1.1. 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;
- 47.1.2. Датой исполнения обязательств по первой части сделки своп является день ее заключения;
- 47.1.3. 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;
- 47.1.4. Базовый курс сделки своп устанавливается равным Центральному курсу, определенному во Время расчета риск-параметров текущего Расчетного дня;
- 47.1.5. Цена сделки своп определяется по формуле, указанной в подпункте 45.1.7 общей части Правил клиринга.

47.2. Выбор Добросовестных участников клиринга, с которыми заключаются сделки свои в соответствии с настоящей статьей общей части Правил клиринга, выбор Торгово-клиринговых счетов Участника клиринга, с указанием которых заключаются указанные сделки, а также определение суммы денежных средств в иностранной валюте / количества драгоценного металла, в отношении которых заключаются указанные сделки, осуществляется Клиринговым центром.

Клиринговый центр, осуществляя указанный выбор, может принимать во внимание категорию Добросовестного Участника клиринга, а также иные обстоятельства, имеющие значение.

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

48.1. Сделки РЕПО Клирингового центра заключаются между Клиринговым центром и Участником клиринга в случае, установленном пунктом 44.9 общей части Правил клиринга.

48.2. Предметом Сделок РЕПО Клирингового центра могут являться ценные бумаги, с которыми возможно заключение Сделок Т+ (далее в настоящей статье – Ценные бумаги).

48.3. Сделки РЕПО Клирингового центра заключаются в порядке и на условиях, установленных настоящей статьей общей части Правил клиринга.

48.4. Клиринговый центр на основании пункта 3.20 общей части Правил клиринга вправе заключить Сделки РЕПО Клирингового центра на основании безадресных заявок с Участником клиринга любой категории, кроме категории «К», подавшим заявку, являющуюся допустимой встречной к заявке Клирингового центра.

Условия Сделки РЕПО Клирингового центра соответствуют условиям сделок РЕПО, заключаемых в Режиме торгов «РЕПО с ЦК - Урегулирование», с учетом особенностей, установленных пунктом 48.7 общей части Правил клиринга.

48.5. В случае незаключения Сделок РЕПО Клирингового центра в соответствии с пунктом 48.4 общей части Правил клиринга, Клиринговый центр вправе без подачи заявок заключить Сделку РЕПО Клирингового центра:

- а) с любым Участником клиринга категории «О», «Б» или «Б2», допущенным к клиринговому обслуживанию на фондовом рынке и рынке депозитов, за исключением Участников клиринга, являющихся Участниками торгов только на рынке депозитов, с использованием любого Торгово-клирингового счета Т+, в состав которого входит Раздел Т+, открытый на торговом счете депо владельца Участника клиринга в Расчетном депозитарии;



- б) с Участником клиринга категории «О», «Б» или «Б2», допущенным к клиринговому обслуживанию на фондовом рынке и рынке депозитов, предоставившим Клиринговому центру запрос на изменение параметров Торгово-клирингового счета, с указанием заключать Сделки РЕПО Клирингового центра, с использованием Торгово-клиринговых счетов Т+, указанных в таком запросе.

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.

- 48.5.1. Выбор Участника клиринга, с которым, в случае необходимости, заключается Сделка РЕПО Клирингового центра, и выбор Торгово-клирингового счета Т+ Участника клиринга, с указанием которого заключается Сделка РЕПО Клирингового центра, а также определение количества ценных бумаг, в отношении которых заключается Сделка РЕПО Клирингового центра, осуществляется Клиринговым центром. Клиринговый центр, осуществляя указанный выбор, может принимать во внимание категорию Участника клиринга, а также иные обстоятельства, имеющие значение.
- 48.5.2. Условия Сделки РЕПО Клирингового центра соответствуют условиям сделок РЕПО, заключаемых в Режиме торгов «РЕПО с ЦК – Адресные заявки», с учетом особенностей, установленных пунктом 48.7 общей части Правил клиринга.
- 48.6. 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.
- 48.7. Особенности условий Сделки РЕПО Клирингового центра:
- 48.7.1. Продавцом по первой части Сделки РЕПО Клирингового центра является Участник клиринга, покупателем – Клиринговый центр.
- 48.7.2. 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;
- 48.7.3. 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;
- 48.7.4. срок Сделки РЕПО Клирингового центра составляет 1 (один) Расчетный день;
- 48.7.5. 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;

- 48.7.6. 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;
- 48.7.7. 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, рынке депозитов и рынке кредитов. Иной Доход Клиринговый центр передает Участнику клиринга в течение 10 (десяти) Расчетных дней, следующих за днем получения Клиринговым центром такого Дохода.
- 48.8. Клиринговый центр заключает Сделки РЕПО Клирингового центра с Участниками клиринга при условии, что на Разделе Т+, входящем в состав соответствующего Торгово-клирингового счета Т+ Участника клиринга, учитываются ценные бумаги, недостающие у Клирингового центра для исполнения Итоговых нетто-требований Добросовестных участников клиринга.
- 48.9. 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 42 общей части Правил клиринга.
- 48.10. 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, рынке депозитов и рынке кредитов. Указанный отчет является документом, удостоверяющим передачу Ценных бумаг Участником клиринга Клиринговому центру / Клиринговым центром Участнику клиринга.

**Статья 49. Порядок заключения и условия сделок РЕПО и сделок купли-продажи ценных бумаг, заключаемых с Добросовестным участником клиринга**

- 49.1. 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 44.9.6 общей части Правил клиринга. Условия сделок РЕПО (двух сделок купли-продажи ценных бумаг) соответствуют определенным Правилами торгов на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов 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:
- 49.1.1. 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;

49.1.2. Датой исполнения обязательств по первой части сделки РЕПО (первой сделке купли-продажи ценных бумаг) является день ее заключения;

49.1.3. Датой исполнения обязательств по второй части сделки РЕПО (второй сделке купли-продажи ценных бумаг) является Расчетный день, следующий за днем ее заключения;

49.1.4. 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;

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

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

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

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

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

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

Разница между суммой первой и второй части сделки РЕПО (между суммой первой и второй сделки купли-продажи) уплачивается в пользу Добросовестного участника клиринга.

49.2. Выбор Добросовестных участников клиринга, с которыми заключаются сделки РЕПО (две сделки купли-продажи ценных бумаг) в соответствии с настоящей статьей общей части Правил клиринга, выбор Торгово-клиринговых счетов Участника клиринга, с указанием которых заключаются указанные сделки, а также определение количества ценных бумаг, в отношении которых заключаются указанные сделки, осуществляется Клиринговым центром. Клиринговый центр, осуществляя указанный выбор, может принимать во внимание категорию Участника клиринга, а также иные обстоятельства, имеющие значение.

49.3. 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 50. Порядок использования и возмещения Гарантийных фондов и иных средств в целях погашения Задолженностей Участников клиринга (процедура кросс-дефолта)**

50.1. Настоящая статья общей части Правил клиринга применяется при наличии у Участника клиринга Задолженности, учитываемой по Расчетному коду, в следующих случаях:

50.1.1. Если у Участника клиринга по такому Расчетному коду учитывается Маржинальное требование, не исполненное в срок, установленный Правилами клиринга,

или

50.1.2. Если Задолженность в соответствующей валюте, 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, Задолженность, возникшая по итогам первого Расчетного дня, не была погашена Участником клиринга в срок, установленный Правилами клиринга, и по итогам второго Расчетного дня Задолженность в такой валюте, учитываемая по такому Расчетному коду, также является непогашенной.

50.2. Настоящая статья общей части Правил клиринга также применяется при неисполнении / ненадлежащем исполнении Провайдером ликвидности обязательств перед Клиринговым центром.

50.3. В случае если Расчетный код, по которому учитывается Задолженность, является Расчетным кодом Единого пула, и настоящая статья общей части Правил клиринга применяется в случае, указанном в подпункте 50.1.1 общей части Правил клиринга, индивидуальное клиринговое, коллективное клиринговое и иное обеспечение Недобросовестного участника клиринга, в том числе Обеспечение под стресс и взнос в Гарантийный фонд, используется, в первую очередь, на том Рынке, на котором возникло Маржинальное требование, а выделенный капитал центрального контрагента и средства Гарантийных фондов из взносов Добросовестных участников клиринга используются на том Рынке, на котором возникла Задолженность (с учетом пункта 50.7 общей части Правил клиринга).

В случае если Расчетный код, по которому учитывается Задолженность, не является Расчетным кодом Единого пула, и настоящая статья общей части Правил клиринга применяется в случае, указанном в подпункте 50.1.2 общей части Правил клиринга, индивидуальное клиринговое и иное обеспечение Недобросовестного участника клиринга, в том числе Обеспечение под стресс и взнос в Гарантийный фонд, используется, в первую очередь, на том Рынке, на котором возникла Задолженность, а выделенный капитал центрального контрагента и средства Гарантийных фондов из взносов Добросовестных участников клиринга используются на том Рынке, на котором возникла Задолженность.

50.4. 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 Рынке, на котором возникло Маржинальное требование / 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 возникло Маржинальное требование / Задолженность, является фондовый рынок;
- 2) свободное Обеспечение Недобросовестного участника клиринга (за исключением клиринговых сертификатов участия) на другом 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 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 14.32 общей части Правил клиринга);
- 4) Обеспечение Недобросовестного участника клиринга на Рынке, на котором возникло Маржинальное требование / 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 возникло Маржинальное требование / Задолженность, является фондовый рынок);

- 5) Обеспечение Недобросовестного участника клиринга на другом 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 Рынков в очередности по выбору Клирингового центра;

- 6) Обеспечение под стресс Недобросовестного участника клиринга на Рынке, на котором возникло Маржинальное требование / Задолженность;
- 7) взнос Недобросовестного участника клиринга в Гарантийный фонд Рынка, на котором возникло Маржинальное требование / Задолженность, или взнос ПАО Московская Биржа в Гарантийный фонд валютного рынка и рынка драгоценных металлов в размере, равном минимальному размеру вноса в Гарантийный фонд валютного рынка и рынка драгоценных металлов Участников клиринга категорий «Б», «Б2» 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 и / или Внебиржевым сделкам с драгоценным металлом);
- 8) Обеспечение под стресс Недобросовестного участника клиринга на другом Рынке по выбору Клирингового центра;
- 9) взнос Недобросовестного участника клиринга в Гарантийный фонд другого Рынка, на котором было использовано Обеспечение под стресс Недобросовестного участника клиринга;

Действия, предусмотренные подпунктами 8)-9), последовательно повторяются Клиринговым центром для всех Рынков в очередности по выбору Клирингового центра;

- 10) выделенный капитал центрального контрагента, установленный для Рынка, на котором возникло Маржинальное требование / Задолженность / выделенный капитал центрального контрагента, установленный для валютного рынка и рынка драгоценных металлов, если неисполнение обязательств было допущено Провайдером ликвидности;

- 11) дополнительный выделенный капитал центрального контрагента, установленный для всех Рынков (используется по решению Клирингового центра);
  - 12) взносы Добросовестных участников клиринга в Гарантийный фонд Рынка, на котором возникло Маржинальное требование / Задолженность, и взнос ПАО Московская Биржа в Гарантийный фонд валютного рынка и рынка драгоценных металлов (если таким Рынком является валютный рынок и рынок драгоценных металлов);
  - 13) взнос ПАО Московская Биржа в Гарантийный фонд Рынка, на котором возникло Маржинальное требование / Задолженность, вносимый по требованию Клирингового центра.
- 50.5. 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.
- 50.6. В случае недостаточности Обеспечения, имущества из имущественного пула, Обеспечения под стресс Недобросовестного участника клиринга, взносов Недобросовестного участника клиринга в Гарантийный фонд для погашения Задолженности Участника клиринга / исполнения обязательства Провайдера ликвидности, используемого в рамках соответствующей очереди, предусмотренной пунктом 50.4 общей части Правил клиринга, Клиринговый центр использует денежные средства / драгоценные металлы / ценные бумаги, которые уже не принимаются в качестве обеспечения, но при этом учитываются на тех же Счетах обеспечения / Счетах обеспечения нерезидентов / Счетах гарантийных фондов / Счетах обеспечения под стресс / Разделах, что используемое в рамках текущей очереди Обеспечение, имущество из имущественного пула, Обеспечение под стресс Недобросовестного участника клиринга, взнос Недобросовестного участника клиринга в Гарантийный фонд.
- 50.7. Выделенный капитал центрального контрагента, дополнительный выделенный капитал центрального контрагента, взносы Добросовестных участников клиринга в Гарантийный фонд, взнос ПАО Московская Биржа в Гарантийный фонд не используются для погашения Задолженности по уплате налога.
- 50.8. Взносы в Гарантийные фонды и иные средства Участников клиринга каждой очереди, указанной в пункте 50.4 общей части Правил клиринга, а в рамках каждой указанной очереди – для каждого 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;

б) товары.

- 50.9. Использование средств Гарантийных фондов и иных средств следующей очереди в соответствии с настоящей статьей общей части Правил клиринга осуществляется в случае, если Задолженность Участника клиринга / неисполненные обязательства Провайдера ликвидности не погашена при использовании средств предыдущей очереди.
- 50.10. Обеспечение Недобросовестного участника в российских рублях используется для погашения его Задолженности при условии отсутствия Маржинального требования по Расчетному коду, открытому для соответствующего Рынка, и в объеме, не приводящем к возникновению Маржинального требования по такому Расчетному коду и/или Задолженности в российских рублях по такому Расчетному коду.
- 50.11. 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 для соответствующего 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.
- 50.12. Имущество из имущественного пула используется при соблюдении условий погашения клиринговых сертификатов участия при выдаче имущества из имущественного пула, установленных Правилами клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.
- 50.13. 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 14.32 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.

- 50.14. 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 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 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, рынке депозитов и рынке кредитов (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 Рынке, на котором возникло Маржинальное требование / Задолженность, затем – на других Рынках (по выбору Клирингового центра).

Порядок заключения закрывающих и балансирующих сделок определен статьей 26 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).

- 50.15. Если после совершения действий, указанных в пункте 50.14 общей части Правил клиринга, Задолженность Участника клиринга не погашена, Клиринговый центр устанавливает для всех Расчетных кодов Участника клиринга на Рынке, на котором возникло Маржинальное требование / 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 Рынке, на котором возникло Маржинальное требование / Задолженность, и заключает балансирующие сделки.

Порядок заключения закрывающих и балансирующих сделок определен статьей 26 общей части Правил клиринга.

После заключения сделок в соответствии с настоящим пунктом общей части Правил клиринга Обеспечение под стресс Недобросовестного участника клиринга на Рынке, на котором возникло Маржинальное требование / Задолженность, а затем взнос Недобросовестного участника клиринга в Гарантийный фонд Рынка, на котором

возникло Маржинальное требование / Задолженность, в том числе в части, превышающей минимальный размер взноса в Гарантийный фонд на таком Рынке, используются для погашения его Задолженности.

- 50.16. Если после использования Обеспечения под стресс Недобросовестного участника клиринга на Рынке, на котором возникло Маржинальное требование / Задолженность, и взноса Недобросовестного участника клиринга в Гарантийный фонд Рынка, на котором возникло Маржинальное требование / Задолженность, Задолженность Участника клиринга не погашена, Клиринговый центр устанавливает для всех Расчетных кодов Участника клиринга на другом 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 Рынке, и заключает балансирующие сделки.

Порядок заключения закрывающих и балансирующих сделок определен статьей 26 общей части Правил клиринга.

После заключения сделок в соответствии с настоящим пунктом общей части Правил клиринга Обеспечение под стресс Недобросовестного участника клиринга на таком Рынке, а затем взнос Недобросовестного участника клиринга в Гарантийный фонд на таком Рынке, в том числе в части, превышающей минимальный размер взноса в Гарантийный фонд на таком Рынке, используются для погашения его Задолженности.

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

- 50.17. Если после совершения действий, указанных в пункте 50.16 общей части Правил клиринга, Задолженность Участника клиринга не погашена, действия, указанные в пункте 50.16 общей части Правил клиринга, совершаются в отношении Недобросовестного участника клиринга на другом Рынке.
- 50.18. 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 50.14-50.16 общей части Правил клиринга без специального полномочия (доверенности), а также без согласия Участника клиринга.
- 50.19. При использовании взноса Недобросовестного участника клиринга в Гарантийный фонд Рынка и/или Обеспечения под стресс на Рынке, к Участнику клиринга применяются меры, предусмотренные соответствующей специальной частью Правил клиринга.
- 50.20. 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.

- 50.20.1. В случае использования вклада 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 вклада 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.

- 50.21. Взносы в Гарантийный фонд Добросовестных участников клиринга на соответствующем Рынке, в том числе в части, превышающей минимальный размер вклада в Гарантийный фонд на таком Рынке, и взнос ПАО Московская Биржа в Гарантийный фонд валютного рынка и рынка драгоценных металлов (если таким Рынком является валютный рынок и рынок драгоценных металлов), используются в случае, если сумма Задолженностей, уменьшенных на размер Задолженностей по налогам, Недобросовестных участников клиринга и неисполненных обязательств Провайдеров ликвидности перед Клиринговым центром на таком Рынке превышает размер текущего выделенного капитала Клирингового центра для такого Рынка, и размер текущего дополнительного выделенного капитала центрального контрагента, установленного для всех Рынков и использованного для такого Рынка, на котором возникло Маржинальное требование / Задолженность / неисполнение обязательств Провайдером ликвидности.
- 50.22. Взносы Добросовестных участников клиринга в Гарантийный фонд соответствующего Рынка и взнос ПАО Московская Биржа в Гарантийный фонд валютного рынка и рынка драгоценных металлов (если таким Рынком является валютный рынок и рынок драгоценных металлов), используются в равных долях, если иное не установлено соответствующей специальной частью Правил клиринга.
- 50.23. В случае возникновения нескольких Маржинальных требований / Задолженностей одного или нескольких Недобросовестных участников клиринга на нескольких Рынках, взнос Недобросовестного участника клиринга в Гарантийный фонд Рынка / Обеспечение под стресс Недобросовестного Участника клиринга на Рынке используется, в первую очередь, для погашения Задолженности Участника клиринга, возникшей на Рынке, на котором возникло Маржинальное требование / Задолженность, во вторую очередь – Задолженностей, возникших на других Рынках.
- 50.24. 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 (с учетом положения пункта 50.7 общей части Правил клиринга) / неисполненным обязательствам Провайдера ликвидности путем передачи денежных средств в

российских рублях, учитываемых в качестве Обеспечения Недобросовестного участника на соответствующем Рынке / вноса Недобросовестного участника клиринга в Гарантийный фонд соответствующего Рынка / Обеспечения под стресс Недобросовестного участника клиринга на соответствующем Рынке / имущества из имущественного пула Недобросовестного участника клиринга / вноса Добросовестного участника клиринга / ПАО Московская Биржа в Гарантийный фонд, Клиринговому центру в счет погашения Задолженности Недобросовестного участника клиринга.

50.25. 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 (с учетом положения пункта 50.7 общей части Правил клиринга) путем:

- 1) продажи указанной иностранной валюты / ценных бумаг / драгоценных металлов / товаров Недобросовестного участника клиринга в объеме, необходимом для погашения указанной Задолженности (с учетом положения пункта 50.7 общей части Правил клиринга), 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 (с учетом положения пункта 50.7 общей части Правил клиринга) в случае невозможности продажи указанных активов Недобросовестного участника клиринга или в случае использования взносов в Гарантийный фонд Добросовестных участников клиринга.

При этом сумма денежных средств в иностранной валюте / количество драгоценных металлов, подлежащие передаче Клиринговому центру из Обеспечения Участника клиринга на соответствующем Рынке / вноса Участника клиринга в Гарантийный фонд соответствующего Рынка / Обеспечения под стресс Участника клиринга на соответствующем 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.

- 50.25.1. 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.
- 50.25.2. Удовлетворение требований за счет Обеспечения / вноса в Гарантийный фонд / Обеспечения под стресс / имущества из имущественного пула Участника клиринга осуществляется Клиринговым центром без предварительного уведомления такого Участника клиринга.
- 50.25.3. 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, 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 / Обеспечения под стресс Недобросовестного участника клиринга / вноса Участника клиринга в Гарантийный фонд.
- 50.26. 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, рынке депозитов и рынке кредитов.
- 50.27. В случае необходимости использования драгоценных металлов, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга / имущества в имущественном пуле, Клиринговый центр списывает соответствующий драгоценный металл с торгового банковского счета Участника клиринга в таком драгоценном металле.
- 50.28. 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.
- 50.29. После передачи Клиринговому центру иностранной валюты / ценных бумаг из взносов в Гарантийный фонд Добросовестных участников клиринга в счет погашения Задолженности Недобросовестного участника клиринга Клиринговый

центр продает всю полученную иностранную валюту и все полученные ценные бумаги на биржевых торгах ПАО Московская Биржа путем подачи безадресных заявок.

- 50.29.1. Положительная разность между общей стоимостью в российских рублях всех проданных Клиринговым центром иностранной валюты и ценных бумаг, переданных Клиринговому центру из взносов в Гарантийный фонд Добросовестных участников клиринга в счет погашения Задолженности Недобросовестного участника клиринга, и их стоимостью, по которой они были переданы Клиринговому центру в счет погашения Задолженности Недобросовестного участника клиринга, передается Добросовестным участникам клиринга пропорционально стоимости в российских рублях иностранной валюты / ценных бумаг, использованных из взноса каждого Добросовестного участника клиринга, рассчитанной в момент их передачи Клиринговому центру.

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 взносов в Гарантийные фонды увеличиваются на сумму переданных денежных средств.

- 50.30. 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 Расчетного дня, следующего за датой использования Гарантийного фонда соответствующего Рынка.

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

- 50.31. После возмещения Недобросовестным участником клиринга использованных средств Гарантийного фонда из взносов Добросовестных участников клиринга / взноса ПАО Московская Биржа, 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 Рынка, осуществляется частичное возмещение таких взносов в размере, пропорциональном сумме использованных средств Гарантийного фонда соответствующего 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.

50.31.1. 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.

50.32. 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 Рынков и/или Обеспечение под стресс на соответствующих Рынках в установленном Клиринговым центром размере.

50.33. В случае использования взносов Добросовестных участников клиринга в Гарантийный фонд соответствующего 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 Рынка до размера, установленного Клиринговым центром.

Указанная обязанность по восполнению взноса в Гарантийный фонд соответствующего 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 51. Порядок действий, направленных на исполнение обязательств Участника торгов перед Участником клиринга**

51.1. 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.

51.1.1. Запрос на заключение сделки за счет Участника торгов / клиента Участника торгов предоставляется с использованием Клиринговой системы в период проведения Торговой сессии на соответствующем Рынке.

51.1.2. Подача указанного запроса является согласием Участника клиринга на заключение Клиринговым центром Сделки на условиях, указанных в запросе.

51.1.3. Подача указанного запроса является заверением Участника клиринга в адрес Клирингового центра о наличии действующего между Участником клиринга и Участником торгов соглашения, предоставляющего право Участнику клиринга подавать указанный запрос на заключение сделок за счет Участника торгов / клиента Участника торгов.

51.1.4. 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 Рынка, а также условиями, указанными в заявке, поданной Клиринговым центром.

51.2. 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.

51.2.1. 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 Рынке.

51.2.2. На основании Запроса на проверку достаточности обеспечения по клиринговому регистру 2-го уровня Клиринговый центр осуществляет проверку достаточности обеспечения для всех заявок / Котировок участника торгов при наличии зарегистрированной заявки, являющейся допустимой встречной к Котировке участника торгов, поданных с указанием такого клирингового регистра 2-го и/или клиринговых регистров 3-го уровня, соответствующих такому клиринговому регистру 2-го уровня.

51.2.3. На основании Запроса на проверку достаточности обеспечения по клиринговому регистру 3-го уровня Клиринговый центр осуществляет проверку достаточности обеспечения для всех заявок / Котировок участника торгов при наличии зарегистрированной заявки, являющейся допустимой встречной к Котировке участника торгов, поданных с указанием клирингового регистра 3-го уровня.

51.2.4. Проверка достаточности обеспечения осуществляется Клиринговым центром в соответствии с порядком, установленным соответствующей специальной частью Правил клиринга.

51.2.5. 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 / Котировок 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 / Котировок участника торгов, 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 52. Порядок взаимодействия с Расчетной организацией, в которой открыты торговые или клиринговые банковские счета для учета денежных средств**

- 52.1. Клиринговый центр взаимодействует с Расчетной организацией по клиринговым банковским счетам в соответствии с условиями договора банковского счета.
- 52.2. 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.
- 52.3. 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.
- 52.4. Клиринговый центр соглашается с проведением любых операций зачисления на торговый банковский счет на основании распоряжений лица, которому открыт такой торговый банковский счет.
- 52.5. В случае обращения взыскания или наложения ареста на имущество Участника клиринга, находящееся на торговом банковском счете и/или на клиринговом банковском счете:
- 52.5.1. Расчетная организация незамедлительно передает информацию об обращении взыскания или наложении ареста Клиринговому центру.
- 52.5.2. 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 каждому торговому банковскому счету, в отношении которого наложен арест / обращено взыскание;
  - устанавливает ограничение на списание и иное использование денежных средств, учитываемых по каждому собственному Расчетному коду Участника клиринга, по которому 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, за исключением использования денежных средств для исполнения (прекращения) обязательств, допущенных к клирингу, не позднее дня, следующего за днем, когда Клиринговый центр получил от Расчетной организации информацию об обращении взыскания или наложении 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.

52.5.3. 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.

52.5.4. 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.

52.5.5. 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, рынке депозитов и рынке кредитов.

**Статья 53. Порядок действий в случае обращения взыскания или наложения ареста на имущество Участника клиринга, находящееся на торговом банковском счете в драгоценном металле**

53.1. 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 каждом торговом банковском счете, в отношении которого наложен арест / обращено взыскание, в количестве, указанном в документе, являющемся основанием для обращения взыскания и/или наложения ареста, за исключением использования драгоценных металлов для исполнения (прекращения) обязательств, допущенных к клирингу, не позднее дня, следующего за днем, когда Клиринговый центр получил документ, являющийся 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.

53.1.1. 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.

#### **Статья 54. Порядок взаимодействия с Расчетным депозитарием и иными депозитариями**

- 54.1. 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.
- 54.2. Списание ценных бумаг с Разделов осуществляется на основании распоряжений Клирингового центра или на основании распоряжений лица, которому открыт такой торговый счет депо / эмиссионный счет с согласия Клирингового центра.
  - 54.2.1. Учет ценных бумаг, принадлежащих Участнику клиринга на праве собственности и переданных Участником клиринга в качестве взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс / Обеспечения под риски концентрации на эмитентов, 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.
  - 54.2.2. Списание / зачисление ценных бумаг с субсчетов / на субсчета депо осуществляется на основании распоряжений Клирингового центра.
  - 54.2.3. Доходы и иные выплаты, причитающиеся Участникам клиринга по ценным бумагам, учитываемые на субсчетах депо, перечисляются в качестве взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс / Обеспечения под риски концентрации на эмитентов, 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 / Обеспечения под риски концентрации на эмитентов в соответствии с настоящим подпунктом общей части Правил клиринга, учитываются как средства Участника клиринга, зачисленные на соответствующий клиринговый счет Клирингового центра.
- 54.3. Клиринговый центр соглашается с проведением любых операций зачисления на Разделы на основании распоряжений лица, которому открыт такой торговый счет депо / эмиссионный счет / счет брокера.

- 54.4. 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.
- 54.5. 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, Обеспечения под стресс, Обеспечения под риски концентрации на эмитентов 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.
- 54.6. Каждый Расчетный день до начала торгов на фондовом рынке Расчетный депозитарий передает Клиринговому центру список Разделов / субсчетов депо и выписку по Разделам / субсчетам депо.
- 54.7. 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.
- 54.8. 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 T0 / Торгово-клиринговым счетам T+.
- 54.9. В случае необходимости в ходе Торгов списания ценных бумаг с Раздела на основании распоряжения лица, которому открыт торговый счет депо, Расчетный депозитарий направляет Клиринговому центру запрос согласия Клирингового центра на списание ценных бумаг с Разделов.

Расчетный депозитарий вправе указать в запросе согласия Клирингового центра на списание ценных бумаг с Разделов признак возможности частичного исполнения.

Клиринговый центр дает согласие на списание ценных бумаг (за исключением клиринговых сертификатов участия) с Раздела T+ при соблюдении условий возврата ценных бумаг, установленных пунктом 30.17 общей части Правил клиринга.

Клиринговый центр дает согласие на списание клиринговых сертификатов участия при соблюдении условий, установленных Правилами клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.

Клиринговый центр дает согласие на списание ценных бумаг с Разделов Т0 при соблюдении условий возврата ценных бумаг, установленных подпунктом 30.17.1 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 или определенное в соответствии с подпунктом 30.16 общей части Правил клиринга.

- 54.10. Порядок проведения расчетов по ценным бумагам установлен Правилами клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.
- 54.11. 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.

- 54.12. В случае обращения взыскания или наложения ареста на имущество Участника клиринга, находящееся на торговом счете депо и/или на клиринговом счете депо:
- 54.12.1. Расчетный депозитарий незамедлительно передает информацию об обращении взыскания или наложении ареста Клиринговому центру.
- 54.12.2. 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 каждого из указанных счетов в количестве ценных бумаг, указанном в документе, являющемся основанием для обращения взыскания и/или наложения ареста, за исключением использования ценных бумаг для исполнения (прекращения) обязательств, допущенных к клирингу, не позднее рабочего дня, следующего за днем, когда Клиринговый центр получил от Расчетного депозитария информацию об обращении взыскания или наложении 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.

54.12.3. Клиринговый центр:

- 1) не позднее рабочего 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 54.13 общей части Правил клиринга.

54.13. В случае обращения взыскания / наложения ареста на клиринговые сертификаты участия Участника клиринга Клиринговый центр не позднее рабочего дня, следующего за днем получения Клиринговым центром копии исполнительных документов:

54.13.1. выводит из имущественного пула денежные средства и/или продает из имущественного пула ценные бумаги, драгоценные металлы 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 T+, входящему в состав Торгово-клирингового счета T+ Участника клиринга, соответствующего Торгово-клирингового счета имущественного пула;

54.13.2. 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;

54.13.3. 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 55. Общий порядок оплаты услуг Клирингового центра, Биржи Технического центра, а также порядок начисления и выплаты процентов на денежные средства, составляющие индивидуальное или коллективное клиринговое обеспечение**

55.1. Клиринговый центр 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 за организацию торгов / биржевой сбор в пользу Биржи;
- абонентскую плату / плату за абонентское обслуживание в пользу Биржи;
- следующие виды вознаграждений в пользу Технического центра (далее совместно - плата за услуги интегрированного технологического сервиса и оказание иных технологических и/или информационных услуг):
  - плату за регистрацию идентификаторов технического доступа и Абонентскую плату за услуги ИТС в соответствии с Условиями предоставления интегрированного технологического сервиса ПАО Московская Биржа в пользу Технического центра;
  - вознаграждение за технологические услуги, связанные с получением и использованием электронной подписи в соответствии с Условиями участия в системе электронного документооборота ПАО Московская Биржа в пользу Технического центра;
  - плату за оказание технологических услуг в соответствии с Правилами оказания услуг в области информационных технологий в Зоне колокации ПАО Московская Биржа, связанные с размещением оборудования клиентов в Зоне колокации ПАО Московская Биржа в пользу Технического центра;
  - плату за оказание технологических и(или) информационных услуг в соответствии с Условиями оказания услуг информационно-технического обеспечения ПАО Московская Биржа в пользу Технического центра;
- предусмотренные специальными частями Правил клиринга дополнительные сборы и вознаграждения в пользу Технического центра;
- комиссионное вознаграждение за клиринговые услуги по открытию и ведению клиринговых регистров 3-го уровня в пользу Клирингового центра;
- комиссионное вознаграждение за клиринговые услуги по регистрации Счетов для возврата обеспечения;
- комиссионное вознаграждение за клиринговые услуги по обработке Запроса на возврат обеспечения;
- комиссионное вознаграждение за клиринговые услуги по обработке Постоянного поручения на возврат обеспечения;

- иные виды комиссионных вознаграждений в пользу указанных или иных лиц, предусмотренные специальными частями Правил клиринга.
- 55.2. 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.
- 55.3. 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 (далее – Тарифы Биржи), на основании договора, заключенного с Биржей.
- 55.4. Плата за регистрацию идентификаторов технического доступа, Абонентская плата за услуги ИТС в соответствии с Условиями предоставления интегрированного технологического сервиса ПАО Московская Биржа, вознаграждение за технологические услуги, связанные с получением и использованием электронной подписи в соответствии с Условиями участия в системе электронного документооборота ПАО Московская Биржа, плата за оказание технологических услуг в соответствии с Правилами оказания услуг в области информационных технологий в Зоне колокации ПАО Московская Биржа, связанные с размещением оборудования клиентов в Зоне колокации ПАО Московская Биржа, плата за оказание технологических и(или) информационных услуг в соответствии с Условиями оказания услуг информационно-технического обеспечения ПАО Московская Биржа взимаются Клиринговым центром на основании договора, заключенного с Техническим центром.
- Дополнительные сборы и вознаграждения в пользу Технического центра рассчитываются и взимаются Клиринговым центром в соответствии с действующими документами Технического центра, определяющими размер вознаграждений Технического центра, на основании договора, заключенного с Техническим центром.
- Плата, вознаграждения и сборы в пользу Технического центра, перечисленные в настоящем пункте общей части Правил клиринга, далее именуются вознаграждением Технического центра.
- 55.5. Участник клиринга исполняет обязательства по уплате комиссионных вознаграждений Биржи, Клирингового центра и вознаграждения Технического центра за Участника торгов, не совпадающего в одном лице с Участником клиринга и имеющего право подавать заявки / Котировки участника торгов с указанием клиринговых регистров 2-го и/или 3-го уровня, соответствующих Расчетным кодам данного Участника клиринга.
- 55.6. Участник клиринга вправе указать Клиринговому центру Идентификатор и наименование Участника торгов, не совпадающего в одном лице с Участником клиринга, в целях списания с указанного в заявлении Расчетного кода подлежащей уплате данным Участником торгов платы за услуги интегрированного



- технологического сервиса и оказание иных технологических и/или информационных услуг.
- 55.7. Комиссионное вознаграждение Биржи взимается с Участника клиринга, являющегося Участником торгов, или с Участника клиринга, исполняющего указанные обязательства за Участника торгов в соответствии с пунктом 55.5 общей части Правил клиринга или в соответствии со специальной частью Правил клиринга.
- 55.8. 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 55.5 общей части Правил клиринга или в соответствии со специальной частью Правил клиринга.
- 55.9. Обязательства по уплате комиссионных вознаграждений Клирингового центра, Биржи и вознаграждений Технического центра, в том числе учитываемых на Расчетных кодах нерезидента, исполняются в российских рублях.
- 55.9.1. 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.
- 55.10. 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 56.2-56.3 общей части Правил клиринга и специальными частями Правил клиринга;
  - комиссионного вознаграждения по тарифному плану «Размещения-фиксированный»;
  - дополнительных сборов и вознаграждений в пользу Технического центра (в случаях, установленных Правилами клиринга);
  - платы за услуги интегрированного технологического сервиса и оказание иных технологических и/или информационных услуг;
  - комиссионного вознаграждения Биржи по сделкам, клиринг по которым осуществляет иная клиринговая организация;
  - комиссионного вознаграждения за учет индивидуального клирингового и иного обеспечения (для всех категорий Участников клиринга), рассчитанного по Счетам гарантийных фондов, Счетам обеспечения под стресс, Счетам обеспечения, соответствующим Расчетному коду для учета Обеспечения под риски концентрации на эмитентов, и комиссионного вознаграждения за учет индивидуального клирингового и иного обеспечения (для отдельных категорий Участников клиринга);

- комиссионного вознаграждения за клиринговые услуги по открытию и ведению клиринговых регистров 3-го уровня (в случаях, установленных Правилами клиринга);
- комиссионного вознаграждения за клиринговые услуги по регистрации Счетов для возврата обеспечения;
- комиссионного вознаграждения за клиринговые услуги по обработке Запроса на возврат обеспечения;
- комиссионного вознаграждения за клиринговые услуги по обработке Постоянного поручения на возврат обеспечения;
- 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.

55.10.1. 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 (для всех категорий Участников клиринга);
- 3) признак, означающий, что с основного Расчетного кода для списания комиссионных вознаграждений, указанного в таком запросе, необходимо удерживать штраф за ненадлежащее исполнение денежных обязательств.

55.11. Участник клиринга вправе предоставить Клиринговому центру Запрос на изменение Расчетного кода для списания комиссионных вознаграждений, 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.

Расчетным кодом для списания комиссионных вознаграждений не может являться Расчетный код для учета взносов в Гарантийные фонды, Расчетный код для учета Обеспечения под риски концентрации на эмитентов, Расчетный код для учета Обеспечения под стресс, Расчетный код имущественного пула.

- 55.11.1. Специальными частями Правил клиринга может быть предусмотрена возможность выбора Участником клиринга Расчетного кода для списания комиссионных вознаграждений за совершение отдельных клиринговых операций, предусмотренных специальными частями Правил клиринга.
- 55.12. Запрос о выборе основного Расчетного кода для списания комиссионных вознаграждений и Запрос на изменение Расчетного кода для списания комиссионных вознаграждений действует, начиная с Расчетного дня, следующего за днем его предоставления.
- 55.13. 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 Расчетного кода для списания комиссионных вознаграждений для Расчетного кода Участника клиринга, входящего в состав / соответствующего Торгово-клиринговому счету, указанному в заявке на заключение Сделки / Котировке участника торгов;
  - 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 55.10 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 Расчетного кода для списания комиссионных вознаграждений 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 / Котировке участника торгов;
  - 3) по Расчетному коду, входящему в состав Торгово-клирингового счета Т+, указанного в заявке на заключение Сделки / Котировке участника торгов / 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;
- 4) по Счету обеспечения Т0, входящему в состав Торгово-клирингового счета Т0, указанного в заявке на заключение Сделки / Котировке участника торгов / по Счету обеспечения Т0 в российских рублях, соответствующего Счету обеспечения Т0 в иностранной валюте, входящему в состав Торгово-клирингового счета Т0, указанного в заявке на заключение Сделки / Котировке участника торгов, 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, обратная часть комиссионного вознаграждения по такой сделке удерживается по Расчетному коду, соответствующему Счету обеспечения Т0 в иностранной валюте.
- 55.14. 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.
- 55.14.1. Тарифный план действует для Участника торгов / Участника клиринга. Тарифный план применяется для всех соответствующих Сделок, заключенных на основании заявок / Котировке участника торгов, поданных с указанием Торгово-клирингового счета Участника клиринга, а также с указанием Торгово-клиринговых счетов 2-го и 3-го уровней, открытых Участником торгов / Участником клиринга.
- 55.14.2. Выбор или изменение тарифного плана, предусмотренного Тарифами Биржи, осуществляется Участником торгов. Выбор или изменение тарифного плана, предусмотренного Тарифами Клирингового центра осуществляется Участником клиринга.
- Выбор или изменение тарифного плана осуществляется 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, но не ранее первого числа месяца, предшествующего месяцу, начиная с которого будет действовать выбранный тарифный план, за исключением случаев первоначального допуска к торгам / клиринговому обслуживанию.
- 55.14.3. 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 (если иного не предусмотрено соответствующей специальной частью Правил клиринга), 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.
- 55.14.4. В случае выбора Участником торгов / Участником клиринга тарифного плана, содержащего постоянную часть комиссионного вознаграждения, такая постоянная часть комиссионного вознаграждения определяется в первый рабочий день календарного месяца, за который взимается постоянная часть комиссионного вознаграждения.
- 55.14.5. 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 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.
- 55.15. 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 или Тарифами Клирингового центра. Отчетный период, по итогам которого Участникам торгов / Участникам клиринга предоставляется премия, устанавливается Тарифами Клирингового центра.
- 55.16. Комиссионное вознаграждение Клирингового центра за учет индивидуального клирингового и иного обеспечения в иностранной валюте определяется в последний Расчетный день календарного месяца оказания услуг и взимается в первый рабочий день календарного месяца, следующего за месяцем оказания услуг. Комиссионное вознаграждение Клирингового центра за учет индивидуального клирингового и иного обеспечения в драгоценных металлах 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).
- 55.16.1. Комиссионное вознаграждение за учет индивидуального клирингового и иного обеспечения, рассчитанное по всем Счетам обеспечения, Счетам гарантийных фондов, Счетам обеспечения под стресс участника клиринга, а также плата за услуги интегрированного технологического сервиса и оказание иных технологических и/или информационных услуг, учитывается по основному Расчетному коду для списания комиссионных вознаграждений, открытому для фондового рынка, рынка депозитов и рынка кредитов, в случае его отсутствия – по основному Расчетному коду для списания комиссионных вознаграждений, открытому для валютного рынка и рынка драгоценных металлов, в случае его отсутствия – по основному Расчетному коду для списания комиссионных вознаграждений, открытому для срочного рынка, в случае его отсутствия – по основному Расчетному коду для списания комиссионных вознаграждений, открытому для товарного рынка, в случае его отсутствия – по основному

- Расчетному коду для списания комиссионных вознаграждений, открытому для рынка Стандартизированных ПФИ.
- 55.16.2. Комиссионное вознаграждение за учет индивидуального клирингового и иного обеспечения, рассчитанное по каждому Счету обеспечения/торговому банковскому счету Участника клиринга отдельно, учитывается по Расчетному коду, соответствующему Счету обеспечения / торговому банковскому счету, 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 55.10 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.
- 55.16.3. 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 55.16.2 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.
- 55.17. 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.
- 55.17.1. 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.
- 55.17.2. Информация о рассчитанных комиссионных вознаграждениях предоставляется Клиринговым центром Участникам клиринга в отчетах о комиссионных вознаграждениях, предусмотренных специальными частями Правил клиринга.
- 55.17.3. Информация о комиссионных вознаграждениях, удержанных с Участников клиринга по Расчетным кодам Участника клиринга, предоставляется Клиринговым центром Участникам клиринга в Отчете о движении денежных средств.
- 55.18. Начисление процентов на денежные средства, составляющие индивидуальное и/или коллективное клиринговое обеспечение и/или иное 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.

- 55.18.1. Выплата Участникам клиринга процентов на денежные средства, составляющие индивидуальное и/или коллективное клиринговое обеспечение и/или иное 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 и/или иное обеспечение, может быть установлен иной порядок выплаты процентов.

- 55.18.2. При прекращении договора об оказании клиринговых услуг выплата процентов на денежные средства, составляющие индивидуальное и/или коллективное клиринговое обеспечение и/или иное обеспечение, производится в последний день действия указанного договора.

- 55.18.3. При прекращении договора об оказании клиринговых услуг в случае отзыва лицензии на осуществление банковских операций у Участника клиринга – Кредитной организации начисление процентов на денежные средства, составляющие индивидуальное и/или коллективное клиринговое обеспечение и/или иное обеспечение, производится до дня (включительно), предшествующего дню отзыва лицензии на осуществление банковских операций у Участника клиринга – Кредитной организации, выплата указанных процентов – в день отзыва лицензии на осуществление банковских операций у Участника клиринга – Кредитной организации.

- 55.18.4. 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 и/или коллективное клиринговое обеспечение и/или иное 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.

- 55.18.5. Проценты на денежные средства, составляющие индивидуальное и/или коллективное клиринговое обеспечение и/или иное 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 и/или иное обеспечение.

Решением Клирингового центра о начислении и выплате Участникам клиринга процентов на денежные средства, составляющие индивидуальное и/или коллективное клиринговое обеспечение и/или иное 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.

- 55.18.6. Проценты на денежные средства в российских рублях, составляющие индивидуальное и/или коллективное клиринговое обеспечение и/или иное обеспечение, выплачиваются в российских рублях.

Проценты на денежные средства в иностранной валюте, составляющие индивидуальное и/или коллективное клиринговое обеспечение и/или иное 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 прибыль организаций с доходов иностранных организаций от источников в Российской Федерации.

- 55.18.7. Сумма процентов в соответствующей валюте на денежные средства, составляющие индивидуальное и/или коллективное клиринговое обеспечение и/или иное 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.

- 55.18.8. Информация о начисленных и выплаченных процентах на денежные средства, составляющие индивидуальное и/или коллективное клиринговое обеспечение и/или иное обеспечение, предоставляется Клиринговым центром Участникам клиринга в Отчете о движении денежных средств, о начисленных – ежедневно, о выплаченных – ежемесячно в дату выплаты.

- 55.19. Плата за услуги интегрированного технологического сервиса и оказание иных технологических и/или информационных услуг учитывается по основному Расчетному коду для списания комиссионных вознаграждений, порядок определения которого установлен подпунктом 55.16.1 общей части Правил



клиринга, и удерживается не позднее 5 (пятого) рабочего дня месяца, следующего за месяцем оказания услуг.

## **Статья 56.      Общий порядок представления отчетов по итогам клиринга**

56.1.      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, Расчетным кодам Участника клиринга, открытым для фондового рынка, рынка депозитов и рынка кредитов, и Расчетным кодам, открытым для валютного рынка и рынка драгоценных металлов);
- 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, о наличии у Участника клиринга Задолженности и ее размере;
- Отчет о гарантийных фондах, содержащий информацию, указанную в пункте 32.6 общей части Правил клиринга;
- Отчет об обеспечении под стресс, содержащий информацию, указанную в пункте 32.6 общей части Правил клиринга;
- Отчет об обеспечении под риски концентрации на эмитентов, содержащий информацию, указанную в пункте 32.8 общей части Правил клиринга;
- Отчет о Маржинальном требовании, содержащий информацию о наличии Маржинального требования, Маржинального требования по фондам, Маржинального требования по обеспечению под стресс, Маржинального требования по риску концентрации на эмитента и о размере указанных маржинальных требований;
- Отчет о Клиринговых идентификаторах, содержащий информацию о Клиринговых идентификаторах, являющихся Аналогом собственноручной подписи на соответствующих Рынках.

Специальными частями Правил клиринга установлен перечень отчетов, направляемых по итогам клиринга на соответствующем Рынке.

56.2.      Отчеты, указанные в пункте 56.1 общей части Правил клиринга, а также отчеты, указанные в специальных частях Правил клиринга, направляются Участнику клиринга / Участнику торгов / Держателю в форме электронных документов в соответствии с Порядком ЭДО.

На основании письменного запроса Участника клиринга / Участника торгов 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 / Участнику торгов.

- 56.3. Отчет о Клиринговых идентификаторах направляется Участнику клиринга не позднее рабочего дня, следующего за днем получения от Технического центра уведомления о присвоении Клирингового идентификатора в соответствии с пунктом 22.2 общей части Правил клиринга, а также каждый первый Расчетный день месяца.
- 56.4. По письменному запросу Участника клиринга могут быть выданы отчеты, не предусмотренные пунктом 56.1 общей части Правил клиринга и специальными частями Правил клиринга (далее – нестандартные отчеты), а также подтверждение остатков обеспечения и неисполненных обязательств Участника клиринга в форме электронного документа или в бумажной форме.
- 56.5. Копии отчетов в бумажной форме или в форме электронных документов, указанные в пункте 56.2 общей части Правил клиринга, а также нестандартные отчеты и подтверждения остатков обеспечения и неисполненных обязательств Участника клиринга в форме электронного документа или в бумажной форме, указанные в пункте 56.4 общей части Правил клиринга, предоставляются/направляются Участникам клиринга в течение 10 (десяти) 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.

- 56.6. В случае обнаружения ошибок Клиринговый центр имеет право сформировать и направить Участникам клиринга исправленные отчеты или отозвать ранее направленные отчеты. При этом, в случае повторного направления отчета, правильным отчетом считается отчет, имеющий более позднюю дату и время формирования отчета.
- 56.7. 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 документами Клирингового центра (соответствующими частями документов Клирингового центра). Указанные документы раскрываются Клиринговым центром путем размещения на Сайте Клирингового центра.

## **РАЗДЕЛ VI. ПРОЧИЕ УСЛОВИЯ**

### **Статья 57. Перевод обязательств и Обеспечения одного Участника клиринга другому Участнику клиринга**

57.1. 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 / каждому Торгово-клиринговому счету Базового Участника клиринга, открытому для такого Обособленного клиента, 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 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:
- 57.1.1. основания, предусмотренные подпунктами 15.1.4-15.1.18, 15.18.10-15.18.11, 15.18.2-15.18.8, 15.21.2-15.21.3 общей части Правил клиринга;
- 57.1.2. наличие дела о банкротстве в отношении Базового Участника клиринга в производстве арбитражного суда более 2 (двух) месяцев с момента подачи соответствующего заявления;
- 57.1.3. нарушение Базовым Участником клиринга правил российских или иностранных организатора торгов или клиринговой организации;
- 57.1.4. 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;
- 57.1.5. принятие органами управления Базового Участника клиринга решения о реорганизации Базового Участника клиринга (за исключением случаев реорганизации, которые не влекут прекращения деятельности Базового Участника клиринга, и реорганизации в форме преобразования);
- 57.1.6. принятие судебного акта о взыскании, наложении ареста либо ином обременении в отношении имущества Базового Участника клиринга;
- 57.1.7. наличие Задолженности Базового Участника клиринга, не погашенной в установленные временными регламентами сроки;
- 57.1.8. предоставление Базовым Участником клиринга Клиринговому центру поручения на перевод обязательств и Обеспечения.
- 57.2. Подлинность подписи лица на Заявлении на перевод обязательств и Обеспечения или на Заявлении на отзыв заявления на перевод обязательств и Обеспечения,

- предусмотренного пунктом 57.18 общей части Правил клиринга, предоставленных в бумажной форме, должна быть засвидетельствована в нотариальном порядке. В случае подписания указанных заявлений представителем физического или юридического лица, в том числе действующим в силу закона, текст удостоверительной надписи нотариуса о свидетельствовании подлинности подписи на документе должен содержать указание на то, что полномочия представителя, подписавшего документ, нотариусом проверены.
- 57.3. Обособленный клиент вправе предоставить Клиринговому центру Заявление на перевод обязательств и Обеспечения с указанием оснований, установленных законодательством, заранее, до наступления указанных оснований.
- 57.4. 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 57.1 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 электронному адресу, указанному в Запросе на регистрацию Обособленного клиента.
- 57.5. 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.
- 57.5.1. 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.
- 57.5.2. Клиринговый центр вправе отказать в исполнении Заявления на перевод обязательств и Обеспечения в случае, если это приведет к нарушению Клиринговым центром законодательства Российской Федерации.
- 57.6. 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 57.13 общей части Правил клиринга. Такое согласие не может быть отозвано Базовым Участником клиринга.
- 57.7. Подача Заявления на перевод обязательств и Обеспечения является безусловным согласием Обособленного клиента на раскрытие (передачу) Клиринговым центром Участнику клиринга – реципиенту информации, предусмотренной пунктом 57.13 общей части Правил клиринга.
- 57.8. Перевод обязательств и Обеспечения не осуществляется при отсутствии согласия Участника клиринга – реципиента, предусмотренного пунктом 57.14 общей части Правил клиринга.

- 57.9. 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 57.1 общей части Правил клиринга.
- 57.10. Днем начала процедуры Перевода обязательств и Обеспечения считается день отзыва 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 рабочий день, следующий за днем 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 57.1 общей части Правил клиринга.
- 57.11. 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 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) рабочих дней со дня ее начала, в случае проведения процедуры Перевода обязательств и Обеспечения по иным основаниям, предусмотренным пунктом 57.1 общей части Правил клиринга.
- 57.12. Клиринговый центр незамедлительно после принятия к исполнению Заявления на перевод обязательств и Обеспечения, но не ранее наступления оснований, установленных законодательством Российской Федерации (для Заявлений с указанием таких оснований), устанавливает Режим урегулирования по Расчетному коду Базового Участника клиринга, открытому для Обособленного клиента, предоставившего Заявление на перевод обязательств и Обеспечения.
- 57.12.1. В случае проведения процедуры Перевода обязательств и Обеспечения по основанию, предусмотренному подпунктом 57.1.8 общей части Правил клиринга, Клиринговый центр вправе установить Режим урегулирования по Расчетному коду Базового Участника клиринга, открытому для Обособленного клиента, предоставившего Заявление на перевод обязательств и Обеспечения, в иное время.
- 57.12.2. В случае проведения процедуры Перевода обязательств и Обеспечения в выходной или нерабочий день по законодательству Российской Федерации Клиринговый центр вправе не устанавливать Режим урегулирования по Расчетному коду Базового Участника клиринга, открытому для Обособленного клиента, предоставившего Заявление на перевод обязательств и Обеспечения, в такой выходной или нерабочий день.
- 57.13. 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 информацию о Расчетных кодах / Торгово-клиринговых счетах Базового Участника клиринга, открытых для Обособленного клиента, предоставившего Заявление на перевод обязательств и Обеспечения, а также следующую информацию, учитываемую по каждому такому Расчетному коду / Торгово-клиринговому счету:
- 57.13.1. об обязательствах / требованиях Базового Участника клиринга по Сделкам, заключенным с центральным контрагентом, исключая обязательства / требования с наступившей Датой исполнения по Сделкам, обязательства по которым исполняются Базовым Участником клиринга / прекращаются у Базового Участника клиринга в соответствии с пунктом 57.18 общей части Правил клиринга;
  - 57.13.2. об обязательствах по передаче Дохода;
  - 57.13.3. об обязательствах по уплате вариационной маржи;
  - 57.13.4. о размере Обеспечения Базового Участника клиринга в ценных бумагах / товарах;
  - 57.13.5. о размере Обеспечения Базового Участника клиринга в денежных средствах / драгоценных металлах или о текущем размере задолженности Базового Участника клиринга, рассчитанных с учетом исполнения / прекращения обязательств по Сделкам, указанным в пункте 57.18 общей части Правил клиринга, и уменьшенных на сумму денежных средств, необходимых для исполнения обязательств Базового Участника клиринга по уплате комиссионных вознаграждений с наступившей Датой исполнения (для Обеспечения и задолженности в российских рублях). Текущий размер задолженности Базового Участника клиринга соответствует отрицательному значению клирингового регистра, предназначенного для учета Обеспечения / Задолженности по Расчетному коду Базового Участника клиринга. Сумма денежных средств, необходимых для исполнения обязательств Базового Участника клиринга по уплате комиссионных вознаграждений, не учитывается при проведении процедуры Перевода обязательств и Обеспечения по основаниям, установленным законодательством;
  - 57.13.6. о значении Единого лимита по Расчетному коду.
- 57.14. 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 57.13 общей части Правил клиринга (далее – Согласие на прием обязательств и Обеспечения), не позднее времени, указанного во Временном регламенте.
- 57.14.1. 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.

57.15. 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 торговых банковских счетов 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.

57.16. Перевод обязательств и Обеспечения не осуществляется в случае выполнения любого из следующих условий:

- типы Расчетных кодов Участника клиринга, входящих в состав Торгово-клиринговых счетов / типы Расчетных кодов Участника клиринга, открытых Базовым Участником клиринга для Обособленного клиента, предоставившего Заявление на перевод обязательств и Обеспечения, не соответствуют типам Расчетных кодов Участника клиринга, входящих в состав Торгово-клиринговых счетов / типам Расчетных кодов, указанных Участником клиринга – реципиентом в Согласии на прием обязательств и Обеспечения;
- в результате проведения процедуры Перевода обязательств и Обеспечения Единый лимит по Расчетному коду Участника клиринга – реципиента, указанному Участником клиринга – реципиентом в Согласии на прием обязательств и Обеспечения, становится отрицательным (в случае проведения процедуры Перевода обязательств и Обеспечения по основанию, предусмотренному подпунктом 57.1.8 общей части Правил клиринга);
- идентификационные данные клиента Участника клиринга, соответствующие Расчетному коду Участника клиринга, открытому для Обособленного клиента Участником клиринга – реципиентом, не соответствуют идентификационным данным клиента Участника клиринга, соответствующим Расчетному коду Участника клиринга, открытому для Обособленного клиента Базовым Участником клиринга (если Участником клиринга – реципиентом открыт отдельный Расчетный код Участника клиринга для Обособленного клиента, и при открытии Расчетного кода Участника клиринга для Обособленного клиента Участником клиринга – реципиентом были указаны идентификационные данные клиента Участника клиринга);
- признак, определяющий имущественный пул Торгово-клирингового счета имущественного пула, соответствующего Торгово-клиринговому счету Базового Участника клиринга, не соответствует признаку, определяющему имущественный пул Торгово-клирингового счета имущественного пула, соответствующего Торгово-клиринговому счету Участника клиринга – реципиента (если Торгово-клиринговому счету Базового Участника клиринга соответствует Торгово-клиринговый счет имущественного пула);

- в случае предоставления Заявления на перевод обязательств и Обеспечения или Согласия на прием обязательств и Обеспечения позднее времени, указанного во Временном регламенте.

57.17. После получения от Участника клиринга – реципиента Согласия на прием обязательств и Обеспечения в соответствии с пунктом 57.14 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 / Расчетный код ДУ 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;
- в случае проведения процедуры Перевода обязательств и Обеспечения по основанию, предусмотренному подпунктом 57.1.8 общей части Правил клиринга, устанавливает Режим урегулирования по Расчетному коду Участника клиринга – реципиента;
- 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 57.13 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 57.13 общей части Правил клиринга, как обязательства и требования Участника клиринга – реципиента в отношении Клирингового центра;
- аннулирует регистрацию Обособленного клиента у Базового Участника клиринга и признак Расчетного кода, открытого Базовым Участником клиринга для Обособленного клиента, указывающий на необходимость защиты денежных средств Обособленного клиента (при наличии).

Действия, указанные в настоящем пункте общей части Правил клиринга, выполняются в периоды времени, установленные Временным регламентом.

57.18. Сделками с центральным контрагентом, обязательства по которым исполняются Базовым Участником клиринга, за исключением случаев проведения процедуры Перевода обязательств и Обеспечения по основаниям, установленным законодательством, являются следующие Сделки с наступившей Датой исполнения:

- Сделки, обеспеченные средствами под исполнение в соответствии с Правилами клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, в случае если исполнение Заявления на перевод обязательств и Обеспечения в соответствии с пунктом 57.17 осуществляется до 16:00;



- Сделки, исполненные в ходе первой расчетной клиринговой сессии, в случае если исполнение Заявления на перевод обязательств и Обеспечения в соответствии с пунктом 57.17 осуществляется после 18:00.
- 57.18.1. Сделками с центральным контрагентом, обязательства по которым прекращаются у Базового Участника клиринга в случае проведения процедуры Перевода обязательств и Обеспечения по основаниям, установленным законодательством, являются Сделки с Датами исполнения в даты, предшествующие дате исполнения Заявления на перевод обязательств и Обеспечения.
- 57.19. Обособленный клиент вправе отозвать свое Заявление о переводе обязательств и Обеспечения путем направления Клиринговому центру Заявления на отзыв заявления на перевод обязательств и Обеспечения в срок, установленный Временным регламентом, но до получения Клиринговым центром от Участника клиринга – реципиента Согласия на прием обязательств и Обеспечения.
- 57.20. Обособленный клиент вправе в срок, установленный Временным регламентом, и 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 57.1 общей части Правил клиринга и предоставляться в порядке, предусмотренном настоящей статьей общей части Правил клиринга.
- 57.21. В случае неполучения Клиринговым центром Согласия на прием обязательств и Обеспечения от Участника клиринга – реципиента, указанного Обособленным клиентом, в срок, установленный Временным регламентом, Клиринговый центр снимает Режим урегулирования по Расчетному коду Базового Участника клиринга, открытому для Обособленного клиента, предоставившего Заявление на перевод обязательств и Обеспечения, если отсутствуют иные основания для установления Режимы урегулирования, предусмотренные Правилами клиринга.
- 57.22. После исполнения Клиринговым центром Заявления на перевод обязательств и Обеспечения Участник клиринга – реципиент вправе дополнить информацию об обязательствах и требованиях Участника клиринга – реципиента, возникших в результате исполнения процедуры Перевода обязательств и Обеспечения, информацией о клиенте Участника торгов, за счет которого исполняются такие обязательства и требования, предоставив Запрос на заполнение краткого кода клиента.
- 57.22.1. Указанное заполнение информации о кратком коде клиента Участника торгов не должно приводить к замене лица, за счет которого исполняются обязательства по Сделкам, обязательства и требования по которым были переданы от Базового Участника клиринга Участнику клиринга – реципиенту в результате исполнения Заявления на перевод обязательств и Обеспечения Обособленного клиента.

- 57.22.2. Запрос на заполнение краткого кода клиента предоставляется до момента времени, установленного Временным регламентом. Запрос на заполнение краткого кода клиента, предоставленный позже указанного времени, не исполняется.
- 57.23. За осуществление процедур Перевода обязательств и Обеспечения с Участника клиринга – реципиента взимается плата в размере, установленном Тарифами Клирингового центра.
- 57.24. 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 58. 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**

- 58.1. В дату включения Участника клиринга в перечень организаций, определенный в подпункте 15.18.9 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 вноса 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 Рынках;
  - уведомляет Биржу о необходимости установления запрета на подачу Участниками торгов заявок на заключение сделок / Котировок участника торгов, стороной по которым будет являться Участник клиринга, и о необходимости снятия таких зарегистрированных заявок / Котировок участника торгов.
- 58.2. 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.

58.3. Клиринговый центр вправе предъявить к Участнику клиринга требование о взыскании нетто-обязательства Участника клиринга, рассчитанного в порядке, предусмотренном пунктом 58.2 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 50 общей части Правил клиринга.

58.4. После исключения Участника клиринга из перечня:

- 58.4.1. в случае если для исполнения нетто-обязательства Участника клиринга, рассчитанного в порядке, предусмотренном пунктом 58.2 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;
- 58.4.2. в случае если для исполнения нетто-обязательства Участника клиринга, рассчитанного в порядке, предусмотренном пунктом 58.2 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 59. Порядок урегулирования обязательств в случае прекращения допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию (ликвидационный неттинг в отношении Участника клиринга)**

- 59.1. В случае отзыва Банком России у Участника клиринга – Кредитной организации лицензии на осуществление банковских операций, допуск Участника клиринга – Кредитной организации к клиринговому обслуживанию на всех Рынках приостанавливается с даты отзыва Банком России у такого Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций и прекращается в Расчетный день, следующий за указанной датой, после прекращения обязательств такого Участника клиринга в соответствии с подпунктом 59.1.1 общей части Правил клиринга.
- 59.1.1. В случае отзыва Банком России у Участника клиринга – Кредитной организации лицензии на осуществление банковских операций обязательства по Сделкам, стороной по которым является такой Участник клиринга, заключенным до даты отзыва такой лицензии, и обязательства по договору об имущественном пуле прекращаются полностью на дату, следующую за датой отзыва Банком России у такого Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций, в порядке, установленном пунктом 59.14 общей части Правил клиринга.
- 59.1.2. Сделки, стороной по которым является Участник клиринга, заключенные в дату отзыва 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 Российской Федерации, в том числе, если это применимо, законодательством о несостоятельности (банкротстве).

- 59.1.3. Подтверждением факта отзыва 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 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 у Участника клиринга – Кредитной организации лицензии на осуществление банковских операций.
- 59.2. В случае принятия решения о ликвидации Участника клиринга, в том числе Участника клиринга – Кредитной организации, и/или принятия федерального закона о ликвидации Участника клиринга, являющегося государственной корпорацией или Участника клиринга, являющегося государственной компанией, и/или принятия федерального закона/издания Указа Президента Российской Федерации о ликвидации Участника клиринга, являющегося публично-правовой компанией, допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию на всех Рынках приостанавливается с даты, в которую Клиринговый центр узнал о принятии Участником клиринга такого решения или с даты вступления в силу федерального закона о ликвидации государственной корпорации, государственной компании, или с даты вступления в силу федерального закона/Указа Президента Российской Федерации о ликвидации публично-правовой компании, если указанным федеральным законом/Указом Президента Российской Федерации не определено иное, и прекращается в Расчетный день, следующий за указанной датой, после прекращения обязательств такого Участника клиринга в соответствии с подпунктом 59.2.1 общей части Правил клиринга.
- 59.2.1. Обязательства по Сделкам, стороной по которым является Участник клиринга, и обязательства по договору об имущественном пуле прекращаются полностью на дату, в которую Клиринговый центр узнал о принятии решения о ликвидации Участника клиринга, или на дату вступления в силу федерального закона о ликвидации государственной корпорации, государственной корпорации, или на дату вступления в силу федерального закона/ Указа Президента Российской Федерации о ликвидации публично-правовой компании, если указанным федеральным законом/ Указом Президента Российской Федерации не определено иное, в порядке, установленном пунктом 59.14 общей части Правил клиринга.
- 59.3. В случае назначения временной администрации или принятия арбитражным судом решения о введении в отношении Участника клиринга – Некредитной организации одной из процедур банкротства, допуск Участника клиринга – Некредитной организации к клиринговому обслуживанию на всех Рынках приостанавливается с даты назначения временной администрации, или даты принятия арбитражным судом решения о введении в отношении Участника клиринга – Некредитной организации одной из процедур банкротства, или даты принятия арбитражным судом решения о признании Участника клиринга – Некредитной организации банкротом и об открытии конкурсного производства, в зависимости от того, какая дата наступила ранее, и прекращается в Расчетный день, следующий за указанной датой, после прекращения обязательств такого Участника клиринга в соответствии с подпунктом 59.3.1 общей части Правил клиринга.

- 59.3.1. В случае назначения временной администрации, или принятия арбитражным судом решения о введении в отношении Участника клиринга – Некредитной организации одной из процедур банкротства, или принятия арбитражным судом решения о признании Участника клиринга – Некредитной организации банкротом и об открытии конкурсного производства 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 датой принятия арбитражным судом решения о введении в отношении Участника клиринга одной из процедур банкротства, или 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 59.14 общей части Правил клиринга.
- 59.4. В случае отзыва Банком России у Участника клиринга – Некредитной организации, являющейся страховой организацией или обществом взаимного страхования, в связи с нарушением таким Участником клиринга требований, установленных Банком России, лицензии на осуществление страховой деятельности допуск Участника клиринга – Некредитной организации, являющейся страховой организацией или обществом взаимного страхования, к клиринговому обслуживанию на всех Рынках приостанавливается с даты отзыва Банком России у такого Участника клиринга лицензии на осуществление страховой деятельности и прекращается в Расчетный день, следующий за указанной датой, после прекращения обязательств такого Участника клиринга в соответствии с подпунктом 59.4.1 общей части Правил клиринга.
- 59.4.1. В случае отзыва Банком России у Участника клиринга – Некредитной организации, являющейся страховой организацией или обществом взаимного страхования, в связи с нарушением таким Участником клиринга требований, установленных Банком России, лицензии на осуществление страховой деятельности обязательства по Сделкам, стороной по которым является такой Участник клиринга, заключенным до даты отзыва такой лицензии, и обязательства по договору об имущественном пуле прекращаются полностью на дату, следующую за датой отзыва Банком России у такого Участника клиринга лицензии на осуществление страховой деятельности, в порядке, установленном пунктом 59.14 общей части Правил клиринга.
- 59.4.2. Подтверждением факта отзыва лицензии на осуществление страховой деятельности у Участника клиринга – Некредитной организации, являющейся страховой организацией или обществом взаимного страхования, 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 выданной Участнику клиринга – Некредитной организации, являющейся страховой организацией и обществом взаимного страхования, лицензии на осуществление страховой деятельности, и/или направленное Банком России по электронному адресу Клирингового центра электронное сообщение, содержащее информацию об отзыве у Участника клиринга – Некредитной организации, являющейся страховой организацией и обществом взаимного страхования, лицензии на осуществление страховой деятельности.

59.5. 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 Участника клиринга – Кредитной организации к клиринговому обслуживанию на всех Рынках приостанавливается с даты введения моратория на удовлетворение требований кредиторов Участника клиринга – Кредитной организации и прекращается в Расчетный день, следующий за указанной датой, после прекращения обязательств такого Участника клиринга 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 Расчетного дня, следующего за датой введения моратория на удовлетворение требований кредиторов Участника клиринга – Кредитной организации в порядке, установленном пунктом 59.14 общей части Правил клиринга.

59.6. В случае назначения временной администрации по управлению Участником клиринга – Кредитной организацией в рамках мер по предупреждению банкротства кредитной организации, за исключением случая публичного заявления Банка России об оказании финансовой поддержки такому Участнику клиринга – Кредитной организации в целях обеспечения непрерывности его деятельности, Клиринговый центр вправе начиная с даты назначения временной администрации принять в отношении Участника клиринга – Кредитной организации решение о:

- приостановлении допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию на всех Рынках;
- прекращении допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию на всех Рынках;
- 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 59.16-59.17 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 Расчетного дня, следующего за датой принятия указанного решения, в порядке, установленном пунктом 59.14 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.

59.7. В случае неисполнения или ненадлежащего исполнения Участником клиринга, допуск к клиринговому обслуживанию которого приостановлен, обязательств по Сделкам, Маржинального требования и/или иных обязательств Участника клиринга, возникших из Правил клиринга, или в случае, если в отношении

Участника клиринга, допуск к клиринговому обслуживанию которого приостановлен, имеется информация о наступлении события, которое не позволит Участнику клиринга исполнять указанные обязательства, Клиринговый центр вправе принять в отношении Участника клиринга решение о:

- прекращении допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию на всех Рынках;
- 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 59.16-59.17 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 Расчетного дня, следующего за датой принятия указанного решения, в порядке, установленном пунктом 59.13 общей части Правил клиринга.

Клиринговый центр посредством ЭДО уведомляет Участника клиринга о принятии решения в соответствии с настоящим пунктом общей части Правил клиринга не позднее дня принятия указанного решения.

- 59.8. В случае принятия уполномоченным органом решения о введении в отношении Участника клиринга – Нерезидента – некредитной организации одной из процедур банкротства и/или назначения лица, которое в силу применимого к такому Участнику клиринга права вправе осуществлять процедуры банкротства в отношении этого Участника клиринга (ликвидатора, администратора, управляющего и т.п.), допуск Участника клиринга – Нерезидента – некредитной организации к клиринговому обслуживанию на всех Рынках приостанавливается с даты, в которую Клиринговый центр узнал о принятии уполномоченным органом решения о введении в отношении Участника клиринга – Нерезидента – некредитной организации одной из процедур банкротства и/или указанного выше лица, и прекращается в Расчетный день, следующий за указанной датой, после прекращения обязательств такого Участника клиринга 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 Расчетного дня, следующего 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 59.14 общей части Правил клиринга.

- 59.8.1. 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.

- 59.9. 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 Участника клиринга – Нерезидента, в том числе Участника клиринга – Банка ЕврАзЭС/ЕАЭС, к клиринговому обслуживанию на всех Рынках приостанавливается с даты, в которую Клиринговый центр узнал об отзыве (аннулировании) такого специального разрешения (лицензии или иного основания), и прекращается в Расчетный день, следующий за указанной датой, после прекращения обязательств такого Участника клиринга в соответствии с подпунктом 59.3.1 общей части Правил клиринга.

Обязательства по Сделкам, стороной по которым является Участник клиринга, и обязательства по договору об имущественном пуле прекращаются полностью на дату Расчетного дня, следующего за датой, в которую Клиринговый центр узнал об отзыве (аннулировании) такого специального разрешения (лицензии или иного основания), в порядке, установленном пунктом 59.14 общей части Правил клиринга.

- 59.9.1. 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.
- 59.10. 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 / Участника-клиринга – Некредитной организации ЕврАзЭС/ЕАЭС, допуск Участника клиринга – Банка ЕврАзЭС/ЕАЭС / Участника-клиринга – Некредитной организации ЕврАзЭС/ЕАЭС к клиринговому обслуживанию на всех Рынках приостанавливается с даты

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/ Участника-клиринга – Некредитной организации ЕврАзЭС/ЕАЭС, и прекращается в Расчетный день, следующий за указанной датой, после прекращения обязательств такого Участника клиринга 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 Расчетного дня, следующего 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 / Участника-клиринга – Некредитной организации ЕврАзЭС/ЕАЭС, в порядке, установленном пунктом 59.14 общей части Правил клиринга.

59.11. В случае назначения временной администрации по управлению Участником клиринга – Банком-нерезидентом или при введении иной аналогичной процедуры в отношении Участника клиринга – Банка-нерезидента, предусмотренной законодательством государства учреждения Участника клиринга – Банка-нерезидента, Клиринговый центр вправе начиная с даты назначения временной администрации или введения иной аналогичной процедуры принять решение в отношении такого Участника клиринга – Банка-нерезидента о:

- приостановлении допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию на всех Рынках;
- прекращении допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию на всех Рынках;
- 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 59.16-59.17 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 Расчетного дня, следующего за датой принятия указанного решения, в порядке, установленном пунктом 59.14 общей части Правил клиринга.

Клиринговый центр посредством ЭДО или системы S.W.I.F.T. уведомляет Участника клиринга – Банка-нерезидента о принятии решения в соответствии с настоящим пунктом общей части Правил клиринга не позднее дня принятия указанного решения.

59.11.1. Подтверждением факта назначения временной администрации по управлению Участником клиринга – Банком-нерезидентом или факта введения иной аналогичной процедуры в отношении Участника клиринга – Банка-нерезидента, предусмотренной законодательством государства учреждения Участника клиринга

– Банка-нерезидента, является письменное уведомление компетентного органа государства учреждения Участника клиринга – Банка-нерезидента, направленное Клиринговому центру (в том числе, посредством факсимильной связи), и/или размещенная на сайте компетентного органа государства учреждения Участника клиринга – Банка-нерезидента или на сайте Участника клиринга – Банка-нерезидента в сети Интернет информация о назначении временной администрации по управлению Участником клиринга – Банком-нерезидентом или о введении иной аналогичной процедуры в отношении Участника клиринга – Банка-нерезидента, предусмотренной законодательством государства учреждения Участника клиринга – Банка-нерезидента.

59.12. 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 Участника клиринга – Международной организации к клиринговому обслуживанию на всех Рынках приостанавливается с даты прекращения международного договора, в соответствии с которым такой Участник клиринга – Международная организация учрежден, для Российской Федерации, либо с даты принятия уполномоченными лицами сторон указанного международного договора решения о прекращении деятельности Участника клиринга – Международной организации и прекращается в Расчетный день, следующий за указанной датой, после прекращения обязательств такого Участника клиринга 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 Расчетного дня, следующего за датой прекращения международного договора, в соответствии с которым такой Участник клиринга – Международная организация учрежден, для Российской Федерации, либо на дату Расчетного дня, следующего за датой принятия уполномоченными лицами сторон указанного международного договора решения о прекращении деятельности Участника клиринга – Международной организации, в порядке, установленном пунктом 59.14 общей части Правил клиринга.

59.13. В случае направления Участником клиринга ходатайства об аннулировании лицензии на осуществление банковских операций, которое не влечет прекращение деятельности Участника клиринга, Клиринговый центр вправе начиная с даты, в которую Клиринговому центру стало известно о направлении Участником клиринга ходатайства об аннулировании лицензии на осуществление банковских операций, принять в отношении такого Участника клиринга решение о:

- приостановлении допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию на всех Рынках;
- прекращении допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию на всех Рынках;
- 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 60.13–60.14 общей части Правил клиринга.

Клиринговый центр вправе принять соответствующее решение при наличии информации, свидетельствующей о неспособности 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.

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 Расчетного дня, следующего за датой принятия указанного решения, в порядке, установленном пунктом 59.14 общей части Правил клиринга.

Клиринговый центр посредством ЭДО уведомляет Участника клиринга о принятии решения в соответствии с настоящим пунктом общей части Правил клиринга не позднее дня принятия указанного решения.

- 59.14. В случаях прекращения допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию по основаниям, указанным в пунктах 59.1-59.13 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 59.16 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 59.17 общей части Правил клиринга, за исключением случая, предусмотренного пунктом 59.15 общей части Правил клиринга.
- 59.15. При урегулировании обязательств в случае прекращения допуска к клиринговому обслуживанию Участника клиринга, являющегося одновременно участником клиринга НКО АО НРД, основаниям, указанным в пунктах 59.1, 59.4, 59.6 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 59.17 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 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 59.6 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.

59.16. Клиринговый центр рассчитывает сумму нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга в российских рублях по Сделкам с центральным контрагентом в порядке, предусмотренном подпунктами 59.16.1-59.16.14 общей части Правил клиринга, отдельно по каждому клиентскому Расчетному коду, по каждому Расчетному коду ДУ и по всем собственным Расчетным кодам Участника клиринга.

Для целей расчета Клиринговым центром суммы нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга в российских рублях по Сделкам с центральным контрагентом в соответствии с настоящей статьей общей части Правил клиринга Датой исполнения второй части Сделки РЕПО с открытой датой, стороной по которой является Участник клиринга, признается Расчетный день, следующий за датой начала проведения процедуры ликвидационного неттинга.

59.16.1. 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, рынке депозитов и рынке кредитов, 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 59.16.10 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, драгоценные металлы и иностранную валюту, учитываемые по Расчетному коду (Расчетным кодам) имущественного пула Участника пула, на соответствующих 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 59.16.1 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, драгоценных металлов 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 T+, 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 59.16.1 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, драгоценных металлов 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 59.16.5 общей части Правил клиринга;

- 4) Клиринговый центр суммирует (с учетом знака) промежуточную величину нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в российских рублях, определенную по итогам действий, указанных в пунктах 2)-3) подпункта 59.16.1 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 59.16.1 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 59.16.5 общей части Правил клиринга.

- 59.16.2. Клиринговый центр с использованием Клиринговой системы формирует и исполняет распоряжения на перевод ценных бумаг / драгоценных металлов / денежных средств с Торгово-клирингового счета имущественного пула Участника клиринга, оставшихся по итогам действий, указанных в подпункте 59.16.1 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, рынке депозитов и рынке кредитов.

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.

- 59.16.3. 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 всем Торгово-клиринговым счетам Т+ / Торгово-клиринговым счетам имущественного пула Участника клиринга (за исключением Торгово-клиринговых счетов, в состав которых входит Расчетный код, открытый для Обособленного клиента), 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 всем Расчетным кодам / Расчетным кодам имущественного пула Участника клиринга (за исключением Расчетных кодов, открытых для Обособленного клиента), 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 всем Торгово-клиринговым счетам (за исключением Торгово-клиринговых счетов, в состав которых входит Расчетный код, открытый для Обособленного клиента), по всем Датам исполнения.

59.16.4. Если промежуточная величина, рассчитанная в соответствии с подпунктом 59.16.3 общей части Правил клиринга по всем Торгово-клиринговым счетам Т+ / Торгово-клиринговым счетам имущественного пула Участника клиринга / по всем Расчетным кодам / Расчетным кодам имущественного пула Участника клиринга по всем Датам исполнения 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.

59.16.5. Если у Участника клиринга учитывается промежуточная величина нетто-обязательства по ценной бумаге (за исключением клиринговых сертификатов участия) / драгоценному металлу / денежным средствам в иностранной валюте / товару Клиринговый центр рассчитывает следующие промежуточные величины:

- промежуточную величину нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга по ценной бумаге, по которой учитывается промежуточная величина нетто-обязательства (за исключением клиринговых сертификатов участия), рассчитанная в соответствии с подпунктом 59.16.3 общей части Правил клиринга, 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, отдельно по каждому Торгово-клиринговому счету Т+, в состав которых входит клиентский Расчетный код или Расчетный код ДУ / Торгово-клиринговому счету имущественного пула, в состав которого входит клиентский Расчетный код имущественного пула или Расчетный код ДУ, и по всем Торгово-клиринговым счетам Т+, в состав которых входит собственный Расчетный код / Торгово-клиринговым счетам имущественного пула, в состав которых входит собственный Расчетный код имущественного пула Участника клиринга, (за исключением Торгово-клиринговых счетов, в состав которых входит Расчетный код, открытый для Обособленного клиента) по всем Датам исполнения;

- промежуточную величину нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга по драгоценному металлу / денежным средствам в иностранной валюте, по которым учитывается промежуточная величина нетто-обязательства, рассчитанная в соответствии с подпунктом 59.16.3 общей части Правил клиринга, 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, отдельно по каждому клиентскому Расчетному коду или Расчетному коду ДУ / клиентскому Расчетному коду имущественного пула или Расчетному коду ДУ имущественного пула, и по всем

собственным Расчетным кодам (за исключением Расчетных кодов, открытых для Обособленного клиента), по всем Датам исполнения;

- промежуточную величину нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга по товарам, по которым учитывается промежуточная величина нетто-обязательства, рассчитанная в соответствии с подпунктом 59.16.3 общей части Правил клиринга, 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, отдельно по каждому Торгово-клиринговому счету, в состав которого входит клиентский Расчетный код или Расчетный код ДУ, и по всем Торгово-клиринговым счетам, в состав которых входит собственный Расчетный код, (за исключением Торгово-клиринговых счетов, в состав которых входит Расчетный код, открытый для Обособленного клиента) по всем Датам исполнения.

59.16.6. 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, рассчитанной по всем собственным Расчетным кодам / собственным Расчетным кодам имущественного пула / всем Торгово-клиринговым счетам Т+, в состав которых входит собственный Расчетный код / Торгово-клиринговым счетам имущественного пула, в состав которых входит собственный Расчетный код имущественного пула Участника клиринга количество (сумму) таких ценных бумаг / драгоценных металлов / денежных средств в иностранной валюте / товаров, учитываемых на конец дня прекращения обязательств по Сделкам по собственным Расчетным кодам / Расчетным кодам имущественного пула / собственным Торгово-клиринговым счетам / Торгово-клиринговым счетам имущественного пула, но не большее, чем минимальное из двух значений: (1) абсолютное значение промежуточной величины нетто-обязательства по соответствующим ценным бумагам (за исключением клиринговых сертификатов участия) / драгоценным металлам / денежным средствам в иностранной валюте / товарам, рассчитанной в соответствии с подпунктом 59.16.3 общей части Правил клиринга, и (2) абсолютное значение промежуточной величины нетто-обязательства по соответствующим ценным бумагам (за исключением клиринговых сертификатов участия) / драгоценным металлам / денежным средствам в иностранной валюте / товарам, рассчитанной в соответствии с подпунктом 59.16.5 общей части Правил клиринга по всем собственным Расчетным кодам / собственным Расчетным кодам имущественного пула / всем Торгово-клиринговым счетам Т+, в состав которых входит собственный Расчетный код / Торгово-клиринговым счетам имущественного пула, в состав которых входит собственный Расчетный код имущественного пула Участника клиринга. При этом количество (сумма) ценных бумаг / драгоценных металлов / денежных средств в иностранной валюте / товаров и абсолютное значение промежуточной величины нетто-обязательства, рассчитанной в соответствии с подпунктом 59.16.3 общей части Правил клиринга, после каждой операции сложения уменьшаются на прибавленную величину.

59.16.7. Если в результате сложения, указанного в подпункте 59.16.6 общей части Правил клиринга промежуточная величина нетто-обязательства Участника клиринга по соответствующим ценным бумагам (за исключением клиринговых сертификатов участия) / драгоценным металлам / денежным средствам в иностранной валюте /

товарам, рассчитанная в соответствии с подпунктом 59.16.3 общей части Правил клиринга осталась отрицательная:

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, рассчитанной по клиентскому Расчетному коду или Расчетному коду ДУ / клиентскому Расчетному коду имущественного пула или Расчетному коду ДУ имущественного пула 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 / Расчетному коду имущественного пула / Торгово-клиринговому счету / Торгово-клиринговому счету имущественного пула, но не большее, чем минимальное из двух значений: (1) абсолютное значение промежуточной величины нетто-обязательства по соответствующим ценным бумагам (за исключением клиринговых сертификатов участия) / драгоценным металлам / денежным средствам в иностранной валюте / товарам, рассчитанной в соответствии с подпунктом 59.16.3 общей части Правил клиринга с учетом сложения, указанного в подпункте 59.16.6 общей части Правил клиринга, и (2) абсолютное значение промежуточной величины нетто-обязательства по соответствующим ценным бумагам (за исключением клиринговых сертификатов участия) / драгоценным металлам / денежным средствам в иностранной валюте / товарам, рассчитанной в соответствии с подпунктом 59.16.5 общей части Правил клиринга для того же Расчетного кода / Расчетного кода имущественного пула / Торгово-клирингового счета / Торгово-клирингового счета имущественного пула. При этом количество (сумма) ценных бумаг / драгоценных металлов / денежных средств в иностранной валюте / товаров и абсолютное значение промежуточной величины нетто-обязательства, рассчитанной в соответствии с подпунктом 59.16.3 общей части Правил клиринга, после каждой операции сложения уменьшаются на прибавленную величину.

59.16.8. 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, отдельно 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 каждой Дате 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, отдельно по Расчетному коду (Расчетным кодам) / Расчетному коду (Расчетным кодам) имущественного пула, по каждой Дате 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, отдельно 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 каждой Дате исполнения.

59.16.9. Клиринговый центр по Расчетному коду (Расчетным кодам) Участника клиринга рассчитывает следующие величины:

- $RUB\_DEPOSIT_n$  – как сумму требований Участника клиринга по возврату депозитов в российских рублях, учитываемых по Расчетному коду (Расчетным кодам), с Датой исполнения  $n$  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;

- $VAL_j\_DEPOSIT_n$  – как сумму требований Участника клиринга по возврату депозитов в  $j$ -ой иностранной валюте, учитываемых по Расчетному коду (Расчетным кодам), с Датой исполнения  $n$  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.

59.16.10. Клиринговый центр в порядке, определенном статьей 26 общей части Правил клиринга, заключает следующие балансирующие сделки:

- балансирующие сделки с иностранной валютой / драгоценными металлами (при этом сумма иностранной валюты / количество драгоценного металла в балансирующих сделках может быть меньше промежуточной величины нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга по соответствующей иностранной валюте / драгоценному металлу, рассчитанной в соответствии с пунктом 59.16.3 общей части Правил клиринга (с учетом уменьшения промежуточной величины нетто-обязательства в соответствии с подпунктом 59.16.6 и/или 59.16.7 общей части Правил клиринга) );

- балансирующие сделки РЕПО с КСУ, направленные на привлечение / размещение Клиринговым центром денежных средств в суммах  $RUB\_DEPOSIT_n$  и  $VAL_j\_DEPOSIT_n$ , рассчитанных в соответствии подпунктом 59.16.9 общей части Правил клиринга;

- балансирующие сделки с ценными бумагами (при этом количество ценных бумаг в балансирующих сделках может быть меньше промежуточной величины нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга по соответствующей ценной бумаге, рассчитанной в соответствии с пунктом 59.16.3 общей части

Правил клиринга (с учетом уменьшения промежуточной величины нетто-обязательства в соответствии с подпунктом 59.16.6 и/или 59.16.7 общей части Правил клиринга));

- 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 59.16.12 общей части Правил клиринга.

59.16.11. Клиринговый центр по каждому Расчетному коду (Расчетным кодам) Участника клиринга рассчитывает величину равную сумме величины  $SUM_{SC}$  рассчитанной по формуле:

$$\begin{aligned} SUM_{SC} = & \sum_n (POS\_RUB_n + RUB\_DEPOSIT_n - RUB\_REPO\_DIF_n + \sum_j ((POS\_VAL_n^j + \\ & + VAL\_DEPOSIT_n^j - VAL\_REPO\_DIF_n^j) \times C\_VAL_n^j) + \sum_i POS\_C_n^i \times CC_n^i \times C\_VAL_n^i + \\ & + \sum_l POS\_T_n^l \times CT_n^l) + \sum_k POS\_D_k \times (CD_k - SP_k) + \sum_m SC_m \end{aligned}$$

, где

$RUB\_DEPOSIT_n$ ,  $VAL\_DEPOSIT_n^j$  - величины, рассчитанные в соответствии подпунктом 59.16.9 общей части Правил клиринга;

$POS\_RUB_n$  – сумма 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 Дате исполнения n;
- требований Участника клиринга по возврату депозитов в российских рублях, учитываемых по Расчетному коду (Расчетным кодам), с Датой исполнения n не позднее, чем Дата прекращения обязательств по Сделкам, включающих всю сумму процентов, рассчитанную исходя из условий депозитного договора;

$POS\_VAL_n^j$  – сумма значений (с учетом знака):

- рассчитанных в соответствии с подпунктом 59.16.8 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 с Датой исполнения n;

- требований Участника клиринга по возврату депозитов в j-ой иностранной валюте, учитываемых по Расчетному коду (Расчетным кодам), с Датой исполнения n не позднее, чем Дата прекращения обязательств по Сделкам, включающих всю сумму процентов, рассчитанную исходя из условий депозитного договора;

$POS_C_n^i$  – сумма значений (с учетом знака) рассчитанных в соответствии с подпунктом 59.16.8 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 T+ / Торгово-клиринговым счетам имущественного пула, в состав которых входит (входят) Расчетный код (Расчетные коды) и соответствующий (соответствующие) ему Расчетный код (Расчетные коды) имущественного пула, с Датой исполнения n;

$POS_T_n^l$  – сумма значений (с учетом знака) рассчитанных в соответствии с подпунктом 59.16.8 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), с Датой исполнения n;

$POS_D_k$  – 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, имеющих коды Брокерских фирм, связанных с Расчетным кодом (Расчетными кодами);

$RUB\_REPO\_DIF_n$  – разность между суммой второй и первой части балансирующих сделок РЕПО с КСУ с расчетами в российских рублях с n-й Датой исполнения второй части, заключенных Клиринговым центром в соответствии с подпунктом 59.16.10 общей части Правил клиринга;

$VAL\_REPO\_DIF_n^j$  – разность между суммой второй и первой части балансирующих сделок РЕПО с КСУ с расчетами в j-ой иностранной валюте с n-й Датой исполнения, заключенных Клиринговым центром в соответствии с подпунктом 59.16.10 общей части Правил клиринга;

$CC_n^i$  – средневзвешенная цена балансирующих сделок с i-ой ценной бумагой для Даты исполнения n, заключенных Клиринговым центром в соответствии с подпунктом 59.16.10 общей части Правил клиринга, рассчитанная по формуле:

$$CC_n^i = WAprice_{B/S} + \sum_{s,n>2} w_{s,n} \times (REPOprice_n - REPOprice_0) - \sum_{s,n=1,2} w_{s,n} \times (REPOprice(YD) - REPOprice(Y0))$$

, где

$WAprice_{B/S}$  – средневзвешенная цена сделок купли-продажи ценных бумаг;

$REPOprice_n$  – средневзвешенная цена вторых частей сделок РЕПО с Датой исполнения n;

$REPOprice_0$  – средневзвешенная цена первых частей сделок РЕПО с Датой исполнения в дату заключения;

$w_{s,n}$  – коэффициент доли объема сделки РЕПО в пропорции от суммарного объема обязательств, при этом:

для  $n > 2$  коэффициент рассчитывается исходя из  $POS\_C_n^i$  в Дату исполнения  $n$ ;

для  $n=1$  и  $n=2$  коэффициент рассчитывается исходя из суммы  $POS\_C_n^i$  по всем Датам исполнения;

$s$  – номер балансирующей сделки с Датой исполнения  $n$ ;

В случае использования информации о ценных бумагах в расчете промежуточной величины нетто-обязательства Участника клиринга по ценным бумагам в соответствии с подпунктами 59.16.6 и/или 59.16.7 общей части Правил клиринга, указанная информация учитывается при расчете средневзвешенной цены сделок купли-продажи ценных бумаг  $WAprice_{B/S}$  по Расчетной цене соответствующей ценной бумаги, установленной Клиринговым центром на дату расчета промежуточной величины нетто-обязательства Участника клиринга по ценным бумагам в соответствии с подпунктом 59.16.6 и/или 59.16.7 общей части Правил клиринга. Если промежуточная величина, рассчитанная в соответствии с подпунктом 59.16.3 общей части Правил клиринга по всем Торгово-клиринговым счетам Т+ / Торгово-клиринговым счетам имущественного пула Участника клиринга по всем Датам исполнения по ценной бумаге равна 0 (нулю), средневзвешенная цена сделок купли-продажи ценных бумаг  $WAprice_{B/S}$  принимается равной Расчетной цене соответствующей ценной бумаги, установленной Клиринговым центром на дату прекращения обязательств Участника клиринга.

$C\_VAL_n^i$  – курс сделки / средневзвешенный курс балансирующих сделок с иностранной валютой с Датой исполнения  $n$ , заключенной / заключенных Клиринговым центром в соответствии с подпунктом 59.16.10 общей части Правил клиринга с  $i$ -ой иностранной валютой. Если  $CC_n^i$  выражена в российских рублях, то  $C\_VAL_n^i=1$ ;

$C\_VAL_n^j$  – средневзвешенный курс сделок с иностранной валютой / драгоценным металлом для Даты исполнения  $n$ , заключенных Клиринговым центром в соответствии с подпунктом 59.16.10 общей части Правил клиринга с  $j$ -ой иностранной валютой /  $j$ -ым драгоценным металлом, рассчитанный по формуле:

$$C\_VAL_n^j = WAprice_{B/S} + \sum_{s,n>2} w_{s,n} \times (SWOPprice_n - SWOPprice_0) - \sum_{s,n=1,2} w_{s,n} \times (SWOPprice(YD) - SWOPprice(Y0))$$

, где

$WAprice_{B/S}$  – средневзвешенная цена сделок купли-продажи иностранной валюты / драгоценных металлов;

$SWOPprice_n$  – средневзвешенная цена вторых частей сделок своп / своп контрактов с Датой исполнения  $n$ ;

$SWOPprice_0$  – средневзвешенная цена первых частей сделок своп / своп контрактов с Датой исполнения в дату заключения;

$w_{s,n}$  – коэффициент доли объема сделки своп / своп контрактов в пропорции от суммарного объема обязательств, при этом:

для  $n > 2$  коэффициент рассчитывается исходя из  $POS\_VAL_n^j$  в Дату исполнения  $n$ ;

для  $n=1$  и  $n=2$  коэффициент рассчитывается исходя из суммы  $POS\_VAL_n^j$  по всем Датам исполнения;

$s$  – номер балансирующей сделки с Датой исполнения  $n$ ;

В случае использования информации о иностранной валюте / драгоценном металле в расчете промежуточной величины нетто-обязательства Участника клиринга по иностранной валюте / драгоценному металлу в соответствии с подпунктом 59.16.6 и/или 59.16.7 общей части Правил клиринга, указанная информация учитывается при расчете средневзвешенной цены сделок купли-продажи иностранной валюты / драгоценных металлов  $WAprice_{B/S}$  по Центральному курсу соответствующей иностранной валюты / соответствующего драгоценного металла, установленному Клиринговым центром на дату расчета промежуточной величины нетто-обязательства Участника клиринга по иностранной валюте / драгоценному металлу в соответствии с подпунктом 59.16.6 и/или 59.16.7 общей части Правил клиринга. Если промежуточная величина, рассчитанная в соответствии с подпунктом 59.16.3 общей части Правил клиринга по всем Расчетным кодам Участника клиринга по всем Датам исполнения по иностранной валюте / драгоценному металлу равна 0 (нулю), средневзвешенная цена сделок купли-продажи иностранной валюты / драгоценных металлов  $WAprice_{B/S}$  принимается равной Центральному курсу соответствующей иностранной валюты / соответствующего драгоценного металла, установленному Клиринговым центром на дату прекращения обязательств Участника клиринга.

$CD_k$  – цена сделки / средневзвешенная цена балансирующих сделок, заключенной / заключенных Клиринговым центром в соответствии с подпунктом 59.16.10 общей части Правил клиринга по  $k$ -му Срочному контракту. Если промежуточная величина, рассчитанная в соответствии с подпунктом 59.16.3 общей части Правил клиринга по всем Расчетным кодам Участника клиринга по всем Датам исполнения по  $k$ -му Срочному контракту равна 0 (нулю), средневзвешенная цена балансирующих сделок принимается равной Расчетной цене  $k$ -го Срочного контракта, определенная Клиринговым центром в ходе вечерней клиринговой сессии дня, предшествующего дате заключения сделок в соответствии с подпунктом 59.16.10 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 59.16.10 общей части Правил клиринга по  $k$ -му Срочному контракту;

$CT_n^l$  – цена сделки / средневзвешенная цена балансирующих сделок с товарами с Датой исполнения  $n$ , заключенной / заключенных Клиринговым центром в соответствии с подпунктом 59.16.10 общей части Правил клиринга с  $l$ -ым товаром (в российских рублях);

В случае использования информации о товаре в расчете промежуточной величины нетто-обязательства Участника клиринга по товару в соответствии с подпунктом 59.16.6 и/или 59.16.7 общей части Правил клиринга, указанная информация учитывается при расчете цены сделки / средневзвешенной цены балансирующих сделок с товарами по Расчетной цене соответствующего товара, установленной Клиринговым центром на дату расчета промежуточной величины нетто-



обязательства Участника клиринга по товару в соответствии с подпунктом 59.16.6 и/или 59.16.7 общей части Правил клиринга. Если промежуточная величина, рассчитанная в соответствии с подпунктом 59.16.3 общей части Правил клиринга по всем Торгово-клиринговым счетам Участника клиринга по всем Датам исполнения по 1-му товару равна 0 (нулю), средневзвешенная цена балансирующих сделок принимается равной Расчетной цене с 1-ого товара, определенной Клиринговым центром на дату прекращения обязательств.

$SC_m$  – расчетная стоимость (с учетом знака) m-го Договора СПФИ, являющегося балансирующей сделкой, определенная после первого в течение Расчетного дня определения Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований по денежным средствам в соответствующей валюте в отношении Клирингового центра, или определенная в отношении Клирингового центра цена (с учетом знака) Аукционной заявки на заключение всех Аукционных договоров, являющихся балансирующими сделками, заключенными Клиринговым центром в ходе Аукциона ликвидации в соответствии с Правилами клиринга на рынке Стандартизированных ПФИ. Расчетная стоимость или цена Аукционной заявки в иностранной валюте пересчитывается в российские рубли по курсу, установленному Банком России на дату прекращения обязательств по Сделкам;

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 59.16.1 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, и
- в) разность абсолютных величин 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 у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций – обязательства по передаче Дохода, возникшие до дня отзыва у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций, и обязательств Клирингового центра по передаче Дохода по балансирующим сделкам РЕПО, заключенным Клиринговым центром в соответствии с подпунктом 59.16.10 общей части Правил клиринга (учитывается со знаком «минус»), и
- г) разность требований Клирингового центра по получению Дохода по балансирующим сделкам РЕПО, заключенным Клиринговым центром в соответствии с подпунктом 59.16.10 общей части Правил клиринга, и абсолютной величины 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 у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций – обязательства по передаче Дохода, возникшие до дня отзыва у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций (учитывается 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, и
- е) значений (с учетом знака) обязательств / требований Участника клиринга по возврату накопленной депозитной маржи, учитываемых по Расчетному коду (Расчетным кодам) на конец дня прекращения обязательств по Сделкам, и
- ж) обязательств Участника клиринга по уплате комиссионных вознаграждений, а также неустоек (штрафов, пеней), подлежащих уплате Участником клиринга в соответствии с Правилами клиринга, учитываемых по Расчетному коду (Расчетным кодам) (учитываются со знаком «минус»), за исключением следующих случаев:
  - отзыв 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
- з) обязательств Участника пула по внесению имущества в имущественный пул, оставшихся после продажи имущества из имущественного пула в соответствии с подпунктом 59.16.1 общей части Правил клиринга (учитываются со знаком «минус»);
- и) 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);
- к) обязательств Участника клиринга по уплате сумм, соответствующих суммам налога на прибыль организаций с доходов иностранных организаций от источников в Российской Федерации (учитываются со знаком «минус»);
- л) обязательств Участника клиринга по уплате сумм, соответствующих суммам налога на доход от источника в США и/или приравненный к нему доход (учитываются со знаком «минус»);

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 59.16.12 общей части Правил клиринга, если неотрицательная – в соответствии с подпунктом 59.16.13 общей части Правил клиринга.

59.16.12. Клиринговый центр рассчитывает сумму с учетом знака отрицательной величины  $SUM_{SC}$ , рассчитанной в соответствии с подпунктом 59.16.11 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 59.16.11 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 59.16.12 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 59.16.12 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 59.16.8 общей части Правил клиринга, и пересчитанной в российские рубли по курсу / средневзвешенному курсу сделок с иностранной валютой, заключенных Клиринговым центром в соответствии с подпунктом 59.16.10 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 59.16.10 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 59.16.10 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 59.16.8 общей части Правил клиринга, и

- пересчитанной в российские рубли по цене / средневзвешенной цене сделок с ценными бумагами, заключенных Клиринговым центром в соответствии с подпунктом 59.16.10 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 59.16.12 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 59.16.10 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 59.16.12 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 59.16.10 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 59.16.12 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 59.16.8 общей части Правил клиринга, и пересчитанной в российские рубли по курсу / средневзвешенному курсу сделок с драгоценным металлом, заключенных Клиринговым центром в соответствии с подпунктом 59.16.10 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 59.16.8 общей части Правил клиринга, и пересчитанной в российские рубли по цене / средневзвешенной цене сделок с товаром, заключенных Клиринговым центром в соответствии с подпунктом 59.16.10 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 59.16.12 общей части Правил клиринга.

Если в результате последовательного выполнения любого из действий, предусмотренных пунктами 1 – 11 настоящего подпункта 59.16.12 общей части

Правил клиринга, полученное значение  $SUM_{SC}$  является неотрицательной величиной, расчет соответствующего нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга продолжается в соответствии с подпунктом 59.16.13 общей части Правил клиринга.

59.16.13. Если величина  $SUM_{SC}$ , рассчитанная в соответствии с подпунктом 59.16.11 или 59.16.12 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 59.16.12 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 59.16.11 или 59.16.12 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  $SUM_{SCi}$ , рассчитанных в соответствии с подпунктом 59.16.12 общей части Правил клиринга по клиентским Расчетным кодам и Расчетных кодов ДУ, и положительной величины  $SUM_{SC2}$ , рассчитанной в соответствии с подпунктом 59.16.12 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:

$$SUM_{SCi} = SUM_{SCi} + \min \left( (SUM_{SCown} / \sum_i SUM_{SCi}) \times SUM_{SCi}; abc(SUM_{SCi}) \right),$$

$$SUM_{SCown} = SUM_{SCown} - \sum_i \left( \min \left( (SUM_{SCown} / \sum_i SUM_{SCi}) \times SUM_{SCi}; abc(SUM_{SCi}) \right) \right), \text{ где}$$

$SUM_{SCi}$  – отрицательная величина  $SUM_{SC}$ , рассчитанная в соответствии с подпунктом 59.16.12 общей части Правил клиринга по клиентскому Расчетному коду или Расчетному коду ДУ;

$SUM_{SCown}$  – положительная величина  $SUM_{SC}$ , рассчитанная в соответствии с подпунктом 59.16.11 и/или 59.16.12 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 59.16.12 общей части Правил клиринга с использованием Обеспечения, учитываемого по собственным Расчетным кодам и соответствующих им Торгово-клиринговым

счетах, 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.

59.16.14. Каждое из обязательств, перечисленных в подпункте 59.16.12 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 59.16.12 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 59.16.8 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 59.16.10 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 59.16.10 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 59.16.8 общей части Правил клиринга, и количеству ценных бумаг в сделках по продаже Обеспечения в ценных бумагах, заключенных Клиринговым центром в соответствии с подпунктом 59.16.10 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, начиная с дня приостановления допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию по основаниям, указанным в пунктах 59.1-59.12 общей части Правил клиринга;

- 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 59.16.8 общей части Правил клиринга, и количеству драгоценных металлов в сделках по продаже Обеспечения в драгоценных металлах, заключенных Клиринговым центром в соответствии с подпунктом 59.16.10 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 59.16.8 общей части Правил клиринга, и количеству товаров в сделках по продаже Обеспечения в товарах, заключенных Клиринговым центром в соответствии с подпунктом 59.16.10 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, начиная с дня приостановления допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию по основаниям, указанным в пунктах 59.1-59.12 общей части Правил клиринга.

59.16.15. В случае непредоставления Клиринговому центру Обособленным клиентом Заявления на перевод обязательств и Обеспечения или Участником клиринга – реципиентом Согласия на прием обязательств и Обеспечения в сроки установленные Временным регламентом, Клиринговый центр рассчитывает сумму нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в российских рублях по Сделкам с центральным контрагентом, заключенным за счет Обособленного клиента Участника клиринга с указанием Торгово-клиринговых счетов / иных клиринговых регистров, соответствующих Расчетным кодам, открытым для Обособленного клиента, в порядке, аналогичном порядку, установленному пунктом 59.16 общей части Правил клиринга.

59.17. 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 59.17.1-59.17.3 общей части Правил клиринга, отдельно по каждому клиентскому Расчетному коду, по каждому Расчетному коду ДУ и по всем собственным Расчетным кодам Участника клиринга:

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

$$\text{SUM} = \text{POS\_RUB} + \sum_i (\text{POS\_C}_i \times \text{CC}_i; 2) + \sum_i (\text{POS\_R}_i \times \text{CC}_i) + \sum_j (\text{POS\_VAL}_j \times \text{C\_VAL}_j), \text{ где}$$

$$\text{POS\_RUB} = \text{ST} - \text{SO},$$

$$\text{POS\_VAL}_j = \text{ST}_j - \text{SO}_j,$$

$$\text{POS\_C}_i = \text{STC}_i - \text{SOC}_i,$$

$$\text{POS\_R}_i = \text{STR}_i - \text{SOR}_i,$$

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

POS\_C<sub>i</sub> – обязательство (требование) Участника клиринга по i-ой ценной бумаге по сделкам купли-продажи ценных бумаг;

POS\_VAL<sub>j</sub> – обязательство (требование) Участника клиринга по денежным средствам в j-ой иностранной валюте;

POS\_R<sub>i</sub> – 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;
- возврату кредита по кредитному договору с кодом расчетов Rb, Sn.
- по передаче Дохода по Сделкам без центрального контрагента, предусмотренных Правилами клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.

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.

При этом сумма обязательств и требований по возврату кредита по кредитному договору рассчитывается исходя из фактического срока кредитного договора, прошедшего от фактической даты исполнения обязательств по выдаче кредита, не включая эту дату, до даты прекращения обязательств по сделкам, 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.

В случае если обязательства по выдаче кредита не исполнены на дату прекращения обязательств по Сделкам в соответствии с настоящей статьей общей части Правил клиринга, обязательства по кредитному договору прекращаются и не учитываются при расчете нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга.

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  $S_n$ ;

- вторым частям сделок РЕПО с кодом расчетов  $R_b, S_n, Z_0$ .

$CC_i$  – 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, рынке депозитов и рынке кредитов 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 фиксинга Московской Биржи соответствующей иностранной валюты, определенному на дату прекращения обязательств по Сделкам (для всех Сделок, за исключением сделок РЕПО с Банком России), для сделок РЕПО с Банком России – 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 фиксинга Московской Биржи  $j$ -ой иностранной валюты, определенный на дату прекращения обязательств по Сделкам (для всех Сделок, за исключением сделок РЕПО с Банком России), для сделок РЕПО с Банком России – курс  $j$ -ой иностранной валюты, установленный Банком России на дату прекращения обязательств по Сделкам;

$\sum_j$  – сумма по иностранным валютам.

59.17.2. Если величина, рассчитанная в соответствии с подпунктом 59.17.1 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.

59.17.3. 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 59.1, 59.4 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, положительная величина, рассчитанная в соответствии с подпунктом 59.17.1 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.

- 59.18. 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 Расчетному коду (Расчетным кодам) Участника клиринга в соответствии с пунктом 59.16 общей части Правил клиринга нетто-обязательствах / нетто-требованиях Участника клиринга в отношении Клирингового центра, а также о рассчитанных по Расчетному коду (Расчетным кодам) Участника клиринга в соответствии с пунктом 59.17 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 59.15 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.

- 59.19. Клиринговый центр направляет Доверенному владельцу счетов в форме электронного документа уведомление о рассчитанной в соответствии с пунктом 59.16 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.

59.20. Возврат Участнику клиринга денежных средств в российских рублях в сумме нетто-требований Участника клиринга, определенных в соответствии с пунктом 59.16 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 59.16 общей части Правил клиринга, осуществляется Клиринговым центром в соответствии с пунктом 4.12 общей части Правил клиринга.

59.20.1. 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 59.16 общей части Правил клиринга, Клиринговый центр на основании пункта 3.20 общей части Правил клиринга осуществляет на соответствующих 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 59.16 общей части Правил клиринга.

В случае заключения балансирующих сделок по реализации Обеспечения / Обеспечения под стресс / взносов в Гарантийные фонды Участника клиринга в иностранной валюте и драгоценных металлах в суммах / количестве, меньшем размера Обеспечения / Обеспечения под стресс / взносов в Гарантийные фонды, иностранная валюта и драгоценные металлы в суммах / количестве, меньшем лота, установленного Биржей, конвертируются в российские рубли по курсу иностранной валюты, установленному Банком России на дату прекращения обязательств по Сделкам / по Центральному курсу соответствующего драгоценного металла, установленному Клиринговым центром на дату прекращения обязательств по Сделкам. В случае, если обязательства по Сделкам прекращаются в выходной или нерабочий (праздничный) день, драгоценные металлы конвертируются в российские рубли по Центральному курсу соответствующего драгоценного металла, установленному Клиринговым центром на дату, предшествующую дате прекращения обязательств по Сделкам.

59.20.2. Клиринговый центр возвращает Участнику клиринга денежные средства в российских рублях в сумме:

- нетто-требований Участника клиринга, определенных в соответствии с пунктом 59.16 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 59.16 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 59.20.1 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 обязательств по Сделкам / по Центральному курсу соответствующего драгоценного металла, установленному Клиринговым центром на дату прекращения обязательств по Сделкам. В случае невозможности продажи Обеспечения / Обеспечения под стресс / взносов в Гарантийные фонды в иностранной валюте / драгоценных металлах Клиринговый центр вправе принять решение о возврате Участнику клиринга Обеспечения / Обеспечения под стресс / взносов в Гарантийные фонды в иностранной валюте / драгоценных металлах без проведения их продажи / конвертации.
- 59.20.3. 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 59.16 общей части Правил клиринга, списываются с Разделов Участника клиринга без согласия Клирингового центра.
- 59.20.4. Товары, оставшиеся на торговых разделах торговых товарных счетов Участников клиринга после определения нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга в порядке, предусмотренном пунктом 59.16 общей части Правил клиринга, списываются с торговых разделов торговых товарных счетов Участника клиринга без согласия Клирингового центра.
- 59.21. Клиринговый центр вправе предъявить к Участнику клиринга требование о взыскании нетто-обязательств Участника клиринга, рассчитанных в порядке, предусмотренном пунктом 59.16 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).
- 59.22. 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 59.16.1 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 участия в указанном количестве погашаются Клиринговым центром, денежные средства в сумме номинальной стоимости погашенных клиринговых сертификатов участия выводятся из соответствующего имущественного пула.

**Статья 60. Порядок урегулирования обязательств в случае банкротства клиента Участника клиринга (ликвидационный неттинг в отношении клиента Участника клиринга)**

60.1. 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 юридического лица, являющегося клиентом 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, при условии предварительного открытия Участником клиринга отдельного Расчетного кода Участника клиринга и/или иных клиринговых регистров, предусмотренных специальными частями Правил клиринга, для такого клиента и установления соответствия между Расчетным кодом Участника клиринга и идентификационными данными клиента Участника клиринга в соответствии с пунктом 16.13 общей части Правил клиринга, и/или при условии регистрации Участником клиринга такого клиента в качестве Обособленного клиента.

60.2. Для того чтобы воспользоваться правом, предусмотренным пунктом 60.1 общей части Правил клиринга, Участник клиринга предоставляет Клиринговому центру Заявление о проведении ликвидационного неттинга в отношении клиента Участника клиринга.

60.3. Участник клиринга уполномочивает Клиринговый центр на заключение балансирующих сделок от имени Участника клиринга, а также на осуществление иных действий в соответствии с Правилами клиринга в целях проведения ликвидационного неттинга в отношении клиента Участника клиринга на основании Заявления о проведении ликвидационного неттинга в отношении клиента Участника клиринга. Настоящая доверенность действует с даты вступления в силу редакции Правил клиринга, содержащей настоящий пункт, и действует в течение 10 (десяти) лет.

60.4. 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.

60.5. 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 такого клиента;
- 2) документы и/или информацию, подтверждающие наличие оснований, указанных в пункте 60.1 общей части Правил клиринга.
- 60.6. Клиринговый центр вправе отказать Участнику клиринга в исполнении Заявления:
- 60.6.1. в случае непредоставления Участником клиринга документов и/или информации, указанных в пунктах 60.2, 60.5 общей части Правил клиринга;
- 60.6.2. в случае, если, по мнению Клирингового центра, исполнение Заявления может создать угрозу финансовой стабильности Клирингового центра;
- 60.6.3. в случае предоставления Заявления позднее времени, указанного во Временном регламенте;
- 60.6.4. в случае, если, по мнению Клирингового центра, исполнение Заявления невозможно в срок, установленный законодательством;
- 60.6.5. если Клиринговым центром начато прекращение обязательств Участника клиринга по основаниям, установленным Правилами клиринга;
- 60.6.6. в случае если обязательства по сделкам, стороной по которым является Участник клиринга, заключенным на соответствующих Рынках за счет клиента Участника клиринга, указанного в Заявлении, прекращены.
- 60.7. Исполнение Заявления о проведении ликвидационного неттинга в отношении клиента Участника клиринга осуществляется в следующем порядке.
- 60.7.1. 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 60.8 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 60.9 общей части Правил клиринга.
- 60.7.2. 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 60.8 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 60.9 общей части Правил клиринга.

- 60.8. 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 указанием Торгово-клиринговых счетов / иных клиринговых регистров, соответствующих Расчетным кодам, указанным Участником клиринга в Заявлении, предоставленном в соответствии с пунктом 60.5 общей части Правил клиринга, в порядке, аналогичном порядку, установленному пунктом 59.16 общей части Правил клиринга, при этом в расчете участвует Обеспечение, учитываемое по Расчетным кодам, указанным Участником клиринга в Заявлении, предоставленном в соответствии с пунктом 60.5 общей части Правил клиринга, и не участвует Обеспечение, учитываемое по другим Расчетным кодам Участника клиринга, Обеспечение под стресс, взносы в Гарантийные фонды.
- 60.9. 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 с указанием Торгово-клиринговых счетов, соответствующих Расчетным кодам, указанным Участником клиринга в Заявлении, предоставленном в соответствии с пунктом 60.5 общей части Правил клиринга, в порядке, аналогичном порядку, установленному пунктом 59.17 общей части Правил клиринга.
- 60.10. 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 60.8 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 60.9 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.

- 60.11. 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 60.8 общей части Правил клиринга;
  - денежные средства в российских рублях в сумме Обеспечения Участника клиринга в российских рублях, учитываемого по Расчетным кодам, указанным Участником клиринга в Заявлении, предоставленном в соответствии с пунктом 60.5 общей части Правил клиринга, и не использованного для определения нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в соответствии с пунктом 60.8 общей части Правил клиринга;
  - денежные средства в иностранной валюте – в сумме Обеспечения Участника клиринга в соответствующей иностранной валюте, учитываемого по Расчетным кодам, указанным Участником клиринга в Заявлении, предоставленном в соответствии с пунктом 60.5 общей части Правил клиринга, и не использованного для определения нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в соответствии с пунктом 60.8 общей части Правил клиринга;
  - драгоценные металлы – в размере Обеспечения Участника клиринга в соответствующем драгоценном металле, учитываемого по Расчетным кодам, указанным Участником клиринга в Заявлении, предоставленном в соответствии с пунктом 60.5 общей части Правил клиринга, и не использованного для определения нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в соответствии с пунктом 60.8 общей части Правил клиринга.
- 60.12. Нетто-обязательство Участника клиринга, рассчитанное в соответствии с пунктом 60.8 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 50 общей части Правил клиринга.
- 60.13. 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.
- 60.14. 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 59.16.1 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 участия в указанном количестве погашаются Клиринговым центром, денежные средства в сумме номинальной стоимости погашенных клиринговых сертификатов участия выводятся из соответствующего имущественного пула.

**Статья 61. Порядок урегулирования обязательств в случае неисполнения Клиринговым центром обязательств по возврату Участнику клиринга денежных средств / ценных бумаг / драгоценных металлов, учитываемых в качестве Обеспечения / Обеспечения под стресс / взносов в Гарантийные фонды (дефолт Клирингового центра в отношении Участника клиринга)**

- 61.1. В случае если Клиринговый центр не исполнил обязательство по возврату Участнику клиринга денежных средств / ценных бумаг / драгоценных металлов, учитываемых в качестве Обеспечения / Обеспечения под стресс / взносов в Гарантийные фонды в порядке и размере, определенном в общей и/или специальной части Правил клиринга, и отсутствия у Участника клиринга неисполненных обязательств перед Клиринговым центром, предусмотренных Правилами клиринга, Участник клиринга вправе направить Клиринговому центру уведомление о прекращении всех обязательств по Сделкам с центральным контрагентом, стороной по которым является данный Участник клиринга (далее – Уведомление о дефолте Клирингового центра в отношении Участника клиринга).
- 61.2. Если в течение 30 (тридцати) дней с даты направления Участником клиринга Клиринговому центру Уведомления о дефолте Клирингового центра в отношении Участника клиринга (далее – Срок для возврата) Клиринговый центр исполнит обязательство по возврату Участнику клиринга денежных средств / ценных бумаг / драгоценных металлов, учитываемых в качестве Обеспечения / Обеспечения под стресс / взносов в Гарантийные фонды, неисполнение которого послужило основанием направления Клиринговому центру Уведомления о дефолте Клирингового центра в отношении Участника клиринга, с учетом условий указанного обязательства, а также условий его исполнения, установленных Правилами клиринга, указанное обязательство Клирингового центра считается исполненным, а Уведомление о дефолте Клирингового центра в отношении Участника клиринга – аннулированным.
- 61.3. Если в течение Срока для возврата и до исполнения Клиринговым центром обязательства по возврату Участнику клиринга денежных средств / ценных бумаг / драгоценных металлов, учитываемых в качестве Обеспечения / Обеспечения под стресс / взносов в Гарантийные фонды, неисполнение которого послужило основанием направления Клиринговому центру Уведомления о дефолте Клирингового центра в отношении Участника клиринга, у Участника клиринга возникает Задолженность и/или Маржинальное требование, не исполненные в срок, установленный Правилами клиринга, по какому-либо Расчетному коду, либо перестают соблюдаться установленные Правилами клиринга условия исполнения указанного обязательства, позволяющие вернуть сумму / количество денежных

средств / ценных бумаг / драгоценных металлов (при возврате на основании распоряжения / поручения с указанием суммы / количества денежных средств / ценных бумаг / драгоценных металлов), либо вернуть любую сумму денежных средств / ценных бумаг / драгоценных металлов (при возврате на основании распоряжения / поручения без указания суммы / количества денежных средств / ценных бумаг / драгоценных металлов), Уведомление о дефолте Клирингового центра в отношении Участника клиринга считается аннулированным.

61.4. Если в течение Срока для возврата Клиринговый центр не исполнит обязательство по возврату денежных средств / ценных бумаг / драгоценных металлов, учитываемых в качестве Обеспечения / Обеспечения под стресс / взносов в Гарантийные фонды, неисполнение которого послужило основанием направления Клиринговому центру Уведомления о дефолте Клирингового центра в отношении Участника клиринга, в соответствии с пунктом 61.2 общей части Правил клиринга, или указанное обязательство не прекратится в соответствии с пунктом 61.3 общей части Правил клиринга, Клиринговый центр признается допустившим дефолт в отношении Участника клиринга.

61.5. В случае признания дефолта Клирингового центра в отношении Участника клиринга обязательства по Сделкам с центральным контрагентом, стороной по которым является Участник клиринга, в отношении которого Клиринговый центр допустил дефолт, прекращаются полностью на дату окончания Срока для возврата возникновением нетто-обязательств / нетто-требований, рассчитанных по состоянию на конец дня окончания Срока для возврата в порядке, аналогичном порядку, указанному в пункте 59.16 общей части Правил клиринга.

Если величина, рассчитанная в соответствии с настоящим подпунктом общей части Правил клиринга, положительная, это означает наличие нетто-обязательства Клирингового центра по отношению к Участнику клиринга, если отрицательная – нетто-требования Клирингового центра по отношению к Участнику клиринга.

61.6. Нетто-обязательства / нетто-требования, рассчитанные в соответствии с пунктом 61.5 общей части Правил клиринга, подлежат исполнению в течение 1 (одного) Расчетного дня после их определения.

61.7. Не являются основаниями для направления Клиринговому центру Уведомления о дефолте Клирингового центра в отношении Участника клиринга в соответствии с настоящей статьей общей части Правил клиринга:

61.7.1. проведение Клиринговым центром процедуры дисконтирования обязательств Клирингового центра по возврату Обеспечения в денежных средствах Участникам клиринга в соответствии с Правилами клиринга об ограничении размера ответственности Клирингового центра;

61.7.2. заключение Клиринговым центром балансирующих сделок с Добросовестными участниками клиринга в соответствии с пунктом 26.3 общей части Правил клиринга;

61.7.3. принятие Клиринговым центром решений и/или осуществление действий, направленных на урегулирование чрезвычайной ситуации, предусмотренных статьей 64 общей части Правил клиринга.

**Статья 62. Порядок урегулирования обязательств в случае отзыва (аннулирования) лицензии на осуществление банковских операций у Клирингового центра (ликвидационный неттинг в отношении Клирингового центра)**

62.1. 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 62.4 общей части Правил клиринга.

62.1.1. 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).

62.2. 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 62.4 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).

62.3. 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 / драгоценных металлов / ценных бумаг и исполняется при соблюдении условий погашения клиринговых сертификатов участия при выдаче указанного имущества из имущественного пула, установленных Правилами клиринга на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.

Для исполнения указанного заявления Клиринговый центр формирует и исполняет распоряжения на перевод денежных средств со Счетов обеспечения, открытых для Расчетных кодов имущественного пула, входящих в состав Торгово-клирингового счета имущественного пула, на Счета обеспечения, связанные с Расчетными кодами, входящими 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, рынке депозитов и рынке кредитов.

62.4. 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, за исключением Обособленных клиентов и сделок, заключенных за счет средств Доверенных владельцев счетов, - по каждому Расчетному коду ДУ и Расчетному коду ДУ имущественного пула.

62.4.1. 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, рынке депозитов и рынке кредитов, 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, драгоценные металлы и иностранную валюту, оставшиеся в имущественном пуле после исполнения распоряжения Участника клиринга, указанного в пункте 62.3 общей части Правил клиринга, и учитываемые по соответствующим Расчетным кодам имущественного пула Участника пула, на соответствующих 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, драгоценных металлов 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 T+, 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, драгоценных металлов 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 62.4.3 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 62.4.1 общей части Правил клиринга, 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 62.4.1 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 62.4.3 общей части Правил клиринга.

- 62.4.2. После выполнения действий, указанных в подпункте 62.4.1 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.

- 62.4.3. 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 / Расчетным кодам имущественного пула 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) 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 отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций /



- день введения в отношении Клирингового центра моратория на удовлетворение требований кредиторов;
- к) значений (с учетом знака) обязательств / требований Участника клиринга по возврату накопленной депозитной маржи, учитываемых по Расчетному коду (Расчетным кодам) на конец дня отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций / день введения в отношении Клирингового центра моратория на удовлетворение требований кредиторов;
  - л) промежуточной величины нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в российских рублях по сделкам РЕПО с клиринговыми сертификатами участия, рассчитанной в соответствии с подпунктом 62.4.1 общей части Правил клиринга (с учетом знака);
  - м) номинальной стоимости (в российских рублях) клиринговых сертификатов участия, предъявленных к выкупу Банком России;
  - н) Обеспечения Участника клиринга в российских рублях, учитываемого по соответствующим Расчетным кодам на конец дня прекращения обязательств по Сделкам (учитывается со знаком «плюс»);
  - о) 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»);
  - п) 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;
  - р) 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;
  - с) 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;

- т) 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);
- у) 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);
- ф) 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);
- х) 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);
- ц) 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);
- ч) 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);
- ш) 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»);
- щ) 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»);
- ы) 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»);
  - э) обязательств Участника клиринга по внесению имущества в имущественный пул, оставшихся после продажи имущества из имущественного пула в соответствии с подпунктом 62.4.1 общей части Правил клиринга (учитываются со знаком «минус»);
  - ю) обязательств Участника клиринга – Нерезидента / Участника клиринга – Международной организации по уплате суммы, соответствующей сумме налога на прибыль организаций с доходов иностранных организаций от источников в Российской Федерации, определенной в соответствии со статьей 7 общей части Правил клиринга (учитываются со знаком «минус»);
  - я) обязательства Участника клиринга – Нерезидента / Участника клиринга – Международной организации по уплате суммы, равной разнице между суммой, соответствующей сумме налога на прибыль организаций с доходов иностранных организаций от источников в Российской Федерации, рассчитанной по максимальной ставке, установленной российским налоговым законодательством, и суммой, соответствующей сумме налога, рассчитанной по действующей в текущем календарном году налоговой ставке, установленной применимым соглашением об избежании двойного налогообложения, заключенным с государством, налоговым резидентом которого являлся Участник клиринга – Нерезидент, фактический получатель дохода Участника клиринга – Нерезидента или фактический получатель дохода Участника клиринга – Международной организации в предыдущем календарном году (налоговом периоде) (учитываются со знаком «минус»);
  - аа) обязательств Участника клиринга по уплате суммы, соответствующей сумме налога на доход от источника в США и/или приравненный к нему доход (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.

- 62.5. Информация о сумме нетто-обязательств / нетто-требований Клирингового центра в российских рублях в отношении Участника клиринга, определенных в соответствии с пунктом 62.4 общей части Правил клиринга, направляется Клиринговым центром Участнику клиринга.

- 62.6. Информация о сумме нетто-обязательства / нетто-требования Клирингового центра в российских рублях в отношении Участника клиринга, определенных в соответствии с пунктом 62.4 общей части Правил клиринга по Сделкам, заключенным за счет средств Доверенного владельца счетов, направляется Клиринговым центром Доверенному владельцу счетов.
- 62.7. После определения нетто-обязательств / нетто-требований Клирингового центра в отношении Участника клиринга в соответствии с пунктом 62.4 общей части Правил клиринга все имущественные пулы прекращаются.

**Статья 63. Возникновение обстоятельств, которые могут повлиять на возможность проведения Торгов и (или) клиринга**

- 63.1. 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 предпринимает все возможные меры, направленные на устранение указанных обстоятельств. При возникновении указанных обстоятельств, влияющих на проведение организованных торгов, или расчеты по итогам клиринга, незамедлительно уведомляет об этом Биржу и/или Расчетную организацию и/или Расчетный депозитарий любым из доступных средств связи.

Если указанные обстоятельства существенно влияют на порядок проведения клиринга, в том числе возможность заключения Внебиржевых сделок, Клиринговый центр вправе ограничить (приостановить) проведение определенных операций до устранения указанных обстоятельств в отношении одного или нескольких Участников клиринга. Соответствующий Участник клиринга (Участники клиринга) уведомляются об указанных ограничениях посредством ЭДО или иным доступным способом, либо, если обстоятельства затрагивают большинство Участников соответствующего рынка – посредством ЭДО либо посредством раскрытия информации на Сайте Клирингового центра, не позднее дня введения ограничений (приостановлений), если иное срок не указан в самом решении о введении ограничений (приостановлений).

- 63.2. В соответствии с пунктом 2 статьи 393, статьей 15 и статьей 401 Гражданского кодекса РФ, Клиринговый центр не несет ответственность за убытки Участника клиринга в случае неисполнения / ненадлежащего исполнения Биржей, Техническим центром обязательств перед Клиринговым центром или Участником клиринга, за исключением случаев, если такое неисполнение явилось следствием умышленных действий Клирингового центра.
- 63.3. Внебиржевая сделка (Внебиржевые сделки, в том числе Парные договоры), заключенные с нарушением Правил клиринга, в том числе в результате

технических сбоев и/или ошибок в работе Клиринговой системы (включая сбои в работе программного обеспечения), программно-технических средств, информационно-коммуникационных средств связи, с помощью которых обеспечивается оказание клиринговых услуг, могут быть признаны незаключенными.

## **Статья 64. Чрезвычайные ситуации**

64.1. 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, иного имущества, внесенного в качестве обеспечения, 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 Банком-нерезидентом;
- действия/бездействия банков или небанковских кредитных организаций, в том числе Банков-нерезидентов, повлекшие невозможность исполнения обязательств Клирингового центра по возврату денежных средств в иностранной валюте / драгоценных металлах Участникам клиринга по не зависящим от Клирингового центра и Участников клиринга причинам, включая случаи введения вышеуказанными

- организациями, в том числе Банками-нерезидентами, специальных режимов переводов денежных средств;
- иные обстоятельства, препятствующие клиринговому обслуживанию Участника клиринга / Участников клиринга, которые, находятся вне контроля Клирингового центра.
- 64.2. Признание ситуации чрезвычайной осуществляется по решению Клирингового центра. Ситуация может быть признана чрезвычайной в отношении одного или нескольких Участников клиринга.
- 64.3. 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.
- 64.4. В качестве мер по урегулированию чрезвычайной ситуации (при необходимости по согласованию с Банком России и Биржей) Клиринговым центром могут быть приняты следующие решения:
- 64.4.1. об изменении Временного регламента и/или сроков осуществления документооборота в процессе взаимодействия Клирингового центра с Расчетной организацией, Расчетным депозитарием и Биржей;
- 64.4.2. об исключении из клирингового пула обязательств по некоторым или всем Сделкам;
- 64.4.3. о прекращении учета (полностью или в части) ценных бумаг, иностранной валюты, драгоценных металлов, товаров, определенных таким решением, в качестве обеспечения исполнения обязательств, в том числе, по Сделкам с частичным обеспечением Участника клиринга / Участников клиринга, в отношении которого / которых ситуация признана чрезвычайной;
- 64.4.4. об изменении цены / порядка определения цены сделок своп, заключаемых Клиринговым центром с Участником клиринга на основании пункта 44.5 общей части Правил клиринга;
- 64.4.5. об изменении ставки РЕПО / порядка определения ставки РЕПО в сделках РЕПО, заключаемых Клиринговым центром с Участником клиринга на основании пункта 44.2 общей части Правил клиринга;
- 64.4.6. о неприменении пунктов 26.8, подпунктов 45.2.3, 46.4.5, 46.4.6, 46.4.7 общей части Правил клиринга для Итоговых нетто-обязательств Участника клиринга в

- иностранной валюте / ценных бумагах / драгоценных металлах / товарах, определенных таким решением;
- 64.4.7. об изменении способа, порядка и Даты исполнения обязательств по Сделкам Участником клиринга / Участниками клиринга и/или Клиринговым центром, в том числе в соответствии с пунктом 64.6 общей части Правил клиринга;
- 64.4.8. об изменении способа, порядка и/или Даты исполнения Клиринговым центром обязательства по возврату Участникам клиринга денежных средств / драгоценных металлов / ценных бумаг / товаров, определенных таким решением, учитываемых на Счетах обеспечения / Счетах обеспечения нерезидентов / Счетах гарантийных фондов / Счетах обеспечения под стресс, Обеспечения под риск концентрации на эмитента Участника клиринга, внесенных в имущественный пул;
- 64.4.9. об изменении способа, порядка и/или Даты исполнения Клиринговым центром обязательства по возврату Доверенным владельцам счетов денежных средств / драгоценных металлов / ценных бумаг / товаров, определенных таким решением, учитываемых на Счетах обеспечения Доверенного владельца счетов;
- 64.4.10. 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.

- 64.5. При принятии Клиринговым центром в соответствии с пунктом 64.4.3 общей части Правил клиринга решения о прекращении учета части иностранной валюты / драгоценных металлов в качестве обеспечения исполнения обязательств Участников клиринга в отношении нескольких Участников клиринга Клиринговый центр своим решением определяет количество иностранной валюты / драгоценных металлов, которое прекращает учитываться в качестве обеспечения исполнения обязательств каждого из Участников клиринга, в отношении которых ситуация признана чрезвычайной, с учетом положений пунктов 64.5.1-64.5.4 общей части Правил клиринга. Клиринговый центр также вправе принять иные решения, необходимые для обеспечения реализации решения о частичном прекращении учета иностранной валюты / драгоценных металлов в качестве обеспечения исполнения обязательств Участников клиринга.

После прекращения обстоятельств, являющихся основанием признания ситуации чрезвычайной, Клиринговый центр с учетом положений пунктов 64.5.5-64.5.9 общей части Правил клиринга принимает решение о возобновлении учета (полностью или в части) в качестве обеспечения иностранной валюты / драгоценных металлов, учет которой(-ых) в качестве обеспечения исполнения обязательств Участников клиринга в соответствии с пунктом 64.4.3 общей части Правил клиринга ранее был прекращен (далее - Снятие блокировки обеспечения Участников клиринга).

- 64.5.1. Иностранная валюта / драгоценные металлы, заблокированная(-ые) банком или небанковской кредитной организацией, в том числе Банком-нерезидентом, на клиринговом банковском и/или корреспондентском счете, используемом для внесения, учета (хранения) обеспечения в такой иностранной валюте/драгоценном металле, и/или банковском счете в драгоценном металле Клирингового центра, и учет которой(-ых) в качестве обеспечения исполнения обязательств Участников

клиринга Клиринговым центром прекращен (далее – Блокировка обеспечения Участников клиринга), учитывается(-ются) Клиринговым центром:

- в части обеспечения в иностранной валюте - на отдельных лицевых счетах, открытых Клиринговым центром на том же балансовом счете, на котором открыт соответствующий Счет обеспечения/Счет гарантийных фондов/Счет обеспечения под стресс, предназначенный для учета заблокированного обеспечения в иностранной валюте (далее – Счет блокировки) с одновременным уменьшением денежных средств в иностранной валюте на Счетах обеспечения/Счетах гарантийных фондов/Счетах обеспечения под стресс, а также на Расчетных кодах Участника клиринга, Расчетных кодах имущественного пула, Расчетных кодах для уплаты налогов, Расчетных кодах для учета взносов в Гарантийные фонды, Расчетных кодах для учета Обеспечения под риски концентрации на эмитентов, Расчетных кодах для учета Обеспечения под стресс, соответствующих Счетам обеспечения;
- в части обеспечения в драгоценных металлах - на торговых банковских счетах.

64.5.2. Сумма/количество обеспечения в соответствующей иностранной валюте/драгоценном металле, заблокированная(-ое) на клиринговых банковских/корреспондентских счетах и/или банковских счетах в драгоценных металлах Клирингового центра, последовательно распределяется по Расчетным кодам Участника клиринга/ Расчетным кодам имущественного пула/ Расчетным кодам для уплаты налогов/ Расчетным кодам для учета взносов в Гарантийные фонды/ Расчетным кодам для учета Обеспечения под риски концентрации на эмитентов/ Расчетным кодам для учета Обеспечения под стресс/торговым банковским счетам Участников клиринга, имеющим на начало процедуры Блокировки обеспечения Участников клиринга обеспечение в соответствующей иностранной валюте/драгоценном металле, за исключением Участников клиринга, в отношении которых на дату и время принятия Решения Клирингового центра имеется решение о прекращении допуска к клиринговому обслуживанию на всех Рынках, в следующем порядке:

- в первую очередь по собственным Расчетным кодам Участника клиринга/ Расчетным кодам имущественного пула/ Расчетным кодам для уплаты налогов/ Расчетным кодам для учета взносов в Гарантийные фонды/ Расчетным кодам для учета Обеспечения под риски концентрации на эмитентов/ Расчетным кодам для учета Обеспечения под стресс/торговым банковским счетам Участника клиринга, которым соответствует собственный Расчетный код Участника клиринга, тех Участников клиринга, учитываемая сумма/количество обеспечения в соответствующей иностранной валюте/драгоценном металле по всем Расчетным кодам Участника клиринга/ Расчетным кодам имущественного пула/ Расчетным кодам для уплаты налогов/ Расчетным кодам для учета взносов в Гарантийные фонды/ Расчетным кодам для учета Обеспечения под риски концентрации на эмитентов/ Расчетным кодам для учета Обеспечения под стресс/торговым банковским счетам которых превышает величину, установленную для каждой иностранной валюты/драгоценного металла, размер которой определен решением Клирингового центра, применяемую для определения очередности использования обеспечения Участников клиринга для проведения процедуры Блокировки обеспечения Участников клиринга (далее – Порог);



- во вторую очередь по собственным Расчетным кодам Участника клиринга/ Расчетным кодам имущественного пула/ Расчетным кодам для уплаты налогов/ Расчетным кодам для учета взносов в Гарантийные фонды/ Расчетным кодам для учета Обеспечения под риски концентрации на эмитентов/ Расчетным кодам для учета Обеспечения под стресс/ торговым банковским счетам Участника клиринга, которым соответствует собственный Расчетный код Участника клиринга, Участников клиринга, кроме указанных выше в настоящем подпункте;
  - в третью очередь по клиентским Расчетным кодам Участника клиринга и Расчетным кодам ДУ Участника клиринга /торговым банковским счетам Участника клиринга, которым соответствует клиентский Расчетный код Участника клиринга, и торговым банковским счетам Участника клиринга, которым соответствует Расчетный код ДУ Участника клиринга, всех Участников клиринга (за исключением тех, которые открыты Обособленным клиентам и Доверенным владельцам счетов);
  - в четвертую очередь по клиентским Расчетным кодам Участника клиринга и Расчетным кодам ДУ Участника клиринга/торговым банковским счетам Участника клиринга, которым соответствует клиентский Расчетный код Участника клиринга, и торговым банковским счетам Участника клиринга, которым соответствует Расчетный код ДУ Участника клиринга, всех Участников клиринга, открытым для Обособленных клиентов / Доверенных владельцев счетов.
- 64.5.3. В целях применения настоящего пункта общей части Правил клиринга используется информация о сумме/количестве обеспечения, учитываемом на Расчетных кодах Участника клиринга/ Расчетных кодах имущественного пула/ Расчетных кодах для уплаты налогов/ Расчетных кодах для учета взносов в Гарантийные фонды/ Расчетных кодах для учета Обеспечения под риски концентрации на эмитентов/ Расчетных кодах для учета Обеспечения под стресс/торговых банковских счетах Участника клиринга на начало процедуры Блокировки обеспечения Участников клиринга.
- 64.5.4. Сумма/количество обеспечения в соответствующей иностранной валюте/ драгоценном металле, заблокированная(-ое) на клиринговых банковских /корреспондентских счетах и/или банковских счетах в драгоценных металлах Клирингового центра распределяется пропорционально между Расчетными кодами Участника клиринга/ Расчетными кодами имущественного пула/ Расчетными кодами для уплаты налогов/ Расчетными кодами для учета взносов в Гарантийные фонды/ Расчетными кодами для учета Обеспечения под риски концентрации на эмитентов/ Расчетными кодами для учета Обеспечения под стресс/торговыми банковскими счетами Участников клиринга одной очереди согласно пункта 64.5.2 общей части Правил клиринга. Сумма/количество обеспечения в соответствующей иностранной валюте/ драгоценном металле, не распределенное между Расчетными кодами Участника клиринга/ Расчетными кодами имущественного пула/ Расчетными кодами для уплаты налогов/ Расчетными кодами для учета взносов в Гарантийные фонды/ Расчетными кодами для учета Обеспечения под риски концентрации на эмитентов/ Расчетными кодами для учета Обеспечения под стресс/торговыми банковскими счетами Участников клиринга одной очереди, распределяется между Расчетными кодами Участника клиринга/ Расчетными кодами имущественного пула/ Расчетными кодами для уплаты налогов/

Расчетными кодами для учета взносов в Гарантийные фонды/Расчетными кодами для учета Обеспечения под риски концентрации на эмитентов/Расчетными кодами для учета Обеспечения под стресс/торговыми банковскими счетами Участников клиринга следующей очереди.

- 64.5.5. С момента признания ситуации чрезвычайной у Участника клиринга возникает обязанность в дату признания ситуации чрезвычайной внести в качестве обеспечения денежные средства в соответствующей иностранной валюте / драгоценные металлы в сумме заблокированных денежных средств / количестве заблокированного драгоценного металла, распределенной / распределенного в соответствии с настоящей статьей Правил клиринга по Расчетным кодам Участника клиринга/ Расчетным кодам имущественного пула/Расчетным кодам для уплаты налогов/ Расчетным кодам для учета взносов в Гарантийные фонды/Расчетным кодам для учета Обеспечения под риски концентрации на эмитентов/Расчетным кодам для учета Обеспечения под стресс/торговым банковским счетам такого Участника клиринга, а у Клирингового центра – обязанность вернуть обеспечение в указанной сумме / указанном количестве после разблокировки указанных средств Банком-нерезидентом.
- 64.5.6. Снятие блокировки обеспечения Участников клиринга осуществляется на основании решения Клирингового центра при получении информации о разблокировании денежных средств в иностранной валюте/драгоценного металла на клиринговых банковских/корреспондентских счетах и/или банковских счетах в драгоценных металлах Клирингового центра.
- 64.5.7. Снятие блокировки обеспечения Участников клиринга в размере суммы/количества обеспечения в соответствующей иностранной валюте/ драгоценном металле, разблокированной(-ого) на клиринговых банковских/корреспондентских счетах и/или банковских счетах в драгоценных металлах Клирингового центра, последовательно осуществляется по Расчетным кодам Участника клиринга/ Расчетным кодам имущественного пула/Расчетным кодам для уплаты налогов/ Расчетным кодам для учета взносов в Гарантийные фонды/Расчетным кодам для учета Обеспечения под риски концентрации на эмитентов/Расчетным кодам для учета Обеспечения под стресс/торговым банковским счетам Участников клиринга, на которых ранее была осуществлена Блокировка обеспечения Участников клиринга, в следующем порядке:
- в первую очередь по клиентским Расчетным кодам Участника клиринга и Расчетным кодам ДУ Участника клиринга/торговым банковским счетам Участника клиринга, которым соответствует клиентский Расчетный код Участника клиринга, и торговым банковским счетам Участника клиринга, которым соответствует Расчетный код ДУ Участника клиринга, всех Участников клиринга, открытым для Обособленных клиентов / Доверенных владельцев счетов;
  - во вторую очередь по клиентским Расчетным кодам Участника клиринга и Расчетным кодам ДУ Участника клиринга /торговым банковским счетам Участника клиринга, которым соответствует клиентский Расчетный код Участника клиринга, и торговым банковским счетам Участника клиринга, которым соответствует Расчетный код ДУ Участника клиринга, всех

Участников клиринга (за исключением тех, которые открыты Обособленным клиентам и Доверенным владельцам счетов);

- в третью очередь по собственным Расчетным кодам Участника клиринга/ Расчетным кодам имущественного пула/ Расчетным кодам для уплаты налогов/ Расчетным кодам для учета взносов в Гарантийные фонды/ Расчетным кодам для учета Обеспечения под риски концентрации на эмитентов/ Расчетным кодам для учета Обеспечения под стресс/ торговым банковским счетам Участника клиринга, которым соответствует собственный Расчетный код Участника клиринга, Участников клиринга, кроме указанных ниже в настоящем подпункте;
- в четвертую очередь по собственным Расчетным кодам Участника клиринга/ Расчетным кодам имущественного пула/ Расчетным кодам для уплаты налогов/ Расчетным кодам для учета взносов в Гарантийные фонды/ Расчетным кодам для учета Обеспечения под риски концентрации на эмитентов/ Расчетным кодам для учета Обеспечения под стресс/ торговым банковским счетам Участника клиринга, которым соответствует собственный Расчетный код Участника клиринга, тех Участников клиринга, учитываемая сумма/ количество обеспечения в соответствующей иностранной валюте/ драгоценном металле по всем Расчетным кодам Участника клиринга/ Расчетным кодам имущественного пула/ Расчетным кодам для уплаты налогов/ Расчетным кодам для учета взносов в Гарантийные фонды/ Расчетным кодам для учета Обеспечения под риски концентрации на эмитентов/ Расчетным кодам для учета Обеспечения под стресс/ торговым банковским счетам которых превышает Порог.

64.5.8. Снятие блокировки обеспечения Участников клиринга в иностранной валюте в размере рассчитанных в соответствии с пунктом 64.5.7 общей части Правил клиринга величин осуществляется путем перевода со Счетов блокировки на соответствующие Счета обеспечения Участников клиринга, на которых ранее учитывалось указанное обеспечение.

64.5.9. При снятии блокировки обеспечения Участников клиринга в драгоценных металлах указанное обеспечение в размере рассчитанных в соответствии с пунктом 64.5.7 общей части Правил клиринга величин разблокируется на торговых банковских счетах Участников клиринга.

64.5.10. В случае, если денежные средства в иностранной валюте/ драгоценные металлы, в том числе ранее заблокированные на клиринговых банковских/ корреспондентских счетах / банковских счетах в драгоценных металлах Клирингового центра, списаны банком/ небанковской кредитной организацией, в том числе Банком-нерезидентом, в котором открыт соответствующий клиринговый банковский/ корреспондентский счет / банковский счет в драгоценном металле, Клиринговым центром в качестве мер по урегулированию чрезвычайной ситуации (при необходимости по согласованию с Банком России и Биржей) может быть принято решение о списании иностранной валюты/ драгоценных металлов со Счетов обеспечения/ Счетов гарантийных фондов/ Счетов обеспечения под стресс/ Счетов блокировки/ торговых банковских счетов. Определение количества иностранной валюты/ драгоценного металла, обязательства по возврату которой/ которого прекращаются, осуществляется в порядке, аналогичном изложенному в пункте 64.5.2-64.5.4 общей части Правил клиринга.

- 64.6. В случае признания ситуации чрезвычайной в связи с обстоятельствами, предусмотренными пунктом 64.1 общей части Правил клиринга, Клиринговый центр вправе принять решение об изменении способа, порядка и Даты исполнения обязательств Участником клиринга / Участниками клиринга и/или Клиринговым центром, в соответствии с которым обязательства по Сделкам с центральным контрагентом исполняются / прекращаются в дату, установленную решением Клирингового центра, в следующем порядке:
- 64.6.1. Обязательства по вторым частям сделок РЕПО с клиринговыми сертификатами участия и депозитным договорам исполняются в дату, установленную решением Клирингового центра, при этом стоимость обратного выкупа по сделке РЕПО / сумма возврата депозита 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 / прекращения обязательств по Сделкам с центральным контрагентом, установленной решением Клирингового центра, включая эту дату.
- 64.6.2. Обязательства по вторым частям сделок РЕПО с ценными бумагами, за исключением клиринговых сертификатов участия, и вторым частям сделок своп прекращаются в дату, установленную решением Клирингового центра, возникновением обязательства по уплате / требования по получению суммы денежных средств, равной сумме дохода по сделке РЕПО / сумме своп-разницы, рассчитанной на дату исполнения / прекращения обязательств по Сделкам с центральным контрагентом, установленную решением Клирингового центра.
- 64.6.3. Обязательства по сделкам купли-продажи ценных бумаг / иностранной валюты / драгоценного металла прекращаются в дату, установленную решением Клирингового центра, возникновением обязательства по уплате / требования по получению суммы денежных средств, рассчитанной как:
- произведение количества ценных бумаг / драгоценного металла / объема иностранной валюты в Сделке и разности Расчетной цены соответствующей ценной бумаги / драгоценного металла / иностранной валюты, определенной в ходе последней проведенной Клиринговым центром клиринговой сессии mark-to-market, если иной порядок определения Расчетной цены не установлен решением Клирингового центра, и цены одной ценной бумаги в Сделке / курса Сделки – для Сделок с направленностью «покупка», или
  - произведение количества ценных бумаг / драгоценного металла / объема иностранной валюты в Сделке и разности цены одной ценной бумаги в Сделке / курса Сделки и Расчетной цены соответствующей ценной бумаги / драгоценного металла / иностранной валюты, определенной в ходе последней проведенной Клиринговым центром клиринговой сессии mark-to-market, если иной порядок определения Расчетной цены не установлен решением Клирингового центра, – для Сделок с направленностью «продажа».
- 64.6.4. Обязательства по сделкам, являющимся производными финансовыми инструментами, прекращаются в дату, установленную решением Клирингового центра, возникновением обязательства по уплате / требования по получению суммы денежных средств, равной сумме вариационной / депозитной маржи, рассчитанной по последней определенной Клиринговым центром в соответствии с

- Правилами клиринга Расчетной цене / Расчетной стоимости, если иной порядок определения Расчетной цены / Расчетной стоимости не установлен решением Клирингового центра.
- 64.6.5. Решением Клирингового центра могут быть установлены иные особенности исполнения / прекращения обязательств по Сделкам с центральным контрагентом, отличные от указанных в настоящем пункте общей части Правил клиринга.
- 64.6.6. Обязательства по вторым частям сделок РЕПО с клиринговыми сертификатами участия и депозитным договорам, определенные в соответствии с подпунктом 64.6.1 общей части Правил клиринга и обязательства / требования по денежным средствам, возникшие в результате прекращения обязательств по Сделкам с центральным контрагентом в соответствии с подпунктами 64.6.2-64.6.5 общей части Правил клиринга, включаются в соответствующий клиринговый пул и прекращаются в указанном клиринговом пуле в порядке, установленном статьей 41 общей части Правил клиринга.
- 64.7. В случае если денежные средства в иностранной валюте / драгоценные металлы Участника клиринга, в отношении которого ситуация признана чрезвычайной, заблокированы Банком-нерезидентом на клиринговом / корреспондентском счете Клирингового центра, используемом для внесения и учета (хранения) обеспечения в такой иностранной валюте, банковском счете Клирингового центра в драгоценных металлах, у Участника клиринга возникает обязанность внести в качестве Обеспечения денежные средства в такой иностранной валюте / драгоценные металлы в сумме заблокированных денежных средств / количестве заблокированного драгоценного металла такого Участника клиринга в дату признания ситуации чрезвычайной в отношении Участника клиринга, а у Клирингового центра – обязанность вернуть Участнику клиринга Обеспечение в указанной сумме после разблокировки указанных средств Банком-нерезидентом.
- 64.7.1. Если Клиринговый центр учитывает Обеспечение Участника клиринга в такой иностранной валюте / таком драгоценном металле, обязанность Участника клиринга по внесению обеспечения в иностранной валюте / драгоценному металлу, предусмотренная настоящим пунктом Правил клиринга, зачитывается с требованием Участника клиринга к Клиринговому центру по возврату обеспечения в такой иностранной валюте.
- 64.8. Маржинальное требование по Расчетному коду и/или Задолженность Участника клиринга, в отношении которого ситуация признана чрезвычайной, в том числе возникшие в результате признания ситуации чрезвычайной в отношении такого Участника клиринга и/или исполнения мер по урегулированию чрезвычайной ситуации, принятых Клиринговым центром, должны быть исполнены Участником клиринга в порядке и сроки, установленные Правилами клиринга.
- 64.9. В случае неисполнения Участником клиринга, в отношении которого ситуация признана чрезвычайной, обязательств, предусмотренных Правилами клиринга, в том числе возникших в результате признания ситуации чрезвычайной в отношении такого Участника клиринга и/или исполнения мер по урегулированию чрезвычайной ситуации, принятых Клиринговым центром, Клиринговый центр урегулирует данные неисполненные обязательства в порядке, предусмотренном Правилами клиринга, в том числе использует уровни защиты центрального

контрагента, предусмотренные Правилами клиринга об ограничении размера ответственности Клирингового центра, а также дисконтирование обязательств Клирингового центра по возврату Обеспечения Участникам клиринга, предусмотренное Правилами клиринга об ограничении размера ответственности Клирингового центра.

- 64.10. 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.
- 64.11. 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.
- 64.12. 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/ применением мер по урегулированию чрезвычайной ситуации в случае признания ситуации чрезвычайной в связи с обстоятельствами, предусмотренными пунктом 64.1 общей части Правил клиринга.

## **Статья 65. Порядок разрешения споров**

- 65.1. 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.
- 65.2. 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.
- 65.3. Передача споров на разрешение в Арбитражный центр возможно только после соблюдения предварительного претензионного порядка урегулирования споров. В случае полного или частичного отказа в удовлетворении претензии или неполучения ответа в течение 10 (десяти) рабочих дней с момента получения претензии заявитель вправе предъявить иск в Арбитражный центр.

65.4. Отличный от закрепленного в настоящей статье порядок разрешения споров может быть установлен в специальных частях Правил клиринга.

|

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
ФИО	
Должность	
Основание полномочий	
Подпись, Печать (при наличии) *	

\* Печать (при наличии) проставляется при подписании и направлении Договора об оказании клиринговых услуг в бумажной форме.



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.

	<b>От имени участника торгов</b>
<b>ФИО</b>	
<b>Должность</b>	
<b>Основание полномочий</b>	
<b>Подпись, Печать (при наличии*)</b>	

\* Печать (при наличии) проставляется при подписании и направлении Договора о ведении клиринговых регистров в бумажной форме.

**Приложение № 3**  
к общей части Правил клиринга

### **Порядок проведения технической экспертизы**

- 1) Проведение технической экспертизы в случае возникновения конфликтной ситуации в связи с использованием ПЭП 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 Рынке уполномоченному представителю заявителю претензии.
- 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 ПЭП в копии Предложения / электронного сообщения на бумажном носителе присвоенному Участнику клиринга / Участнику торгов / Клиринговому центру Клиринговому идентификатору на соответствующем Рынке;
  - фиксирование результатов проверки в протоколе работы технической комиссии.
- б) 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 ПЭП в копии Предложения / электронного сообщения на бумажном носителе присвоенному Участнику клиринга / Участнику торгов / Клиринговому центру Клиринговому идентификатору на соответствующем Рынке;
- 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.

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

### I. Список документов, предоставляемых Резидентом<sup>1</sup>

- 1) 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 в форме электронного документа и/или на бумажном носителе.
- 3) В отношении Руководителя<sup>2</sup>:
  - оригинал 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 оригинал выписки, заверенный подписью лица, уполномоченного на подписание решения, или заверенный подписью Руководителя и печатью юридического лица (при наличии)) об избрании (назначении) Руководителя в форме электронного документа и/или на бумажном носителе;

---

<sup>1</sup> Юридические лица, являющиеся органом государственной власти Российской Федерации, органом государственной власти субъекта Российской Федерации, органом местного самоуправления, органом государственной власти иностранного государства, Банком России представляют документы в отношении представителей согласно требованиям настоящего Приложения, а также Анкету в целях выявления иностранных налогоплательщиков с учетом положений, предусмотренных пунктом 12.9 общей части Правил клиринга.

<sup>2</sup> Указанные документы на Руководителя не представляются следующими юридическими лицами-резидентами:  
- органами государственной власти, иными государственными органами, органами местного самоуправления, учреждениями, находящимися в их ведении, государственными внебюджетными фондами, государственными корпорациями или организациями, в которых Российская Федерация, субъекты Российской Федерации либо муниципальные образования имеют более 50 процентов акций (долей) в капитале;  
- эмитентами ценных бумаг, допущенных к организованным торгам, которые раскрывают информацию в соответствии с законодательством Российской Федерации о ценных бумагах;  
- Банком России,

за исключением случаев, когда Руководитель совершает от имени юридического лица действия, необходимые для приема, приостановления и/или прекращения Клиринговым центром клирингового обслуживания юридического лица, либо совершает от имени юридического лица операцию с денежными средствами или иным имуществом.

- копия документа, удостоверяющего личность Руководителя, заверенная подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии) в форме электронного документа и/или на бумажном носителе 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, адрес места жительства (регистрации) или места пребывания, заверенное подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии) при одновременном предоставлении оригинала или нотариально удостоверенной копии документа 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 форме электронного документа и/или на бумажном носителе. 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) в форме электронного документа и/или на бумажном носителе 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, адрес места жительства (регистрации) или места пребывания, заверенное подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии), при одновременном предоставлении оригинала или нотариально удостоверенной копии документа или копии документа, удостоверяющего личность представителя, заверенной подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии) для сверки предоставленных сведений.
- 5) 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) в форме электронного документа и/или на бумажном носителе, или письмо юридического лица в произвольной форме, содержащее следующие сведения о физическом лице: фамилия, имя, отчество (при наличии), реквизиты документа, подтверждающего право иностранного гражданина (лица без гражданства) на пребывание (проживание) в Российской Федерации: серия (если имеется) и номер документа, дата начала срока

действия права пребывания (проживания), дата окончания срока действия права пребывания в Российской Федерации), заверенное подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии) при одновременном предоставлении оригинала или нотариально удостоверенной копии документа или копии документа, подтверждающего право иностранного гражданина (лица без гражданства) на пребывание (проживание) в Российской Федерации, заверенной подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии) для сверки предоставленных сведений;

- заверенную подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии) копию миграционной карты<sup>3</sup> в форме электронного документа и/или на бумажном носителе или письмо юридического лица в произвольной форме, содержащее следующие сведения о физическом лице: фамилия, имя, отчество (при наличии), реквизиты миграционной карты: номер карты, дата начала срока пребывания, дата окончания срока пребывания в Российской Федерации, заверенное подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии) при одновременном предоставлении оригинала или нотариально удостоверенной копии документа или копии миграционной карты, заверенной подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии) для сверки предоставленных сведений;

- 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), заверенное подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии) в форме электронного документа и/или на бумажном носителе.

б) Отчетность, указанная в пунктах 1), 3) – 12) приложения № 5 к общей части Правил клиринга, в форме электронного документа:

- Кредитные организации предоставляют месячные формы отчетности – за тринадцать последних отчетных дат, квартальные формы отчетности – за пять последних отчетных дат, 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) - 7) приложения № 5 к общей части Правил клиринга предоставляют годовые формы отчетности на последнюю отчетную дату, квартальные формы отчетности – за пять последних отчетных дат, месячные формы отчетности – за пять последних отчетных дат (по состоянию на 31 марта, 30 июня, 30 сентября, 31 декабря), отчетность по формам 0420402, 0420152, 0420251, 0420880 содержащую сведения об акционерах (участниках) и аффилированных лицах, актуальные по состоянию на дату предоставления документов;

---

<sup>3</sup> Сведения о миграционной карте предоставляются в случае отсутствия иных документов, подтверждающих право иностранного гражданина или лица без гражданства на пребывание (проживание) в Российской Федерации.

- Некредитные организации, указанные в пункте 8) приложения № 5 к общей части Правил клиринга, предоставляют годовые формы отчетности на последнюю отчетную дату, квартальные формы отчетности – за пять последних отчетных дат (по состоянию на 31 марта, 30 июня, 30 сентября, 31 декабря), а также справку, содержащую сведения об акционерах (участниках) и аффилированных лицах, актуальные по состоянию на дату предоставления документов, по форме, установленной Порядком предоставления информации и отчетности;
- Некредитные организации, указанные в пунктах 8), 12) приложения № 5 к общей части Правил клиринга, при допуске с категорией «Б» или «Б2» предоставляют годовой бухгалтерский баланс и годовой отчет о финансовых результатах на последнюю отчетную дату, квартальные формы отчетности – за пять последних отчетных дат, а также финансовую отчетность по МСФО (в т.ч. консолидированную) на русском или английском языке – по мере составления или публикации;
- Некредитные организации, указанные в пунктах 8), 12) приложения № 5 к общей части Правил клиринга, при допуске с категорией «В» предоставляют годовые формы финансовой отчетности за последний завершённый год, финансовую отчетность на последнюю отчетную дату и за аналогичный период прошлого года в соответствии с требованиями к периодичности составления отчетности согласно законодательству РФ, а также финансовую отчетность по МСФО (в т.ч. консолидированную) на русском или английском языке – по мере составления или публикации;
- Некредитные организации, указанные в пункте 8) приложения № 5 к общей части Правил клиринга, предоставляют справку об аффилированных лицах по форме, установленной Порядком предоставления информации и отчетности (в случае если на Некредитную организацию не распространяются требования по раскрытию списка аффилированных лиц в соответствии с Положением Банка России №714-П «О раскрытии информации эмитентами эмиссионных ценных бумаг», актуальную по состоянию на дату предоставления документов);
- Региональные органы власти, указанные в пункте 13) приложения № 5 к общей части Правил клиринга, предоставляют годовые формы отчетности на последнюю отчетную дату; квартальные формы отчетности – за пять последних отчетных дат.

Для вновь созданного юридического лица финансовая отчетность может быть предоставлена за меньшее количество отчетных периодов, чем указано в пункте 8 настоящего Раздела, но за все отчетные периоды, начиная с даты его создания.

- 7) В случае если вновь созданное юридическое лицо образовано в результате реорганизации (за исключением реорганизации в форме преобразования) Клиринговый центр вправе запросить квартальную отчетность до 5 (пяти) последних отчетных периодов юридического лица - правопреемника. 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 12.9 общей части Правил клиринга) в форме электронного документа и/или на бумажном носителе.
- 8) Иные документы, которые могут быть запрошены Клиринговым центром в необходимых случаях, в том числе необходимые для целей выявления Клиринговым центром лиц, на которых распространяются временные меры экономического



характера, 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.

Документы, представляемые в форме электронного документа, должны содержать сканированную копию документа. Сканированная копия выполняется с оригинала документа или иного документа, оформленного в соответствии с требованиями настоящего приложения к общей части Правил клиринга.

Учредительные документы, заверенные федеральным органом исполнительной власти, уполномоченным на осуществление государственной регистрации юридических лиц, в электронном виде и представленные Клиринговому центру в форме электронного документа, считаются оригиналом и должны содержать помимо файла с учредительными документами файл с электронной подписью представителя уполномоченного органа.

В Клиринговый центр могут быть представлены оригиналы документов, указанных в пункте 2, третьем абзаце пункта 3, втором абзаце пункта 4, пункте 5 настоящего Раздела для изготовления копий и заверения их сотрудником Клирингового центра.

## **II. Список документов, предоставляемых государственной корпорацией, государственной компанией, публично-правовой компанией<sup>4</sup>**

- 1) 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 публично-правовой компании - Копии учредительных документов юридического лица с изменениями и дополнениями с отметкой о регистрации федеральным органом исполнительной власти, уполномоченным на осуществление государственной регистрации юридических лиц (при наличии). Указанные копии должны быть заверены федеральным органом исполнительной власти, уполномоченным на осуществление государственной регистрации юридических лиц, или нотариально в форме электронного документа и/или на бумажном носителе.
- 3) В отношении Руководителя<sup>5</sup>:
  - оригинал или нотариально удостоверенная копия решения уполномоченного органа государственной корпорации (также могут быть предоставлены

---

<sup>4</sup> Юридические лица, являющиеся государственными корпорациями, государственными компаниями, публично-правовыми компаниями представляют документы в отношении представителей согласно требованиям настоящего Приложения, а также Анкету в целях выявления иностранных налогоплательщиков с учетом положений, предусмотренных пунктом 12.9 общей части Правил клиринга.

<sup>5</sup> Указанные документы на Руководителя не представляются государственными корпорациями, государственными компаниями, публично-правовыми компаниями за исключением случаев, когда Руководитель совершает от имени юридического лица действия, необходимые для приема, приостановления и/или прекращения Клиринговым центром клирингового обслуживания юридического лица, либо совершает от имени юридического лица операцию с денежными средствами или иным имуществом.

нотариально удостоверенная выписка из решения или оригинал выписки, заверенный подписью лица, уполномоченного на подписание решения), предусмотренного федеральным законом, определяющим статус, цели деятельности, функции и полномочия данной государственной корпорации, о назначении Руководителя в форме электронного документа и/или на бумажном носителе;

- копия документа, удостоверяющего личность Руководителя государственной корпорации, заверенная подписью уполномоченного лица и печатью государственной корпорации в форме электронного документа и/или на бумажном носителе 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 нотариально удостоверенной копии документа 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 государственной корпорации, уполномоченного осуществлять действия (операции) от имени государственной корпорации во взаимоотношениях с Клиринговым центром, включая полномочия по подписанию необходимых документов в форме электронного документа и/или на бумажном носителе. 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 в форме электронного документа и/или на бумажном носителе 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 нотариально удостоверенной копии документа или копии документа, удостоверяющего личность представителя, заверенной подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии) для сверки предоставленных сведений.

5) 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) в форме электронного документа и/или на бумажном носителе, или письмо юридического лица в произвольной форме, содержащее следующие сведения о физическом лице: фамилия, имя, отчество (при наличии), реквизиты документа, подтверждающего право иностранного гражданина (лица без гражданства) на пребывание (проживание) в Российской Федерации: серия (если имеется) и номер документа, дата начала срока действия права пребывания (проживания), дата окончания срока действия права пребывания в Российской Федерации), заверенное подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии) при одновременном предоставлении оригинала или нотариально удостоверенной копии документа или копии документа, подтверждающего право иностранного гражданина (лица без гражданства) на пребывание (проживание) в Российской Федерации, заверенной подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии) для сверки предоставленных сведений;

- заверенную подписью уполномоченного лица и печатью государственной корпорации копию миграционной карты<sup>4</sup> в форме электронного документа и/или на бумажном носителе или письмо юридического лица в произвольной форме, содержащее следующие сведения о физическом лице: фамилия, имя, отчество (при наличии), реквизиты миграционной карты: номер карты, дата начала срока пребывания, дата окончания срока пребывания в Российской Федерации, заверенное подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии) при одновременном предоставлении оригинала или нотариально удостоверенной копии документа или копии миграционной карты, заверенной подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии) для сверки предоставленных сведений;

- 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), заверенное подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии) в форме электронного документа и/или на бумажном носителе.

- 6) Отчетность, указанная в пунктах 2), 8) и 12) приложения № 5 к общей части Правил клиринга, в форме электронного документа: месячные формы отчетности – за тринадцать последних отчетных дат, квартальные формы отчетности – за пять последних отчетных дат, финансовая отчетность по МСФО (в т.ч. консолидированная) на русском или английском языке (при наличии), актуальная на дату предоставления документов.
- 7) 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 12.9 общей части Правил клиринга) в форме электронного документа и/или на бумажном носителе.
- 8) Иные документы, которые могут быть запрошены Клиринговым центром в необходимых случаях, в том числе необходимые для целей выявления Клиринговым центром лиц, на которых распространяются временные меры экономического характера, 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.

Документы, представляемые в форме электронного документа, должны содержать сканированную копию документа. Сканированная копия выполняется с оригинала документа или иного документа, оформленного в соответствии с требованиями настоящего приложения к общей части Правил клиринга.

В Клиринговый центр могут быть представлены оригиналы документов, указанных в пункте 2, третьем абзаце пункта 3, втором абзаце пункта 4, пункте 5 настоящего Раздела для изготовления копий и заверения их сотрудником Клирингового центра.

### **III. Список документов, предоставляемых Международной организацией<sup>6</sup>**

- 1) 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 в форме электронного документа и/или на бумажном носителе.
- 3) Копия свидетельства о постановке на учет в налоговом органе (при наличии), заверенная подписью уполномоченного лица и печатью Международной организации (при наличии) в форме электронного документа и/или на бумажном носителе.
- 4) В отношении лица, уполномоченного действовать от имени Международной организации в соответствии с международным договором и/или учредительными документами (далее – Руководитель)<sup>7</sup>:
  - нотариально удостоверенная копия протокола или выписка из протокола заседания уполномоченного органа Международной организации, содержащая решение уполномоченного органа Международной организации об избрании (назначении) Руководителя в форме электронного документа и/или на бумажном носителе;
  - копия документа, удостоверяющего личность Руководителя, заверенная подписью уполномоченного лица и печатью Международной организации (при

---

<sup>6</sup> Юридические лица, являющиеся международными организациями, представляют документы в отношении представителей согласно требованиям настоящего Приложения, а также Анкету в целях выявления иностранных налогоплательщиков с учетом положений, предусмотренных пунктом 12.10 общей части Правил клиринга.

<sup>7</sup> Указанные документы на Руководителя не представляются международными организациями, за исключением случаев, когда Руководитель совершает от имени юридического лица действия, необходимые для приема, приостановления и/или прекращения Клиринговым центром клирингового обслуживания юридического лица, либо совершает от имени юридического лица операцию с денежными средствами или иным имуществом.

наличии) в форме электронного документа и/или на бумажном носителе 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 нотариально удостоверенной копии документа или копии документа, удостоверяющего личность Руководителя, заверенной подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии) для сверки предоставленных сведений.

- 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 форме электронного документа и/или на бумажном носителе. В случае если доверенность предоставляет полномочия на совершение операций с денежными средствами или иным имуществом, дополнительно предоставляется:
- копия документа, удостоверяющего личность представителя Международной организации, заверенная подписью уполномоченного лица и печатью Международной организации (при наличии) в форме электронного документа и/или на бумажном носителе 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 нотариально удостоверенной копии документа или копии документа, удостоверяющего личность представителя, заверенной подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии) для сверки предоставленных сведений.
- 6) Отзывы о деловой репутации Международной организации в форме электронного документа и/или на бумажном носителе (при наличии)<sup>8</sup>.
- 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:

---

<sup>8</sup> Сведения о деловой репутации (отзывы (в произвольной письменной форме) о юридическом лице других клиентов Клирингового центра, имеющих с ним деловые отношения; и (или) отзывы (в произвольной письменной форме) от других кредитных организаций, в которых юридическое лицо ранее находилось на обслуживании, с информацией этих кредитных организаций об оценке деловой репутации юридического лица), отзывы о деловой репутации от контрагентов, не являющихся клиентами Клирингового центра, и/или аудиторское заключение за последний финансовый год и/или информацию о кредитном рейтинге юридического лица.

- 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) в форме электронного документа и/или на бумажном носителе, или письмо юридического лица в произвольной форме, содержащее следующие сведения о физическом лице: фамилия, имя, отчество (при наличии), реквизиты документа, подтверждающего право иностранного гражданина (лица без гражданства) на пребывание (проживание) в Российской Федерации: серия (если имеется) и номер документа, дата начала срока действия права пребывания (проживания), дата окончания срока действия права пребывания в Российской Федерации), заверенное подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии) при одновременном предоставлении оригинала или нотариально удостоверенной копии документа или копии документа, подтверждающего право иностранного гражданина (лица без гражданства) на пребывание (проживание) в Российской Федерации, заверенной подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии) для сверки предоставленных сведений;
  - заверенную подписью уполномоченного лица и печатью Международной организации (при наличии) копию миграционной карты<sup>4</sup> в форме электронного документа и/или на бумажном носителе или письмо юридического лица в произвольной форме, содержащее следующие сведения о физическом лице: фамилия, имя, отчество (при наличии), реквизиты миграционной карты: номер карты, дата начала срока пребывания, дата окончания срока пребывания в Российской Федерации, заверенное подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии) при одновременном предоставлении оригинала или нотариально удостоверенной копии документа или копии миграционной карты, заверенной подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии) для сверки предоставленных сведений;
  - 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), заверенное подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии) в форме электронного документа и/или на бумажном носителе.
- 8) Отчетность, указанная в пункте 16) приложения № 5 к общей части Правил клиринга, в форме электронного документа: квартальные формы отчетности – за пять последних отчетных дат, финансовая отчетность по МСФО (в т.ч. консолидированная) на русском или английском языке (при наличии), актуальная на дату предоставления документов.
- 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 12.9 общей части Правил клиринга) в форме электронного документа и/или на бумажном носителе.
- 10) В целях выполнения Клиринговым центром функций налогового агента в

соответствии со статьей 7 общей части Правил клиринга (документы, указанные в настоящем пункте, не предоставляются в отношении фактического получателя дохода Международной организации в случае, если Международная организация планирует становиться только стороной по сделкам спот и сделкам своп с иностранной валютой в интересах фактического получателя дохода):

- 10.1) Международной организации дополнительно необходимо предоставить:
  - 10.1.1) 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 (при наличии) на бумажном носителе.
  - 10.1.2) Письмо-подтверждение о наличии у Международной организации фактического права на получаемый доход (доходы), указанный (указанные) в Правилах клиринга, в смысле требований статьи 7 Налогового кодекса Российской Федерации на бумажном носителе.
  - 10.1.3) В случае если Международная организация не имеет фактического права на получаемый доход (доходы), указанный (указанные) в Правилах клиринга, Международная организация представляет письмо-подтверждение об отсутствии фактического права на получаемый доход (доходы), указанный (указанные) в Правилах клиринга, и Письмо-подтверждение о наличии у фактического получателя дохода фактического права на получаемый доход (доходы), указанный (указанные) в Правилах клиринга, в смысле требований статьи 7 Налогового кодекса Российской Федерации на бумажном носителе.
  - 10.1.4) Анкету для налоговых целей, составленную по форме Клирингового центра на бумажном носителе.
  - 10.1.5) Иные документы, которые могут быть запрошены Клиринговым центром в необходимых случаях. Также Клиринговый центр вправе потребовать уточнения информации, содержащейся в ранее предоставленных документах.
- 10.2) В случае, если фактический получатель дохода планирует применять ДИДН (договор / соглашение / конвенцию об избежании двойного налогообложения), то дополнительно необходимо предоставить:
  - 10.2.1) Документ, подтверждающий постоянное местонахождение фактического получателя дохода в государстве, с которым Российская Федерация имеет международный договор (соглашение), регулирующий вопросы налогообложения (далее в настоящем разделе - сертификат налогового резидентства). Документ должен быть заверен компетентным органом соответствующего иностранного государства на бумажном носителе.

Предоставление указанного документа не требуется в случае выплаты доходов по операциям с Банком-нерезидентом, за исключением филиала Банка-нерезидента / 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.
  - 10.2.2) Документ, подтверждающий наличие у фактического получателя дохода права на применение льгот по международному договору (соглашению), регулирующему

вопросы налогообложения, в соответствии со статьями, регулируемыми ограничением льгот (при наличии таких положений). Документ должен быть заверен компетентным органом соответствующего иностранного государства. Документ не предоставляется, если соответствующие положения содержатся в сертификате налогового резидентства, указанном в подпункте 10.2.1 настоящего раздела в форме электронного документа и/или на бумажном носителе.

- 10.2.3) Письмо-подтверждение о наличии у фактического получателя дохода фактического права на получаемый доход (доходы), указанный (указанные) в Правилах клиринга, в смысле требований статьи 7 Налогового кодекса Российской Федерации на бумажном носителе.
- 10.2.4) Если фактический получатель дохода имеет право на упрощенную процедуру подтверждения фактического права на доход согласно пункту 1.5 статьи 312 Налогового кодекса Российской Федерации, юридическое лицо предоставляет документы, подтверждающие соответствие фактического получателя дохода условиям пункта 1.5 статьи 312 Налогового кодекса Российской Федерации на бумажном носителе.
- 10.2.5) Устав и финансовую отчетность фактического получателя дохода.
- 10.2.6) Анкету для налоговых целей, составленную по форме Клирингового центра на бумажном носителе.
- 10.2.7) Иные документы, которые могут быть запрошены Клиринговым центром в необходимых случаях, в том числе необходимые для целей выявления Клиринговым центром лиц, на которых распространяются временные меры экономического характера, также Клиринговый центр вправе потребовать уточнения информации, содержащейся в ранее предоставленных документах.
- 10.3) Если фактический получатель дохода не планирует применять ДИДН (договор / соглашение / конвенцию об избежании двойного налогообложения), то дополнительно необходимо предоставить:
- 10.3.1) Письмо-подтверждение о наличии у фактического получателя дохода фактического права на получаемый доход (доходы), указанный (указанные) в Правилах клиринга, в смысле требований статьи 7 Налогового кодекса Российской Федерации на бумажном носителе.
- 10.3.2) Анкету для налоговых целей, составленную по форме Клирингового центра на бумажном носителе.
- 10.3.3) Иные документы, которые могут быть запрошены Клиринговым центром в необходимых случаях. Также Клиринговый центр вправе потребовать уточнения информации, содержащейся в ранее предоставленных документах.
- 10.4) В случае если получаемый доход (доходы), указанный (указанные) в Правилах клиринга, относятся к постоянному представительству фактического получателя дохода в Российской Федерации, Международная организация предоставляет по такому фактическому получателю дохода копию свидетельства о постановке на учет фактического получателя дохода в налоговых органах Российской Федерации, оформленное не ранее чем в предшествующем налоговом периоде, и письмо-заявление, составленное фактическим получателем дохода по форме Клирингового центра, о том, что получаемый доход (доходы), указанный (указанные) в Правилах клиринга, относятся к такому постоянному представительству Российской Федерации и постоянное представительство такого фактического получателя дохода



будет исполнять обязанности налогоплательщика в отношении полученных доходов. В таком случае также предоставляется положение о филиале или представительстве фактического получателя дохода в Российской Федерации.

- 10.5) В случае если клиентом Участника клиринга – Международной организации является иностранная структура без образования юридического лица, по согласованию с Клиринговым центром Письмо-подтверждение о наличии у фактического получателя дохода фактического права на получаемый доход (доходы), указанный (указанные) в Правилах клиринга, может не предоставляться.

Международная организация предоставляет в отношении фактических получателей дохода сертификат налогового резидентства и документ, подтверждающий право на применение льгот по договору (соглашению) об избежании двойного налогообложения, упомянутые в подпунктах 10.2.1 и 10.2.2 настоящего раздела, ежегодно не позднее более ранней из дат: первой даты выплаты дохода (доходов), указанного (указанных) в Правилах клиринга, или не позднее 30 апреля текущего года. В отдельных случаях срок предоставления сертификата налогового резидентства может быть увеличен исключительно в связи с требованиями национального законодательства, согласно которым предоставление сертификата налогового резидентства компетентным органом осуществляется в более поздние сроки по сравнению с установленными выше. Не позднее 31 декабря каждого года фактические получатели дохода предоставляют письмо-заверение о готовности предоставить сертификаты налогового резидентства на следующий календарный год в сроки, установленные Правилами клиринга, а также подтверждают, что место постоянного местонахождения (страна налогового резидентства) в новом календарном году остается неизменным.

Финансовая отчетность, указанная в подпункте 10.2.5 настоящего раздела, предоставляется ежегодно в сроки, установленные требованиями национального законодательства.

В случае изменения информации, содержащейся документах, указанных выше в подпунктах 10.1.2-10.1.3, 10.2.1-10.2.4, 10.3.1, 10.4, настоящего раздела, которая может повлиять на применение порядка налогообложения доходов от источников в РФ и/или положений международных договоров, в том числе регулирующих вопросы налогообложения, в частности о намерении фактического получателя дохода изменить страну налогового резидентства или создать постоянное представительство в Российской Федерации, Международная организация незамедлительно письменно сообщает о таких изменениях Клиринговому центру.

При появлении нового фактического получателя дохода Международная организация предоставляет комплект документов, указанный в пунктах 10.2, 10.3 или 10.4 настоящего раздела. Новый комплект документов, указанный в пунктах 10.1, 10.2, 10.3 или 10.4 настоящего раздела, также предоставляется в случае, если фактический получатель дохода меняет страну налогового резидентства или создает постоянное представительство в Российской Федерации.

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, при условии наличия у физического лица документа, подтверждающего право законного пребывания на территории Российской Федерации (например, виза, миграционная карта), 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 (за исключением двуязычных версий документов), должны быть переведены на русский язык. Верность перевода или подлинность подписи переводчика должна быть засвидетельствована нотариусом. Устав и финансовая отчетность, указанные в подпункте 10.2.5 настоящего раздела, составленные на английском языке, могут предоставляться без перевода на русский язык; в иных случаях документы должны быть переведены на русский язык, а верность перевода или подлинность подписи переводчика должна быть засвидетельствована нотариусом. Устав и финансовая отчетность, указанные в пункте 10.2.5 настоящего раздела, могут быть предоставлены в электронном виде.

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

Документы, представляемые в форме электронного документа или в электронном виде, должны содержать сканированную копию документа. Сканированная копия выполняется с оригинала документа или иного документа, оформленного в соответствии с требованиями настоящего приложения к общей части Правил клиринга.

#### **IV. Список документов, предоставляемых Нерезидентом<sup>9</sup>**

- 1) 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 в форме электронного документа и/или на бумажном носителе.
- 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) в форме электронного документа и/или на бумажном носителе.
- 4) Действующие редакции учредительных документов юридического лица и все изменения к ним в форме электронного документа и/или на бумажном носителе.
- 5) Документ, подтверждающий государственную регистрацию юридического лица в форме электронного документа и/или на бумажном носителе.
- 6) Документ о постановке на учет в налоговом органе юридического лица (при наличии) в форме электронного документа и/или на бумажном носителе.
- 7) Специальное разрешение (лицензия), выданное уполномоченным органом государства учреждения юридического лица, на право осуществления деятельности,

---

<sup>9</sup> Юридические лица, являющиеся органом государственной власти иностранного государства, представляют документы в отношении представителей согласно требованиям настоящего Приложения, а также Анкету в целях выявления иностранных налогоплательщиков с учетом положений, предусмотренных пунктом 12.9 общей части Правил клиринга.

осуществление которой в соответствии с национальным законодательством государства юридического лица возможно при наличии соответствующего специального разрешения уполномоченного органа в форме электронного документа и/или на бумажном носителе.

- 8) Документ, подтверждающий постановку юридического лица на налоговый учет в Российской Федерации (копия, верность которой засвидетельствована нотариусом или самим юридическим лицом) (при наличии<sup>10</sup>) в форме электронного документа и/или на бумажном носителе.
- 9) В отношении лица, уполномоченного действовать от имени юридического лица в соответствии с учредительными документами (далее по тексту – Руководитель)<sup>11</sup>:
- документ, подтверждающий согласование кандидатуры Руководителя юридического лица уполномоченным органом государства учреждения юридического лица (если такое согласование предусмотрено законодательством государства учреждения юридического лица) в форме электронного документа и/или на бумажном носителе;
  - документ уполномоченного органа юридического лица, подтверждающий избрание (назначение) Руководителя в форме электронного документа и/или на бумажном носителе;
  - 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 в форме электронного документа и/или на бумажном носителе.

---

<sup>10</sup> В случае, если Нерезидент получает допуск к участию в торгах на рынке депозитов ПАО Московская Биржа, он обязан предоставить документ, подтверждающий постановку юридического лица на налоговый учет в Российской Федерации (копия, верность которой засвидетельствована нотариусом или самим юридическим лицом).

<sup>11</sup> Указанные документы на Руководителя не представляются следующими юридическими лицами-нерезидентами:

- иностранными государствами или административно-территориальными единицами иностранных государств, обладающими самостоятельной правоспособностью;
  - иностранными организациями, ценные бумаги которых прошли процедуру листинга на иностранной бирже, входящей в перечень, утвержденный Банком России;
  - иностранной организацией, имеющей в соответствии с ее личным законом право оказывать услуги, связанные с привлечением от клиентов и размещением денежных средств или иных финансовых активов для хранения, управления, инвестирования и (или) осуществления иных сделок в интересах клиента либо прямо или косвенно за счет клиента, при условии, что такая организация является резидентом иностранного государства – члена Группы разработки финансовых мер борьбы с отмыванием денег (ФАТФ), имеет показатель рейтинговой оценки, присвоенный российским кредитным рейтинговым агентством или международным рейтинговым агентством, а также включена в перечень (реестр) действующих организаций соответствующего иностранного государства,
- за исключением случаев, когда Руководитель совершает от имени юридического лица действия, необходимые для приема Клиринговым центром юридического лица на обслуживание, либо совершает от имени юридического лица операцию с денежными средствами или иным имуществом.

- 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 форме электронного документа и/или на бумажном носителе. В случае если доверенность предоставляет полномочия на совершение операций с денежными средствами или иным имуществом, дополнительно предоставляется:
- 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 в форме электронного документа и/или на бумажном носителе.
- 11) Отзывы о деловой репутации юридического лица в форме электронного документа и/или на бумажном носителе (при наличии)<sup>12</sup>.
- 12) 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) в форме электронного документа и/или на бумажном носителе, или письмо юридического лица в произвольной форме, содержащее следующие сведения о физическом лице: фамилия, имя, отчество (при наличии), реквизиты документа, подтверждающего право иностранного гражданина (лица без гражданства) на пребывание (проживание) в Российской Федерации: серия (если имеется) и номер документа, дата начала срока действия права пребывания (проживания), дата окончания срока действия права пребывания в Российской Федерации), заверенное подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии) при одновременном предоставлении оригинала или нотариально удостоверенной копии документа или копии документа, подтверждающего право иностранного гражданина (лица без гражданства) на пребывание (проживание) в Российской Федерации

---

<sup>12</sup> Сведения о деловой репутации (отзывы (в произвольной письменной форме) о юридическом лице других клиентов Клирингового центра, имеющих с ним деловые отношения; и (или) отзывы (в произвольной письменной форме) от других кредитных организаций, в которых юридическое лицо ранее находилось на обслуживании, с информацией этих кредитных организаций об оценке деловой репутации юридического лица), отзывы о деловой репутации от контрагентов, не являющихся клиентами Клирингового центра, и/или аудиторское заключение за последний финансовый год и/или информацию о кредитном рейтинге юридического лица.

- Федерации, заверенной подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии) для сверки предоставленных сведений;
- заверенную подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии) копию миграционной карты<sup>4</sup> в форме электронного документа и/или на бумажном носителе или письмо юридического лица в произвольной форме, содержащее следующие сведения о физическом лице: фамилия, имя, отчество (при наличии), реквизиты миграционной карты: номер карты, дата начала срока пребывания, дата окончания срока пребывания в Российской Федерации, заверенное подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии) при одновременном предоставлении оригинала или нотариально удостоверенной копии документа или копии миграционной карты, заверенной подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии) для сверки предоставленных сведений;
  - 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), заверенное подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица (при наличии) в форме электронного документа и/или на бумажном носителе.
- 13) Отчетность, указанная в пункте 16) приложения № 5 к общей части Правил клиринга, в форме электронного документа: квартальные формы отчетности – за пять последних отчетных дат, 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.  
Для вновь созданного юридического лица-Нерезидента финансовая отчетность может быть предоставлена за меньшее количество отчетных периодов, чем указано в пункте 14 настоящего Раздела, но за все отчетные периоды, начиная с даты его создания. В случае если вновь созданное юридическое лицо - Нерезидент образовано в результате реорганизации (за исключением реорганизации в форме преобразования), Клиринговый центр вправе запросить квартальную отчетность до 5 (пяти) последних отчетных периодов юридического лица - правопродшественника.
- 14) 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 в форме электронного документа и/или на бумажном носителе.
- 15) В целях выполнения Клиринговым центром функций налогового агента в соответствии со статьей 7 общей части Правил клиринга (документы, указанные в настоящем пункте, не предоставляются в отношении фактического получателя дохода Нерезидента в случае, если Нерезидент планирует становиться только стороной по сделкам спот и сделкам своп с иностранной валютой в интересах фактического получателя дохода):
- 15.1) В случае, если юридическое лицо и/или фактический получатель дохода не планирует применять ДИДН (договор / соглашение / конвенцию об избежании двойного налогообложения), то дополнительно необходимо предоставить:

- 15.1.1) Письмо-подтверждение о наличии у юридического лица фактического права на получаемый доход (доходы), указанный (указанные) в Правилах клиринга, в смысле требований статьи 7 Налогового кодекса Российской Федерации на бумажном носителе.
- 15.1.2) В случае если юридическое лицо не имеет фактического права на получаемый доход (доходы), указанный (указанные) в Правилах клиринга, юридическое лицо представляет письмо-подтверждение об отсутствии фактического права на получаемый доход (доходы), указанный (указанные) в Правилах клиринга, и письмо-подтверждение о наличии у фактического получателя дохода фактического права на получаемый доход (доходы), указанный (указанные) в Правилах клиринга, в смысле требований статьи 7 Налогового кодекса Российской Федерации на бумажном носителе.
- 15.1.3) Анкету для налоговых целей, составленную по форме Клирингового центра на бумажном носителе. По согласованию с Клиринговым центром центральные банки иностранных государств анкету для налоговых целей могут не предоставлять.
- 15.1.4) Иные документы, которые могут быть запрошены Клиринговым центром в необходимых случаях, в том числе необходимые для целей выявления Клиринговым центром лиц, на которых распространяются временные меры экономического характера. Также Клиринговый центр вправе потребовать уточнения информации, содержащейся в ранее предоставленных документах.
- 15.2) В случае, если юридическое лицо и/или фактический получатель дохода планирует применять ДИДН (договор / соглашение / конвенцию об избежании двойного налогообложения), то дополнительно необходимо предоставить:
- 15.2.1) Документ, подтверждающий постоянное местонахождение юридического лица в государстве, с которым Российская Федерация имеет международный договор (соглашение), регулирующий вопросы налогообложения (далее в настоящем разделе - сертификат налогового резидентства) на бумажном носителе. Документ должен быть заверен компетентным органом соответствующего иностранного государства.
- Предоставление указанного документа не требуется в случае выплаты доходов по операциям с Банком-нерезидентом, за исключением филиала Банка-нерезидента / 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.
- 15.2.2) Документ, подтверждающий наличие у юридического лица права на применение льгот по международному договору (соглашению), регулирующему вопросы налогообложения, в соответствии со статьями, регулирующими ограничение льгот (при наличии таких положений) на бумажном носителе. Документ должен быть заверен компетентным органом соответствующего иностранного государства. Документ не предоставляется, если соответствующие положения содержатся в сертификате налогового резидентства, указанном в подпункте 15.2.1 настоящего раздела.
- 15.2.3) Письмо-подтверждение о наличии у юридического лица фактического права на получаемый доход (доходы), указанный (указанные) в Правилах клиринга, в смысле требований статьи 7 Налогового кодекса Российской Федерации на бумажном носителе.

- 15.2.4) В случае если юридическое лицо не имеет фактического права на получаемый доход (доходы), указанный (указанные) в Правилах клиринга, юридическое лицо представляет письмо-подтверждение об отсутствии фактического права на получаемый доход (доходы), указанный (указанные) в Правилах клиринга, и информацию о фактическом получателе дохода на бумажном носителе.
- В отношении каждого фактического получателя дохода юридическое лицо предоставляет документы, указанные в подпунктах 15.2.1 и 15.2.2 выше, подпункте 15.2.3 выше (подписанное фактическим получателем дохода), а также в подпунктах 15.2.5-15.2.8 настоящего раздела. Также по каждому фактическому получателю дохода предоставляются устав и финансовая отчетность.
- 15.2.5) Если юридическое лицо и/или фактический получатель дохода имеет право на упрощенную процедуру подтверждения фактического права на доход согласно пункту 1.5 статьи 312 Налогового кодекса Российской Федерации, юридическое лицо предоставляет документы, подтверждающие соответствие юридического лица и/или фактического получателя дохода условиям пункта 1.5 статьи 312 Налогового кодекса Российской Федерации.
- 15.2.6) Анкету для налоговых целей, составленную по форме Клирингового центра на бумажном носителе.
- 15.2.7) Иные документы, которые могут быть запрошены Клиринговым центром в необходимых случаях. Также Клиринговый центр вправе потребовать уточнения информации, содержащейся в ранее предоставленных документах.
- 15.3) В случае если получаемый доход (доходы), указанный (указанные) в Правилах клиринга, относятся к постоянному представительству юридического лица или фактического получателя дохода в Российской Федерации, юридическое лицо предоставляет по такому лицу копию свидетельства о постановке на учет в налоговых органах Российской Федерации, оформленное не ранее чем в предшествующем налоговом периоде, и письмо-заявление, составленное по форме Клирингового центра, о том, что получаемый доход (доходы), указанный (указанные) в Правилах клиринга, относятся к такому постоянному представительству Российской Федерации и постоянное представительство такого лица будет исполнять обязанности налогоплательщика в отношении полученных доходов, а в случае наличия постоянного представительства в Российской Федерации у юридического лица - также выполнять функции налогового агента в отношении фактических получателей дохода (подпункт 1 пункта 2 статьи 310 Налогового кодекса Российской Федерации).
- В таком случае также предоставляется положение о филиале или представительстве юридического лица или фактического получателя дохода в Российской Федерации.
- 15.4) В случае если клиентом Участника клиринга – Нерезидента является иностранная структура без образования юридического лица, по согласованию с Клиринговым центром Письмо-подтверждение о наличии у фактического получателя дохода фактического права на получаемый доход (доходы), указанный (указанные) в Правилах клиринга, может не предоставляться.
- Сертификат налогового резидентства и документ, подтверждающий право на применение льгот по договору (соглашению) об избежании двойного налогообложения, предоставляются в отношении юридического лица и фактического получателя дохода ежегодно не позднее 30 апреля текущего года. В отдельных случаях срок предоставления налогового сертификата

может быть увеличен исключительно в связи с требованиями национального законодательства, согласно которым предоставление налогового сертификата компетентным органом осуществляется в более поздние сроки по сравнению с установленными выше. Не позднее 31 декабря каждого года юридическое лицо и фактические получатели дохода предоставляют письмо-заверение о готовности предоставить сертификаты налогового резидентства на следующий календарный год в сроки, установленные Правилами клиринга, а также подтверждают, что место постоянного местонахождения (страна налогового резидентства) в новом календарном году остается неизменным.

Финансовая отчетность, указанная в пункте 15.2.4 настоящего раздела, предоставляется ежегодно в сроки, установленные требованиями национального законодательства.

В случае изменения информации, содержащейся в документах, указанных выше в подпунктах 15.1.1, 15.1.2, 15.2.1-15.2.5, 15.3 настоящего раздела, которая может повлиять на применение порядка налогообложения доходов от источников в РФ и/или положений международных договоров, регулирующих вопросы налогообложения, в частности о намерении юридического лица или фактического получателя дохода изменить страну налогового резидентства или создать постоянное представительство в Российской Федерации, юридическое лицо незамедлительно письменно сообщает о таких изменениях Клиринговому центру.

При появлении нового фактического получателя дохода юридическое лицо предоставляет комплект документов, указанный в подпункте 15.1, 15.2 или 15.3 настоящего раздела. Новый комплект документов, указанный в пунктах 15.1, 15.2, или 15.3 настоящего раздела, также предоставляется в случае, если Участник клиринга / фактический получатель дохода меняет страну налогового резидентства или создает постоянное представительство в Российской Федерации.

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, при условии наличия у физического лица документа, подтверждающего право законного пребывания на территории Российской Федерации (например, виза, миграционная карта), 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 (за исключением двуязычных версий документов), должны быть переведены на русский язык. Верность перевода или подлинность подписи переводчика должна быть засвидетельствована нотариусом. Устав и финансовая отчетность, указанные в подпункте 15.2.4 настоящего раздела, составленные на английском языке, могут предоставляться без перевода на русский язык; в иных случаях документы должны быть переведены на русский язык, а верность перевода или подлинность подписи переводчика должна быть засвидетельствована нотариусом. Устав и финансовая отчетность, указанные в подпункте 15.2.4 настоящего раздела, могут быть предоставлены в электронном виде.

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

Документы, представляемые в форме электронного документа или в электронном виде, должны содержать сканированную копию документа. Сканированная копия выполняется с



оригинала документа или иного документа, оформленного в соответствии с требованиями настоящего приложения 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)<sup>13</sup>, список аффилированных лиц, принадлежащих к группе лиц, к которой принадлежит кредитная организация (форма 0409052)<sup>14</sup>, справку о численном значении норматива структурной ликвидности (чистого стабильного фондирования) (Базель III) (Н28 (Н29)) (по данным формы 0409121<sup>15</sup>) – 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), информацию о качестве активов кредитной организации (по данным формы 0409115), сведения об условных обязательствах кредитного характера (по данным формы 0409155<sup>16</sup>), сведения об обязательных нормативах и о выделенном капитале центрального контрагента (по данным формы 0409722<sup>17</sup> на первое число месяца, следующего за отчетным) – ежемесячно;
- 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;

---

<sup>13</sup> На дату представления отчета сведения, содержащиеся в нем, должны соответствовать последней актуальной информации об аффилированных лицах, представленной в Банк России.

<sup>14</sup> На дату представления отчета сведения, содержащиеся в нем, должны соответствовать последней актуальной информации об аффилированных лицах, представленной в Банк России.

<sup>15</sup> В соответствии с п. 1.3 Положения Банка России №596-П, предоставление информации о значении норматива Н28 осуществляется головной кредитной организацией банковской группы, являющейся СЗКО, на консолидированной основе; значение норматива Н29 предоставляется СЗКО, не являющейся головной кредитной организацией банковской группы, на индивидуальной основе (за исключением СЗКО, являющейся участником банковской группы, в отношении головной кредитной организации которой установлены требования по соблюдению норматива Н28).

<sup>16</sup> В соответствии со строкой 27 Приложения 2 Указания Банка России №4927-У, предоставление формы осуществляется кредитными организациями, кроме банков с базовой лицензией.

<sup>17</sup> В соответствии со строкой 3 Приложения 2 Указания Банк России №4927-У, предоставление формы осуществляется небанковскими кредитными организациями – центральными контрагентами.

- 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 отчитывающейся организации (список лиц, ответственных за предметные области отчётности), сведения об аффилированных лицах и структуре собственности профессионального участника (форма 0420402), сведения о дебиторской и кредиторской задолженности профессионального участника (форма 0420412), сведения о займах и кредитах (форма 0420414), отчет профессионального участника по ценным бумагам (форма 0420415), расчет показателя краткосрочной ликвидности брокера (форма 0420454), расчет показателя достаточности капитала (форма 0420455) – по состоянию на 31 марта, 30 июня, 30 сентября, 31 декабря отчетного года;
  - расчет собственных средств (форма 0420413) – ежемесячно.
- 4) 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;
  - расчет собственных средств управляющей компании инвестиционных фондов, паевых инвестиционных фондов и негосударственных пенсионных фондов (форма 0420514) – ежемесячно.
- 5) Некредитные организации, являющиеся страховыми организациями и обществами взаимного страхования, представляют Клиринговому центру:
- отчет об акционерах (участниках) и список аффилированных лиц (форма 0420152)<sup>18</sup> – ежегодно;
- 

<sup>18</sup> 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), общие сведения о страховщике (форма 0420150), отчет о страховых резервах (форма 0420155), отчет о платежеспособности (форма 0420156)<sup>19</sup>, 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.
- б) Некредитные организации, являющиеся негосударственными пенсионными фондами, представляют Клиринговому центру:
- 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); 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) – 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.
- 7) Некредитные организации, являющиеся микрофинансовыми организациями, представляют Клиринговому центру:
- микрофинансовые компании – отчет о микрофинансовой деятельности (форма 0420840), отчет о финансовых результатах (форма 0420843 или 042812<sup>20</sup>), бухгалтерский баланс (форма 0420842 или 0420810<sup>21</sup>), справку об аффилированных лицах по форме, установленной Порядком предоставления информации и отчетности – ежеквартально и ежегодно;
  - микрокредитные компании – отчет о микрофинансовой деятельности (форма 0420846), отчет о финансовых результатах (форма 0710002), бухгалтерский

---

<sup>19</sup> Не представляется обществами взаимного страхования.

<sup>20</sup> В зависимости от организационно-правовой формы микрофинансовой компании.

<sup>21</sup> В зависимости от организационно-правовой формы микрофинансовой компании.

- баланс (форма 0710001), справку об аффилированных лицах по форме, установленной Порядком предоставления информации и отчетности – ежеквартально и ежегодно;
- микрофинансовые компании – Расчет собственных средств (согласно форме, приведенной в Приложении к Указанию Банка России № 4037-У<sup>22</sup> от 09.06.2016) – ежемесячно.
- 8) Некредитные организации, являющиеся Биржами, 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); расчет норматива достаточности собственных средств организатора торговли (форма 0420327) – ежегодно и ежеквартально;
  - сведения об аффилированных лицах и структуре собственности профессионального участника (форма 0420402) – по состоянию на 31 марта, 30 июня, 30 сентября, 31 декабря отчетного года;
- 9) Некредитные организации, являющиеся Клиринговыми организациями, 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;
  - сведения об аффилированных лицах и структуре собственности профессионального участника (форма 0420402) – по состоянию на 31 марта, 30 июня, 30 сентября, 31 декабря отчетного года;
- 10) Некредитные организации, являющиеся Кредитными рейтинговыми агентствами, 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;
  - отчет о деятельности кредитного рейтингового агентства (форма 0420880): Раздел 3. Сведения об учредителях (акционерах, участниках) кредитного рейтингового агентства – ежегодно; Раздел 4. Сведения о связанных сторонах кредитного рейтингового агентства – каждые полгода.
- 11) Некредитные организации, не перечисленные в пунктах 3) – 10) настоящего приложения, осуществляющие ведение бухгалтерского учета и отчетности по российским стандартам, представляют Клиринговому центру:
- 

<sup>22</sup> Об установлении методики определения собственных средств (капитала) микрофинансовой компании.

- бухгалтерский баланс (форма 0710001), отчет о финансовых результатах (форма 0710002), отчет о движении денежных средств (форма 0710005) – ежегодно;
  - бухгалтерский баланс (форма 0710001), отчет о финансовых результатах (форма 0710002)– ежеквартально, для Участников клиринга категории «В» с периодичностью, предусмотренной законодательством РФ;
  - отчет эмитента (при наличии) – ежеквартально (в случае направления в адрес Участника клиринга соответствующего запроса);
  - справку об аффилированных лицах по форме, установленной Порядком предоставления информации и отчетности или по форме, определенной Положением Банка России №714-П «О раскрытии информации эмитентами эмиссионных ценных бумаг» (в случае если на Некредитную организацию распространяются требования указанного нормативного акта Банка России) – на полугодовой основе и(или) в случае изменения списка аффилированных лиц;
  - финансовую отчетность по МСФО (в т.ч. консолидированную) на русском или английском языке (при наличии).
- 12) Государственные корпорации и Международные организации, осуществляющие ведение бухгалтерского учета и отчетности по российским стандартам, но не указанные в пункте 2) настоящего приложения, государственные компании, публично-правовые компании представляют Клиринговому центру:
- бухгалтерский баланс (форма 0710001), отчет о финансовых результатах (форма 0710002), отчет о движении денежных средств (форма 0710005) – ежегодно;
  - бухгалтерский баланс (форма 0710001), отчет о финансовых результатах (форма 0710002) – ежеквартально, для Участников клиринга категории «В» с периодичностью, предусмотренной законодательством РФ;
  - 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).
- 13) Региональные органы власти предоставляют Клиринговому центру:
- отчёт об исполнении консолидированного бюджета субъекта Российской Федерации и бюджета территориального государственного внебюджетного фонда (форма 0503317) – ежеквартально,
  - баланс исполнения консолидированного бюджета субъекта Российской Федерации и бюджета территориального государственного внебюджетного фонда (форма 0503320), консолидированный отчёт о финансовых результатах деятельности (форма 0503321) – ежегодно.
- 14) Участники клиринга обязаны представлять отчетность, указанную в пунктах 1) – 12) 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), сведения об условных обязательствах кредитного характера (по данным формы 0409155<sup>23</sup>), сведения об обязательных нормативах и о выделенном капитале центрального контрагента (по данным формы 0409722<sup>24</sup> на первое число месяца, следующего за отчетным) – не позднее 15 (пятнадцатого) 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), информацию о качестве активов кредитной организации (по данным формы 0409115) – не позднее 15 (пятнадцатого) рабочего дня месяца, следующего за отчетным месяцем, при этом по состоянию на 1 апреля, 1 июля и 1 октября – не позднее 15 (пятнадцатого) рабочего дня второго месяца квартала, следующего за отчетным месяцем, а по состоянию на 1 января – не позднее двух месяцев года, следующего за отчетным месяцем;
- справку о численном значении норматива структурной ликвидности (чистого стабильного фондирования) (Базель III) (Н28 (Н29)) (по данным формы 0409121<sup>25</sup>) – по состоянию на 1 апреля, 1 июля и 1 октября – не позднее 15 (пятнадцатого) рабочего дня второго месяца квартала, следующего за отчетным, а по состоянию на 1 января – не позднее двух месяцев года, следующего за отчетным (в случае расчета соответствующих нормативов);
- 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 (пятнадцатого) рабочего дня месяца, следующего за отчетным кварталом.

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 (пятнадцатого) рабочего дня месяца, следующего за отчетным месяцем;

---

<sup>23</sup> В соответствии со строкой 27 Приложения 2 Указания Банка России №4927-У, предоставление формы осуществляется кредитными организациями, кроме банков с базовой лицензией.

<sup>24</sup> В соответствии со строкой 3 Приложения 2 Указания Банк России №4927-У, предоставление формы осуществляется небанковскими кредитными организациями – центральными контрагентами.

<sup>25</sup> В соответствии с п. 1.3 Положения Банка России №596-П, предоставление информации о значении норматива Н28 осуществляется головной кредитной организацией банковской группы, являющейся СЗКО, на консолидированной основе; значение норматива Н29 предоставляется СЗКО, не являющейся головной кредитной организацией банковской группы, на индивидуальной основе (за исключением СЗКО, являющейся участником банковской группы, в отношении головной кредитной организации которой установлены требования по соблюдению норматива Н28).

- отчет о финансовых результатах (форма 0409102) - не позднее 15 (пятнадцатого) 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; сведения об отчитывающейся организации (список лиц, ответственных за предметные области отчётности), 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), сведения о займах и кредитах (форма 0420414), отчет профессионального участника по ценным бумагам (форма 0420415), расчет показателя краткосрочной ликвидности брокера (форма 0420454), расчет показателя достаточности капитала (форма 0420455) по состоянию на 31 марта, 30 июня, 30 сентября отчетного года – не позднее 30 (тридцати) календарных дней, следующих 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; сведения об отчитывающейся организации (список лиц, ответственных за предметные области отчётности), 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), расчет показателя достаточности капитала (форма 0420455) по состоянию на 31 декабря отчетного года – не позднее 45 (сорока пяти) календарных дней, следующих за отчетным периодом/датой;
- расчет размера собственных средств (форма 0420413) по состоянию на последний календарный день каждого месяца – не позднее 30 (тридцати) календарных дней, следующих за отчетным месяцем.

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; оборотную ведомость по счетам бухгалтерского учета акционерного инвестиционного фонда,



управляющей компании (форма 0420521) за март, июнь, сентябрь, декабрь отчетного года - не позднее 1 (одного) календарного месяца, следующего за отчетным периодом;

- расчет собственных средств управляющей компании инвестиционных фондов, паевых инвестиционных фондов и негосударственных пенсионных фондов (форма 0420514), - не позднее 10 (десятого) рабочего дня месяца, следующего за отчетным периодом.

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), общие сведения о страховщике (форма 0420150), отчет о страховых резервах (форма 0420155), отчет о платежеспособности (форма 0420156)<sup>26</sup>, 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;
- 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), общие сведения о страховщике (форма 0420150), отчет об акционерах (участниках) и список аффилированных лиц (форма 0420152)<sup>27</sup>, отчет о страховых резервах (форма 0420155), отчет о платежеспособности (форма 0420156)<sup>28</sup>, 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 05 марта, следующего за отчетным периодом.

---

<sup>26</sup> Не представляется обществами взаимного страхования.

<sup>27</sup> Не представляется обществами взаимного страхования.

<sup>28</sup> Не представляется обществами взаимного страхования.

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), 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)<sup>29</sup> 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), 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)<sup>30</sup> 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 (тридцать первого) марта, следующего за отчетным периодом.

Некредитные организации, являющиеся микрофинансовыми организациями:

- отчет о микрофинансовой деятельности микрофинансовой компании (форма 0420840) по состоянию на 31 марта, 30 июня, 30 сентября отчетного года; бухгалтерский баланс (форма 0420842 или 0420810<sup>31</sup>), отчет о финансовых результатах (форма 0420843 или 0420812<sup>32</sup>), отчет о микрофинансовой деятельности микрокредитной компании (форма 0420846), бухгалтерский баланс (форма 0710001), отчет о финансовых результатах (форма 0710002) за первый квартал, первое полугодие, девять месяцев отчетного года – не позднее 23 (двадцати трёх) рабочих дней, следующих за отчетным периодом;

---

<sup>29</sup> Не представляется некоммерческими организациями.

<sup>30</sup> Не представляется некоммерческими организациями.

<sup>31</sup> В зависимости от организационно-правовой формы микрофинансовой компании.

<sup>32</sup> В зависимости от организационно-правовой формы микрофинансовой компании.

- отчет о микрофинансовой деятельности микрофинансовой компании (форма 0420840) по состоянию на 31 декабря отчетного года; бухгалтерский баланс (форма 0420842 или 0420810<sup>33</sup>), отчет о финансовых результатах (форма 0420843 или 0420812<sup>34</sup>), отчет о микрофинансовой деятельности микрокредитной компании (форма 0420846), бухгалтерский баланс (форма 0710001), отчет о финансовых результатах (форма 0710002) за отчетный год – не позднее 1 апреля года, следующего за отчетным годом;
- Расчет собственных средств микрофинансовой компании – не позднее 23 (двадцати трёх) рабочих дней, следующих за отчетным месяцем;
- справку об аффилированных лицах по форме, установленной Порядком предоставления информации и отчетности, по состоянию на 31 марта, 30 июня, 30 сентября отчетного года – не позднее 30 (тридцати) календарных дней, следующих за отчетной датой.

Некредитные организации, указанные в пункте 8) настоящего приложения:

- ежеквартальный бухгалтерский баланс некредитной организации (форма 0710001), ежеквартальный отчет о финансовых результатах некредитной организации (форма 0710002) – 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 0710005) – не позднее 15 апреля года, следующего за отчетным годом;
- справку об аффилированных лицах по форме, установленной Порядком предоставления информации и отчетности или по форме, определенной Положением Банка России №714-П «О раскрытии информации эмитентами эмиссионных ценных бумаг» (в случае если на Некредитную организацию распространяются требования указанного нормативного акта Банка России), по состоянию на 31 декабря и 30 июня отчетного года, а также в случае изменения списка аффилированных лиц – не позднее 30 (тридцати) календарных дней, следующих за отчетной датой и(или) датой изменения списка аффилированных лиц;
- финансовую отчетность по МСФО (в т.ч. консолидированную) на русском или английском языке – по мере составления или публикации.

Некредитные организации, являющиеся Биржами:

- 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; сведения об аффилированных лицах и структуре собственности профессионального участника (форма 0420402) по состоянию

---

<sup>33</sup> В зависимости от организационно-правовой формы микрофинансовой компании.

<sup>34</sup> В зависимости от организационно-правовой формы микрофинансовой компании.

на 1 апреля, 1 июля, 1 октября отчетного года; расчет норматива достаточности собственных средств организатора торговли (форма 0420327) по состоянию на 1 апреля, 1 июля, 1 октября – не позднее 30 (тридцати) календарных дней, следующих 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, расчет норматива достаточности собственных средств организатора торговли (форма 0420327) по состоянию на 1 января – не позднее 45 (сорока пяти) календарных дней, следующих за отчетным периодом/датой;

Некредитные организации, являющиеся Клиринговыми организациями, представляют Клиринговому центру:

- 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; сведения об аффилированных лицах и структуре собственности профессионального участника (форма 0420402) по состоянию на 1 апреля, 1 июля, 1 октября отчетного года – не позднее 30 (тридцати) календарных дней, следующих 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 – не позднее 45 (сорока пяти) календарных дней, следующих за отчетным периодом/датой;

Некредитные организации, являющиеся Кредитными рейтинговыми агентствами:

- 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; сведения об аффилированных лицах и структуре собственности профессионального участника (форма 0420402) по состоянию на 1 апреля, 1 июля, 1 октября отчетного года – не позднее 30 (тридцати) календарных дней, следующих 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 – не позднее 45 (сорока пяти) календарных дней, следующих за отчетным периодом/датой;
- отчет о деятельности кредитного рейтингового агентства (форма 0420880): Раздел 4. Сведения о связанных сторонах кредитного рейтингового агентства на 30 июня – не позднее 30 (тридцати) календарных дней, следующих за отчетным периодом/датой;
- отчет о деятельности кредитного рейтингового агентства (форма 0420880): Раздел 3. Сведения об учредителях (акционерах, участниках) кредитного рейтингового агентства на 31 декабря, Раздел 4. Сведения о связанных

сторонах кредитного рейтингового агентства на 31 декабря – не позднее 90 (девяноста) календарных дней, следующих за отчетным периодом/датой.

Государственные корпорации и Международные организации, указанные в пункте 12) настоящего приложения:

- ежеквартальный бухгалтерский баланс некредитной организации (форма 0710001), ежеквартальный отчет о финансовых результатах некредитной организации (форма 0710002) – 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 0710005) – не позднее 15 апреля года, следующего за отчетным годом;
- финансовую отчетность по МСФО (в т.ч. консолидированную) на русском или английском языке – по мере составления или публикации.

15) Региональные органы власти:

- отчет об исполнении консолидированного бюджета субъекта Российской Федерации и бюджета территориального государственного внебюджетного фонда (форма 0503317) – не позднее 15 (пятнадцатого) календарного дня месяца, следующего за отчетным периодом;
- баланс исполнения консолидированного бюджета субъекта Российской Федерации и бюджета территориального государственного внебюджетного фонда (форма 0503320), консолидированный отчет о финансовых результатах деятельности (форма 0503321) – не позднее срока представления годовой бюджетной отчетности в Федеральное казначейство.

16) 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.

17) Национальные (центральные) банки стран-членов ЕврАзЭС/ЕАЭС не позднее 15 (пятнадцати) рабочих дней с даты подписания уполномоченным лицом финансовой отчетности 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 – в соответствии с периодичностью составления;
- основные показатели деятельности Нерезидента по форме приложения № 3 (для банков ЕврАзЭС/ЕАЭС) к Порядку представления информации и отчетности) – ежеквартально для Национальных (центральных) банков, допущенных к клиринговому обслуживанию в категории «Б» или «Б2» на одном из рынков присутствия, а также в соответствии с периодичностью составления для Национальных (центральных) банков, допущенных к клиринговому обслуживанию в категории «В» на всех рынках присутствия.

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

19) Документы, указанные в пункте 16) 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.

20) В случае принятия органами, регулируемыми сроки предоставления отчетности, указанной в настоящем приложении к общей части Правил клиринга, решения об изменении сроков предоставления отчетности, такая отчетность должна быть представлена в соответствии со сроками, указанными в соответствующем решении.

**Приложение № 6**  
к общей части Правил клиринга

**Временной регламент**

№ п/п	Наименование операции	Время (московское)
<b>1.</b>	<b>Время (сроки) проведения клиринговых и иных операций в Клиринговой системе</b>	
1.1.	Получение от Расчетного депозитария выписки по Разделам / субсчетах депо.	до 9:30
1.2.	Проведение клиринговой сессии mark-to-market:	
1.2.1.	на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов.	до 06:50 Расчетного дня
1.2.2.	на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.	до 07:00 Расчетного дня
1.3.	Определение минимального размера Обеспечения под стресс	до 09:45 Расчетного дня
1.4.	Определение Маржинальных требований, Маржинальных требований по фондам, Маржинальных требований по обеспечению под стресс, Маржинальных требований по пулу, Маржинальных требований по риску концентрации на эмитента, Маржинальных требований по Расчетному коду для уплаты налогов.	10:00 Расчетного дня
1.5.	Проведение первой расчетной клиринговой сессии.	с 17:30 до 18:00
1.6.	Проведение второй расчетной клиринговой сессии.	с 19:00 до 20:00
1.7.	Проведение третьей расчетной клиринговой сессии.	с 20:00 до 20:45
1.8.	Передача Участником клиринга в Клиринговый центр Запроса на проведение ранних расчетов, Постоянного поручения на ограничение времени начала заключения сделок с Клиринговым центром и Запросов на ограничение времени окончания заключения сделок с Клиринговым центром.	с 9:00 до 18:00
1.9.	Направление Клиринговым центром Расчетному депозитарию Запроса на подбор ценных бумаг с целью исполнения Маржинальных требований, Маржинальных требований по фондам и/или Маржинальных требований по обеспечению под стресс, Маржинальных требований по пулу, Маржинальных требований по риску концентрации на эмитентов, Маржинальных требований по Расчетному коду для уплаты налогов.	- сразу после определения Маржинальных требований; - с 16:30 до 16:45
1.10.	Передача Участником клиринга Запроса на замену Торгово-клирингового счета.	до 20:00 Расчетного дня
1.11.	Передача Участником клиринга Запроса на присвоение Расчетному коду признака «Единый пул».	до 18:30 Расчетного дня
1.12.	Передача Участником клиринга Запроса на изменение области действия Расчетного кода Единого пула.	до 18:30 Расчетного дня
1.13.	Время начала заключения Сделок с Клиринговым центром в случае ограничения Участником клиринга времени начала заключения Сделок с Клиринговым центром.	10:00
1.14.	Время окончания заключения Сделок с Клиринговым центром в случае предоставления Участником клиринга Запроса на ограничение времени окончания заключения сделок с Клиринговым центром без указания времени.	в течение 15 минут после получения Клиринговым центром Запроса на ограничение времени окончания заключения сделок с

		Клиринговым центром, в период с 12:00 до 14:00 и с 15:15 до 17:30
1.15.	Время окончания заключения Сделок с Клиринговым центром в случае предоставления Участником клиринга Запроса на ограничение времени окончания заключения сделок с Клиринговым центром с указанием времени / Постоянного поручения на ограничение времени окончания заключения сделок с Клиринговым центром.	В момент времени, указанный в запросе / поручении Участника клиринга
<b>2.</b>	<b>Время (сроки) внесения и возврата Обеспечения</b>	
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 указанием Торгово-клиринговых счетов, в состав которых не входит Счет обеспечения Т0 (с использованием Клиринговой системы фондового рынка).	с 06:50 до 23:50 Расчетного дня
2.3.	Передача Участником клиринга Клиринговому центру распоряжений на перевод денежных средств с целью внесения / возврата Обеспечения / взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс с указанием Торгово-клиринговых счетов, в состав которых входит Счет обеспечения Т0 (с использованием Клиринговой системы фондового рынка).	с 09:05 до 19:00 Расчетного дня
2.4.	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).	с 06:50 до 19:00 Расчетного дня
2.5.	Передача Участником клиринга Клиринговому центру Запросов на передачу Профилей активов:	
2.5.1.	на фондовом рынке, на валютном рынке и рынке драгоценных металлов, на срочном рынке.	с 06:50 до 23:50 Расчетного дня
2.5.2.	на рынке стандартизированных ПФИ	с 10:00 до 21:00 Расчетного дня
2.6.	Прием Клиринговым центром от Участников клиринга Запросов на перевод Обеспечения в иностранной валюте, российских рублях, драгоценных металлах.	с 06:50 до 23:50 Расчетного дня
2.7.	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
	- вьетнамских донгов;	с 08:00 до 10:00 Расчетного дня
	- гонконгских долларов, египетских фунтов, азербайджанских манатов, таджикских сомони, киргизских сомов;	с 08:00 до 11:00 Расчетного дня
	- узбекских сум, армянских драм, дирхамов ОАЭ;	с 08:00 до 12:30 Расчетного дня
	- юаней, белорусских рублей, казахстанских тенге, южноафриканских рэндов;	с 08:00 до 13:15 Расчетного дня
	- швейцарских франков, турецких лир;	с 08:00 до 14:00 Расчетного дня



	- евро, фунтов стерлингов с клиринговых счетов в НКО АО НРД;	с 08:00 до 16:25 Расчетного дня
	- фунтах стерлингов с клиринговых / корреспондентских счетов в Расчетных организациях / Расчетных банках (кроме НКО АО НРД);	с 08:00 до 17:00 Расчетного дня
	- евро с клиринговых / корреспондентских счетов в Расчетных организациях / Расчетных банках (кроме НКО АО НРД);	с 08:00 до 15:45 Расчетного дня
	- канадских долларов;	с 08:00 до 17:00 Расчетного дня
	- российских рублей;	с 08:00 до 19:30 Расчетного дня
	- долларов США, драгоценных металлов;	с 08:00 до 20:00 Расчетного дня
	- иен, австралийских долларов с зачислением на счет получателя не позднее Расчетного дня, следующего за датой получения запроса.	с 08:00 до 20:00 Расчетного дня
2.8.	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 <sup>1</sup> в:	
	- вьетнамских донгах;	10:30
	- гонконгских долларах;	11:00
	- египетских фунтов, азербайджанских манатов, таджикских сомони, киргизских сомов;	12:45
	- белорусских рублях, казахстанских тенге, турецких лирах, узбекских сумах, армянских драмах, дирхамах ОАЭ;	13:00
	- юанях;	13:15
	- швейцарских франках, южноафриканских рэндах;	14:00
	- евро, фунтах стерлингов с клиринговых счетов в НКО АО НРД;	16:20
	- фунтах стерлингов с клиринговых / корреспондентских счетов в Расчетных организациях / Расчетных банках (кроме НКО АО НРД);	17:15
	- евро с клиринговых / корреспондентских счетов в Расчетных организациях / Расчетных банках (кроме НКО АО НРД);	16:00
	- канадских долларах;	17:15
	- российских рублях;	19:45
	- долларах США, драгоценных металлов;	20:00
	- иенах, австралийских долларах с зачислением на счет получателя не позднее Расчетного дня, следующего за датой получения запроса.	20:00
2.9.	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 <sup>1</sup> в:	
	- вьетнамских донгах;	10:30
	- гонконгских долларах;	11:00
	- египетских фунтов, азербайджанских манатов, таджикских сомони, киргизских сомов;	12:45
	- белорусских рублях, казахстанских тенге;	13:00
	- юанях;	13:15
	- швейцарских франках, турецких лирах, южноафриканских рэндах, узбекских сумах, армянских драмах, дирхамах ОАЭ;	14:00
	- фунтах стерлингов, канадских долларах;	17:15

	- евро;	16:00
	- российских рублях;	19:45
	- долларах США, драгоценных металлов;	20:00
	- иенах, австралийских долларах с зачислением на счет получателя не позднее Расчетного дня, следующего за датой получения запроса.	20:00
2.10.	Возврат Клиринговым центром Участникам клиринга денежных средств / драгоценных металлов / ценных бумаг, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга <sup>2</sup> .	В являющийся Расчетным днем день получения Клиринговым центром соответствующего запроса / распоряжения / в Расчетный день (в случае возврата денежных средств / драгоценных металлов на основании Постоянного поручения на возврат обеспечения)
2.11.	Возврат Клиринговым центром Участникам клиринга денежных средств / ценных бумаг, учитываемых в качестве взносов в Гарантийные фонды / Обеспечения под стресс.	в являющийся Расчетным днем день получения Клиринговым центром соответствующего запроса / распоряжения
<b>3.</b>	<b>Сроки определения подлежащих исполнению обязательств по денежным средствам / драгоценным металлам по Расчетным кодам Единого пула, Расчетным кодам, открытым для фондового рынка, рынка депозитов и рынка кредитов, Расчетным кодам, открытым для валютного рынка и рынка драгоценных металлов</b>	
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, возникало 2 (два) Расчетных дня подряд, в 3 (третий) Расчетный день; - Участников клиринга, клиринговое обслуживание которых приостановлено;	10:00 Даты исполнения
3.2.	Определение Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований по денежным средствам / драгоценным металлам (указанное Итоговое нетто-требование используется для исполнения Постоянных поручений на возврат обеспечения содержащих признак, указывающий на необходимость возврата денежных средств / драгоценного металла в размере нетто-требования):	
	- во вьетнамских донгах;	10:00 Даты исполнения
	- в гонконгских долларах, армянских драмах, египетских фунтов, азербайджанских манатов, таджикских сомони, киргизских сомов;	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 до 11:00 или Запрос на проведение ранних	11:00 Даты исполнения

	расчетов / Постоянное поручение на проведение ранних расчетов с указанием времени 11:00;	
	- юанях, белорусских рублях, казахстанских тенге, швейцарских франках, турецких лирах, южноафриканских рэндах, узбекских сумах, дирхамах ОАЭ;	12:30 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 12:30 или Запрос на проведение ранних расчетов / Постоянное поручение на проведение ранних расчетов с указанием времени 12:30;	12:30 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 12:00 до 14:00;	в течение 15 минут после получения Клиринговым центром Запроса на проведение ранних расчетов
	- в евро, фунтах стерлингов, канадских долларах 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, австралийских долларах, драгоценных металлах (за исключением драгоценных металлов с признаком Локо Лондон) для Участников клиринга, не предоставивших Запрос на проведение ранних расчетов или Постоянное поручение на проведение ранних расчетов, по сделкам, заключенным до 19:00 Даты исполнения;	19:20 Даты исполнения
	- в российских рублях по сделкам РЕПО / сделкам купли-продажи ценных бумаг, заключенным в соответствии с пунктом 5.7 Временного регламента;	
	- в гонконгских долларах, египетских фунтов, азербайджанских манатов, таджикских сомони, киргизских сомов, по сделкам, заключенным с 11:00 до 19:00 Даты исполнения;	19:20 Даты исполнения
	- в юанях, белорусских рублях, казахстанских тенге, швейцарских франках, турецких лирах, узбекских сумах, армянских драмах,	

	дирхамах ОАЭ по сделкам, заключенным с 12:30 до 19:00 Даты исполнения; - в евро, фунтах стерлингов по сделкам, заключенным с 15:15 до 19:00 Даты исполнения;	
	- в драгоценных металлах (по драгоценным металлам с признаком Локо Лондон).	10:00 Даты исполнения
<b>4.</b>	<b>Сроки определения подлежащих исполнению обязательств по ценным бумагам по Торгово-клиринговым счетам Единого пула, Торгово-клиринговым счетам, открытым для фондового рынка, рынка депозитов и рынка кредитов</b>	
4.1.	Определение предварительных Итоговых нетто-обязательств по ценным бумагам: - Участников клиринга, у которых Итоговое нетто-обязательство по ценной бумаге, для исполнения которого недостаточно ценных бумаг, по одному Торгово-клиринговому счету возникало 4 (четыре) Расчетных дня подряд, в 5 (пятый) Расчетный день; - Участников клиринга, у которых Итоговое нетто-обязательство по ценной бумаге, для исполнения которого недостаточно ценных бумаг, по любому Торгово-клиринговому счету возникало 8 (восемь) Расчетных дней подряд, в 9 (девятый) Расчетный день.	до 9:45
4.2.	Направление Клиринговым центром Расчетному депозитарию Запроса на подбор ценных бумаг.	с 9:45 до 10:00
4.3.	Определение Итоговых нетто-обязательств по ценным бумагам: - Участников клиринга, у которых Итоговое нетто-обязательство по ценной бумаге, для исполнения которого недостаточно ценных бумаг, по одному Торгово-клиринговому счету возникало 4 (четыре) Расчетных дня подряд, в 5 (пятый) Расчетный день; - Участников клиринга, у которых Итоговое нетто-обязательство по ценной бумаге, для исполнения которого недостаточно ценных бумаг, по любому Торгово-клиринговому счету возникало 8 (восемь) Расчетных дней подряд, в 9 (девятый) Расчетный день; - Участников клиринга, клиринговое обслуживание которых приостановлено.	10:00 Даты исполнения
4.4.	Определение Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований по ценным бумагам по сделкам, заключенным до 16:00 Даты исполнения.	16:00 Даты исполнения
4.5.	Направление Клиринговым центром Расчетному депозитарию Запроса на подбор ценных бумаг.	с 16:30 до 16:45
4.6.	Определение предварительных Итоговых нетто-обязательств по ценным бумагам по сделкам, заключенным с 16:00 до 18:30 Даты исполнения.	18:30 Даты исполнения
4.7.	Направление Клиринговым центром Расчетному депозитарию Запроса на подбор ценных бумаг.	с 18:30 до 19:00
4.8.	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
<b>5.</b>	<b>Сроки исполнения обязательств</b>	
5.1.	Исполнение Итоговых нетто-обязательств по денежным средствам / драгоценным металлам Участниками клиринга, у которых Итоговое нетто-обязательство, для исполнения которого недостаточно	10:00 Даты исполнения

	денежных средств / драгоценных металлов, или Задолженность возникли 2 (два) Расчетных дня подряд, в 3 (третий) Расчетный день. Исполнение Итоговых нетто-обязательств по ценным бумагам Участниками клиринга, у которых Итоговое нетто-обязательство, для исполнения которого недостаточно ценных бумаг, по одному Торгово-клиринговому счету возникало 4 (четыре) Расчетных дня подряд, в 5 (пятый) Расчетный день. Исполнение Итоговых нетто-обязательств по ценным бумагам Участниками клиринга, у которых Итоговое нетто-обязательство, для исполнения которого недостаточно ценных бумаг, по любому Торгово-клиринговому счету возникало 8 (восемь) Расчетных дней подряд, в 9 (девятый) Расчетный день. Исполнение Итоговых нетто-обязательств по денежным средствам / драгоценным металлам / ценным бумагам Участниками клиринга, клиринговое обслуживание которых было приостановлено в предыдущий Расчетный день.	
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:	
	- во вьетнамских донгах, определенных по сделкам, заключенным до 10:00 Даты исполнения;	до 10:00 Даты исполнения <sup>3</sup>
	- в гонконгских долларах, египетских фунтах, азербайджанских манатах, киргизских сомах, узбекских сумах, определенных по сделкам, заключенным до 11:00 Даты исполнения;	до 12:00 Даты исполнения <sup>3</sup>
	- в армянских драмах, таджикских сомони, определенных по сделкам, заключенным до 11:00 Даты исполнения;	до 13:00 Даты исполнения <sup>3</sup>
	- в юанях, белорусских рублях, казахстанских тенге, южноафриканских рэндах, определенных по сделкам, заключенным до 12:30 Даты исполнения;	до 13:15 Даты исполнения <sup>3</sup>
	- в швейцарских франках, турецких лирах, дирхамах ОАЭ, определенных по сделкам, заключенным до 12:30 Даты исполнения;	до 14:00 Даты исполнения <sup>3</sup>
	- в фунтах стерлингов, определенных по сделкам, заключенным до 15:15 Даты исполнения;	до 17:00 Даты исполнения <sup>3</sup>
	- в евро, определенных по сделкам, заключенным до 15:15 Даты исполнения;	до 16:00
	- в канадских долларах, определенных по сделкам, заключенным до 15:15 Даты исполнения;	до 17:00
	- в долларах США, российских рублях, иенах, австралийских долларах, драгоценных металлах (за исключением драгоценных металлов с признаком Локо Лондон) по сделкам, заключенным до 19:00 Даты исполнения; - в гонконгских долларах, египетских фунтов, азербайджанских манатов, таджикских сомони, киргизских сомов, определенных по сделкам, заключенным с 11:00 до 19:00 Даты исполнения; - в юанях, белорусских рублях, казахстанских тенге, швейцарских франках, турецких лирах, узбекских сумах, армянских драмах,	до 20:00 Даты исполнения <sup>3</sup>

	дирхамах ОАЭ, определенных по сделкам, заключенным с 12:30 до 19:00 Даты исполнения; - в евро, фунтах стерлингов, определенных по сделкам, заключенным с 15:15 до 19:00 Даты исполнения;	
	- в драгоценных металлах (по драгоценным металлам с признаком Локо Лондон).	до 12:00 Даты исполнения
5.5.	Исполнение Маржинальных требований по фондам, Маржинальных требований по обеспечению под стресс, Маржинальных требований по риску концентрации на эмитента, Маржинальных требований по Расчетному коду для уплаты налогов, Маржинальных требований, возникших по Расчетным кодам Единого пула и Расчетным кодам, открытым для фондового рынка, рынка депозитов и рынка кредитов, 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.	с 17:00 до 17:30 Расчетного дня
5.7.	Заключение сделок РЕПО / сделок купли-продажи ценных бумаг в 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.	с 19:00 до 19:20 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 <sup>3</sup>
5.9.	Прекращение Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований по денежным средствам / драгоценным металлам.	20:30 <sup>3</sup> Даты исполнения
5.10.	Исполнение обязательств по уплате комиссионных вознаграждений по сделкам, заключенным с 19:00 до 23:50, на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, на валютном рынке и рынке драгоценных металлов.	После окончания Торговой сессии / времени подачи Предложений на соответствующем Рынке
5.11.	Исполнение обязательств по уплате комиссионных вознаграждений по сделкам, заключенным с 19:00 до 23:50, на срочном рынке.	На следующий Расчетный день, следующий за датой исполнения обязательств по уплате соответствующего комиссионного вознаграждения
<b>6.</b>	<b>Сроки предоставления отчетов по итогам клиринга</b>	
6.1.	Передача Клиринговым центром Участникам клиринга Отчетов о движении денежных средств, Отчетов о гарантийных фондах, Отчетов об обеспечении под риски концентрации на эмитентов, Отчетов об обеспечении под стресс.	до 9:00 следующего Расчетного дня
6.1.1.	Направление Участникам клиринга Уведомлений о значениях минимального размера Обеспечения под стресс.	10:00
6.2.	Передача Клиринговым центром Участникам клиринга Отчетов о Маржинальных требованиях.	10:00 – 10:15

6.3.	Передача Клиринговым центром Участникам клиринга Отчетов об Итоговых нетто-обязательствах / Итоговых нетто-требованиях по Расчетным кодам Единого пула, Расчетным кодам, открытым для фондового рынка, рынка депозитов и рынка кредитов, 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, возникало 2 (два) Расчетных дня подряд, в 3 (третий) Расчетный день, или для Участников клиринга, у которых Итоговое нетто-обязательство по ценной бумаге, для исполнения которого недостаточно ценных бумаг, по одному Торгово-клиринговму счету возникало 4 (четыре) Расчетных дня подряд, в 5 (пятый) Расчетный день, или для Участников клиринга, у которых Итоговое нетто-обязательство по ценной бумаге, для исполнения которого недостаточно ценных бумаг, по любому Торгово-клиринговму счету возникало 8 (восемь) Расчетных дней подряд, в 9 (девятый) Расчетный день;	с 10:00 до 10:15 Даты исполнения
	- денежным средствам во вьетнамских донгах, определенных по сделкам, заключенным до 10:00 Даты исполнения;	с 10:00 до 10:15 Даты исполнения
	- денежным средствам в гонконгских долларах, египетских фунтах, азербайджанских манатах, таджикских сомони, киргизских сомах, узбекских сумах, дирхамах ОАЭ, армянских драмах, определенных по сделкам, заключенным до 11:00 Даты исполнения;	с 11:00 до 11:15 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 указанием времени 11:00;	с 11:00 до 11:15 Даты исполнения
	- денежным средствам в юанях, белорусских рублях, казахстанских тенге, швейцарских франках, турецких лирах, южноафриканских рэндах, определенных по сделкам, заключенным до 12:30 Даты исполнения;	с 12:30 до 12:45 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 с 11:00 до 12:30 или Запрос на проведение ранних расчетов / Постоянное поручение на проведение ранних расчетов с указанием времени 12:30;	с 12:30 до 12:45 Даты исполнения
	- 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 12:30 до 14:00;	в течение 15 минут после получения Клиринговым центром Запроса на проведение ранних расчетов
	- денежным средствам в евро, фунтах стерлингов, канадских долларах, 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	с 15:15 до 15:30 Даты исполнения

	14:00 до 15:15 или Запрос на проведение ранних расчетов / Постоянное поручение на проведение ранних расчетов с указанием времени 15:15;	
	- 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, австралийских долларах, драгоценных металлах (за исключением драгоценных металлов с признаком Локо Лондон) по сделкам, заключенным до 19:00 Даты исполнения, Участникам клиринга, не предоставившим Запрос на проведение ранних расчетов или Постоянное поручение на проведение ранних расчетов; - денежным средствам в гонконгских долларах, египетских фунтов, азербайджанских манатов, таджикских сомони, киргизских сомов, 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; - денежным средствам в юанях, белорусских рублях, казахстанских тенге, швейцарских франках, турецких лирах, узбекских сумах, армянских драмах, дирхамах ОАЭ, определенных по сделкам, заключенным с 12:30 до 19:00 Даты исполнения, Участникам клиринга, не предоставившим Запрос на проведение ранних расчетов или Постоянное поручение на проведение ранних расчетов; - 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
	- драгоценным металлам (по драгоценным металлам с признаком Локо Лондон);	с 10:00 до 10:30 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 / драгоценным металлам и/или 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 <sup>3</sup>
6.4.	Передача Клиринговым центром Участникам клиринга Отчетов о комиссионных вознаграждениях на фондовом рынке, рынке депозитов и рынке кредитов, на валютном рынке и рынке драгоценных металлов:	



	- Участникам клиринга, предоставившим Запрос на ограничение времени окончания 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 / Постоянное поручение на ограничение времени окончания заключения сделок с Клиринговым центром с указанием времени 12:30;	с 12:30 до 12:45 даты заключения сделок
	- Участникам клиринга, предоставившим Запрос на ограничение времени окончания заключения сделок с Клиринговым центром без указания времени с 12:30 до 14:00 или с 15:15 до 17:30;	в течение 15 минут после получения Клиринговым центром Запроса на ограничение времени окончания заключения сделок с Клиринговым центром
	- Участникам клиринга, предоставившим Запрос на ограничение времени окончания заключения сделок с Клиринговым центром без указания времени с 14:00 до 15:15 или Запрос / Постоянное поручение на ограничение времени окончания заключения сделок с Клиринговым центром с указанием времени 15:15;	с 15:15 до 15:30 даты заключения сделок
	- Участникам клиринга, предоставившим Запрос на ограничение времени окончания заключения сделок с Клиринговым центром без указания времени с 17:30 до 18:00 или Запрос / Постоянное поручение на ограничение времени окончания 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 ограничение времени окончания 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 ограничение времени окончания 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 ограничение времени окончания заключения сделок с Клиринговым центром.	до 09:00 Расчетного дня, следующего за датой заключения сделок
<b>7.</b>	<b>Сроки перевода обязательств и Обеспечения</b>	
7.1.	Передача Обособленным клиентом Клиринговому центру Заявления на перевод обязательств и Обеспечения.	до 18:00 дня D1 <sup>4</sup> или до 13:00 дня D2 <sup>4</sup> 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 15:00 дня, следующего за днем D1 <sup>4</sup> ; не позднее 17:00 дня D2 <sup>4</sup> ; не позднее 15:00 рабочего дня, следующего за днем D3 <sup>4</sup>
7.3.	Передача Участником клиринга – реципиентом Клиринговому центру Согласия на прием обязательств и Обеспечения.	не позднее 16:00 дня, следующего за днем D1 <sup>4</sup> ; не позднее 18:00 дня D2 <sup>4</sup> ; не позднее 16:00 рабочего дня, следующего за днем D3 <sup>4</sup>
7.4.	Передача Обособленным клиентом Клиринговому центру Заявления на отзыв заявления на перевод обязательств и Обеспечения, Заявления на перевод обязательств и Обеспечения с указанием наименования нового Участника клиринга – реципиента.	не позднее 13:00 дня, следующего за днем D1 <sup>4</sup> ; не позднее 13:00 дня D2 <sup>4</sup> ; не позднее 13:00 рабочего дня, следующего за днем D3 <sup>4</sup>
7.5.	Исполнение Клиринговым центром Заявления на перевод обязательств и Обеспечения.	с 10:00 до 16:00, с 18:00 до 19:00.
7.6.	Передача Участником клиринга – реципиентом Запроса на заполнение краткого кода клиента.	до 20:00 Расчетного дня, предшествующего Дате исполнения обязательств по Сделкам, указанным в запросе
<b>8.</b>	<b>Сроки проведения ликвидационного неттинга в отношении клиента Участника клиринга</b>	
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
<b>9.</b>	<b>Сроки проведения иных операций</b>	
9.1.	Обеспечение Участником клиринга встречных обязательств в соответствии с подпунктом 26.4.2 общей части Правил клиринга.	До 18:45 дня, в который возникла необходимость заключения балансирующих сделок
9.2.	Время заключения балансирующих сделок в соответствии с пунктом 26.3 общей части Правил клиринга.	18:45 дня, в который возникла необходимость заключения балансирующих сделок

<sup>1</sup> – под внутренним платежом понимается возврат денежных средств на Счет для возврата обеспечения, открытый в кредитной организации, являющейся Расчетным банком / Расчетной организацией по такой валюте, под внешним платежом - возврат денежных средств на Счет для возврата обеспечения, открытый в кредитной организации, не являющейся Расчетным банком / Расчетной организацией по такой валюте.

<sup>2</sup> – зачисление денежных средств в иностранной валюте 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.

<sup>3</sup>– при наличии сбоя в платежных системах указанное время может быть продлено по решению Клирингового центра до устранения указанного сбоя.

<sup>4</sup> – D1 – день начала процедуры Перевода обязательств и Обеспечения, при проведении процедуры Перевода обязательств и Обеспечения по основаниям, установленным законодательством, в случае если день, следующий за днем начала указанной процедуры, является рабочим днем;

D2 – день начала процедуры Перевода обязательств и Обеспечения, при проведении процедуры Перевода обязательств и Обеспечения по основаниям, установленным законодательством, в случае если день, следующий за днем начала указанной процедуры, является нерабочим или праздничным днем;

D3 – день начала процедуры Перевода обязательств и Обеспечения, при проведении процедуры Перевода обязательств и Обеспечения по иным основаниям.

