

УТВЕРЖДЕНО
советом директоров
Небанковской кредитной организации - центрального контрагента
«Клиринговый центр МФБ»
(акционерное общество)
(протокол № 5/2021 от 31.03.2021)

**ПРАВИЛА ОСУЩЕСТВЛЕНИЯ
КЛИРИНГОВОЙ ДЕЯТЕЛЬНОСТИ**
на рынке ценных бумаг и на рынке производных финансовых инструментов
Небанковской кредитной организации-центрального контрагента
«Клиринговый центр МФБ» (акционерное общество)

Москва,
2021 год

ОГЛАВЛЕНИЕ

РАЗДЕЛ I. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ	4
Статья 1. Термины и определения.....	4
Статья 2. Общие положения	10
Статья 3. Порядок проведения клиринга.....	10
Статья 4. Взаимодействие КЦ с Организатором торговли, Расчетной организацией, Расчетным депозитарием и техническим центром.....	12
Статья 5. Общие правила использования информации.....	13
Статья 6. Клиринговые регистры	14
Статья 7. Виды клиринговых счетов.....	20
Статья 8. Порядок регистрации Торгово-клиринговых счетов.....	22
РАЗДЕЛ II. ПРАВА И ОБЯЗАННОСТИ КЦ И УЧАСТНИКОВ КЛИРИНГА. ТРЕБОВАНИЯ К УЧАСТНИКАМ КЛИРИНГА	25
Статья 9. Права, обязанности и ответственность КЦ и Участников клиринга....	25
Статья 10. Требования к Участникам клиринга, допущенным к клиринговому обслуживанию	27
Статья 11. Регистрация в качестве Участника клиринга	28
Статья 12. Требования к Участникам клиринга по предоставлению финансовой отчетности в КЦ и их финансовой устойчивости	38
Статья 13. Допуск к клиринговому обслуживанию, приостановление, возобновление и прекращение допуска к клиринговому обслуживанию	39
Статья 14. Оплата услуг КЦ и Организатора торговли.....	42
РАЗДЕЛ III. МЕРЫ, НАПРАВЛЕННЫЕ НА УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ.....	43
Статья 15. Способы снижения рисков при осуществлении клиринга.....	43
Статья 16. Обеспечение исполнения обязательств Участников клиринга. Условия соглашения об индивидуальном клиринговом обеспечении и коллективном клиринговом обеспечении.....	44
Статья 17. Ограничение ответственности центрального контрагента (уровни защиты центрального контрагента).....	47
Статья 18. Гарантйные фонды	48
Статья 19. Порядок расчета величины Доступных средств	49
Статья 20. Маржинальные требования	51
Статья 21. Последствия нарушения Маржинального требования	52
Статья 22. Порядок использования и возмещения Гарантйных фондов.....	55
РАЗДЕЛ IV. ПОРЯДОК ВНЕСЕНИЯ, ИСПОЛЬЗОВАНИЯ И ВОЗВРАТА СРЕДСТВ ОБЕСПЕЧЕНИЯ	59
Статья 23. Порядок внесения, использования и возврата Средств обеспечения.....	59
Статья 24. Порядок внесения и возврата вноса в Гарантйные фонды.....	64
РАЗДЕЛ V. ПОРЯДОК И УСЛОВИЯ ДОПУСКА ОБЯЗАТЕЛЬСТВ К КЛИРИНГУ	67
Статья 25. Порядок взаимодействия с Организатором торговли при подаче Заявок и заключении Договоров. Порядок и условия допуска обязательств к клирингу.....	67
Статья 26. Прием Поручений на клиринг внебиржевых договоров	69
Статья 27. Порядок заключения Внебиржевых договоров ОТС	70
РАЗДЕЛ VI. ПОРЯДОК ВКЛЮЧЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ В КЛИРИНГОВЫЙ ПУЛ. ПОРЯДОК ИСПОЛНЕНИЯ/ПРЕКРАЩЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ	74
Статья 28. Виды клиринговых пулов. Порядок включения обязательств в клиринговые пулы.....	74

Статья 29. Порядок формирования клирингового пула по Договорам, расчётного клирингового пула, клирингового пула по Внутриброкерским договорам и клирингового пула ОТС. Порядок исполнения / прекращения обязательств, допущенных к клирингу.....	76
Статья 30. Порядок урегулирования ненадлежащего исполнения обязательств.....	82
Статья 31. Донорский договор.....	90
Статья 32. Порядок формирования клирингового пула по Договорам размещения и выкупа. Порядок исполнения / прекращения обязательств, допущенных к клирингу..	94
Статья 33. Порядок формирования клирингового пула по договорам, заключаемым без участия Центрального контрагента. Порядок исполнения / прекращения обязательств, допущенных к клирингу	96
Статья 34. Порядок формирования клирингового пула по Договорам с полным обеспечением с ЦК и клирингового пула по Договорам с полным обеспечением без ЦК. Порядок исполнения / прекращения обязательств, допущенных к клирингу	98
Статья 35. Порядок формирования клирингового пула для расчетов по итогам Торгов.....	100
Статья 36. Задолженность по денежному регистру.....	101
Статья 37. Порядок передачи Доходов по Договорам репо, Внебиржевым договорам репо ОТС, Парам договоров, Договорам купли-продажи облигаций, Договорам ПФИ	102
Статья 38. Порядок исполнения обязательств по Договорам ПФИ.....	107
Статья 39. Случаи и порядок заключения Договоров купли-продажи с ЦК без подачи заявок.....	109
РАЗДЕЛ VII. ПОРЯДОК И СПОСОБЫ ВЗАИМОДЕЙСТВИЯ КЦ, УЧАСТНИКОВ КЛИРИНГА, РАСЧЕТНОЙ ОРГАНИЗАЦИИ, РАСЧЕТНОГО ДЕПОЗИТАРИЯ, ОРГАНИЗАТОРА ТОРГОВЛИ. ОТЧЕТЫ КЦ.....	110
Статья 40. Порядок взаимодействия КЦ с Расчетной организацией, Расчетным депозитарием	110
Статья 41. Порядок взаимодействия КЦ с Организатором торговли	111
Статья 42. Способы получения и передачи документов при взаимодействии КЦ с Участниками клиринга, Организатором торговли, Расчетным депозитарием и Расчетной организацией	111
Статья 43. Отчеты КЦ и иная информация, предоставляемая Участникам клиринга	113
РАЗДЕЛ VIII. ПРОЧИЕ УСЛОВИЯ.....	113
Статья 44. Порядок действия КЦ при операциях с ценными бумагами вследствие корпоративных событий	113
Статья 45. Порядок перевода обязательств и передачи имущества Обособленного клиента.....	115
Статья 46. Взаимодействие КЦ и Участников клиринга при исполнении налоговых обязательств по Доходам, полученным по Ценным бумагам эмитентов США и Ценным бумагам эмитентов ФРГ	117
Статья 47. Хранение и учет документов и информации внутреннего учета	117
Статья 48. Порядок урегулирования неисполненных обязательств в случае прекращения клирингового обслуживания	118
Приложение № 1 к Правилам осуществления клиринговой деятельности на рынке ценных бумаг и на рынке производных финансовых инструментов	124
Приложение № 2 к Правилам осуществления клиринговой деятельности на рынке ценных бумаг и на рынке производных финансовых инструментов	134

РАЗДЕЛ I. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ

Статья 1. Термины и определения

Акцепт ОТС – согласие КЦ на заключение с Участником клиринга Внебиржевого договора ОТС или Пары внебиржевых договоров ОТС на условиях, указанных в Оферте ОТС.

Аналог собственноручной подписи/АСП – реквизит электронного сообщения, направляемого с использованием Клиринговой системы, позволяющий идентифицировать лицо, направившее указанное электронное сообщение, и подтверждающий целостность и неизменность электронных документов за счет использования специализированных программно-технических средств и организационных мероприятий. Аналогом собственноручной подписи признаются Имя и Пароль.

Бенефициар дохода – КЦ, Участник клиринга, клиент Участника клиринга или клиент Посредника (Субклиент Участника клиринга), ценные бумаги которого учитываются на Счете депо или Счете депо номинального держателя, имеющий фактическое право на получение Дохода по таким ценным бумагам, являющийся непосредственным выгодоприобретателем такого Дохода, то есть лицом, которое фактически получает выгоду от выплачиваемого Дохода и определяет его дальнейшую экономическую судьбу.

Валюта Доступных средств – российские рубли или иностранная валюта, указанные Участником клиринга для расчета Доступных средств.

Валюта обязательства – валюта, в которой определяются обязательства Участника клиринга по уплате денежных средств, возникающие в связи с заключением Договора.

Валюта требования – валюта, в которой определяются права требования Участника клиринга по денежным средствам, возникающие в связи заключением Договора.

Вариационная маржа – сумма денежных средств, которая по условиям Договора ПФИ подлежит уплате одной из сторон указанного договора другой его стороне периодически в зависимости от изменения цен (значений) базисного актива указанного договора.

Внебиржевой договор – Внебиржевой договор купли-продажи или Внебиржевой договор репо.

Внебиржевой договор купли-продажи – договор купли-продажи ценных бумаг или иностранной валюты, заключаемый не на Торгах, за исключением Внебиржевого договора купли-продажи ОТС.

Внебиржевой договор репо – договор репо, заключаемый не на Торгах, за исключением Внебиржевого договора репо ОТС.

Внебиржевой договор ОТС – Внебиржевой договор купли-продажи ОТС или Внебиржевой договор репо ОТС.

Внебиржевой договор купли-продажи ОТС – договор купли-продажи ценных бумаг, заключаемый с КЦ не на Торгах в порядке и на условиях, определенных настоящими Правилами.

Внебиржевой договор репо ОТС – договор репо, заключаемый с КЦ не на Торгах в порядке и на условиях, определенных настоящими Правилами.

Выделенный капитал – рассчитанная в соответствии с Методикой определения выделенного капитала центрального контрагента и установленная решением КЦ величина собственных средств КЦ, предназначенная для покрытия возможных потерь, вызванных ненадлежащим исполнением или неисполнением Участниками клиринга перед КЦ своих обязательств, допущенных к клирингу, и используемая КЦ до использования средств, внесенных добросовестными Участниками клиринга в Гарантийный фонд.

Гарант – лицо, осуществляющее на основании договора, заключенного с КЦ, добровольные взносы в формируемый КЦ специальный Гарантийный фонд.

Гарантийное обеспечение – величина, выраженная в Валюте Доступных средств, используемая для оценки достаточности Средств обеспечения Участников клиринга и рассчитываемая в соответствии с Методикой расчета гарантийного обеспечения. Размер Гарантийного обеспечения определяется на основании оценки КЦ риска неисполнения обязательств, допущенных к клирингу, учитываемых на регистрах учета позиций (портфельная оценка риска), с использованием риск-параметров, рассчитанных в соответствии с Методикой установления и изменения риск-параметров.

Гарантийный фонд – коллективное клиринговое обеспечение, формируемое КЦ за счет взносов всех Участников клиринга и (или) иных лиц, указанных в настоящих Правилах.

Депозитарий – организация, на имя которой в Расчетном депозитарии открыт Субсчет депо номинального держателя или иностранного номинального держателя, которая осуществляет учет прав на ценные бумаги Участника клиринга, клиентов и (или) Субклиентов Участника клиринга.

Дивидендный эквивалент - денежные средства или иное имущество, которые подлежат передаче по Договорам репо или Договорам ПФИ и величина которых прямо или косвенно зависит от суммы Дохода.

Договор – Договор купли-продажи, или Договор репо, или Договор ПФИ, или Донорский договор.

Договор купли-продажи - договор купли-продажи ценных бумаг, заключаемый на Торгах в соответствии с Правилами торговли и настоящими Правилами.

Договор репо - договор репо, заключаемый на Торгах в соответствии с Правилами торговли и настоящими Правилами.

Договор ПФИ – расчетный фьючерсный договор, или расчетный форвардный договор, или расчетный опционный договор, являющийся производным финансовым инструментом и заключаемый на Торгах в соответствии с Правилами торговли.

Донорский договор - Донорский договор купли-продажи или Донорский договор репо.

Донорский договор купли-продажи - Пара договоров, заключаемая в случаях и в порядке, указанных в статье 31 настоящих Правил.

Донорский договор репо - Договор репо или Внебиржевой договор репо ОТС, заключаемый в случаях и в порядке, указанных в статье 31 настоящих Правил.

Дополнительное обеспечение - величина, выраженная в Валюте Доступных средств, используемая для оценки достаточности Средств обеспечения Участников клиринга, а также иных источников финансового покрытия рисков КЦ, и рассчитываемая в соответствии с Методикой расчета гарантийного обеспечения. Размер Дополнительного обеспечения определяется на основании оценки КЦ риска неисполнения обязательств, допущенных к клирингу, учитываемых на регистрах учета позиций (портфельная оценка риска), в случае стрессовых сценариев с использованием риск-параметров, рассчитанных в соответствии с Методикой установления и изменения риск-параметров.

Доступные средства - сумма, выраженная в Валюте Доступных средств, рассчитываемая КЦ, используемая для ограничения рисков Участника клиринга в соответствии со статьей 19 настоящих Правил.

Доход - денежные средства и (или) иное имущество, в том числе в виде дивидендов и процентов, причитающиеся лицу, осуществляющему права по ценным бумагам.

Задолженность – требование КЦ к Участнику клиринга в объеме равном объему неисполненного Маржинального требования.

Имя – пользовательское имя (логин), представляющее собой уникальное условное обозначение, однозначно определяющее Участника клиринга/КЦ, присвоенное

Участнику клиринга/КЦ в целях осуществления операций в Клиринговой системе/Системе.

Квалифицированный дилер деривативов (Qualified Derivatives Dealer, QDD) – Квалифицированный посредник, заключивший соглашение с налоговой службой США, в соответствии с которым такой посредник вправе предоставлять Бенефициарам дохода налоговые льготы в отношении Дивидендных эквивалентов по Ценным бумагам эмитентов США, являющихся предметом Договора репо или базисным активом Договора ПФИ, в соответствии с соглашением об избежании двойного налогообложения, заключенным между Россией и США (при условии, что вышестоящий по отношению к такому посреднику Квалифицированный посредник оказывает услуги по предоставлению налоговых льгот), а также осуществлять сбор и хранение подтверждающих документов о Бенефициарах дохода как основание для возможного получения налоговых льгот.

Квалифицированный посредник – (Qualified Intermediary, QI) – Посредник, заключивший соглашение с Налоговой службой США, в соответствии с которым такой Посредник вправе предоставлять Бенефициарам дохода льготы по соглашению об избежании двойного налогообложения, заключенному между Россией и США (при условии, что вышестоящий по отношению к такому Посреднику QI оказывает услуги по предоставлению налоговых льгот), а также осуществлять сбор и хранение подтверждающих документов о Бенефициарах дохода как основание для возможного получения налоговых льгот и передавать в агрегированном виде информацию вышестоящему удерживающему Налоговому агенту для фактического удержания налога в соответствии со статусом Бенефициара дохода.

Клиринговая система – совокупность вычислительных средств, программного обеспечения, баз данных, телекоммуникационных средств и другого оборудования, используемых КЦ для осуществления клиринговой деятельности.

Клиринговый денежный счет - клиринговый банковский счет, открытый КЦ в Расчетной организации, на который зачисляются денежные средства в российских рублях или иностранной валюте, которые могут быть использованы для исполнения и (или) обеспечения исполнения обязательств Участников клиринга, допущенных к клирингу.

Клиринговый счет депо - клиринговый счет депо, открытый КЦ в Расчетном депозитарии, на котором могут учитываться ценные бумаги Участников клиринга, клиентов или Субклиентов Участников клиринга, КЦ, которые могут быть использованы для исполнения и (или) обеспечения исполнения обязательств, допущенных к клирингу.

Клиринговый счет – Клиринговый денежный счет или Клиринговый счет депо.

Критически важные процессы – процессы / операции КЦ, приостановление или прекращение которых влечет за собой нарушение нормального осуществления деятельности КЦ, его контрагентов и (или) Участников клиринга.

КЦ – Небанковская кредитная организация - центральный контрагент «Клиринговый центр МФБ» (акционерное общество).

Лимит по риску концентрации на эмитента – величина, определяемая КЦ в соответствии с Методикой установления и изменения риск-параметров в целях контроля за риском концентрации на эмитента (группу ценных бумаг одного эмитента).

Маржинальное требование - требование КЦ к Участнику клиринга об обеспечении исполнения и исполнении обязательств, предъявляемое в порядке и случаях, определенных настоящими Правилами.

Методика расчета гарантийного обеспечения - внутренний документ КЦ, утверждаемый единоличным исполнительным органом КЦ, раскрываемый на Сайте КЦ и устанавливающий порядок определения Гарантийного обеспечения и Дополнительного обеспечения.

Методика установления и изменения риск-параметров – внутренний документ КЦ, утверждаемый единоличным исполнительным органом КЦ, раскрываемый на Сайте КЦ и устанавливающий порядок определения риск-параметров и правила определения

стоимости имущества, принимаемого в индивидуальное клиринговое обеспечение и коллективное клиринговое обеспечение.

Налоговый агент – лицо, на которое в соответствии с применимым российским и (или) иностранным законодательством возложены обязанности по исчислению налогов, их удержанию у налогоплательщика и их уплате.

Организатор торговли – юридическое лицо, которое оказывает услуги по проведению организованных торгов и информация о котором раскрыта на Сайте КЦ.

Оферта ОТС – предложение Участника клиринга КЦ, направленное на заключение Внебиржевого договора ОТС или Пары внебиржевых договоров ОТС, содержащее условия указанного договора (договоров) и иную информацию, предусмотренную настоящими Правилами.

Пара договоров - два Договора купли-продажи (далее - Пара биржевых договоров) или два Внебиржевых договора купли-продажи ОТС (далее - Пара внебиржевых договоров ОТС), которые соответствуют одновременно следующим условиям:

- оба договора заключаются одновременно между одними и теми же лицами;
- дата исполнения одного договора определяется как T+k (далее - Первый договор), а дата другого договора определяется как T+n (далее - Второй договор), где T - дата заключения Пары договоров, а k и n - число Расчетных дней, определяемое решением КЦ, причем значение «k» не должно превышать значение «n»;
- по Первому договору одна сторона обязуется приобрести у другой стороны (обязуется передать другой стороне) определенное количество ценных бумаг, а по Второму договору она обязуется передать другой стороне (обязуется приобрести у другой стороны) те же ценные бумаги в том же количестве;
- количество ценных бумаг, являющихся предметом обоих договоров, определяется в соответствии с настоящими Правилами;
- по Первому договору и по Второму договору оплата ценных бумаг должна осуществляться в одной и той же валюте;
- цена Второго договора определяется исходя из цены Первого договора и Ставки репо;
- по Второму договору сторона, являющаяся продавцом, обязана передать Доход стороне, являющейся покупателем.

Пароль – последовательность букв, и (или) цифр, и (или) иных символов, используемая для аутентификации Участника клиринга / КЦ в целях осуществления операций в Клиринговой системе / Системе.

Перечень ценных бумаг - перечень ценных бумаг, которые могут вноситься в качестве Средств обеспечения.

Поручение на клиринг внебиржевых договоров - поручение Участника клиринга, направляемое в КЦ с целью осуществления клиринга Внебиржевых договоров и регистрации в Системе параметров Внебиржевого договора.

Правила - настоящие Правила осуществления клиринговой деятельности на рынке ценных бумаг и на рынке производных финансовых инструментов.

Правила торговли – внутренний документ (внутренние документы) Организатора торговли, в котором (которых) установлен порядок оказания услуг по проведению организованных торгов ценными бумагами и организованных торгов, на которых заключаются договоры, являющиеся ПФИ.

Покупатель - сторона Договора ПФИ, которая является управомоченным лицом по опционному договору или которой причитается Вариационная маржа в случае увеличения цены (значения) базисного актива указанного договора.

Посредник – финансовый институт в соответствии с Законом США «О налогообложении иностранных счетов» (Foreign Account Tax Act, FATCA), в том числе участвующий в последовательности учета прав на Ценные бумаги эмитентов США,

являющийся Участником клиринга, клиентом Участника клиринга или Депозитарием, ценные бумаги клиентов которого учитываются на Счете депо номинального держателя или на Субсчете депо.

Премия - сумма денежных средств, которая в соответствии с условиями Договора ПФИ, являющегося опционным договором, подлежит уплате Покупателем Продавцу при заключении указанного договора.

Продавец - сторона Договора ПФИ, которая является обязанным лицом по опционному договору или которой причитается Вариационная маржа в случае уменьшения цены (значения) базисного актива указанного договора.

ПФИ – производный финансовый инструмент, определенный в соответствии с законодательством Российской Федерации.

Расчетный день – период времени, в течение которого КЦ оказывает клиринговые услуги в соответствии с настоящими Правилами.

Расчетная организация – кредитная организация, которая осуществляет денежные расчеты в связи с осуществлением КЦ клиринговой деятельности и информация о которой раскрыта на Сайте КЦ.

Расчетный депозитарий – юридическое лицо, осуществляющее депозитарную деятельность на основании лицензии профессионального участника рынка ценных бумаг на осуществление депозитарной деятельности, которое на основании договора с КЦ осуществляет операции, связанные с исполнением обязательств по передаче ценных бумаг по итогам клиринга и информация о котором раскрыта на Сайте КЦ.

Регистрационный код – уникальный код Участника клиринга, клиента или Субклиента Участника клиринга, присваиваемый КЦ в соответствии с требованиями Федерального закона «О клиринге, клиринговой деятельности и центральном контрагенте» и принятых в соответствии с ним нормативных актов.

Регламент клиринга – регламент осуществления КЦ клиринговой деятельности на рынке ценных бумаг и на рынке производных финансовых инструментов, являющийся внутренним документом КЦ, утверждаемый единоличным исполнительным органом КЦ, раскрываемый на Сайте КЦ, и устанавливающий расписание Расчетного дня КЦ (включая время проведения операций, осуществляемых в соответствии с настоящими Правилами), сроки направления в КЦ и получения от КЦ документов в процессе взаимодействия с Участниками клиринга в соответствии с настоящими Правилами, формы / форматы документов, используемых в документообороте между Участниками клиринга и КЦ, а также иные положения, за исключением тех положений, которые в соответствии с требованиями Федерального закона «О клиринге, клиринговой деятельности и центральном контрагенте» и принятых в соответствии с ним нормативных актов должны содержаться в настоящих Правилах.

Сайт КЦ – сайт в сети Интернет по адресу www.mse.ru, на котором осуществляется раскрытие информации.

Система – совокупность вычислительных средств, программного обеспечения, баз данных, телекоммуникационных средств и другого оборудования, предназначенная для обмена электронными сообщениями между Участниками клиринга и КЦ в соответствии с настоящими Правилами, в том числе Офертами ОТС, связанными Офертами ОТС, Акцептами ОТС и Поручениями на клиринг внебиржевых договоров.

Система электронного документооборота – организационно-техническая система технического центра, определенного КЦ, информация о котором раскрыта на Сайте КЦ, представляющая собой совокупность программного обеспечения, баз данных и вычислительных средств, обеспечивающая обмен Электронными документами, подписанными Электронной подписью.

Список обязательств – список предметов обязательств из договоров, заключённых не на Торгах, в отношении которых КЦ оказывает клиринговые услуги. Список обязательств составляется КЦ и подлежит раскрытию на Сайте КЦ.

Список ПФИ – перечень производных финансовых инструментов, клиринг которых осуществляет КЦ.

Список ценных бумаг - перечень ценных бумаг, являющихся предметом обязательств из Договоров купли-продажи, Договоров репо, Внебиржевых договоров и Внебиржевых договоров ОТС, клиринг которых осуществляет КЦ.

Средства обеспечения - имущество, являющееся предметом индивидуального клирингового обеспечения, которое может быть использовано для обеспечения и (или) исполнения обязательств Участника клиринга по Договорам, Внебиржевым договорам, Внебиржевым договорам ОТС.

Ставка репо – величина, выраженная в процентах годовых и используемая для расчета цены второй части Договора репо (второй части Внебиржевого договора репо ОТС, Второго договора, составляющего Пару договоров), или суммы второй части Договора репо (второй части Внебиржевого договора репо ОТС, Второго договора, составляющего Пару договоров).

Субсчет депо - составная часть Клирингового счета депо, открываемая Расчетным депозитарием Участнику клиринга, клиенту или Субклиенту Участника клиринга, Депозитарию с согласия КЦ и предназначенная для учета прав на ценные бумаги и проведения расчетов по ценным бумагам по итогам клиринга обязательств из Договоров (кроме Договоров ПФИ) и Внебиржевых договоров ОТС на основании распоряжений КЦ.

Субклиент – клиент клиента Участника клиринга.

Счет депо – счет депо владельца или счет депо доверительного управляющего, открытый у Участника клиринга, клиента Участника клиринга или в Депозитарии, предназначенный для учета прав на ценные бумаги, принадлежащие Участнику клиринга, клиенту или Субклиенту Участника клиринга.

Счет депо номинального держателя - счет депо номинального держателя, открытый у Участника клиринга или в Депозитарии, предназначенный для учета прав на ценные бумаги, принадлежащие клиенту или Субклиенту Участника клиринга.

Торги – организованные торги ценными бумагами и организованные торги, на которых заключаются договоры, являющиеся ПФИ, проводимые Организатором торговли в соответствии с требованиями Правил торговли и настоящих Правил.

ТКС (Торгово-клиринговый счет) - группа клиринговых регистров, предназначенных для учета объектов внутреннего учета КЦ, объединяемая во внутреннем учете КЦ общим признаком и устанавливающая однозначное соответствие между определенной позицией по ценным бумагам и определенной позицией по денежным средствам.

Участник клиринга - юридическое лицо, с которым у КЦ заключен и действует договор об оказании клиринговых услуг.

Ценные бумаги эмитентов США – ценные бумаги, Доходы по которым подлежат налогообложению в США в соответствии с главами 3 и 4 Налогового кодекса США и права на которые учитываются или могут учитываться на Субсчетах депо.

Ценные бумаги эмитентов ФРГ - ценные бумаги, Доходы по которым подлежат налогообложению в ФРГ в соответствии с Налоговым кодексом ФРГ и права на которые учитываются или могут учитываться на Субсчетах депо.

Чрезвычайная ситуация - обстоятельства, которые по оценке КЦ нарушили, нарушают или могут нарушить надлежащее оказание услуг Участникам клиринга в соответствии с настоящими Правилами.

Электронный документ – электронный документ в значении, установленном Федеральным законом «Об информации, информационных технологиях и о защите информации».

Электронная подпись – электронная подпись в значении, установленном Федеральным законом «Об электронной подписи».

Термины, специально не определенные в настоящих Правилах, используются в значениях, установленных Правилами торговли и (или) Федеральным законом «О клиринге, клиринговой деятельности и центральном контрагенте» и принятыми в соответствии с ним нормативными актами.

Статья 2. Общие положения

2.1. Настоящие Правила разработаны в соответствии с уставом и другими внутренними документами КЦ, а также в соответствии с Федеральным законом «О клиринге, клиринговой деятельности и центральном контрагенте» и принятыми в соответствии с ним нормативными актами.

2.2. Настоящие Правила устанавливают порядок оказания КЦ клиринговых услуг Участникам клиринга и определяют условия договора об оказании клиринговых услуг, заключаемого КЦ с Участниками клиринга.

2.3. Договор об оказании клиринговых услуг заключается и вступает в силу в порядке, определенном статьями 11 настоящих Правил.

2.4. КЦ вправе в одностороннем порядке вносить изменения в настоящие Правила. Изменения в настоящие Правила вступают в силу по истечении 5 (пяти) дней, а в части установления или изменения положений об ограничении размера ответственности лица, осуществляющего функции центрального контрагента, изменений, связанных с исключением из настоящих Правил положений третейского соглашения или изменением третейского суда - по истечении 3 (трех) месяцев после раскрытия информации об этом в соответствии со статьями 19 Федерального закона «О клиринге, клиринговой деятельности и центральном контрагенте», если больший срок не установлен КЦ в соответствии с указанным Федеральным законом.

Изменения в настоящие Правила соответствующим образом изменяют условия всех ранее заключенных договоров об оказании клиринговых услуг, если иное не установлено решением КЦ.

2.5. Договор об оказании клиринговых услуг прекращается по соглашению сторон, а также в иных случаях, предусмотренных законодательством Российской Федерации и настоящими Правилами, в том числе в результате отказа Участника клиринга или КЦ от его исполнения.

Прекращение договора об оказании клиринговых услуг влечет прекращение всех обязательств, за исключением обязательств по возврату имущества, составляющего Средства обеспечения и взнос в Гарантийный фонд, и иных обязательств в соответствии с настоящими Правилами, возникших и не исполненных до даты прекращения договора об оказании клиринговых услуг.

2.6. Любой спор, разногласие или претензию, вытекающие из настоящих Правил или в связи с ними, в том числе касающиеся исполнения, нарушения, прекращения или недействительности договора об оказании клиринговых услуг или договора с Гарантом о внесении взносов в специальный Гарантийный фонд (далее в настоящем пункте - Спор), стороны будут пытаться разрешить путем переговоров в претензионном (досудебном) порядке.

Если стороны не приходят к соглашению (Спор не был разрешен путем переговоров) в течение 30 (тридцати) дней после направления какой-либо стороной другой стороне первого письма с описанием возникшего спора, то такой спор подлежит передаче на рассмотрение в Арбитражный суд города Москвы.

Статья 3. Порядок проведения клиринга

3.1. КЦ устанавливает требования к порядку, размеру и срокам предоставления индивидуального клирингового обеспечения, осуществляет контроль достаточности предоставленного индивидуального клирингового обеспечения в целях подачи Заявок на заключение Договоров, заключения Внебиржевых договоров ОТС и приема Поручений на

клиринг внебиржевых договоров к исполнению в порядке, предусмотренном настоящими Правилами. КЦ контролирует достаточность предоставленного индивидуального клирингового обеспечения для проведения расчетов по денежным средствам и ценным бумагам в порядке и сроки, установленные настоящими Правилами.

3.2. По обязательствам, возникшим из Договоров купли-продажи и Договоров репо, в которых указан Код расчетов Тп, Код расчетов ТкТп и Код расчетов Y0, а также по обязательствам, возникшим из Договоров ПФИ, КЦ осуществляет клиринг с участием центрального контрагента.

По обязательствам, возникшим из Договоров купли-продажи и Договоров репо, в которых указан Код расчетов X0, Код расчетов U0, Код расчетов W0, Код расчетов Оп и Код расчетов OkOn, КЦ осуществляет клиринг без участия центрального контрагента.

По обязательствам, возникшим из Внебиржевых договоров КЦ осуществляет клиринг без участия центрального контрагента.

По обязательствам, возникшим из Внебиржевых договоров ОТС, КЦ осуществляет клиринг с участием центрального контрагента.

3.3. При осуществлении клиринга с участием центрального контрагента функции центрального контрагента осуществляет КЦ.

3.4. КЦ оказывает клиринговые услуги каждый рабочий день. КЦ вправе оказывать клиринговые услуги в иные дни. КЦ вправе принять решение о неоказании клиринговых услуг в любой из указанных дней. КЦ вправе принять решение об ограничении поведения отдельных операций в определенный день.

КЦ оказывает клиринговые услуги в течение Расчетных дней. Время начала и время окончания Расчетного дня устанавливается Регламентом клиринга.

Информация об оказании клиринговых услуг или о неоказании клиринговых услуг раскрывается КЦ в Системе и (или) на Сайте КЦ не менее чем за 1 (один) рабочий день до установленного времени.

Раскрытие информации в Системе и (или) на Сайте КЦ считается надлежащими способами информирования Участников клиринга.

3.5. Расчеты по денежным средствам и ценным бумагам в связи с исполнением Договоров, за исключением исполнения обязательств по уплате Премии и Вариационной маржи по Договорам ПФИ, проводятся в Даты исполнения Договоров.

Расчеты по денежным средствам в связи с исполнением обязательств по уплате Премии и Вариационной маржи по Договорам ПФИ проводятся в даты, установленные в соответствии со спецификацией соответствующего Договора ПФИ (далее – Дата расчетов).

Расчеты по денежным средствам и ценным бумагам в связи с исполнением Внебиржевых договоров ОТС проводятся в даты исполнения, определенные условиями указанных договоров.

Расчеты по Внебиржевым договорам проводятся Участниками клиринга в даты исполнения и в порядке, определённые условиями указанных договоров.

3.6. Клиринг обязательств, возникших из Договоров, осуществляется на основании документов от Организатора торговли, без получения от Участников клиринга подтверждений о заключении Договоров. КЦ не осуществляет клиринг по Договорам, заключённым на Торгах, с нарушением требований, установленных настоящими Правилами. КЦ не осуществляет клиринг по Договорам на основании документов от Организатора торговли, в случае нарушения требований к составу и (или) формам представления информации, содержащейся в указанных документах, установленных договором, заключённым между КЦ и Организатором торговли.

Клиринг обязательств, возникших из Внебиржевых договоров, осуществляется на основании Поручений на клиринг внебиржевых договоров.

Клиринг обязательств, возникших из Внебиржевых договоров ОТС, осуществляется на основании информации о заключении указанных договоров, формируемой в Системе.

3.7. КЦ осуществляет клиринг по Договорам, Внебиржевым договорам, Внебиржевым договорам ОТС, заключённым с расчётами в валюте Российской Федерации и иностранной валюте.

3.8. КЦ контролирует наличие ценных бумаг на Субсчетах депо и денежных средств на денежных регистрах, которые необходимы для расчетов по обязательствам, допущенным к клирингу.

3.9. КЦ осуществляет учет на клиринговых регистрах обязательств Участников клиринга из Договоров, Внебиржевых договоров, Внебиржевых договоров ОТС, учет информации о ценных бумагах и денежных средствах, являющихся предметом индивидуального клирингового обеспечения, учет информации о ценных бумагах и денежных средствах, предназначенных для исполнения обязательств Участников клиринга из Договоров, Внебиржевых договоров, Внебиржевых договоров ОТС.

3.10. КЦ осуществляет клиринг обязательств из Договоров, заключенных в отношении ценных бумаг, включенных в Список ценных бумаг. Порядок и условия формирования и изменения указанного списка определяются в договоре, заключенном между КЦ и Организатором торговли.

КЦ осуществляет клиринг обязательств из договоров, заключенных не на Торгах, при условии, что предмет таких договоров включен в Список обязательств.

3.11. КЦ вправе в целях заключения Договоров и Внебиржевых договоров ОТС и исполнения итоговых нетто-требований, определенных по итогам клиринга обязательств из указанных договоров, приобретать и отчуждать ценные бумаги в результате совершения сделок на организованных торгах, проводимых иностранными биржами, или, если ценные бумаги не допущены к указанным торгам, в результате совершения внебиржевых сделок. При этом КЦ обязуется приложить разумные усилия в достижении равенства цен, по которым совершаются указанные сделки, и цен, по которым заключаются Договоры и Внебиржевые договоры ОТС.

КЦ вправе в случаях неисполнения или ненадлежащего исполнения Участником клиринга обязательств, допущенных к клирингу, заключать Договоры без подачи Заявок на Торгах, а также вправе заключать Договоры и Внебиржевые договоры ОТС в отношении себя лично от имени Участника клиринга, определенного КЦ, без специального полномочия (доверенности), а также без согласия Участника клиринга.

Статья 4. Взаимодействие КЦ с Организатором торговли, Расчетной организацией, Расчетным депозитарием и техническим центром

4.1. Перечень Организаторов торговли, технических центров, Расчетных организаций и Расчетных депозитариев, взаимодействие с которыми осуществляет КЦ, указан на Сайте КЦ.

4.2. Порядок взаимодействия КЦ с Расчетной организацией, Расчетным депозитарием, Организатором торговли, техническим центром, в том числе, перечень документов, которыми обмениваются КЦ и указанные организации в процессе взаимодействия при осуществлении клиринга и расчетов по итогам клиринга, реквизиты и форматы указанных документов, способы и сроки их предоставления, определяются настоящими Правилами и договорами, заключенными между КЦ и указанными организациями.

4.3. В случае возникновения обстоятельств, вызывающих и (или) создающих предпосылки к возникновению сбоев (отказов) при эксплуатации Системы / Клиринговой системы и (или) непосредственно препятствующих ее нормальному (штатному) функционированию, в том числе, обстоятельств непреодолимой силы, сбоев,

неисправностей и отказов оборудования; сбоев и ошибок программного обеспечения; сбоев, неисправностей и отказов систем связи, энергоснабжения, кондиционирования и других систем жизнеобеспечения, а также иных обстоятельств, таких как случаи нарушения правил разграничения доступа и (или) попыток несанкционированного доступа к Системе / Клиринговой системе, КЦ незамедлительно уведомляет об этом Организатора торговли, Расчетную организацию, Расчетный депозитарий и (или) технический центр любым из доступных средств связи и предпринимает все возможные меры, направленные на устранение указанных обстоятельств.

4.4. При возникновении Чрезвычайных ситуаций КЦ руководствуется внутренним документом, устанавливающим меры, предпринимаемые КЦ в случае возникновения Чрезвычайных ситуаций и направленные на обеспечение непрерывности осуществления клиринговой деятельности.

4.5. КЦ имеющимися доступными средствами связи незамедлительно уведомляет Участников клиринга, Организатора торговли, Расчетную организацию, Расчетный депозитарий и технический центр о возникновении Чрезвычайной ситуации и предпринимает все возможные меры для ее устранения. При этом КЦ использует один или несколько из следующих способов направления уведомлений:

- посредством размещения информации о возникновении Чрезвычайной ситуации на Сайте КЦ;

- посредством всех имеющихся средств связи, в том числе Системы, направляя информацию по адресам электронной почты, указанным в «Анкете (досье) клиента – юридического лица, траста, или иной иностранной структуры без образования юридического лица» (далее также Анкета Заявителя), и (или) иным доступным способом.

КЦ может быть принято решение о дополнительном информировании Участников клиринга по телефонам, указанным в Анкете Заявителя.

4.6. В течение дня возникновения Чрезвычайной ситуации КЦ предпринимает все возможные меры, направленные на устранение возникшей Чрезвычайной ситуации

Статья 5. Общие правила использования информации

5.1. Настоящей статьей устанавливаются общие положения, касающиеся обеспечения конфиденциальности информации, которая стала известна КЦ в связи оказанием клиринговых услуг, в том числе была предоставлена КЦ Участниками клиринга, Расчетной организацией, Расчетным депозитарием, Организатором торговли и (или) техническим центром.

5.2. К указанной информации относится, в частности, информация об обязательствах, в отношении которых проводится клиринг, информация, предоставляемая Участниками клиринга в соответствии со статьей 12 настоящих Правил, информация о Субсчетах депо, об операциях по указанным Субсчетам и об операциях с денежными средствами по денежным регистрам, которая стала известна в связи с оказанием услуг КЦ (далее в настоящей статье - Информация).

5.3. Участник клиринга, заключая договор об оказании клиринговых услуг, соглашается с тем, что Информация может быть предоставлена Расчетной организации, Расчетному депозитарию, техническому центру и (или) Организатору торговли.

5.4. Информация предоставляется КЦ в Банк России по его запросу, соответствующему требованиям Федерального закона «О клиринге, клиринговой деятельности и центральном контрагенте».

5.5. Информация может быть предоставлена КЦ судам и арбитражным судам (судьям), а при наличии согласия руководителя следственного органа - органам предварительного следствия по делам, находящимся в их производстве, а также органам внутренних дел при осуществлении ими функций по выявлению, предупреждению и пресечению налоговых преступлений при наличии согласия руководителя указанных органов.

5.6. Наличие у КЦ Информации является необходимым условием осуществления клиринга.

Статья 6. Клиринговые регистры

6.1. При осуществлении клиринговой деятельности КЦ ведет клиринговые регистры Участников клиринга и Гарантов. Ведение клиринговых регистров осуществляется в Клиринговой системе. КЦ открывает и ведет, включая, но не ограничиваясь, следующие клиринговые регистры:

- депо регистры, на которых учитываются позиции по ценным бумагам. Применительно к депо регистрам позицией по ценным бумагам является количество ценных бумаг на Субсчете депо Участника клиринга, учтенное КЦ в качестве Средств обеспечения;

- денежные регистры (в российских рублях или иностранной валюте), на которых учитываются позиции по денежным средствам в российских рублях или иностранной валюте. Применительно к денежным регистрам, позицией по денежным средствам является сумма денежных средств (в российских рублях или в иностранной валюте), учтенная КЦ в качестве Средств обеспечения;

- регистры учета позиций, на которых учитываются допущенные к клирингу обязательства и требования Участника клиринга;

- регистры учета обеспечения, на которых учитываются требования КЦ к обеспечению обязательств Участника клиринга;

- регистры учета средств Гарантийных фондов, на которых учитывается взносы в Гарантийные фонды.

6.2. На клиринговых регистрах КЦ учитывает следующие объекты внутреннего учета (далее – Объекты учета):

- позиции Участника клиринга по ценным бумагам, составляющим Средства обеспечения / средства Гарантийного фонда, за исключением позиций Участника клиринга, являющегося Участником торгов и выполняющего в интересах и за счет эмитента функции продавца при размещении ценных бумаг (далее - Участник клиринга-Продавец) по размещаемым ценным бумагам. Указанные позиции учитываются на депо регистрах. Позиция по ценным бумагам рассчитывается для каждого Субсчета депо и по каждому идентификационному коду / коду ценных бумаг на основании информации об остатках ценных бумаг на Субсчетах депо, полученной от Расчетного депозитария;

- позиции Участника клиринга-Продавца по размещаемым ценным бумагам. Указанные позиции учитываются на депо регистрах. Позиция по ценным бумагам в указанном случае рассчитывается исходя из остатка ценных бумаг, подлежащих размещению, в соответствии с Договорами, в которых указан Код расчетов Х0;

- позиции Участника клиринга по денежным средствам, составляющим Средства обеспечения / средства Гарантийных фондов. Указанные позиции учитываются по видам валют, учет которых осуществляется на денежных регистрах;

- обязанности и требования Участников клиринга по каждому допущенному к клирингу обязательству из Договора. Указанные обязанности и требования учитываются на регистрах учета позиций;

- обязанности и требования Участников клиринга по каждому допущенному к клирингу обязательству из Внебиржевого договора. Указанные обязанности и требования учитываются на регистрах учета позиций;

- обязанности и требования Участников клиринга по каждому допущенному к клирингу обязательству из Внебиржевого договора ОТС. Указанные обязанности и требования учитываются на регистрах учета позиций;

- позиции по Договорам ПФИ Участника клиринга. Указанные позиции определяются в соответствии с пунктом 6.4. настоящих Правил и учитываются на регистрах учета позиций;

- нетто-обязательства / нетто-требования Участников клиринга по денежным средствам / ценным бумагам из Договоров Внебиржевых договоров / Внебиржевых договоров ОТС в разрезе денежных регистров/ связанных с ним депо регистров, Дат исполнения / дат исполнения, определенных в соответствии с указанными договорами, Дат расчетов по Договорам ПФИ, валют / идентификационных кодов ценных бумаг / кодов ценных бумаг/ идентификационных кодов ПФИ. Указанные нетто-обязательства и нетто-требования учитываются на регистрах учета позиций;

- итоговые нетто-обязательства / итоговые нетто-требования Участников клиринга по обязательствам, включенным в состав клирингового пула по Внутриброкерским договорам, в которых указан Код расчетов TkTn и которые заключены на основании Заявок, в которых указаны одинаковые ТКС (далее - Внутриброкерские договоры) и по Внебиржевым договорам ОТС, в которых Идентификатор Участника клиринга, указанный в Оферте ОТС, совпадает с Идентификатором Участника клиринга, направившим связанную Оферту ОТС, и в которых указаны одинаковые ТКС (далее - Внутриброкерские Внебиржевые договоры ОТС), в разрезе денежных регистров / связанных с ним депо регистров / валют / идентификационных кодов ценных бумаг/кодов ценных бумаг. Указанные нетто-обязательства и нетто-требования учитываются на регистрах учета позиций;

- итоговые нетто-обязательства / итоговые нетто-требования Участников клиринга по обязательствам, включенным в состав клирингового пула по Договорам размещения и выкупа ценных бумаг, в разрезе денежных регистров / связанных с ним депо регистров/ валют / идентификационных кодов ценных бумаг. Указанные нетто-обязательства и нетто-требования учитываются на регистрах учета позиций;

- итоговые нетто-обязательства / итоговые нетто-требования Участников клиринга по обязательствам, включенным в состав клирингового пула по договорам, заключаемым без участия Центрального контрагента, в разрезе денежных регистров / связанных с ним депо регистров / валют / идентификационных кодов ценных бумаг. Указанные нетто-обязательства и нетто-требования учитываются на регистрах учета позиций;

- итоговые нетто-обязательства / итоговые нетто-требования Участников клиринга по обязательствам, включенным в состав расчетного клирингового пула, в разрезе денежных регистров / связанных с ним депо регистров / валют / идентификационных кодов ценных бумаг / кодов ценных бумаг. Указанные нетто-обязательства и нетто-требования учитываются на регистрах учета позиций;

- итоговые нетто-обязательства / итоговые нетто-требования Участников клиринга по обязательствам, включенным в клиринговый пул для расчётов по итогам Торгов, в разрезе денежных регистров. Указанные нетто-обязательства и нетто-требования учитываются на регистрах учета позиций;

- итоговые нетто-обязательства / итоговые нетто-требования Участников клиринга по обязательствам, включенным в клиринговый пул по Договорам с полным обеспечением с ЦК, в разрезе денежных регистров / связанных с ним депо регистров / валют / идентификационных кодов ценных бумаг. Указанные нетто-обязательства и нетто-требования учитываются на регистрах учета позиций;

- итоговые нетто-обязательства / итоговые нетто-требования Участников клиринга по обязательствам, включенным в клиринговый пул по Договорам с полным обеспечением без ЦК, в разрезе денежных регистров / связанных с ним депо регистров/ валют / идентификационных кодов ценных бумаг. Указанные нетто-обязательства и нетто-требования учитываются на регистрах учета позиций;

- оценочная стоимость Средств обеспечения в разрезе ТКС, определяемая исходя из расчетной цены, определенной в соответствии с Методикой установления и изменения риск-параметров. Указанная оценочная стоимость Средств обеспечения учитывается на регистрах учета обеспечения;

- требования к Участникам клиринга по Гарантийному обеспечению в разрезе ТКС, рассчитываемые в соответствии с Методикой установления и изменения риск-параметров. Указанные требования учитываются на регистрах учета обеспечения;

- требования к Участникам клиринга по Дополнительному обеспечению в разрезе ТКС, рассчитываемые в соответствии с Методикой установления и изменения риск-параметров. Указанные требования учитываются на регистрах учета обеспечения;

- Доступные средства каждого Участника клиринга в разрезе ТКС, рассчитываемые в порядке, предусмотренном настоящими Правилами. Указанные Доступные средства учитываются на регистрах учета обеспечения;

- Маржинальные требования к Участникам клиринга (в случае наличия). Указанные Маржинальные требования учитываются на регистрах учета обеспечения;

- взносы Участников клиринга и иных лиц в Гарантийные фонды, рассчитываемые в Валюте Доступных средств в соответствии с Методикой установления и изменения риск-параметров. Указанные взносы учитываются на регистрах учета средств Гарантийных фондов.

6.3. Обязательства и требования из Договоров купли-продажи / Договоров репо/ Внебиржевых договоров, предметом которых являются ценные бумаги / Внебиржевых договоров ОТС учитываются КЦ на регистрах учета позиций, на которых каждая позиция определяется:

- стороной обязательств по передаче ценных бумаг (какой стороной в обязательстве по передаче ценных бумаг является Участник клиринга, на регистре которого учитывается такое обязательство);

- фактом того, заключён ли договор с участием центрального контрагента или без участия центрального контрагента;

- ценной бумагой, в отношении которой заключен договор;

- Датой исполнения по Договору / датой исполнения по Внебиржевому договору или Внебиржевому договору ОТС;

- ТКС, с указанием которого заключен договор;

- количеством ценных бумаг (в штуках), обязательства по передаче которых учитываются в составе позиции;

- суммой денежных средств, соответствующей размеру обязательства по оплате ценных бумаг по договорам, составляющим позицию.

6.4. Обязательства и требования из Договоров ПФИ учитываются КЦ на регистрах учета позиций, на которых каждая позиция определяется:

- стороной обязательств по Договору ПФИ (какой стороной в обязательстве по Договору ПФИ является Участник клиринга, на регистре которого учитывается такое обязательство);

- идентификационным кодом ПФИ;

- Датой расчетов по ПФИ / Датой исполнения Договора ПФИ;

- ТКС, с указанием которого заключен договор;

- количеством Договоров ПФИ (в штуках), составляющих позицию по ПФИ;

- суммой денежных средств, соответствующей размеру обязательства по уплате Премии/ Вариационной маржи и (или) размеру обязательства по исполнению Договора ПФИ.

Обязательства и требования из Договоров ПФИ составляют позицию по Договорам ПФИ. Позиция по Договорам ПФИ определяется в отношении каждого ТКС, по каждому идентификационному коду ПФИ, в разрезе Дат исполнения на основании информации о заключенных Участником клиринга Договорах ПФИ. При определении позиции по Договорам ПФИ учитывается, какой стороной в обязательстве по Договору ПФИ является Участник клиринга, а также количество Договоров ПФИ.

В случае если по двум Договорам ПФИ Участник клиринга является Продавцом или Покупателем (Участник клиринга является одной стороной обязательств), позиция по

Договорам ПФИ определяется как сумма обязательств по таким Договорам ПФИ. В случае если по одному Договору ПФИ Участник клиринга является Продавцом, а по другому Договору ПФИ – Покупателем (разные стороны обязательств по Договорам ПФИ), такие Договоры ПФИ признаются противоположными (далее - офсетные Договоры ПФИ) и позиция по Договорам ПФИ определяется как разница между обязательствами и требованиями Участника клиринга. При заключении Договоров ПФИ ранее определенная позиция по Договорам ПФИ увеличивается (открывается) или уменьшается (закрывается). Открытие позиции осуществляется при заключении Договора ПФИ, в котором Участник клиринга является той же стороной, что и в позиции по ПФИ. Заккрытие позиции осуществляется при заключении Договора ПФИ, являющегося офсетным по отношению к учитываемой позиции по Договорам ПФИ, если сторона позиции после заключения Договора ПФИ не меняется.

Две позиции по Договорам ПФИ с одним идентификационным кодом, учитываемые на регистрах учета позиций, соответствующих разным ТКС, являются противоположными, если по одной из них Участник клиринга является Покупателем, а по другой этот или иной Участник клиринга является Продавцом.

6.5. Внебиржевые договоры, предметом которых является иностранная валюта, учитываются КЦ на регистрах учета позиций, на которых каждая позиция определяется:

- стороной обязательств по денежным средствам в соответствующей валюте (какой стороной в обязательстве по передаче денежных средств в соответствующей валюте является Участник клиринга, на регистре которого учитывается такое обязательство);

- валютой, в отношении которой заключен Внебиржевой договор;
- датой исполнения обязательств по Внебиржевому договору;
- ТКС, указанным в Поручении на клиринг внебиржевых договоров;
- суммой денежных средств в соответствующей валюте, соответствующей размеру денежного обязательства по Внебиржевому договору.

6.6. Позиции по денежным средствам по видам валют могут иметь следующие типы:

- денежная позиция КЦ;
- денежная позиция Участника клиринга;
- клиентская денежная позиция Участника клиринга;
- денежная позиция Участника клиринга - доверительного управляющего;
- денежная позиция Участника клиринга по учету средств, внесенных в Гарантимальные фонды;
- денежная позиция Гаранта по учету средств, внесенных в специальный Гарантимальный фонд.

Позиции по ценным бумагам могут иметь следующие типы:

- позиция КЦ;
- позиция Участника клиринга - владельца;
- позиции Участника клиринга - Продавца по размещаемым ценным бумагам;
- позиция Участника клиринга – номинального держателя;
- позиция клиента Участника клиринга, имеющего отдельный Субсчет депо;
- позиция Субклиента Участника клиринга, имеющего отдельный Субсчет депо;
- позиция Участника клиринга - доверительного управляющего;
- позиция Участника клиринга - владельца, депозитарное обслуживание которого осуществляет Депозитарий;
- позиция Участника клиринга – номинального держателя, депозитарное обслуживание которого осуществляет Депозитарий;
- позиция Участника клиринга - доверительного управляющего, депозитарное обслуживание которого осуществляет Депозитарий;

- позиция Участника клиринга по ценным бумагам, внесенным в Гарантийные фонды;
- позиция Участника клиринга, депозитарное обслуживание которого осуществляет Депозитарий по ценным бумагам, внесенным в Гарантийные фонды;
- позиция Гаранта по ценным бумагам, внесенным в специальный Гарантийный фонд.

6.7. КЦ по требованию Участника клиринга осуществляет на отдельных клиринговых регистрах обособленный учет следующих Объектов учета в отношении клиентов или Субклиентов Участника клиринга:

- позиции клиента или Субклиента Участника клиринга по ценным бумагам, составляющим Средства обеспечения. Указанные позиции учитываются на депо регистрах. Позиция по ценным бумагам рассчитывается для каждого Субсчета депо и по каждому идентификационному коду ценных бумаг/коду ценных бумаг на основании информации об остатках ценных бумаг на Субсчетах депо, полученной от Расчетного депозитария;
- позиции клиента или Субклиента Участника клиринга по денежным средствам, составляющим Средства обеспечения. Указанные позиции учитываются на денежных регистрах;
- обязанности и требования Участника клиринга по каждому допущенному к клирингу обязательству из Договора купли-продажи / Договора репо, заключенного за счет и по поручению клиента или Субклиента Участника клиринга. Указанные обязанности и требования учитываются на регистрах учета позиций;
- обязанности и требования Участника клиринга по каждому допущенному к клирингу обязательству из Внебиржевого договора / Внебиржевого договора ОТС, заключенного за счет и по поручению клиента или Субклиента Участника клиринга. Указанные обязанности и требования учитываются на регистрах учета позиций;
- позиции по ПФИ Участника клиринга в случае заключения Договоров ПФИ за счет и по поручению клиента или Субклиента Участника клиринга. Указанные позиции учитываются на регистрах учета позиций;
- нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам из Договоров Внебиржевых договоров / Внебиржевых договоров ОТС, заключённых Участником клиринга за счет и по поручению клиента или Субклиента Участника клиринга. Указанные нетто-обязательства и нетто-требования учитываются на регистрах учета позиций;
- итоговые нетто-обязательства / итоговые нетто-требования Участника клиринга по обязательствам, включенным в состав расчетного клирингового пула. Указанные нетто-обязательства и нетто-требования учитываются на регистрах учета позиций;
- итоговые нетто-обязательства / итоговые нетто-требования Участников клиринга по обязательствам, возникшим из заключённых Участником клиринга за счет и по поручению клиента или Субклиента Участника клиринга Договоров / Внебиржевых договоров ОТС и включенным в состав клирингового пула по Внутриброкерским договорам. Указанные нетто-обязательства и нетто-требования учитываются на регистрах учета позиций;
- итоговые нетто-обязательства / итоговые нетто-требования Участников клиринга по обязательствам, возникшим из заключённых Участником клиринга за счёт и по поручению клиента или Субклиента Участника клиринга Договоров, в которых указан Код расчетов Х0 и Код расчетов W0, и включенным в состав клирингового пула по Договорам размещения и выкупа. Указанные нетто-обязательства и нетто-требования учитываются на регистрах учета позиций;
- итоговые нетто-обязательства / итоговые нетто-требования Участников клиринга по обязательствам, возникшим из заключённых Участником клиринга за счет и по поручению клиента или Субклиента Участника клиринга договоров, заключаемых без

участия Центрального контрагента, и включенным в состав клирингового пула по договорам, заключаемым без участия центрального контрагента. Указанные нетто-обязательства и нетто-требования учитываются на регистрах учета позиций;

- итоговые нетто-обязательства / итоговые нетто-требования Участников клиринга по обязательствам, определенным в отношении клиента или Субклиента Участника клиринга и включенным в клиринговый пул для расчетов по итогам Торгов. Указанные обязательства и требования учитываются на регистрах учета позиций;

- итоговые нетто-обязательства / итоговые нетто-требования Участников клиринга по обязательствам, возникшим из заключенных Участником клиринга за счет и по поручению клиента или Субклиента Участника клиринга из Договоров, в которых указан Код расчетов У0, и включенным в клиринговый пул по Договорам с полным обеспечением с ЦК. Указанные нетто-обязательства и нетто-требования учитываются на регистрах учета позиций;

- итоговые нетто-обязательства / итоговые нетто-требования Участников клиринга по обязательствам, возникшим из заключенных Участником клиринга за счет и по поручению клиента или Субклиента Участника клиринга из Договоров, в которых указан Код расчетов У0, и включенным в клиринговый пул по Договорам с полным обеспечением без ЦК. Указанные нетто-обязательства и нетто-требования учитываются на регистрах учета позиций;

- оценочная стоимость Средств обеспечения клиента или Субклиента Участника клиринга, определяемая исходя из расчетной цены, определенной в соответствии с Методикой установления и изменения риск-параметров. Указанная оценочная стоимость Средств обеспечения учитывается на регистрах учета обеспечения;

- требования к Участнику клиринга по Гарантийному обеспечению, рассчитываемые по обязательствам, возникшим из Договоров Внебиржевых договоров / Внебиржевых договоров ОТС, заключенных за счет и по поручению клиента или Субклиента Участника клиринга, в соответствии с Методикой установления и изменения риск-параметров. Указанные требования учитываются на регистрах учета обеспечения;

- Доступные средства каждого клиента или Субклиента Участника клиринга, рассчитываемые в порядке, предусмотренном настоящими Правилами. Указанные Доступные средства учитываются на регистрах учета обеспечения.

6.8. Клиринговые регистры группируются в рамках ТКС.

Если иное не указано в настоящих Правилах, КЦ могут быть открыты следующие типы ТКС: собственный (основной), клиентский, доверительного управляющего, ТКС для учета требований по Дополнительному обеспечению и (или) ТКС учета средств Гарантийных фондов.

6.9. ТКС учитывает соответственно позиции Участника клиринга, его клиента (клиентов) или Субклиента (Субклиентов).

6.10. КЦ открывает денежные регистры, депо регистры, регистры учета позиций, на которых учитываются допущенные к клирингу обязательства и требования Участника клиринга по денежным средствам и ценным бумагам, и регистры учета обеспечения при получении заявления Участника клиринга на регистрацию нового ТКС.

6.11. КЦ открывает регистры учета обеспечения для учета требований к Участникам клиринга по Дополнительному обеспечению без дополнительных поручений от Участников клиринга при предоставлении Участнику клиринга допуска к клиринговому обслуживанию (для вновь зарегистрированных Участников клиринга) или при возникновении у КЦ такого требования к Участнику клиринга (для существующих Участников клиринга).

6.12. КЦ открывает регистры учета средств Гарантийных фондов без дополнительных заявлений от Участников клиринга при принятии решения о формировании Гарантийных фондов (для существующих Участников клиринга) или при

предоставлении Участнику клиринга допуска к клиринговому обслуживанию (для вновь зарегистрированных Участников клиринга), а также при заключении договора с Гарантом.

6.13. Закрытие клиринговых регистров, входящих в состав ТКС, возможно на основании заявления на закрытие ТКС либо по инициативе КЦ в случае прекращения действия договора об оказании клиринговых услуг между Участником клиринга и КЦ при условии отсутствия открытых позиций по Договорам/ /Внебиржевым договорам/ Внебиржевым договорам ОТС и при нулевых остатках денежных средств и ценных бумаг, учитываемых на данных клиринговых регистрах. Закрытие основного (собственного) ТКС Участника клиринга осуществляется КЦ после закрытия всех остальных ТКС данного Участника клиринга.

Статья 7. Виды клиринговых счетов

7.1. Клиринговые счета используются для внесения индивидуального клирингового обеспечения и коллективного клирингового обеспечения.

Для внесения индивидуального клирингового обеспечения в денежных средствах в российских рублях и иностранной валюте используются соответствующие Клиринговые денежные счета.

Для внесения индивидуального клирингового обеспечения в ценных бумагах используются соответствующие Клиринговые счета депо.

КЦ имеет право открыть несколько Клиринговых денежных счетов в одной или нескольких Расчетных организациях. КЦ имеет право открыть несколько Клиринговых счетов депо в одном или нескольких Расчетных депозитариях.

Информация о реквизитах Клиринговых денежных счетов / Клиринговых счетов депо, предназначенных для учета денежных средств / ценных бумаг, составляющих индивидуальное клиринговое обеспечение и коллективное клиринговое обеспечение, размещается на Сайте КЦ. Об изменении реквизитов указанных счетов КЦ извещает Участников клиринга путем размещения соответствующей информации на Сайте КЦ не позднее, чем за 3 (три) рабочих дня до введения этих изменений в действие. Размещение указанной информации на Сайте КЦ считается надлежащим способом информирования Участников клиринга об изменении реквизитов Клиринговых денежных счетов.

КЦ по своему усмотрению определяет Расчетные организации и Расчетные депозитарии.

Проведение операций с денежными средствами осуществляется по Клиринговому денежному счету на основании поручений КЦ в соответствии с требованиями, установленными в документах Расчетной организации, в которой открыт соответствующий Клиринговый денежный счет, и настоящих Правил. Проведение операций с ценными бумагами осуществляется по Клиринговому счету депо (Субсчетам депо) на основании поручений КЦ в соответствии с требованиями, установленными внутренними документами Расчетного депозитария, в котором открыт соответствующий Клиринговый счет депо, и настоящих Правил.

Гарантийные фонды учитываются на регистрах учета средств Гарантийных фондов после поступления денежных средств в российских рублях и (или) иностранной валюте на Клиринговые денежные счета, предназначенные для учета коллективного клирингового обеспечения, и (или) зачисления ценных бумаг на Клиринговый счет депо, предназначенный для учета коллективного клирингового обеспечения.

7.2. Условием заключения Участником клиринга от своего имени и за свой счет Договоров и Внебиржевых договоров ОТС является открытие этому Участнику клиринга Субсчета депо владельца.

Условием заключения Участником клиринга Договоров/Внебиржевых договоров ОТС в интересах и за счет клиентов или Субклиентов Участника клиринга является открытие такому Участнику клиринга, его клиенту или Субклиенту, либо Депозитарию,

который учитывает права клиентов или Субклиентов Участника клиринга на ценные бумаги, Субсчета депо номинального держателя.

Участник клиринга - Продавец не обязан иметь Субсчет депо для проведения расчетов по ценным бумагам по Договорам, в которых указан Код расчетов Х0.

Условием заключения Участником клиринга, являющимся доверительным управляющим, в интересах и за счет его клиентов является открытие такому Участнику клиринга Субсчета депо доверительного управляющего.

Участник клиринга и Гарант открывают отдельные Субсчета депо для учета средств Гарантийных фондов в ценных бумагах.

Участник клиринга может открыть торговые счета депо в Депозитарии при условии, что указанный Депозитарий откроет соответствующие им Субсчета депо номинального держателя Депозитария в Расчетном депозитарии и предоставит КЦ согласие Депозитария на проведение по указанным Субсчетам депо номинального держателя операций по итогам клиринга обязательств указанного Участника клиринга по форме, указанной в Регламенте клиринга.

7.3. Условием открытия Субсчета депо является представление Расчетному депозитарию документов, перечень которых определен Расчетным депозитарием. Документы могут быть представлены непосредственно в Расчетный депозитарий или в КЦ, за исключением случая, если Расчетным депозитарием является Участник клиринга. КЦ, получивший документы для открытия Субсчета депо, обязан передать их в Расчетный депозитарий.

При открытии Субсчетов депо клиентам и (или) Субклиентам Участника клиринга, являющегося Расчетным депозитарием, указанные документы представляются непосредственно в Расчетный депозитарий.

7.4. В случае открытия Субсчета депо Участнику клиринга, его клиенту или Субклиенту, документы представляются Участником клиринга, а если Участник клиринга является Расчетным депозитарием, то его клиентом или Субклиентом, которому открывается Субсчет депо.

В случае открытия Субсчета депо Депозитарию документы представляются Депозитарием.

7.5. КЦ не несет ответственности в случае отказа Расчетным депозитарием в открытии Субсчета депо в связи с непредставлением и (или) ненадлежащим представлением документов, требуемых в соответствии с настоящими Правилами и внутренними документами Расчетного депозитария для открытия Субсчета депо, и (или) несоблюдением установленных Расчетным депозитарием условий открытия Субсчета депо.

7.6. Закрытие Субсчета депо возможно по инициативе лица, которому открыт указанный Субсчет депо, или его уполномоченного представителя, или по инициативе КЦ.

Для закрытия Субсчета депо по инициативе лица, которому открыт указанный Субсчет депо, или его уполномоченного представителя, соответствующее лицо должно подать в КЦ заявление на закрытие Субсчета депо.

КЦ вправе по собственной инициативе принять решение о закрытии Субсчета депо, если в течение 3 (трех) месяцев подряд на Субсчете депо не учитываются ценные бумаги, не проводятся операции по Субсчету депо и (или) Субсчет депо не включен в состав ТКС.

7.7. Открытие и закрытие Субсчета депо, проведение операций по Субсчету депо осуществляется в соответствии с настоящими Правилами, внутренними документами Расчетного депозитария, а также в соответствии с договорами, заключенными между КЦ и Расчетным депозитарием.

КЦ не принимает поручения от лиц, которым открыты Субсчета депо, по зачислению ценных бумаг на указанные Субсчета депо, в случае если указанные ценные бумаги не входят в Список ценных бумаг и (или) не входят в Перечень ценных бумаг.

7.8. Подача Участником клиринга в КЦ поручения на зачисление ценных бумаг на Субсчет депо считается завершением Участника клиринга о том, что если указанные поручения поданы в связи с совершением сделок и (или) операций, при совершении которых в соответствии с иностранным законодательством подлежит уплате налог или сбор (далее - транзакционный налог), то на день подачи указанного поручения отсутствует нарушение обязанности по уплате транзакционного налога в связи с совершением указанных сделок и (или) операций.

Подача Участником клиринга в КЦ поручения на зачисление ценных бумаг на Субсчет депо, открытый его клиенту, или Субклиенту, либо Депозитарию, или поручения на списание ценных бумаг с такого Субсчета депо считается завершением Участника клиринга о наличии у него на день подачи указанного поручения полномочий на его подачу и (или) совершение иных действий, которые могут повлечь проведение операций по указанному Субсчету депо.

Указанные заверения считаются заверением об обстоятельствах по смыслу статьи 431.2 Гражданского кодекса Российской Федерации, на которое КЦ полагается и которое имеет для него существенное значение.

Участник клиринга обязан также обеспечить, чтобы он, его клиенты и Субклиенты надлежащим образом исполняли все обязанности, связанные с уплатой транзакционного налога в связи с совершением сделок и (или) операций с ценными бумагами, учитываемыми на Субсчете депо, которые возлагаются на них в соответствии с иностранным законодательством.

7.9. В отношении каждого открытого Субсчета депо КЦ вправе:

- получать от Расчетного депозитария информацию о ценных бумагах, учитываемых на Субсчете депо;
- составлять и подписывать обязательные для исполнения Расчетным депозитарием поручения на проведение операций по Субсчету депо.

Статья 8. Порядок регистрации Торгово-клиринговых счетов

8.1. Участник клиринга должен по факту открытия Субсчета депо зарегистрировать Торгово-клиринговые счета путем подачи в КЦ заявления на регистрацию Торгово-клирингового счета. Субсчет депо, не зарегистрированный в составе ТКС, не используется для целей заключения договоров и проведения клиринга обязательств по договорам.

Заявление на регистрацию Торгово-клирингового счета подается по каждой уникальной паре позиции по ценным бумагам и позиции по денежным средствам. Одна позиция по ценным бумагам может входить в состав только одного ТКС. Одна позиция по денежным средствам может входить в состав только одного ТКС.

Участник клиринга, являющийся Расчетным депозитарием (Участник клиринга категории А), вправе зарегистрировать ТКС, в состав которого может входить несколько позиций по ценным бумагам и одна позиция по денежным средствам.

ТКС для учета требований КЦ к Участнику клиринга по Дополнительному обеспечению регистрируется одновременно с открытием регистра учета обеспечения для учета требований к Участникам клиринга по Дополнительному обеспечению без подачи Участником клиринга заявления на регистрацию Торгово-клирингового счета. ТКС для учета требований КЦ к Участнику клиринга по Дополнительному обеспечению является собственным ТКС Участника клиринга.

ТКС для учета денежных средств и (или) ценных бумаг, внесенных Участником клиринга и (или) Гарантом в Гарантйные фонды, открывается одновременно с

открытием регистра учета средств Гарантийных фондов без подачи Участником клиринга (Гарантом) заявления на регистрацию Торгово-клирингового счета.

Перечень допустимых ТКС:

- собственный ТКС Участника клиринга, в который входят позиция Участника клиринга по денежным средствам и позиция Участника клиринга – владельца по ценным бумагам;

- собственный ТКС Участника клиринга, в который входят позиция Участника клиринга - Продавца по денежным средствам и позиция по размещаемым ценным бумагам Участника клиринга - Продавца;

- ТКС доверительного управляющего, в который входят позиция по денежным средствам Участника клиринга - доверительного управляющего и позиция по ценным бумагам Участника клиринга - доверительного управляющего;

- клиентский ТКС, в который входят клиентская позиция по денежным средствам и позиция по ценным бумагам Участника клиринга - номинального держателя;

- клиентский ТКС, в который входят позиция по денежным средствам клиента – доверительного управляющего и позиция по ценным бумагам клиента – доверительного управляющего;

- собственный ТКС Участника клиринга, в который входят позиция Участника клиринга по денежным средствам и позиция Участника клиринга - владельца по ценным бумагам, депозитарное обслуживание которого осуществляет Депозитарий;

- ТКС доверительного управляющего, в который входят позиция по денежным средствам и позиция по ценным бумагам Участника клиринга - доверительного управляющего, депозитарное обслуживание которого осуществляет Депозитарий;

- клиентский ТКС, в который входят клиентская позиция по денежным средствам и позиция по ценным бумагам Участника клиринга - номинального держателя, депозитарное обслуживание которого осуществляет Депозитарий;

- клиентский ТКС, в который входят клиентская позиция по денежным средствам и позиция по ценным бумагам клиента или Субклиента Участника клиринга, которому открыт Субсчет депо владельца;

- ТКС учета средств Гарантийных фондов, в который входят позиция Участника клиринга по денежным средствам, внесенным в Гарантийный фонд, и позиция Участника клиринга по ценным бумагам, внесенным в Гарантийный фонд;

- ТКС учета средств Гарантийных фондов, в который входят позиция Гаранта по денежным средствам, внесенным в специальный Гарантийный фонд, и позиция Гаранта по ценным бумагам, внесенным в специальный Гарантийный фонд.

8.2. Участник клиринга вправе зарегистрировать отдельный ТКС для своего клиента или Субклиента в целях отдельного учета денежных средств и (или) ценных бумаг указанного клиента или Субклиента Участника клиринга, предоставленных в качестве Средств обеспечения, и обязательств Участника клиринга, возникших из Договоров /Внебиржевых договоров / Внебиржевых договоров ОТС, заключенных за счет данного клиента или Субклиента (далее - Обособленный клиент). Для целей регистрации отдельного ТКС для клиента или Субклиента Участника клиринга он обязан в заявлении на регистрацию Торгово-клирингового счета указать Регистрационный код, присвоенный КЦ указанному клиенту или Субклиенту при его регистрации.

8.3. ТКС может содержать признак, указывающий на осуществление КЦ обособленного учёта Средств обеспечения Участника клиринга, учитываемых в составе данного ТКС. Обособленный учёт Средств обеспечения Участника клиринга, учитываемых в составе ТКС, устанавливается при регистрации данного ТКС, в случае указания Участником клиринга в заявлении о регистрации Торгово-клирингового счета такого признака. Средства обеспечения, учитываемые в составе ТКС, в отношении которого установлен признак обособленного учета Средств обеспечения (далее – Обособленный ТКС), участвуют в расчете Доступных средств в порядке,

предусмотренном статьей 19 настоящих Правил. Признак обособленного учета Средств обеспечения, учитываемых в составе ТКС, открытого Участнику клиринга – доверительному управляющему, а также в составе ТКС, открытого в целях отдельного учета имущества Обособленного клиента Участника клиринга, предоставленного в качестве Средств обеспечения, и обязательств Участника клиринга, возникших из Договоров/Внебиржевых договоров/Внебиржевых договоров ОТС, заключённых за счет Обособленного клиента Участника клиринга, проставляется автоматически.

8.4. Участник клиринга – Продавец регистрирует ТКС без указания в заявлении на регистрацию Торгово-клирингового счета Субсчета депо. ТКС, зарегистрированный Участником клиринга – Продавцом без указания Субсчета депо, предназначен исключительно для заключения Договоров, в которых указан Код расчетов Х0.

8.5. В целях учета в составе ТКС обязательств и требований Участника клиринга из заключенных Внебиржевых договоров/Договоров, в которых указан Код расчетов Оп и Код расчетов OkOn, указанный Участник клиринга вправе зарегистрировать ТКС без указания в заявлении на его регистрацию Субсчета депо.

8.6. КЦ вправе отказать в регистрации ТКС или приостановить проведение операций с использованием ТКС в случае, если использование данного ТКС при заключении Договоров/ Внебиржевых договоров/Внебиржевых договоров ОТС и/или расчетах по указанным договорам приведет к нарушению настоящих Правил.

8.7. КЦ аннулирует регистрацию ТКС в следующих случаях:

- на основании заявления Участника клиринга, который регистрировал этот ТКС. В этом случае КЦ аннулирует регистрацию ТКС, в отношении которого подано заявление;
- в случае прекращения договора об оказании клиринговых услуг с Участником клиринга, зарегистрировавшим ТКС. В этом случае КЦ аннулирует регистрацию всех ТКС Участника клиринга;

- в случае отзыва Банком России у Участника клиринга лицензии профессионального участника рынка ценных бумаг на осуществление брокерской деятельности. В этом случае КЦ аннулирует регистрацию всех клиентских ТКС Участника клиринга;

- в случае отзыва Банком России у Участника клиринга лицензии профессионального участника рынка ценных бумаг на осуществление дилерской деятельности. В этом случае КЦ аннулирует регистрацию всех собственных ТКС Участника клиринга, кроме ТКС для учета требований КЦ к Участнику клиринга по Дополнительному обеспечению;

- в случае отзыва Банком России у Участника клиринга лицензии профессионального участника рынка ценных бумаг на осуществление деятельности по управлению ценными бумагами. В этом случае КЦ аннулирует регистрацию всех ТКС доверительного управляющего Участника клиринга;

- в случае перевода долга/уступки требований/передачи имущества одного Участника клиринга по обязательствам, допущенным к клирингу, другому Участнику клиринга. В этом случае КЦ аннулирует регистрацию ТКС, по которому учитывались соответствующие обязательства (требование, имущество);

- в случае отсутствия операций с использованием ТКС в течение 6 (шести) месяцев подряд. В этом случае КЦ аннулирует регистрацию указанного ТКС.

Аннулирование регистрации ТКС производится при условии, что на клиринговых регистрах, открытых в рамках данного ТКС, на момент принятия решения об аннулировании регистрации ТКС не учитываются Объекты учета.

8.8. Участник клиринга обязан зарегистрировать в КЦ на основании заявления на регистрацию счета для вывода денежных средств (форма которого предусмотрена в Регламенте клиринга) расчетный счет в российских рублях и (или) иностранной валюте соответственно (далее – Счет). При этом в качестве Счета может быть зарегистрирован только расчетный счет самого Участника клиринга или его клиента.

Возврат денежных средств с Клирингового денежного счета допускается только на указанный Счет, за исключением случаев, предусмотренных настоящими Правилами.

В случае необходимости изменения реквизитов зарегистрированного в КЦ Счета, Участник клиринга предоставляет в КЦ новое заявление на регистрацию счета для вывода денежных средств до начала проведения таким Участником клиринга операций с использованием измененных реквизитов. Перечисление денежных средств по новым реквизитам осуществляется с рабочего дня, следующего за днем поступления в КЦ нового заявления на регистрацию счета для вывода денежных средств.

Риск несвоевременного уведомления КЦ об актуальных реквизитах Счета несет Участник клиринга.

8.9. В случае необходимости закрытия зарегистрированного в КЦ Счета Участник клиринга обязан проинформировать КЦ об этом по форме, установленной в Регламенте клиринга.

8.10. КЦ вправе аннулировать регистрацию Счета:

- на основании заявления Участника клиринга, зарегистрировавшего Счет;
- в случае невозможности осуществления вывода денежных средств на такой Счет по причине его блокировки или закрытия;
- в случае прекращения действия договора об оказании клиринговых услуг с Участником клиринга, зарегистрировавшим Счет.

8.11. Участник клиринга обязан зарегистрировать в КЦ на основании заявления на регистрацию счета для вывода ценных бумаг по форме, указанной в Регламенте клиринга, счет депо для возврата ценных бумаг с Субсчета депо. Вид счета депо для вывода ценных бумаг (счет депо владельца ценных бумаг, счет депо номинального держателя, счет депо доверительного управляющего) должен соответствовать виду Субсчета депо, на котором учитываются ценные бумаги (соответственно Субсчет депо владельца ценных бумаг, Субсчет депо номинального держателя, Субсчет депо доверительного управляющего).

Возврат ценных бумаг с Субсчета депо допускается только на зарегистрированный счет депо соответствующего вида, за исключением случаев, предусмотренных настоящими Правилами.

8.12. В случае необходимости изменения реквизитов зарегистрированного в КЦ счета депо для возврата ценных бумаг, Участник клиринга предоставляет в КЦ новое заявление на регистрацию счета депо до начала проведения таким Участником клиринга операций с использованием измененных реквизитов. Перевод ценных бумаг по новым реквизитам осуществляется с рабочего дня, следующего за днем поступления в КЦ нового заявления на регистрацию счета депо для возврата ценных бумаг.

Риск несвоевременного уведомления КЦ об актуальных реквизитах счета депо для возврата ценных бумаг несет Участник клиринга.

РАЗДЕЛ II. ПРАВА И ОБЯЗАННОСТИ КЦ И УЧАСТНИКОВ КЛИРИНГА. ТРЕБОВАНИЯ К УЧАСТНИКАМ КЛИРИНГА

Статья 9. Права, обязанности и ответственность КЦ и Участников клиринга

9.1. Порядок взаимодействия Участников клиринга и КЦ, а также права, обязанности Участников клиринга и КЦ определяются законодательством Российской Федерации и договором об оказании клиринговых услуг.

9.2. Порядок взаимодействия Гарантов и КЦ, а также права и обязанности Гарантов и КЦ определяются законодательством Российской Федерации и договором между ними.

9.3. КЦ не несет ответственности за неисполнение или ненадлежащее исполнение своих обязанностей, предусмотренных настоящими Правилами, если их неисполнение или ненадлежащее исполнение стало следствием:

- действий или бездействия Участника клиринга или Гаранта, в том числе несвоевременного предоставления Участником клиринга или Гарантом информации и (или) предоставления Участником клиринга или Гарантом неполной или недостоверной информации;

- возникновения Чрезвычайной ситуации (при условии надлежащего информирования Участников клиринга о ее возникновении);

- неисполнения или ненадлежащего исполнения Расчетной организацией, Расчетным депозитарием, техническим центром и (или) иными лицами своих обязанностей (кроме случаев, когда указанное неисполнение или ненадлежащее исполнение допущено по вине КЦ);

- неисполнения или ненадлежащего исполнения обязанностей Организатора торговли перед Участниками клиринга, их клиентами или Субклиентами, которые являются Участниками торгов;

- приостановлением или прекращением Торгов Организатором торговли.

9.4. КЦ не отвечает по обязательствам Участника клиринга.

9.5. Участник клиринга или КЦ освобождается от ответственности за неисполнение или ненадлежащее исполнение своих обязательств, если он докажет, что их надлежащее исполнение оказалось невозможным вследствие обстоятельств непреодолимой силы.

Участник клиринга (КЦ) обязан предпринять все разумные меры по незамедлительному уведомлению КЦ (Участника клиринга) о наступлении и прекращении обстоятельств непреодолимой силы, а также КЦ (Участнику клиринга) документы, подтверждающие их наступление и прекращение. В случае нарушения Участником клиринга (КЦ) этой обязанности он теряет право ссылаться на указанные обстоятельства как основание освобождения от ответственности.

9.6. Участник клиринга вправе отказаться от исполнения договора об оказании клиринговых услуг при условии письменного уведомления КЦ не менее, чем за 10 (десять) дней до прекращения указанного договора.

Действие договора прекращается по истечении 10 (десяти) дней со дня получения КЦ уведомления Участника клиринга об отказе от его исполнения или, если в уведомлении указана более поздняя дата его прекращения, с даты, указанной в уведомлении, при условии отсутствия у Участника клиринга имущественных обязательств по указанному договору и неисполненных им обязательств, допущенных к клирингу.

9.7. КЦ вправе в одностороннем порядке отказаться от исполнения договора об оказании клиринговых услуг в следующих случаях:

- если Участник клиринга в течение 6 (шести) месяцев с момента заключения договора об оказании клиринговых услуг не получил допуск к клиринговому обслуживанию;

- если Участник клиринга в течение 6 (шести) месяцев подряд не имел допуск к клиринговому обслуживанию в связи с его приостановлением;

- в случаях, предусмотренных статьями 48 настоящих Правил.

КЦ обязан предварительно уведомить Участника клиринга о своем отказе от исполнения договора об оказании клиринговых услуг. Указанный договор прекращается по истечении 10 (десяти) дней после дня получения Участником клиринга уведомления КЦ об отказе от его исполнения или, если в уведомлении указана более поздняя дата его прекращения, с даты, указанной в уведомлении.

9.8. В случае прекращения допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию договор об оказании клиринговых услуг прекращается с момента прекращения указанного допуска.

Статья 10. Требования к Участникам клиринга, допущенным к клиринговому обслуживанию

10.1. Условием оказания клиринговых услуг является допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию. Участник клиринга, допущенный к клиринговому обслуживанию, обязан в течение всего срока клирингового обслуживания соблюдать одновременно следующие требования:

1) Участник клиринга должен быть зарегистрирован в качестве Участника клиринга, и эта регистрация не должна быть приостановлена и аннулирована;

2) Участник клиринга должен внести взнос в Гарантийный фонд участников (в случае его формирования);

3) Участнику клиринга или Депозитарию, у которого Участнику клиринга открыт торговый счет депо, должен быть открыт Субсчет депо, который входит в состав ТКС, зарегистрированного на этого Участника клиринга (если иное не предусмотрено настоящими Правилами);

4) у Участника клиринга исходя из отчетности или иной информации, представленной в соответствии со статьей 12 настоящих Правил, должны отсутствовать факты ухудшения финансового состояния, и (или) факты, дающие основания считать возможным ухудшение финансового состояния Участника клиринга, и (или) факты, указывающие на неспособность Участника клиринга своевременно и в полном объеме исполнять свои обязанности из Договоров / Внебиржевых договоров / Внебиржевых договоров ОТС и (или) иные обязательства Участника клиринга из настоящих Правил;

5) Участник клиринга должен соответствовать требованиям к финансовой устойчивости, установленным статьей 12 настоящих Правил;

6) Участник клиринга должен иметь доступ к Системе электронного документооборота на основании договора, заключенного с техническим центром, который определен КЦ и информация о котором раскрыта на Сайте КЦ, и соблюдать условия указанного договора;

7) Участник клиринга должен иметь доступ к Системе на основании договора, заключенного с техническим центром, который определен КЦ и информация о котором раскрыта на Сайте КЦ, и соблюдать условия указанного договора (в случае заключения Внебиржевых договоров ОТС);

8) Участник клиринга – кредитная организация должен обладать действующей лицензией на осуществление банковских операций (кроме Банка России);

9) Участник клиринга, являющийся брокером, дилером, управляющим или управляющей компанией инвестиционных фондов, паевых инвестиционных фондов и негосударственных пенсионных фондов, должен являться членом Ассоциации участников финансового рынка «Некоммерческое партнерство развития финансового рынка РТС» (если это предусмотрено решением КЦ);

10) Участник клиринга должен надлежащим образом исполнять обязанности по представлению КЦ информации и (или) документов в соответствии с требованиями Федерального закона «О клиринге, клиринговой деятельности и центральном контрагенте» и принятых в соответствии с ним нормативных актов, а также настоящих Правил, в том числе своевременно и в полном объеме представлять КЦ все документы (информацию), необходимые для допуска к клиринговому обслуживанию;

11) Участник клиринга должен предоставить код идентификации юридических лиц (далее – код LEI) с указанием адреса сайта в сети Интернет локального операционного подразделения, присвоившего код LEI, по форме, указанной в Регламенте клиринга (в случае заключения Внебиржевых договоров ОТС), а также обеспечивать своевременную верификацию указанного кода;

12) Участник клиринга должен обеспечивать актуальность, достоверность и полноту документов и (или) информации, предоставляемой в КЦ, в том числе в целях идентификации Участника клиринга, его клиентов, Субклиентов и Депозитария, а также

своевременное предоставление изменений и дополнений в такие документы и (или) информацию;

13) Участник клиринга обязан соблюдать настоящие Правила, в том числе надлежащим образом оплачивать услуги КЦ, а также иные документы, утвержденные КЦ в соответствии с настоящими Правилами и раскрытые на Сайте КЦ.

10.2. Соблюдение требований, предусмотренных подпунктами 6 - 12 пункта 10.1 настоящих Правил, является условием регистрации в качестве Участника клиринга.

Статья 11. Регистрация в качестве Участника клиринга

11.1. Допуск к клиринговому обслуживанию предоставляется лицам, зарегистрированным в соответствии с настоящими Правилами в качестве Участников клиринга.

11.2. Лицо, намеревающееся стать Участником клиринга (далее - Заявитель), должно представить в КЦ следующие документы:

11.2.1. Заявители, являющиеся юридическими лицами, созданными в соответствии с законодательством Российской Федерации:

1) заявление, которое должно быть составлено по форме, определенной КЦ и опубликованной на Сайте КЦ, заполнено в отношении Заявителя, подписано от имени Заявителя и заверено печатью Заявителя (при наличии);

2) «Анкету (досье) клиента – юридического лица, траста, или иной иностранной структуры без образования юридического лица»¹, которая должна быть составлена по форме, определенной КЦ и опубликованной на Сайте КЦ, заполнена в отношении Заявителя, подписана от имени Заявителя и заверена печатью Заявителя (при наличии).

Указанная в настоящем пункте Анкета Заявителя считается предоставленной также в случае размещения анкеты, составленной в целях исполнения требований Федерального закона «О противодействии легализации (отмыванию) доходов полученных преступным путем, и финансированию терроризма» и принятых в соответствии с ним нормативно-правовых актов на официальном сайте Заявителя в информационно-телекоммуникационной сети Интернет. При этом, если объем сведений, содержащихся в Анкете Заявителя, указанной в настоящем пункте превышает объем сведений, приведенный в анкете, размещенной на официальном сайте Заявителя в информационно-телекоммуникационной сети Интернет, Заявитель обязан предоставить в КЦ письмо в свободной форме, подписанное уполномоченным лицом Заявителя, содержащее недостающие сведения.

3) «Сведения о принадлежности Клиента, его представителя, бенефициарного владельца, выгодоприобретателя к публичным должностным лицам», которые должны быть оставлены по форме определенной КЦ и опубликованной на Сайте КЦ, заполнены в отношении Заявителя, подписаны от имени Заявителя и заверены печатью Заявителя (при наличии);

4) опросный лист, составленный по форме, установленной Приложением №1 к Критериям отнесения клиентов КЦ к категории клиента – иностранного налогоплательщика и способам получения от них необходимой информации, который должен быть заполнен в отношении Заявителя, подписан от имени Заявителя и заверен печатью Заявителя (при наличии), если указанный опросный лист не включен в форму анкеты, указанной в подпункте 2) настоящего пункта;

¹ Идентификация представителя, являющегося единоличным исполнительным органом, может не осуществляться в отношении Заявителя, указанного в абзаце четвертом подпункта 2 пункта 1 статьи 7 Федерального закона от 07.08.2001 г. № 115-ФЗ «О противодействии легализации (отмыванию) доходов, полученных преступным путем, и финансированию терроризма»

5) форму подтверждения статуса налогового резидента, которая должна быть составлена по форме, определенной КЦ и опубликованной на Сайте КЦ, заполнена в отношении Заявителя, подписана от имени Заявителя и заверена печатью Заявителя (при наличии);

6) два экземпляра договора об оказании клиринговых услуг, который должен быть составлен по форме, определенной КЦ и опубликованной на Сайте КЦ, подписан от имени Заявителя и заверен печатью Заявителя (при наличии);

7) согласие на обработку КЦ персональных данных, которое должно быть составлено по форме, определенной КЦ и опубликованной на Сайте КЦ, заполнено в отношении лиц, в отношении которых Заявителем заполнен раздел «Сведения о представителях (физических лицах)» Анкеты Заявителя, в отношении лиц, в отношении которых Заявитель предоставляет в КЦ «Анкету представителя клиента – физического лица», а также лиц, указанных в заявлении, и подписано этими лицами. Согласие на обработку КЦ персональных данных не предоставляется в отношении единоличного исполнительного органа Заявителя;

8) документы для целей идентификации Бенефициаров дохода и Посредников по Ценным бумагам иностранных эмитентов (в порядке, определенном статьей 46 настоящих Правил).

Участники клиринга обязаны предоставлять обновленные формы документов, указанных в подпунктах 2) - 3), 5) настоящего пункта по мере изменения сведений, но не реже одного раза в год. В случае изменения сведений исключительно о представителях Участника клиринга, Участник клиринга может предоставить в КЦ «Анкету представителя клиента – юридического лица» / «Анкету представителя клиента – физического лица», которая должна быть составлена по форме, определенной КЦ и опубликованной на Сайте КЦ. КЦ вправе запросить любую дополнительную информацию, как по обновлению сведений, так и по ранее полученным документам, а также при возникновении сомнений в достоверности и точности ранее полученной информации. Информация и документы должны быть предоставлены в срок, указанный в запросе КЦ.

Участники клиринга обязаны предоставлять в КЦ обновленные формы документов, указанных в подпунктах 4), 7) настоящего пункта, а также обновленную информацию, приведенную в документе, указанном в подпункте 1 настоящего пункта по мере изменения сведений незамедлительно после того, как им стало или должно было стать известно об их изменении.

Участники клиринга обязаны предоставлять в КЦ обновленные формы документов, указанных в подпункте 8) настоящего пункта в порядке, определенном Регламентом обмена информацией в целях исполнения Закона США «О налогообложении иностранных счетов» (FATCA), Налогового кодекса ФРГ и иных законодательных актов в сфере налогообложения Доходов по Ценным бумагам иностранных эмитентов Небанковской кредитной организации - центрального контрагента «Клиринговый центр МФБ» (акционерное общество), который утверждается КЦ и раскрывается на Сайте КЦ (далее – Регламент обмена информацией).

В случае нарушения указанной обязанности КЦ вправе приостановить или прекратить клиринговое обслуживание. КЦ не несет ответственности за негативные последствия, вызванные нарушением указанной обязанности. 11.2.2. Заявители, являющиеся иностранными лицами, созданными в соответствии с законодательством иностранного государства:

1) заявление, которое должно быть составлено по форме, определенной КЦ и опубликованной на Сайте КЦ, заполнено в отношении Заявителя, подписано от имени Заявителя и заверено печатью Заявителя (при наличии);

2) «Анкету (досье) клиента – юридического лица, траста, или иной иностранной структуры без образования юридического лица»², которая должна быть составлена по форме, определенной КЦ и опубликованной на Сайте КЦ, заполнена в отношении Заявителя, подписана от имени Заявителя и заверена печатью Заявителя (при наличии);

3) «Сведения о принадлежности Клиента, его представителя, бенефициарного владельца, выгодоприобретателя к публичным должностным лицам», которые должны быть составлены по форме определенной КЦ и опубликованной на Сайте КЦ, заполнены в отношении Заявителя, подписаны от имени Заявителя и заверены печатью Заявителя (при наличии);

4) Вольфсбергский опросник (для кредитных организаций) или письмо в произвольной форме о соблюдении процедур противодействия легализации денежных средств (Anti Money Laundering - AML), либо письмо о неприменимости к Заявителю указанных процедур. Документ, указанный в настоящем подпункте, должен быть подписан от имени Заявителя и заверен печатью Заявителя (при наличии);

5) «Анкету выгодоприобретателя – юридического лица» / «Анкету выгодоприобретателя – физического лица/индивидуального предпринимателя/физического лица, занимающегося частной практикой»³, которая должна быть составлена по форме, определенной КЦ и опубликованной на Сайте КЦ, заполнена в отношении каждого лица, являющегося выгодоприобретателем Заявителя, подписана от имени Заявителя и заверена печатью Заявителя (при наличии);

6) опросный лист, составленный по форме, установленной Приложением №1 к Критериям отнесения клиентов КЦ к категории клиента – иностранного налогоплательщика и способам получения от них необходимой информации, который должен быть заполнен в отношении Заявителя, подписан от имени Заявителя и заверен печатью Заявителя (при наличии), если указанный опросный лист не включен в форму анкеты, указанной в подпункте 2) настоящего пункта;

7) форму подтверждения статуса налогового резидента, которая должна быть составлена по форме, определенной КЦ и опубликованной на Сайте КЦ, заполнена в отношении Заявителя, подписана от имени Заявителя и заверена печатью Заявителя (при наличии);

8) два экземпляра договора об оказании клиринговых услуг, который должен быть составлен по форме, определенной КЦ и опубликованной на Сайте КЦ, подписан от имени Заявителя и заверен печатью Заявителя (при наличии);

9) согласие на обработку КЦ персональных данных, которое должно быть составлено по форме, определенной КЦ и опубликованной на Сайте КЦ, заполнено в

² Идентификация представителя, являющегося единоличным исполнительным органом, может не осуществляться в отношении Заявителя, указанного в абзацах третьем и пятом подпункта 2 пункта 1 статьи 7 Федерального закона от 07.08.2001 г. № 115-ФЗ «О противодействии легализации (отмыванию) доходов, полученных преступным путем, и финансированию терроризма», а также Заявителя, являющегося 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 действующих организаций соответствующего иностранного государства

³ Указанная в настоящем подпункте анкета не предоставляется банком-резидентом иностранного государства – члена Группы разработки финансовых мер борьбы с отмыванием денег (ФАТФ), имеющим показатель рейтинговой оценки, присвоенной российским национальным рейтинговым агентством или международным рейтинговым агентством (Moody's Investors Service, Standard & Poor's, Fitch Ratings), и включенным в перечень действующих кредитных организаций соответствующего иностранного государства

отношении лиц, в отношении которых Заявителем заполнен раздел «Сведения о представителях (физических лицах)» Анкеты Заявителя, в отношении лиц, в отношении которых Заявитель предоставляет в КЦ «Анкету представителя клиента – физического лица», а также лиц, указанных в заявлении и подписано этими лицами;

10) документы для целей идентификации Бенефициаров дохода и Посредников по Ценным бумагам иностранных эмитентов (в порядке, определенном статьей 46 настоящих Правил).

Участники клиринга обязаны предоставлять обновленные формы документов, указанных в подпунктах 2) – 5), 7) настоящего пункта по мере изменения сведений, но не реже одного раза в год. В случае изменения сведений исключительно о представителях Участника клиринга, Участник клиринга может предоставить в КЦ «Анкету представителя клиента – юридического лица» / «Анкету представителя клиента – физического лица», которая должна быть составлена по форме, определенной КЦ и опубликованной на Сайте КЦ. КЦ вправе запросить любую дополнительную информацию, как по обновлению сведений, так и по ранее полученным документам, а также при возникновении сомнений в достоверности и точности ранее полученной информации. Информация и документы должны быть предоставлены в срок, указанный в запросе КЦ.

Участники клиринга обязаны предоставлять в КЦ обновленные формы документов, указанных в подпунктах 6), 9) настоящего пункта, а также обновленную информацию, приведенную в документе, указанном в подпункте 1 настоящего пункта по мере изменения сведений незамедлительно после того, как им стало или должно было стать известно об их изменении.

Участники клиринга обязаны предоставлять в КЦ обновленные формы документов, указанных в подпункте 10) настоящего пункта в порядке, определенном Регламентом обмена информацией.

В случае нарушения указанной обязанности КЦ вправе приостановить или прекратить клиринговое обслуживание. КЦ не несет ответственности за негативные последствия, вызванные нарушением указанной обязанности.

11.3. Для рассмотрения вопроса о регистрации Заявителя в качестве Участника клиринга в КЦ, помимо документов, указанных в пункте 11.2 настоящих Правил, представляются документы, указанные в Приложении №1 к настоящим Правилам, за исключением случаев, если информация, содержащаяся в этих документах, раскрывается Заявителем в соответствии с законодательством Российской Федерации, в том числе со статьёй 30 Федерального закона «О рынке ценных бумаг».

КЦ вправе потребовать представления Заявителем иных документов (информации), в том числе документов (информации), подтверждающих финансовое состояние Заявителя. Заявитель обязан представить документы (информацию), указанные в требовании КЦ, в установленные КЦ срок и порядке.

11.4. Решение о регистрации Заявителя в качестве Участника клиринга или об отказе в такой регистрации принимается КЦ в течение 10 (десяти) рабочих дней с даты получения всех необходимых документов и информации.

11.5. Решение о регистрации Заявителя в качестве Участника клиринга может быть принято, если соблюдаются требования, являющиеся условием такой регистрации.

11.6. КЦ информирует Заявителя о принятом решении путем направления уведомления по адресу, указанному в Анкете Заявителя, или путем направления уведомления в форме Электронного документа, подписанного Электронной подписью.

11.7. В случае принятия КЦ решения о регистрации Заявителя в качестве Участника клиринга КЦ подписывает со своей стороны два экземпляра договора об оказании клиринговых услуг и направляет Заявителю один экземпляр подписанного договора по адресу, указанному в Анкете Заявителя.

11.8. С даты регистрации Заявителя в качестве Участника клиринга вступает в силу заключенный с ним договор об оказании клиринговых услуг. С указанной даты Заявитель становится Участником клиринга и информация о нем включается в реестр Участников клиринга, клиентов и Субклиентов.

Договор об оказании клиринговых услуг заключается посредством подписания сторонами указанного договора по форме, определенной КЦ и содержащейся в Регламенте клиринга. КЦ вправе по своему усмотрению вносить изменения в форму договора об оказании клиринговых услуг. С момента вступления в силу указанных изменений все ранее заключенные договоры считаются измененными соответствующим образом, если иное не установлено решением КЦ.

Договор об оказании клиринговых услуг заключается на неопределённый срок и действует с момента подписания указанного договора КЦ и Участником клиринга и до даты прекращения допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию в соответствии с настоящими Правилами или прекращения действия указанного договора в соответствии с требованиями законодательства Российской Федерации.

Состав оказываемых КЦ услуг, условия и порядок их оказания и оплаты, а также иные права и обязанности сторон договора об оказании клиринговых услуг, связанные с оказанием клиринговых услуг, устанавливаются настоящими Правилами.

11.9. При регистрации Заявителя в качестве Участника клиринга ему присваивается одна из следующих категорий:

- категория А - участник клиринга, являющийся Расчетным депозитарием;
- категория Б - участник клиринга, не являющийся Расчетным депозитарием.

11.10. В целях регистрации Заявителя в качестве Участника клиринга КЦ присваивает Заявителю Регистрационный код.

КЦ информирует Заявителя о присвоенном ему Регистрационном коде путем указания данного кода в уведомлении о регистрации Заявителя в качестве Участника клиринга.

При регистрации Заявителя в качестве Участника клиринга КЦ также присваивает Участнику клиринга уникальный код, который может состоять из букв, цифр или их сочетаний (далее - Идентификатор Участника клиринга).

Одному Участнику клиринга может быть присвоен только один Идентификатор Участника клиринга. При этом устанавливается однозначное соответствие между всеми кодами Участника клиринга и Идентификатором Участника клиринга.

КЦ информирует Заявителя о присвоенном ему Идентификаторе Участника клиринга путем указания данного кода в уведомлении о регистрации Заявителя в качестве Участника клиринга.

КЦ вправе присваивать дополнительные коды Участникам клиринга в порядке, предусмотренном настоящими Правилами.

11.11. Участник клиринга вправе регистрировать своих клиентов и Субклиентов в порядке, предусмотренном настоящими Правилами.

КЦ не заключает Договоры / Внебиржевые договоры ОТС и не осуществляет клиринг по Договорам / Внебиржевым договорам / Внебиржевым договорам ОТС, если по указанным договорам расчеты осуществляются за счет клиентов или Субклиентов Участника клиринга, не зарегистрированных КЦ.

Регистрация клиентов и Субклиентов Участника клиринга осуществляется на основании заявления на регистрацию клиентов (Субклиентов) Участника клиринга по форме, установленной Регламентом клиринга. Одновременно с заявлением на регистрацию клиентов (Субклиентов) Участник клиринга предоставляет в КЦ документы для целей идентификации Бенефициаров дохода и Посредников по Ценным бумагам иностранных эмитентов (в порядке, определённом статьей 46 настоящих Правил) .

КЦ вправе потребовать от Участника клиринга представления дополнительных документов и (или) сведений о клиенте или Субклиенте Участника клиринга при его

регистрации и в любое время после его регистрации. Участник клиринга обязан предоставлять КЦ запрошенные документы и (или) сведения о его клиенте и (или) Субклиенте в объеме, порядке и сроки, определенные запросом КЦ.

Регистрация клиентов и Субклиентов Участника клиринга может осуществляться КЦ на основании информации, полученной от Организатора торговли и (или) технического центра и содержащей все необходимые сведения без предоставления заявления на регистрацию клиентов (Субклиентов). При регистрации клиентов и Субклиентов Участника клиринга на основании информации, полученной от Организатора торговли и (или) технического центра, Участник клиринга обязан направить в КЦ документы для целей идентификации Бенефициаров дохода и Посредников по Ценным бумагам иностранных эмитентов (в порядке, определенном статьей 46 настоящих Правил).

Регистрация клиентов и Субклиентов Участников клиринга означает присвоение им Регистрационного кода и внесение информации о них в реестр Участников клиринга, клиентов и Субклиентов. Регистрационный код клиента или Субклиента Участника клиринга присваивается КЦ в течение 5 (пяти) рабочих дней с даты представления Участником клиринга заявления на регистрацию клиентов и иных необходимых документов (при отсутствии оснований для отказа в регистрации).

При регистрации клиента или Субклиента Участника клиринга КЦ присваивает им также краткие коды клиентов Участника клиринга. Краткий код клиента Участника клиринга присваивается на основании информации, указанной в заявлении на регистрацию клиентов Участник клиринга, и может состоять из букв, цифр или их сочетаний.

КЦ вправе присваивать также дополнительные коды клиентам и Субклиентам Участника клиринга в порядке, предусмотренном настоящими Правилами.

Информация о присвоенных кодах клиентам или Субклиентам Участника клиринга или об отказе в их регистрации доводится до сведения Участника клиринга путем направления уведомления в форме Электронного документа, подписанного Электронной подписью.

Клиент или Субклиент Участника клиринга может быть исключен из реестра клиентов и Субклиентов Участников клиринга на основании заявления на deregистрацию клиента. В указанном заявлении указывается Регистрационный код клиента или Субклиента Участника клиринга, а также может быть указана дата, начиная в которую клиент или Субклиент Участник клиринга должен быть исключен из реестра Участников клиринга, клиентов и Субклиентов, но не ранее 5 (пяти) рабочих дней после представления заявления в КЦ.

11.12. Если законодательством не установлено иное, КЦ вправе не осуществлять регистрацию Заявителя, не осуществлять регистрацию (приостановить или прекратить действие регистрации) клиента или Субклиента Участника клиринга, а также приостановить или прекратить клиринговое обслуживание Участника клиринга, в том числе в части операций, совершаемых в интересах одного, нескольких или всех клиентов и (или) Субклиентов Участника клиринга, в следующих случаях:

- в случае указания Участником клиринга в документах, представленных в КЦ, в том числе при регистрации или в целях идентификации Бенефициаров дохода и Посредников по Ценным бумагам иностранных эмитентов, неполной или недостоверной информации, а также в случае непредоставления Участником клиринга в КЦ дополнительных сведений по его запросу;

- при наличии в деятельности Участника клиринга – резидента оснований для осуществления мер по предупреждению банкротства в соответствии с законодательством Российской Федерации о несостоятельности (банкротстве), а также основания для отзыва уполномоченным органом исполнительной власти лицензии на осуществление

соответствующего вида деятельности в соответствии с законодательством Российской Федерации;

- 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, появившиеся на основании проверки отчетности в соответствии со статьей 12 настоящих Правил;

- если в отношении Заявителя (Участника клиринга), его клиента, Субклиента или их аффилированных лиц действуют меры ограничительного характера, которые введены иностранным государством, объединением иностранных государств или международной организацией и в соответствии с которыми запрещается совершение сделок, осуществление расчетов по таким сделкам или иным образом ограничиваются операции с ценными бумагами, совершаемые Заявителем (Участником клиринга), его клиентом, Субклиентом или их аффилированными лицами (далее - Ограничения);

- если Заявитель (Участник клиринга) не уведомил своевременно КЦ о применении Ограничений в отношении него, его клиента или Субклиента либо не соблюдает Ограничения или не обеспечивает их соблюдение его клиентами или Субклиентами;

- если заключение и (или) исполнение Участником клиринга, в том числе в интересах его клиентов и (или) Субклиентов, договоров, по обязательствам из которых проводится клиринг в соответствии с настоящими Правилами, и (или) исполнение возникших из указанных договоров обязательств, приведет и (или) может привести к применению Ограничений в отношении таких лиц, и (или) повлечет и (или) может повлечь возникновение ответственности и (или) применение мер воздействия в отношении КЦ;

- если Участник клиринга не предоставил КЦ затребованные КЦ документы и (или) сведения в отношении себя, своих клиентов и (или) Субклиентов, либо предоставил ее несвоевременно и (или) не в полном объеме, либо указанные документы и (или) сведения являются неточными и (или) недостоверными;

- при наличии оснований, предусмотренных требованиями процедуры «Знай своего клиента» (Know your clients), требованиями о противодействии легализации (отмыванию) доходов, полученных преступным путем, и финансировании терроризма, и (или) иными аналогичными требованиями, а также требованиями, устанавливающими налоговый контроль в соответствии с законодательством Российской Федерации, законодательством иностранных государств и (или) международными договорами;

- если клиринговое обслуживание Участника клиринга, его клиента или Субклиента или регистрация указанных лиц повлечет и (или) может повлечь нарушение КЦ требований законодательства Российской Федерации, иного применимого законодательства и (или) договорных обязательств.

11.13. КЦ не несет ответственности перед Участником клиринга, его клиентом и Субклиентом за непроведение и (или) несвоевременное проведение операций по договору об оказании клиринговых услуг, включая случаи блокировки третьими лицами активов (ценных бумаг, денежных средств) Участника клиринга, его клиента или Субклиента, по причинам, не зависящим от КЦ и (или) связанным с действиями (бездействием) третьих лиц, в том числе:

- при блокировании третьими лицами операций с ценными бумагами / денежными средствами Участника клиринга, его клиента или Субклиента;

- при распространении Ограничений на Участника клиринга, его клиента или Субклиента или их аффилированных лиц;

- если Участник клиринга не предоставил КЦ затребованные КЦ документы и (или) сведения в отношении себя, своих клиентов и (или) Субклиентов, либо предоставил

ее несвоевременно и (или) не в полном объеме, либо указанные документы и (или) сведения являются неточными и (или) недостоверными;

- при отказе в оказании услуг КЦ и (или) третьими лицами по основаниям, предусмотренным требованиями процедуры «Знай своего клиента» (Know your clients), требованиями о противодействии легализации (отмыванию) доходов, полученных преступным путем, и финансировании терроризма, и (или) иными аналогичными требованиями, а также требованиями, устанавливающими налоговый контроль в соответствии с законодательством Российской Федерации, законодательством иностранных государств и (или) международными договорами.

11.14. Участник клиринга обязан уведомить КЦ о факте применения Ограничений к нему, его клиенту или Субклиенту незамедлительно с момента, когда соответствующее лицо узнало и (или) должно было узнать о применении в отношении него Ограничений.

Участник клиринга обязуется соблюдать и обеспечить соблюдение его клиентами и Субклиентами Ограничений, а также обязуется возместить убытки, возникшие у КЦ в связи с распространением Ограничений на указанных лиц.

11.15. КЦ вправе также приостановить или прекратить клиринговое обслуживание Участника клиринга и (или) приостановить или прекратить действие регистрации одного, нескольких или всех клиентов и (или) Субклиентов Участника клиринга в случае нарушения Участником клиринга требований применимого законодательства или настоящих Правил, в случае, если осуществление клирингового обслуживания Участника клиринга привело или может привести к нарушению КЦ требований применимого законодательства и настоящих Правил, а также в случае получения КЦ соответствующего заявления Участника клиринга.

КЦ вправе использовать информацию, ставшую общеизвестной, для принятия решения о приостановлении или прекращении клирингового обслуживания Участника клиринга (о приостановлении или прекращении действия регистрации клиента или Субклиента Участника клиринга).

11.16. Приостановление клирингового обслуживания Участника клиринга означает запрет на осуществление клиринга по Договорам / Внебиржевым договорам / Внебиржевым договорам ОТС, заключаемым соответствующим Участником клиринга в течение срока действия такого приостановления, а также запрет на заключение в течение указанного срока договоров, по обязательствам из которых должен проводиться клиринг с участием центрального контрагента. При этом ранее уплаченная плата за предоставление этому Участнику клиринга допуска к клиринговому обслуживанию не возвращается.

На срок приостановления клирингового обслуживания Участника клиринга приостанавливается действие регистрации его клиентов и Субклиентов.

Приостановление клирингового обслуживания Участника клиринга не влечет приостановления или прекращения действия договора об оказании клиринговых услуг, заключенного с этим Участником клиринга.

Приостановление действия регистрации клиента или Субклиента Участника клиринга означает запрет на осуществление клиринга по Договорам / Внебиржевым договорам / Внебиржевым договорам ОТС, расчеты по которым осуществляются за счет соответствующего клиента или Субклиента и которые заключаются соответствующим Участником клиринга в течение срока действия такого приостановления, а также запрет на заключение в течение указанного срока договоров, по обязательствам из которых должен проводиться клиринг с участием центрального контрагента и расчеты по которым должны осуществляться за счет соответствующего клиента или Субклиента.

Допускается частичное приостановление клирингового обслуживания Участника клиринга или приостановление действия регистрации клиента или Субклиента Участника клиринга, в том числе по видам договоров, по которым проводится клиринг в соответствии с настоящими Правилами.

Допуск к клиринговому обслуживанию (действие регистрации клиента или Субклиента Участника клиринга) возобновляется по решению КЦ в течение 5 (пяти) рабочих дней после прекращения действия обстоятельств, являвшихся основанием для приостановления клирингового обслуживания (для приостановления действия регистрации клиента или Субклиента Участника клиринга), при условии соблюдения требований к Участнику клиринга.

Возобновление клирингового обслуживания Участника клиринга означает также возобновление действия регистрации клиентов и Субклиентов Участника клиринга, кроме случаев, когда действие регистрации клиентов или Субклиентов Участника клиринга было приостановлено или прекращено по иным основаниям.

11.17. Прекращение клирингового обслуживания Участника клиринга означает запрет на осуществление клиринга обязательств по договорам, заключаемым соответствующим Участником клиринга с момента вступления в силу решения о прекращении клирингового обслуживания, а также запрет на заключение с указанного момента договоров, по обязательствам из которых должен проводиться клиринг с участием центрального контрагента. При этом ранее уплаченная плата за предоставление допуска к клиринговому обслуживанию не возвращается.

С момента прекращения клирингового обслуживания Участника клиринга прекращается действие регистрации его клиентов и Субклиентов.

Прекращение действия регистрации клиента или Субклиента Участника клиринга означает запрет на осуществление клиринга обязательств по договорам, расчеты по которым осуществляются за счет соответствующего клиента или Субклиента Участника клиринга и которые заключаются соответствующим Участником клиринга с момента вступления в силу решения о прекращении действия регистрации его клиента или Субклиента, а также запрет на заключение с указанного момента договоров, по обязательствам из которых должен проводиться клиринг с участием центрального контрагента и расчеты по которым должны осуществляться за счет соответствующего клиента или Субклиента.

11.18. КЦ информирует Участника клиринга о приостановлении и возобновлении действия регистрации его клиентов и Субклиентов посредством направления по Системе электронного документооборота сообщения по форме, установленной Регламентом обмена информацией.

КЦ информирует Участника клиринга о прекращении регистрации его клиентов и Субклиентов путем направления уведомления в форме Электронного документа, подписанного Электронной подписью.

11.19. КЦ вправе передать Организатору торговли и (или) техническому центру информацию об Участнике клиринга, его клиенте или Субклиенте, которой обладает КЦ и которая может быть использована Организатором торговли в целях предоставления допуска к участию в Торгах и (или) техническим центром для целей заключения Внебиржевых договоров ОТС, включая информацию обо всех кодах, присвоенных Участнику клиринга, клиенту или Субклиенту Участника клиринга в соответствии с настоящими Правилами.

11.20. КЦ ведет реестр Участников клиринга, клиентов и Субклиентов, который содержит следующие сведения:

- полное наименование Участника клиринга (для юридических лиц);
- код (коды) Участника клиринга, присвоенные КЦ;
- код (коды) клиента Участника клиринга, присвоенные КЦ;
- код (коды) Субклиента Участника клиринга, присвоенные КЦ;
- место нахождения, номер телефона, факса, адрес электронной почты Участника клиринга;

- дату включения Участника клиринга (дату регистрации в качестве Участника клиринга), каждого клиента и Субклиента Участника клиринга в реестр Участников клиринга, клиентов и Субклиентов;

- фамилию, имя, отчество (при наличии) и должность единоличного исполнительного органа Участника клиринга;

- информацию об исключении Участника клиринга, каждого клиента и Субклиента Участника клиринга из реестра Участников клиринга, клиентов и Субклиентов.

Реестр Участников клиринга, клиентов и Субклиентов может содержать дополнительную информацию.

КЦ вправе вести отдельный реестр клиентов и Субклиентов Участников клиринга. В этом случае сведения о клиентах Участника клиринга и Субклиентах Участника клиринга в реестр Участников клиринга не включаются.

11.21. В случае прекращения действия договора об оказании клиринговых услуг КЦ возвращает Участнику клиринга имущество, являющееся индивидуальным клиринговым обеспечением, а также имущество, являющееся коллективным клиринговым обеспечением и составляющее взнос Участника клиринга в Гарантимальный фонд участников, учитываемый на дату прекращения действия договора об оказании клиринговых услуг, или денежные средства. При этом если в соответствии с настоящими Правилами и решением КЦ по взносам Участников клиринга в Гарантимальный фонд начисляются проценты, которые включаются в состав взноса в Гарантимальный фонд или в состав Средств обеспечения, то сумма денежных средств, подлежащих возврату Участнику клиринга, определяется с учетом фактически полученных процентов на день прекращения договора об оказании клиринговых услуг. Проценты начисленные, но не выплаченные на день прекращения договора об оказании клиринговых услуг, включаются в состав взноса Участника клиринга в Гарантимальный фонд или в состав Средств обеспечения и подлежат возврату в соответствии с настоящим пунктом.

Возврат денежных средств в российских рублях и (или) иностранной валюте, являющихся Средствами обеспечения и (или) средствами Гарантимального фонда, осуществляется не позднее 3 (трех) рабочих дней с даты прекращения действия договора об оказании клиринговых услуг, за исключением случаев, указанных в статье 48 настоящих Правил. Возврат денежных средств осуществляется на Счет, зарегистрированный в КЦ. В случае отсутствия у Участника клиринга такого Счета в валюте, соответствующей валюте денежных средств, подлежащих возврату, КЦ вправе без поручения Участника клиринга осуществить замену валюты денежных средств в сумме, равной сумме денежных средств, подлежащих возврату. В случае отсутствия у Участника клиринга Счета, зарегистрированного в КЦ, КЦ осуществляет возврат денежных средств на банковский счет Участника клиринга, указанный в заключённом с КЦ договоре об оказании клиринговых услуг.

Возврат ценных бумаг в случае прекращения действия договора об оказании клиринговых услуг производится при наличии зарегистрированного в КЦ счета депо и при условии совершения Участником клиринга действий, требуемых для совершения операции по зачислению ценных бумаг на указанный счет депо. В случае прекращения действия договора об оказании клиринговых услуг КЦ не принимает от лица, которому открыт указанный счет, или лица, которое вправе в соответствии с законодательством Российской Федерации, представлять интересы лица, которому открыт указанный счет, поручения на зачисление ценных бумаг на Субсчет депо.

По усмотрению КЦ его обязательство по возврату Средств обеспечения/ средств Гарантимального фонда в ценных бумагах может быть прекращено с возникновением обязательства по перечислению Участнику клиринга денежных средств в сумме, рассчитанной исходя из количества ценных бумаг и расчетной цены соответствующей

ценной бумаги по состоянию на дату прекращения договора об оказании клиринговых услуг.

Статья 12. Требования к Участникам клиринга по предоставлению финансовой отчетности в КЦ и их финансовой устойчивости

12.1. В целях оказания клиринговых услуг КЦ предъявляет к Участникам клиринга требования к финансовой устойчивости, которые должны соблюдаться в течение всего срока клирингового обслуживания:

12.1.1. Участники клиринга – российские кредитные организации должны соответствовать следующим требованиям к финансовой устойчивости:

- соблюдение обязательных нормативов Банка России, установленных для кредитных организаций;
- соблюдение требований Банка России к минимальному размеру собственных средств (капитала), установленных для кредитных организаций;
- отсутствие оснований для осуществления мер по предупреждению банкротства в соответствии с законодательством Российской Федерации о несостоятельности (банкротстве) кредитных организаций, а также оснований для отзыва Банком России лицензии на осуществление банковских операций в соответствии с законодательством Российской Федерации о банковской деятельности.

12.1.2. Участники клиринга – российские некредитные организации должны соответствовать следующим требованиям к финансовой устойчивости:

- соблюдение требований Банка России к минимальному размеру собственных средств (если Участник клиринга является профессиональным участником рынка ценных бумаг);
- отсутствие оснований для осуществления мер по предупреждению банкротства в соответствии с законодательством Российской Федерации о несостоятельности (банкротстве).

12.1.3. Участники клиринга – нерезиденты должны соответствовать следующим требованиям к финансовой устойчивости:

- соблюдение обязательных нормативов, установленных компетентным органом государства учреждения Участника клиринга в соответствии с законодательством указанного государства;
- отсутствие оснований для отзыва специального разрешения, выданного компетентным органом государства учреждения Участника клиринга - кредитной организации, на основании которого указанный Участник клиринга вправе осуществлять банковские операции;
- отсутствие оснований для приостановления и (или) прекращения Участником клиринга осуществления брокерской деятельности (если Участник клиринга осуществляет указанную деятельность).

12.2. Участники клиринга обязаны незамедлительно уведомлять КЦ о своем несоответствии требованиям, указанным в настоящей статье.

12.3. Участники клиринга, к финансовой устойчивости которых настоящими Правилами установлены требования, обязаны предоставлять в КЦ финансовую отчетность, в объеме и сроки, установленные Приложением №2 к настоящим Правилам, а также дополнительно по запросу КЦ в объеме и сроки, определенные запросом КЦ. Такие Участники клиринга обязаны также предоставлять КЦ по его запросу любую иную информацию для оценки их финансового состояния, в объеме и сроки, определенные запросом КЦ.

Указанная отчетность или иная информация предоставляется в КЦ в виде Электронного документа, подписанного Электронной подписью, или в бумажном виде, за исключением следующих случаев:

- если отчетность или иная информация в соответствии с требованиями Банка России раскрывается на официальном сайте Банка России в сети Интернет, то указанная отчетность или иная информация считается предоставленной КЦ с момента ее размещения на указанном сайте;

- если отчетность или иная информация в соответствии с требованиями Банка России раскрывается на сайте Участника клиринга в сети Интернет, то указанная отчетность или иная информация считается предоставленной КЦ с момента ее размещения на указанном сайте при условии, что адрес такого сайта указан в Анкете Заявителя, предоставленной в КЦ.

12.4. Участники клиринга - нерезиденты, к финансовой устойчивости которых настоящими Правилами установлены требования, обязаны предоставлять в КЦ финансовую отчетность в течение 2 (двух) месяцев после ее составления и (или) предоставления в соответствии с законодательством государства учреждения соответствующего Участника клиринга.

Финансовая отчетность Участника клиринга - нерезидента предоставляется КЦ в виде Электронного документа, подписанного Электронной подписью, или в бумажном виде.

Статья 13. Допуск к клиринговому обслуживанию, приостановление, возобновление и прекращение допуска к клиринговому обслуживанию

13.1. Допуск к клиринговому обслуживанию предоставляется Участнику клиринга одновременно с регистрацией в качестве Участника клиринга при условии соблюдения всех установленных требований.

Одновременно с принятием решения о допуске Участника клиринга к клиринговому обслуживанию КЦ присваивает указанному Участнику клиринга краткий код Участника клиринга. Краткий код Участника клиринга соответствует Идентификатору Участника клиринга.

Участник клиринга вправе зарегистрировать дополнительные краткие коды Участника клиринга путем предоставления заявления по форме, предусмотренной Регламентом клиринга.

КЦ информирует Участника клиринга о принятом решении о допуске Участника клиринга к клиринговому обслуживанию или о непредставлении допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию путем направления уведомления по адресу, указанному в Анкете Заявителя или путем направления уведомления в форме Электронного документа, подписанного Электронной подписью.

КЦ информирует Участника клиринга о присвоенном ему кратком коде Участника клиринга путем направления уведомления в форме Электронного документа, подписанного Электронной подписью.

13.2. КЦ имеет право приостановить допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию в случаях, предусмотренных статьями 11 настоящих Правил, а также в следующих случаях:

- в случае нарушения требований, предъявляемых к Участнику клиринга в соответствии с настоящими Правилами, нарушения им обязанностей, предусмотренных настоящими Правилами, недостоверности заверений об обстоятельствах, предоставленных Участником клиринга в соответствии с настоящими Правилами, неполноты и (или) недостоверности информации, предоставленной Участником клиринга в КЦ;

- в случае нарушения обязанности Участника клиринга по внесению или увеличению взноса в Гарантийный фонд участников (в случае формирования Гарантийного фонда участников);

- на основании уведомления одного или нескольких Организаторов торговли о приостановлении допуска к участию в Торгах Участника клиринга, являющегося Участником торгов;
- в случае получения от одного или нескольких Организаторов торговли уведомления о прекращении допуска Участника клиринга, являющегося Участником торгов, к участию в Торгах;
- при отсутствии у Участника клиринга хотя бы одного зарегистрированного ТКС;
- при закрытии Участнику клиринга Субсчета депо, входящего в состав зарегистрированного ТКС;
- при отсутствии зарегистрированного в КЦ Счета для возврата денежных средств или счета депо для возврата ценных бумаг;
- при получении КЦ от Участника клиринга заявления о приостановлении клирингового обслуживания;
- в случае отзыва специального разрешения, выданного компетентным органом государства учреждения Участника клиринга – иностранной кредитной организации, на основании которого указанный Участник клиринга вправе осуществлять банковские операции (для Участников клиринга - нерезидентов).

13.3. Заявление Участника клиринга о приостановлении клирингового обслуживания предоставляется КЦ в бумажной форме или в форме Электронного документа, подписанного Электронной подписью. Указанное заявление может содержать дату, с которой Участник клиринга просит приостановить клиринговое обслуживание, которая не может наступить ранее 1 (одного) рабочего дня с даты получения КЦ указанного заявления, и (или) период времени, на который Участник клиринга просит приостановить клиринговое обслуживание. КЦ вправе отказать Участнику клиринга в приостановлении клирингового обслуживания при наличии у данного Участника клиринга неисполненных обязательств, направив соответствующее уведомление Участнику клиринга.

13.4. КЦ продолжает осуществлять клиринг и иные функции, связанные с осуществлением клиринга по обязательствам данного Участника клиринга, возникшим из Договоров / Внебиржевых договоров / Внебиржевых договоров ОТС, заключенных данным Участником клиринга до момента приостановления допуска к клиринговому обслуживанию.

13.5. Решение о приостановлении клирингового обслуживания принимается КЦ. Указанное решение вступает в силу с начала Расчетного дня, следующего за днем принятия указанного решения, если иная дата вступления в силу не установлена КЦ. Приостановление клирингового обслуживания не влечет приостановление действия или прекращение договора об оказании клиринговых услуг.

13.6. КЦ возобновляет допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию в рабочий день, следующий за днем, когда КЦ получил достаточную информацию (документы), подтверждающие устранение причин, послуживших основанием для такого приостановления, или, если допуск к клиринговому обслуживанию был приостановлен по заявлению Участника клиринга, в рабочий день, следующий за днем, когда КЦ получил заявление Участника клиринга о возобновлении допуска к клиринговому обслуживанию, при условии соблюдения Участником клиринга требований, предусмотренных статьями 10 настоящих Правил.

13.7. КЦ вправе прекратить допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию в случаях, предусмотренных статьями 11 настоящих Правил, а также прекращает указанный допуск в следующих случаях:

- в случае прекращения действия договора об оказании клиринговых услуг;
- в случае неисполнения требований, предусмотренных статьями 10 настоящих Правил, в течение 6 (шести) месяцев подряд;

- в случае отзыва (аннулирования) Банком России лицензии на осуществление банковских операций у Участника клиринга – российской кредитной организации;
- в случае назначения временной администрации или принятия арбитражным судом решения о введении в отношении Участника клиринга одной из процедур банкротства;
- в случае реорганизации или ликвидации Участника клиринга (при этом КЦ вправе не прекращать допуск к клиринговому обслуживанию в случае реорганизации Участника клиринга, которая не влечет прекращения его деятельности);
- в случае получения от всех Организаторов торговли уведомления о прекращении допуска Участника клиринга, являющегося Участником торгов, к участию в Торгах;
- в случае получения от Участника клиринга заявления о прекращении клирингового обслуживания.

13.8. Заявление Участника клиринга о прекращении клирингового обслуживания представляется КЦ в бумажной форме или в форме Электронного документа, подписанного Электронной подписью. Указанное заявление должно содержать дату, с которой Участник клиринга просит прекратить клиринговое обслуживание, которая не может наступить ранее 1 (одного) рабочего дня с даты получения КЦ указанного заявления. КЦ вправе отказать Участнику клиринга в прекращении клирингового обслуживания при наличии у данного Участника клиринга неисполненных обязательств, направив Участнику клиринга соответствующее уведомление.

13.9. Решение КЦ о прекращении клирингового обслуживания Участника клиринга вступает в силу с начала Расчетного дня, следующего за днем принятия указанного решения, если иная дата вступления в силу не установлена КЦ. Если указанное решение принято КЦ на основании заявления Участника клиринга о прекращении клирингового обслуживания, оно вступает в силу с даты, указанной в заявлении.

13.10. Прекращение допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию означает исключение информации об Участнике клиринга, его клиентах и Субклиентах из реестра Участников клиринга, клиентов и Субклиентов и влечёт прекращение действия договора об оказании клиринговых услуг. Действие договора об оказании клиринговых услуг прекращается в дату исключения информации об Участнике клиринга и клиентах и Субклиентах Участника клиринга из реестра Участников клиринга, клиентов и Субклиентов. КЦ не оказывает Участнику клиринга клиринговых услуг с момента исключения Участника клиринга из реестра Участников клиринга, клиентов и Субклиентов.

13.11. Порядок прекращения допуска к клиринговому обслуживанию в случае отзыва Банком России лицензии на осуществление банковских операций у Участника клиринга – кредитной организации, а также в случае введения процедур банкротства в отношении Участника клиринга, не являющегося кредитной организацией, определен в статье 48 настоящих Правил.

13.12. КЦ извещает Участника клиринга и Организатора торговли о приостановлении, возобновлении и прекращении допуска соответствующего Участника клиринга к клиринговому обслуживанию в течение 1 (одного) рабочего дня после принятия соответствующего решения КЦ путем направления соответствующего уведомления в адрес Участника клиринга и Организатора торговли в виде Электронного документа, подписанного Электронной подписью, и (или) в бумажном виде.

13.13. КЦ вправе на Сайте КЦ раскрывать информацию о нарушениях Участниками клиринга требований настоящих Правил, в том числе, о фактах неисполнения ими обязательств, допущенных к клирингу.

Статья 14. Оплата услуг КЦ и Организатора торговли

14.1. Если иное не предусмотрено настоящими Правилами, КЦ рассчитывает и взимает с Участников клиринга:

- сумму платы за оказание клиринговых услуг, а также иные платежи, предусмотренные настоящими Правилами или тарифами КЦ, включая вознаграждение за учет индивидуального клирингового обеспечения и вознаграждение за учет коллективного клирингового обеспечения, и возмещение расходов КЦ (далее – Клиринговый сбор);

- сумму платы за оказание услуг по проведению Торгов, а также иные платежи в пользу Организатора торговли, предусмотренные Правилами торговли или тарифами Организатора торговли (далее - Торговый сбор).

14.2. Размер Клирингового сбора рассчитывается КЦ в соответствии с установленными КЦ тарифами. Тарифы КЦ устанавливаются решением совета директоров КЦ и раскрываются на Сайте КЦ.

В состав Клирингового сбора включаются также суммы возмещения следующих расходов КЦ:

- 1) расходов, связанных с ведением Клирингового счета депо и Субсчетов депо, в том числе расходов, связанных с возмещением Расчетным депозитарием затрат депозитариям или иностранным лицам, осуществляющим учет прав на ценные бумаги, которыми Расчетному депозитарию открыты счета, на которых учитываются ценные бумаги, учитываемые на Субсчетах депо;

- 2) расходов, связанных с осуществлением прав по ценным бумагам, учитываемым на Субсчетах депо, в том числе прав на получение доходов по указанным ценным бумагам (включая суммы, выплачиваемые при погашении облигаций), прав на получение денежных средств и (или) ценных бумаг в результате реорганизации эмитента указанных ценных бумаг или, в случае депозитарных расписок, эмитента представляемых ценных бумаг, и (или) конвертации указанных ценных бумаг, и (или) иных аналогичных обстоятельств, в том числе:

- расходов, связанных с получением КЦ и направлением лицам, которые в соответствии с применимым правом составляют список лиц, осуществляющих права по указанным ценным бумагам, сведений, необходимых для составления такого списка, включая сведения об Участниках клиринга, их клиентах и Субклиентах;

- расходов, связанных с получением КЦ и перечислением лицам, на имя которых открыты Субсчета депо, денежных средств и (или) ценных бумаг, в том числе доходов по указанным ценным бумагам;

- иных расходов, связанных с осуществлением прав по указанным ценным бумагам, включая расходы по уплате налогов на доходы по указанным ценным бумагам, и (или) иных аналогичных платежей, а также расходы, связанные с возвратом излишне или ошибочно выплаченных сумм денежных средств и (или) ценных бумаг;

- 3) иных расходов, подлежащих возмещению Участниками клиринга в соответствии с настоящими Правилами или тарифами КЦ.

14.3. Размер Торгового сбора рассчитывается КЦ в соответствии с тарифами Организатора торговли на основании договора, заключенного между КЦ и Организатором торговли, за исключением случаев, если указанными тарифами или Правилами торговли предусмотрено, что Торговый сбор рассчитывается и взимается непосредственно Организатором торговли.

14.4. Обязательства по уплате сборов, взимаемых КЦ с Участников клиринга, допускаются к клирингу на основании информации о размерах сборов, рассчитанных КЦ, в том числе на основании информации, полученной КЦ от Организатора торговли. При этом обязательства по уплате сборов, связанных с заключением Договоров, допускаются к клирингу с момента получения КЦ информации о регистрации соответствующего

Договора в реестре Договоров, а обязательства по уплате иных сборов, допускаются к клирингу с момента возникновения оснований для взимания соответствующих сборов.

14.5. Если иное не предусмотрено настоящим пунктом или тарифами КЦ, допущенные к клирингу обязательства по уплате сборов, взимаемых в связи с заключением Участниками клиринга Договоров / Внебиржевых договоров / Внебиржевых договоров ОТС, включаются в клиринговый пул для расчетов по итогам Торгов в дату заключения Участниками клиринга соответствующих договоров, а в случае заключения указанных договоров по истечении времени формирования клирингового пула для расчетов по итогам Торгов – в ближайший клиринговый пул для расчетов по итогам Торгов, формируемый после даты заключения соответствующего договора. Обязательства по уплате сборов, взимаемых в связи с заключением Участниками клиринга Пар договоров, в том числе Донорских договоров купли-продажи включаются в клиринговый пул для расчетов по итогам Торгов в дату заключения Пары договоров и (или) в дату получения Поручения на клиринг внебиржевых договоров.

Допущенные к клирингу обязательства по оплате сборов, взимаемых в связи с заключением Участниками клиринга Договоров / Внебиржевых договоров / Внебиржевых договоров ОТС (за исключением сборов, взимаемых в связи с заключением Договоров на основании Заявок, в которых указаны одинаковые ТКС, после времени начала формирования клирингового пула по Договорам), могут быть включены в клиринговый пул для расчетов по итогам Торгов в Дату исполнения Договора / дату исполнения Внебиржевого договора / дату исполнения Внебиржевого договора ОТС / Дату расчетов Договора ПФИ, в связи с заключением которого взимаются соответствующие сборы, по заявлению Участника клиринга, подаваемого в КЦ по форме, установленной в Регламенте клиринга.

Обязательства по уплате сборов, взимаемых в связи с заключением Участниками клиринга Пар договоров, в том числе Донорских договоров, включаются в клиринговый пул для расчетов по итогам торгов в дату исполнения Второго договора, составляющего Пару договоров.

14.6. Обязательства по уплате сборов, взимаемых КЦ с Участником клиринга, которые рассчитываются в отношении ТКС Участника клиринга-Продавца, не допускаются к клирингу и подлежат исполнению путем оплаты Участниками клиринга счетов, выставляемых им КЦ.

РАЗДЕЛ III. МЕРЫ, НАПРАВЛЕННЫЕ НА УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ

Статья 15. Способы снижения рисков при осуществлении клиринга

15.1. В целях снижения рисков, связанных с осуществлением клиринга, КЦ:

- предъявляет требования к финансовой устойчивости Участников клиринга и осуществляет мониторинг финансовой устойчивости Участников клиринга не реже одного раза в квартал;
- проверяет соответствие Участников клиринга требованиям, предъявляемым КЦ к Участникам клиринга;
- предъявляет к Участникам клиринга требование о внесении Средств обеспечения;
- осуществляет предварительный контроль достаточности Средств обеспечения по каждому Участнику клиринга при подаче Заявок на заключение Договоров, при направлении Поручений на клиринг внебиржевых договоров и Оферт ОТС, в которых указан данный Участник клиринга (в случае осуществления указанного контроля);
- осуществляет расчет и контроль Доступных средств при подаче Заявок, при направлении Поручений на клиринг внебиржевых договоров и Оферт ОТС, при заключении Договоров / Внебиржевых договоров / Внебиржевых договоров ОТС, при принятии Поручений на клиринг внебиржевых договоров к исполнению, при исполнении/

прекращении обязательств из Договоров, Внебиржевых договоров и Внебиржевых договоров ОТС, при возврате Средств обеспечения;

- устанавливает риск-параметры и лимиты в соответствии с Методикой установления и изменения риск-параметров;

- формирует Гарантийный фонд/Гарантийные фонды для обеспечения исполнения обязательств, допущенных к клирингу;

- не реже одного раза в течение Расчетного дня осуществляет переоценку Гарантийного обеспечения, Дополнительного обеспечения, Средств обеспечения и контроль достаточности Доступных средств, в случае недостаточности – предъявляет Участнику клиринга Маржинальное требование;

- не реже одного раза в течение Расчетного дня осуществляет переоценку стоимости иностранной валюты и ценных бумаг, учитываемых в качестве взносов в Гарантийные фонды, и в случае недостаточности – предъявляет Участнику клиринга требование по пополнению взносов в Гарантийный фонд;

- обеспечивает контроль за проведением Расчетным депозитарием операций по Субсчетам депо на основании поручений КЦ;

- ограничивает размер своей ответственности в соответствии со статьей 17 настоящих Правил;

- принимает иные меры, направленные на снижение рисков осуществления клиринговой деятельности, в соответствии с требованиями внутренних документов КЦ.

15.2. КЦ устанавливает перечень иностранных валют и ценных бумаг, принимаемых в качестве Средств обеспечения, в порядке, установленном статьей 23 настоящих Правил.

15.3. Ценные бумаги, эмитентом которых является Участник клиринга или связанное с ним лицо, учитываемые по ТКС, в состав которого входит Субсчет депо владельца такого Участника клиринга, учитываются при определении стоимости Средств обеспечения в соответствии с Методикой установления и изменения риск-параметров с дисконтом 100%. При этом связанность эмитентов определяется в соответствии со статьей 64 Федерального закона «О Центральном банке Российской Федерации (Банке России)».

Ценные бумаги, эмитентом которых является Участник клиринга или связанное с ним лицо, не учитываются в качестве взноса в Гарантийный фонд такого Участника клиринга.

15.4. КЦ устанавливает Лимит риска концентрации на одного эмитента, в порядке, определенном Методикой установления и изменения риск-параметров. При достижении Лимита риска концентрации на одного эмитента КЦ производит пересчет величины Дополнительного обеспечения с учетом уменьшения стоимости Средств обеспечения Участников клиринга, на ТКС которых учитываются ценные бумаги данного эмитента, в порядке, установленном Методикой расчета Гарантийного обеспечения.

15.5. КЦ вправе утвердить список ценных бумаг, в отношении которых Участник клиринг вправе заключать Договоры / Внебиржевые договоры ОТС, в которых Участник клиринга действует на стороне продавца, только на условиях полного обеспечения, то есть при условии внесения этим Участником клиринга в качестве Средств обеспечения ценных бумаг в составе и количестве, достаточном для надлежащего исполнения обязательств по указанным договорам (далее – Список ценных бумаг с полным обеспечением). Список ценных бумаг с полным обеспечением публикуется на Сайте КЦ.

Статья 16. Обеспечение исполнения обязательств Участников клиринга. Условия соглашения об индивидуальном клиринговом обеспечении и коллективном клиринговом обеспечении

16.1. Если иное не предусмотрено Федеральным законом «О клиринге, клиринговой деятельности и центральном контрагенте» и принятыми в соответствии с ним нормативными актами, а также настоящими Правилами, обязательства Участников

клиринга, допущенные к клирингу, обеспечиваются индивидуальным клиринговым обеспечением и коллективным клиринговым обеспечением.

Допущенные к клирингу обязательства Участника клиринга - Продавца, обязательства Участников клиринга, возникшие из Договоров, в которых указан Код расчетов Оп и Код расчетов OkOp, а также обязательства, возникшие из Внебиржевых договоров, если в Поручении на клиринг внебиржевых договоров Участник клиринга указал на отсутствие обеспечения по указанному договору, не обеспечиваются индивидуальным клиринговым обеспечением и коллективным клиринговым обеспечением.

16.2. Условием обеспечения исполнения допущенных к клирингу обязательств Участников клиринга является обязательное предварительное резервирование Участниками клиринга на Клиринговых денежных счетах денежных средств и/или на Субсчетах депо ценных бумаг для прохождения процедуры контроля обеспечения в порядке, определенном статьей 25 настоящих Правил.

Для целей обеспечения исполнения и (или) исполнения обязательств, возникающих из Договора, в котором указан Код расчетов X0, Код расчетов W0, Код расчетов U0 или Код расчетов Y0, Участник клиринга обязан предоставить в качестве Средств обеспечения исключительно имущество, являющееся предметом обязательства, возникшего из соответствующего Договора, в объеме не меньшем требуемому для исполнения обязательств, возникающего из каждого соответствующего Договора.

Обеспечение исполнения и исполнение обязательств, возникающих из Договора ПФИ, производится в порядке и на условиях, определенных Спецификацией соответствующего Договора ПФИ.

КЦ вправе требовать обеспечения исполнения допущенных к клирингу обязательств по денежным средствам в полном объеме до даты исполнения Договоров / Внебиржевых договоров ОТС. В случае принятия такого решения КЦ определяет дату заключения Договоров / Внебиржевых договоров ОТС, начиная с которой будет применяться данное требование, а также перечень ценных бумаг, при заключении Договоров / Внебиржевых договоров ОТС с которыми необходимо внесение полного денежного обеспечения, и (или) перечень Договоров ПФИ и срок до даты исполнения Договоров / Внебиржевых договоров ОТС, в который данное требование должно быть исполнено. Перечень ценных бумаги (или) перечень Договоров ПФИ и срок, в который должно быть исполнено данное требование, устанавливается КЦ и публикуется на Сайте КЦ с указанием даты, начиная с которой КЦ начнет предъявлять указанное требование.

В установленный срок КЦ проверяет наличие на денежном регистре, входящем в состав ТКС, с указанием которого был заключен Договор / Внебиржевой договор ОТС, денежных средств в объеме, достаточном для исполнения обязательств по денежным средствам. В случае недостаточности денежных средств на денежном регистре у Участника клиринга возникают обязательства по уплате КЦ штрафа, определяемого следующим образом:

$$\text{Penalty} = \text{Liability} * \text{Forfeit rate prepayment} * \left(\frac{T365}{365} + \frac{T366}{366} \right),$$

где:

Penalty – величина штрафа;

Liability – величина нехватки денежных средств для обеспечения обязательств по денежным средствам в полном объеме в соответствующей валюте;

Forfeit rate prepayment – штрафная ставка, установленная КЦ в зависимости от Валюты обязательств по денежным средствам и определенная в соответствии с Методикой установления и изменения риск-параметров;

T_{365} – количество календарных дней между текущим и следующим Расчетным днем, приходящихся на календарный год, состоящий из 365 дней;

T_{366} – количество календарных дней между текущим и следующим Расчетным днем, приходящихся на календарный год, состоящий из 366 дней.

Обязательство Участника клиринга по уплате штрафа допускается к клирингу в момент его возникновения и включается в клиринговый пул для расчетов по итогам Торгов, формируемый в соответствии со статьей 35 настоящих Правил, в дату допуска указанного обязательства к клирингу.

16.3. Имущество, предназначенное для индивидуального клирингового обеспечения, могут составлять денежные средства в рублях и (или) иностранной валюте, а также ценные бумаги. Имущество, обремененное залогом, не может являться индивидуальным клиринговым обеспечением.

16.4. Имущество, являющееся предметом индивидуального клирингового обеспечения, может использоваться для обеспечения исполнения и (или) исполнения обязательств, допущенных к клирингу, в том числе итоговых нетто-обязательств.

16.5. Условием обеспечения исполнения обязательств Участника клиринга является передача имущества, составляющего индивидуальное клиринговое обеспечение, до заключения Договоров / направления Поручения на клиринг внебиржевых договоров и Оферты ОТС.

16.6. Доходы от денежных средств, являющихся предметом индивидуального клирингового обеспечения, не зачисляются в индивидуальное клиринговое обеспечение.

16.7. Индивидуальное клиринговое обеспечение учитывается на Клиринговых денежных счетах и на Субсчетах депо.

16.8. Передача имущества, предназначенного для индивидуального клирингового обеспечения, осуществляется путем зачисления денежных средств на Клиринговые денежные счета, а ценных бумаг - на Субсчета депо, указанные в статье 7 настоящих Правил.

Имущество включается КЦ в состав индивидуального клирингового обеспечения и учитывается в качестве Средств обеспечения с момента зачисления денежных средств и (или) ценных бумаг на соответствующие счета. Особенности внесения и возврата Средств обеспечения определены в статье 23 настоящих Правил.

16.9. Объем имущества, передаваемого в индивидуальное клиринговое обеспечение, определяется Участником клиринга исходя из объема Договоров, Внебиржевых договоров и Внебиржевых договоров ОТС, планируемых к заключению соответствующим Участником клиринга, и объема имеющихся неисполненных обязательств по ранее заключенным Договорам, Внебиржевым договорам и Внебиржевым договорам ОТС с учетом следующего:

- при недостаточности Доступных средств Заявка, поданная Участником клиринга, не регистрируется в реестре Заявок, Поручение на клиринг внебиржевых договоров, направленное данным Участником клиринга, не принимается к исполнению и (или) КЦ не акцептует Оферту ОТС;

- при отрицательном значении Доступных средств Участника клиринга ему предъявляется Маржинальное требование;

- итоговые нетто-обязательства Участника клиринга должны обеспечиваться индивидуальным клиринговым обеспечением на Дату исполнения, на дату исполнения Внебиржевого договора, Внебиржевого договора ОТС и (или) на Дату расчетов по ПФИ в полном объеме (за исключением случаев, когда условиями соответствующего договора предусмотрено иное): итоговое нетто-обязательство по денежным средствам в российских рублях или иностранной валюте в размере нетто-обязательства - денежными средствами в российских рублях или иностранной валюте, итоговое нетто-обязательство по ценным бумагам в размере нетто-обязательства - ценными бумагами того же эмитента, вида, категории, типа, выпуска.

16.10. Обязанность по представлению КЦ достаточного количества имущества, являющегося индивидуальным клиринговым обеспечением, возлагается на Участника клиринга.

16.11. КЦ вправе использовать в своих интересах денежные средства, являющиеся предметом индивидуального клирингового обеспечения. В этом случае денежные средства, являющиеся предметом индивидуального клирингового обеспечения, зачисляются КЦ на собственный банковский счет КЦ.

КЦ обязан возвратить в состав индивидуального клирингового обеспечения денежные средства в сумме и срок, которые необходимы для удовлетворения требований, обеспеченных индивидуальным клиринговым обеспечением.

Доходы от использования КЦ в своих интересах денежных средств, являющихся предметом индивидуального клирингового обеспечения, не зачисляются в индивидуальное клиринговое обеспечение.

16.12. КЦ в целях обеспечения исполнения обязательств, допущенных к клирингу, любого из Участников клиринга, формирует один или несколько Гарантийных фондов. Условия и порядок формирования Гарантийных фондов указаны в настоящей статье и в статье 18 настоящих Правил.

16.13. Особенности внесения и возврата взноса в Гарантийный фонд определены в статье 24 настоящих Правил.

16.14. Передача имущества, предназначенного для коллективного клирингового обеспечения, осуществляется путем зачисления денежных средств в российских рублях и (или) иностранной валюте на Клиринговые денежные счета, а также ценных бумаг на Субсчета депо, открытые к клиринговому счету депо, предназначенному для учета средств коллективного клирингового обеспечения.

16.15. КЦ вправе использовать в своих интересах денежные средства, составляющие коллективное клиринговое обеспечение. В этом случае денежные средства, составляющие коллективное клиринговое обеспечение, зачисляются КЦ на его собственный банковский счет.

КЦ обязан возвратить в состав коллективного клирингового обеспечения денежные средства в сумме и срок, которые необходимы для удовлетворения требований, обеспеченных Гарантийным фондом.

Доходы от использования КЦ в своих интересах денежных средств, являющихся предметом коллективного клирингового обеспечения, не зачисляются в коллективное клиринговое обеспечение, если решением КЦ не предусмотрено иное.

КЦ вправе принять решение о начислении и выплате процентов по взносам Участников клиринга и (или) Гарантов в Гарантийный фонд. Процентная ставка, порядок и сроки начисления и выплаты указанных процентов определяются решением КЦ. Кроме того, решением КЦ может быть предусмотрено, что указанные проценты не перечисляются Участникам клиринга (Гарантам), а включаются в состав взносов в Гарантийный фонд или (применительно к процентам по взносам Участников клиринга) включаются в состав Средств обеспечения. КЦ вправе в любое время принять решение об изменении или отмене решения о начислении и выплате процентов по взносам Участников клиринга и (или) Гарантов в Гарантийный фонд. Все решения КЦ, предусмотренные настоящим абзацем, подлежат раскрытию на Сайте КЦ не менее, чем за 3 (три) дня до их вступления в силу.

Статья 17. Ограничение ответственности центрального контрагента (уровни защиты центрального контрагента)

17.1. В случае наличия Участника клиринга, не исполнившего свои обязательства (далее – Должник), КЦ использует для исполнения своих обязательств имущество в следующей очередности:

- Средства обеспечения Должника;

- взносы Должника в Гарантйные фонды;
- собственные средства КЦ в размере Выделенного капитала;
- взносы Гарантов в специальный Гарантйный фонд;
- взносы Участников клиринга, не являющихся Должниками (далее - Добросовестные Участники клиринга), в Гарантйные фонды;
- Дополнительное обеспечение, предоставленное Добросовестными Участниками клиринга на основании требования КЦ о предоставлении Дополнительного обеспечения на общую сумму, равную оставшейся не погашенной Задолженности Должника.

Имущество каждой последующей очереди используется только в случае недостаточности имущества предыдущей очереди в порядке, установленном статьей 22 настоящих Правил.

17.2. Ответственность КЦ за неисполнение или ненадлежащее исполнение обязательств перед Добросовестными Участниками клиринга ограничена размером Выделенного капитала КЦ.

Размер Выделенного капитала КЦ составляет 200 (двести) миллионов рублей.

17.3. В случае использования Выделенного капитала КЦ принимает решение о восполнении Выделенного капитала.

Статья 18. Гарантйные фонды

18.1. КЦ формирует один или несколько Гарантйных фондов за счет взносов Участников клиринга и (или) Гарантов.

18.2. КЦ вправе формировать следующие Гарантйные фонды:

- Гарантйный фонд участников, формируемый за счет обязательных взносов Участников клиринга;
- специальный Гарантйный фонд, формируемый за счет добровольных взносов Гарантов.

18.3. Участники клиринга вносят взносы в Гарантйный фонд участников на основании уведомления КЦ и настоящих Правил.

Гаранты вносят взносы в специальный Гарантйный фонд на основании договора с КЦ.

18.4. В качестве взносов в Гарантйные фонды могут быть внесены денежные средства в российских рублях и (или) иностранной валюте, и (или) ценные бумаги.

Имущество, обремененное залогом, не может составлять Гарантйные фонды.

18.5. Перечень иностранных валют и (или) ценных бумаг, внесение которых возможно в качестве взносов в Гарантйные фонды, устанавливается внутренним документом КЦ, определяющим методику выбора и оценки иностранных валют и (или) ценных бумаг, и раскрытым на Сайте КЦ.

Предельная доля иностранной валюты, принимаемой в качестве взноса в Гарантйные фонды, составляет 100%. Указанная доля может быть уменьшена по решению КЦ.

Предельная доля ценных бумаг, принимаемых в качестве взноса в Гарантйные фонды, определяется решением КЦ и размещается на Сайте КЦ.

18.6. КЦ самостоятельно принимает решение о дате начала формирования Гарантйного фонда, о чем информирует Участников клиринга или Гарантов не позднее, чем за 10 (десять) рабочих дней до даты начала формирования Гарантйных фондов, путем направления уведомлений в виде Электронного документа, подписанного Электронной подписью, и (или) в бумажном виде.

18.7. Совокупный размер Гарантйных фондов определяется КЦ исходя из необходимости его поддержания на уровне, достаточном для покрытия потенциальных убытков КЦ в случае неисполнения или ненадлежащего исполнения допущенных к клирингу обязательств двумя крупнейшими по величине потенциальных потерь Участниками клиринга. При этом размер потенциальных убытков определяется с

доверительной вероятностью, определенной требованиями нормативных актов Банка России, с учетом Средств обеспечения таких Участников клиринга и Выделенного капитала КЦ.

Для целей определения достаточности совокупного размера Гарантийных фондов КЦ проводит процедуры стресс-тестирования и оценки точности модели центрального контрагента в соответствии с внутренними документами КЦ, определяющими правилами организации системы управления рисками. В случае если совокупный размер Гарантийных фондов недостаточен для успешного прохождения стресс-тестирования и/или один из сценариев обратного стресс-тестирования является, по оценке КЦ, правдоподобным, то КЦ принимает решение об увеличении совокупного размера Гарантийных фондов или об изменении размеров индивидуального клирингового обеспечения. В случае если стресс-тестирование пройдено успешно и ни один из сценариев обратного стресс-тестирования не является, по оценке КЦ, правдоподобным, то совокупный размер Гарантийных фондов может оставаться неизменным. КЦ может принять решение об уменьшении совокупного размера Гарантийных фондов при условии, что стресс-тестирование с использованием уменьшенного совокупного размера Гарантийных фондов пройдено успешно и ни один из сценариев обратного стресс-тестирования не является, по оценке КЦ, правдоподобным.

На основании совокупного размера Гарантийных фондов, определенного в соответствии с настоящим пунктом, КЦ устанавливает минимальный размер вноса Участника клиринга или Гаранта в соответствующий Гарантийный фонд (далее – Размер вноса) или порядок его определения. Размер вноса определяется в Валюте Доступных средств.

18.8. Информация о Размерах взносов Участников клиринга или Гарантов в Гарантийный фонд и (или) о порядке их определения направляется Участникам клиринга или Гарантам по Системе электронного документооборота и (или) размещается на Сайте КЦ.

Установленные КЦ Размеры взносов или порядок их определения должны быть одинаковыми для всех Участников клиринга одной категории. При этом порядок определения Размеров взносов может учитывать объем обязательств Участников клиринга, по которым проводился клиринг за определенный период времени, и иные показатели, которые могут иметь различные значения для различных Участников клиринга.

КЦ в порядке, определенном настоящими Правилами, и по форме, указанной в Регламенте клиринга, уведомляет Участников клиринга или Гарантов о доле имущества соответствующего Участника клиринга (Гаранта) в коллективном клиринговом обеспечении.

18.9. Лицо, не исполнившее или ненадлежащим образом исполнившее обязательство по внесению взноса в Гарантийный фонд участников или специальный гарантийный фонд, обязано возместить в полном размере убытки, причиненные КЦ в результате неисполнения или ненадлежащего исполнения им указанного обязательства.

Статья 19. Порядок расчета величины Доступных средств

19.1. Величина Доступных средств используется для проверки возможности подачи Участником клиринга Заявок в целях заключения Договоров, приема к исполнению Поручений на клиринг внебиржевых договоров и направления Оферт ОТС, прекращения обязательств из Договоров / Внебиржевых договоров ОТС, возврата Участнику клиринга Средств обеспечения, предъявления Маржинального требования и контроля за его исполнением. Указанная проверка осуществляется исходя из анализа изменения величины Доступных средств Участника клиринга как до, так и после совершения действий, указанных в пункте 19.2 настоящих Правил.

19.2. КЦ рассчитывает величину Доступных средств при изменении размера Средств обеспечения Участника клиринга, при подаче Участником клиринга Заявок на заключение Договоров, отзыве или аннулировании таких Заявок, при заключении Участником клиринга Договоров, при приеме Поручений на клиринг внебиржевых договоров и направлении Участником клиринга Оферт ОТС, исполнении / прекращении обязательств из Договоров / Внебиржевых договоров / Внебиржевых договоров ОТС, изменении риск-параметров.

19.3. Величина Доступных средств Участника клиринга рассчитывается с учетом Объявленных Заявок, направленных Поручений на клиринг внебиржевых договоров и Оферт ОТС данного Участника клиринга.

19.4. КЦ осуществляет расчет следующих величин:

19.4.1. Величина Доступных средств по каждому ТКС Участника клиринга:

$$AF_{TCA} = CLT_{TCA} - IM_{TCA}$$

где:

AF_{TCA} - величина Доступных средств по ТКС Участника клиринга в Валюте Доступных средств;

CLT_{TCA} – величина оценочной стоимости Средств обеспечения по данному ТКС, в Валюте Доступных средств. Средства обеспечения по ТКС, в состав которого входят несколько позиций по ценным бумагам, определяются как общее количество ценных бумаг, учитываемых на соответствующих депо регистрах;

IM_{TCA} - величина Гарантийного обеспечения по позициям, учтенным по регистру учета позиций/регистрам учета позиций, сгруппированным в рамках одного ТКС, объявленным Заявкам, направленным Поручениям на клиринг внебиржевых договоров и Офертам ОТС, содержащих данный ТКС, в Валюте Доступных средств.

19.4.2. Величина Доступных средств Участника клиринга:

$$AF_{CM} = \sum_{TCA \in B} AF_{TCA} - AdM + \sum_{TCA \in B} \min(AF_{TCA}; 0)$$

где:

AF_{CM} - величина Доступных средств Участника клиринга в Валюте Доступных средств;

AF_{TCA} - величина Доступных средств по ТКС Участника клиринга в Валюте Доступных средств;

$\sum_{TCA \in B}$ – сумма Доступных средств по всем ТКС Участника клиринга, кроме Обособленных ТКС (далее- Группа ТКС);

$\sum_{TCA \in B}$ – сумма Доступных средств по всем Обособленным ТКС Участника клиринга;

AdM – величина Дополнительного обеспечения, учитываемая в качестве требования КЦ к Участнику клиринга, в Валюте Доступных средств.

19.5. Величина Гарантийного обеспечения и величина Дополнительного обеспечения рассчитываются по совокупности позиций и объявленных Заявок, направленных Оферт ОТС с использованием риск-параметров, определенных в соответствии с Методикой установления и изменения риск-параметров.

19.6. Изменение риск-параметров приводит к перерасчету Гарантийного обеспечения и Дополнительного обеспечения.

19.7. Перечень Валют Доступных средств устанавливается КЦ и раскрывается на Сайте КЦ. Участник клиринга вправе выбрать одну валюту из перечня Валют Доступных средств путем подачи заявления на регистрацию Валюты Доступных средств по форме, предусмотренной Регламентом клиринга, в которой будет осуществляться расчет

Доступных средств, Гарантийного обеспечения, а также Средств обеспечения. Если Участник клиринга не выбрал Валюту Доступных средств, то таковой считаются рубли Российской Федерации.

Статья 20. Маржинальные требования

20.1. В срок, установленный Регламентом клиринга, КЦ проводит клиринговую сессию в целях переоценки стоимости Средств обеспечения и средств, составляющих взносы в Гарантийные фонды, а также обязательств и требований Участника клиринга (далее – Клиринговая сессия), в ходе которой КЦ:

- устанавливает риск-параметры в соответствии с Методикой установления и изменения риск-параметров;
- производит контроль достаточности Средств обеспечения по каждому Участнику клиринга по обязательствам, возникшим из Договоров / Внебиржевых договоров / Внебиржевых договоров ОТС;
- определяет Участников клиринга, у которых возникли Маржинальные требования и суммы указанных Маржинальных требований;
- производит контроль выполнения Участниками клиринга и (или) Гарантами требований по внесению взносов в Гарантийные фонды в Размаре взноса. В случае невыполнения Участниками клиринга или Гарантами указанного требования КЦ предъявляет к таким Участникам клиринга или Гарантам требование о пополнении взноса в Гарантийные фонды.

20.2. Маржинальное требование возникает у КЦ к Участнику клиринга, если рассчитанная в соответствии с приведенной ниже формулой величина является отрицательной величиной:

$$MC_{CM} = \sum_{TCA \in B} \min(AF_{TCA} - AdM; 0) + \sum_{TCA \in B} \min(AF_{TCA}; 0)$$

где:

MC_{CM} - величина Маржинального требования к Участнику клиринга в Валюте Доступных средств;

$\sum_{TCA \in B}$ – сумма Доступных средств по всем ТКС Участника клиринга, кроме Обособленных ТКС (далее - Группа ТКС);

$\sum_{TCA \in B}$ – сумма Доступных средств по всем Обособленным ТКС Участника клиринга;

AdM – величина Дополнительного обеспечения, учитываемая в качестве требования КЦ к Участнику клиринга, в Валюте Доступных средств.

20.3. Маржинальное требование, возникшее у Участника клиринга после проведения Клиринговой сессии, должно быть исполнено Участником клиринга не позднее времени, установленного Регламентом клиринга.

Маржинальное требование к Участнику клиринга считается исполненным, когда значение Доступных средств Участника клиринга станет неотрицательным.

20.4. Маржинальное требование должно быть исполнено Участником клиринга путем внесения Средств обеспечения в порядке, установленном статьей 23 настоящих Правил.

Маржинальное требование также считается исполненным, если в результате совершения следующих действий уменьшилась величина Гарантийного обеспечения и (или) увеличилась сумма Доступных средств:

- исполнение обязательств из Договоров с наступившей Датой исполнения, и (или) обязательств из Внебиржевых договоров ОТС с наступившей датой исполнения, и (или) обязательств из Внебиржевых договоров с наступившей датой исполнения (в случае наличия требования о внесении Средств обеспечения по указанным договорам);

- отзыв объявленных Заявок / направленных Оферт ОТС;
- заключение Договоров / Внебиржевых договоров ОТС, а также Внебиржевых договоров (в случае наличия требования о внесении Средств обеспечения по указанным договорам).

Статья 21. Последствия нарушения Маржинального требования

21.1. В случае нарушения Участником клиринга Маржинального требования КЦ применяет к нему процедуру принудительного закрытия в соответствии с настоящей статьей.

КЦ осуществляет процедуру принудительного закрытия до момента наступления одного из событий: исполнения Маржинального требования или прекращения учета обязательств и требований на регистре учета позиций, относящемся к ТКС, в отношении которого производилось принудительное закрытие.

При наличии у Участника клиринга, у которого возникло Маржинальное требование, отрицательных Доступных средств по Обособленному ТКС процедура принудительного закрытия производится в первую очередь в отношении такого ТКС до момента, когда Доступные средства Обособленного ТКС перестанут быть отрицательными. Если после проведения принудительного закрытия Обособленного ТКС Доступные средства данного Обособленного ТКС не перестали быть отрицательными, КЦ использует Средства обеспечения, учитываемые на данном Обособленном ТКС, для погашения Маржинального требования в соответствии с настоящей статьей.

Если после проведения принудительного закрытия Обособленного ТКС Доступные средства данного Обособленного ТКС перестали быть отрицательными, но Маржинальное требование к Участнику клиринга осталось неисполненным, КЦ осуществляет принудительное ТКС, входящих в Группу ТКС.

21.2. В целях осуществления процедуры принудительного закрытия КЦ вправе:

- заключать Договоры купли-продажи / Договоры ПФИ / Внебиржевые договоры купли-продажи ОТС в отношении КЦ от имени Участника клиринга, не исполнившего Маржинальное требование, без специального полномочия (доверенности), а также без согласия этого Участника клиринга; и (или)

- заключать Договоры купли-продажи / Договоры ПФИ / Внебиржевые договоры купли-продажи ОТС без подачи Заявок, без направления Оферт ОТС и Акцептов ОТС.

21.3. Заключение Договоров купли-продажи / Договоров ПФИ / Внебиржевых договоров купли-продажи ОТС без подачи Заявок, без направления Оферт ОТС и Акцептов ОТС при применении процедуры принудительного закрытия осуществляется, в том числе, с соблюдением следующих условий:

- в случае если на регистрах учета позиций Участника клиринга, не исполнившего Маржинальное требование, которые относятся к разным ТКС, учитываются противоположные позиции, возникшие в связи с заключенными Договорами / Внебиржевыми договорами ОТС, КЦ в первую очередь заключает Договоры купли-продажи / Договоры ПФИ / Внебиржевые договоры купли-продажи ОТС без подачи Заявок (без направления Оферт ОТС и Акцептов ОТС) противоположной направленности с Участником клиринга, не исполнившим Маржинальное требование, а во вторую очередь - с другими Участниками клиринга и с Участником клиринга, не исполнившим Маржинальное требование;

- Договоры купли-продажи / Договоры ПФИ / Внебиржевые договоры купли-продажи ОТС без подачи Заявок (без направления Оферт ОТС и Акцептов ОТС) заключаются КЦ с Участниками клиринга, на регистрах учета позиций которых учитывается позиция, противоположная позиции Участника клиринга, не исполнившего Маржинальное требование, и с этим Участником клиринга. Указанные договоры заключаются в объемах, пропорциональных объему позиции по данной ценной бумаге / ПФИ каждого Участника клиринга, с которым КЦ заключает договоры;

- в случае невозможности заключения Договора купли-продажи / Договора ПФИ / Внебиржевого договора купли-продажи ОТС в соответствии с абзацем третьим настоящего пункта КЦ заключает соответствующие договоры без подачи Заявок (без направления Оферт ОТС и Акцептов ОТС) с Участниками клиринга, на регистрах учета позиций которых не учитывается позиция, противоположная позиции Участника клиринга, не исполнившего Маржинальное требование, и с этим Участником клиринга. Указанные договоры заключаются в объемах, пропорциональных стоимости Средств обеспечения каждого Участника клиринга, с которым КЦ заключает договоры;

- при заключении КЦ Договоров купли-продажи / Договоров ПФИ / Внебиржевых договоров купли-продажи ОТС без подачи Заявок противоположной направленности с Участником клиринга, не исполнившим Маржинальное требование, на регистрах учета позиций которого учитываются противоположные позиции, цена заключения таких договоров считается равной последней определенной расчетной цене;

- цена заключения Договора купли-продажи / Договора ПФИ / Внебиржевого договора купли-продажи ОТС, покупателем (продавцом) в которых является Участник клиринга, не исполнивший Маржинальное требование, считается равной Верхней (Нижней) цене принудительного закрытия, определенной в рамках последней Клиринговой сессии в соответствии с Методикой установления и изменения риск-параметров. Заключение Договора купли-продажи / Договора ПФИ / Внебиржевого договора купли-продажи ОТС, предметом (базисным активом) которого является ценная бумага, учитываемая при определении стоимости Средств обеспечения с дисконтом 100%, производится по цене, устанавливаемой на основании экспертной оценки КЦ.

При установлении на основании экспертной оценки значения цены КЦ, в том числе, должен обеспечивать, чтобы указанное значение цены находилось в диапазоне между значением минимальной цены ценной бумаги и значением максимальной цены ценной бумаги, определяемыми в отношении ценной бумаги, являющейся предметом (базисным активом) Договора купли-продажи / Договора ПФИ / Внебиржевого договора купли-продажи ОТС, иностранной биржей, на которой указанная ценная бумага прошла процедуру листинга, по состоянию на день заключения соответствующего договора.

В случае если ценная бумага не прошла процедуру листинга на иностранной бирже, то для определения значений минимальной цены ценной бумаги и максимальной цены ценной бумаги используются сайты в сети Интернет, на которых раскрывается информация об указанных значениях. Перечень сайтов в сети Интернет, используемых в целях настоящего пункта, подлежит опубликованию на Сайте КЦ. Для целей настоящего пункта КЦ использует текущие значения минимальной цены ценной бумаги и максимальной цены ценной бумаги по состоянию на момент заключения Договора купли-продажи / Договора ПФИ / Внебиржевого договора купли-продажи ОТС.

21.4. Договоры купли-продажи / Договоры ПФИ / Внебиржевые договоры купли-продажи ОТС, заключаемые при применении процедуры принудительного закрытия, учитываются при расчете нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам по Договорам по соответствующим Датам исполнения / по Внебиржевым договорам купли-продажи ОТС по соответствующим датам исполнения.

21.5. Если после выполнения процедуры принудительного закрытия у Участника клиринга осталось неисполненное Маржинальное требование, оно учитывается как Задолженность, а Участник клиринга признается Должником.

21.6. В целях погашения Задолженности КЦ использует Средства обеспечения Должника. Указанные средства используются для погашения Задолженности Участника клиринга без согласия и без предварительного уведомления Участника клиринга.

При наличии у Должника отрицательных Доступных средств по Обособленному ТКС погашение Задолженности Должника в размере, равном абсолютному значению

указанных отрицательных Доступных средств, производится за счет Средств обеспечения, учитываемых на денежных и депо регистрах, относящихся к такому Обособленному ТКС.

При наличии у Должника отрицательных Доступных средств по ТКС, входящих в Группу ТКС, погашение Задолженности Должника в размере, равном абсолютному значению суммы отрицательных Доступных средств по Группе ТКС, производится за счет Средств обеспечения, учитываемых на денежных и депо регистрах, относящихся к ТКС, входящих в Группу ТКС.

21.7. В случае наличия у Должника Средств обеспечения в валюте, отличной от Валюты Доступных средств (далее – иная валюта), КЦ использует Средства обеспечения Должника в указанной иной валюте для погашения Задолженности Должника путем продажи указанной иной валюты за Валюту Доступных средств.

Погашение Задолженности Должника осуществляется путем замены Средств обеспечения должника в иностранной валюте на Валюту Доступных средств по курсу, установленному КЦ на момент совершения операции.

В целях настоящих Правил указанная замена имущества, составляющего предмет индивидуального клирингового обеспечения, именуется заменой валюты денежных средств, учитываемых в качестве Средств обеспечения.

Сумма, полученная в результате замены Средств обеспечения должника, засчитывается КЦ в счет погашения Задолженности Должника.

Размер Средств обеспечения Должника в иной валюте по соответствующему денежному регистру уменьшается на сумму Средств обеспечения Должника в иной валюте, использованных в соответствии с настоящим пунктом.

21.8. В случае наличия у Должника Средств обеспечения в ценных бумагах КЦ по своему усмотрению использует Средства обеспечения Должника в указанных ценных бумагах для целей погашения Задолженности Должника путем продажи указанных ценных бумаг.

Продажа ценных бумаг может осуществляться КЦ на Торгах Организатора торговли путем заключения Договоров, в том числе в отношении себя лично, от имени Должника, Средства обеспечения которого используются для погашения Задолженности, без специального полномочия (доверенности), а также без согласия Должника. КЦ осуществляет продажу ценных бумаг по максимально возможной цене и на условиях, определяемых в соответствии с Правилами торговли.

Продажа ценных бумаг может осуществляться КЦ путем заключения КЦ Внебиржевых договоров купли-продажи ОТС в отношении себя лично от имени Должника, Средства обеспечения которого используются для погашения Задолженности, без специального полномочия (доверенности), а также без согласия Должника. КЦ осуществляет продажу ценных бумаг по цене, устанавливаемой на основании экспертной оценки КЦ. При этом значение цены устанавливается на основании экспертной оценки КЦ с соблюдением требований, предъявляемых к ее определению в случае заключения Договоров купли-продажи / Договоров ПФИ / Внебиржевых договоров купли-продажи ОТС без подачи Заявок, без направления Оферт ОТС и Акцептов ОТС при применении процедуры принудительного закрытия.

21.9. В случае если продажа ценных бумаг на Торгах Организатора торговли и (или) путем заключения Внебиржевых договоров купли-продажи ОТС произведена не за Валюту Доступных средств, а за иную валюту, то денежные средства, полученные в результате продажи ценных бумаг, используются для погашения Задолженности Должника путем продажи указанной иной валюты за Валюту Доступных средств в порядке, установленном настоящей статьей.

21.10. Сумма денежных средств, полученная в результате продажи ценных бумаг засчитывается КЦ в счет погашения Задолженности Должника.

21.11. Выбор используемого в целях погашения Задолженности Должника Средства обеспечения осуществляется КЦ самостоятельно без предварительного уведомления Должника.

21.12. В случае отсутствия у Должника Средств обеспечения в иной валюте и (или) ценных бумагах либо если в результате использования КЦ Средств обеспечения Должника в иной валюте и (или) ценных бумагах Задолженность Должника не погашена полностью и Должник не внес имущество, являющееся Средством обеспечения, для погашения Задолженности, КЦ вправе требовать от такого Должника погашения Задолженности в судебном порядке и (или) вправе использовать средства Гарантийных фондов.

Статья 22. Порядок использования и возмещения Гарантийных фондов

22.1. Средства Гарантийных фондов используются КЦ для погашения Задолженности Должника, не погашенной полностью после использования КЦ Средств обеспечения Должника.

22.2. Взнос Должника в Гарантийный фонд участников используется для погашения Задолженности Должника путем перечисления денежных средств и (или) ценных бумаг, составляющих указанный взнос, в счет погашения указанной Задолженности.

22.3. В случае использования для погашения Задолженности Должника вклада Должника в Гарантийный фонд участников, выраженного в валюте, отличной от Валюты Доступных средств, в счет погашения указанной Задолженности перечисляется сумма, полученная в результате продажи указанной валюты за Валюту Доступных средств. КЦ продаёт валюту за Валюту Доступных средств на условиях, указанных в статье 21 настоящих Правил.

В случае использования для погашения Задолженности Должника вклада Должника в Гарантийный фонд участников в ценных бумагах, в счет погашения указанной Задолженности перечисляется сумма, полученная в результате продажи указанных ценных бумаг за Валюту Доступных средств. КЦ продаёт ценные бумаги за Валюту Доступных средств на условиях, указанных в статье 21 настоящих Правил.

22.4. Погашение Задолженности Должника за счет вклада Должника в Гарантийный фонд участников осуществляется КЦ без согласия и предварительного уведомления Должника.

22.5. Взнос Должника в Гарантийный фонд участников уменьшается на сумму средств, использованную для погашения Задолженности Должника.

22.6. В случае если Задолженность Должника возникла в связи с наличием отрицательных Доступных средств по ТКС, входящих в Группу ТКС, и вклада Должника в Гарантийный фонд участников оказалось недостаточно для полного погашения Задолженности Должника, КЦ производит следующие действия:

- произвести принудительное закрытие Должника по Обособленному ТКС;
- уведомить Организатора торговли о невозможности регистрации Заявки, подаваемой Должником с указанием Обособленного ТКС, в реестре Заявок;
- уведомить Должника о невозможности акцепта Оферты ОТС и о невозможности принятия Поручения на клиринг внебиржевых договоров к исполнению, в которых указан Обособленный ТКС.

22.7. В случае если Задолженность Должника возникла в связи с наличием отрицательных Доступных средств по Обособленному ТКС и вклада Должника в Гарантийный фонд участников оказалось недостаточно для полного погашения Задолженности Должника, КЦ вправе произвести следующие действия:

- произвести принудительное закрытие Должника по ТКС, входящим в Группу ТКС, а также по Обособленному ТКС, Доступные средства которого являются положительной величиной (далее - иной Обособленный ТКС);

- уведомить Организатора торговли о невозможности регистрации Заявки, подаваемой Должником с указанием ТКС, входящих в Группу ТКС, а также иного Обособленного ТКС;

- уведомить Должника о невозможности акцепта Оферты ОТС и о невозможности принятия Поручения на клиринг внебиржевых договоров к исполнению, в которых указаны ТКС, входящие в Группу ТКС, и (или) иной Обособленный ТКС;

- использовать Средства обеспечения, учитываемые на ТКС, в состав которого входит Субсчет депо владельца Должника, для погашения Задолженности Должника в соответствии со статьей 21 настоящих Правил;

- использовать Средства обеспечения, учитываемые на ТКС, входящих в Группу ТКС, в размере превышения величины Дополнительного обеспечения над величиной оценочной стоимости Средств обеспечения, использованных для погашения Задолженности Должника в соответствии с абзацем пятым настоящего пункта.

22.8. В случае недостаточности взноса Должника в Гарантийный фонд участников для полного погашения Задолженности Должника и осуществления КЦ всех действий, предусмотренных пунктами 22.6 и 22.7 настоящих Правил, КЦ уменьшает величину Выделенного капитала КЦ на сумму оставшейся Задолженности Должника.

22.9. В случае если после уменьшения величины Выделенного капитала КЦ в соответствии с пунктом 22.8 настоящих Правил, для полного погашения Задолженности Должника, КЦ использует для ее погашения взносы Гарантов в Размаре взносов в специальный Гарантийный фонд путем перечисления денежных средств и (или) ценных бумаг, составляющих взносы, в счет погашения указанной Задолженности.

В случае использования для погашения Задолженности Должника взноса Гаранта в специальный Гарантийный фонд, выраженного в валюте, отличной от Валюты Доступных средств, в счет удовлетворения указанных требований перечисляется сумма, полученная в результате продажи указанной валюты за Валюту Доступных средств на условиях, указанных в статье 21 настоящих Правил.

В случае использования для погашения Задолженности Должника взноса Гаранта в специальный Гарантийный фонд в ценных бумагах, в счет ее погашения перечисляется сумма, полученная в результате продажи указанных ценных бумаг за Валюту Доступных средств. КЦ продаёт ценные бумаги за Валюту Доступных средств на условиях, установленных договором между КЦ и Гарантом. В случае если продажа ценных бумаг произведена не за Валюту Доступных средств, а за иную валюту, то денежные средства, полученные в результате продажи ценных бумаг, используются для удовлетворения требований КЦ по Задолженности Участника клиринга в порядке, предусмотренном статьей 21 настоящих Правил.

Использование взносов Гарантов в специальный Гарантийный фонд для погашения Задолженности Должника осуществляется пропорционально Размаре взноса каждого Гаранта в специальный Гарантийный фонд. При этом КЦ использует эти взносы без согласия и предварительного уведомления Гарантов.

Взносы Гарантов в специальный Гарантийный фонд уменьшаются на сумму средств, использованную для погашения Задолженности Должника.

22.10. В случае недостаточности взноса Должника в Гарантийные фонды, Выделенного капитала КЦ и взносов Гарантов в специальный Гарантийный фонд для полного погашения Задолженности Должника, КЦ в целях ее погашения использует взносы Добросовестных Участников клиринга в Гарантийный фонд участников в Размаре взносов.

Размеры взноса Добросовестных Участников клиринга в Гарантийный фонд участников используются для погашения Задолженности Должника путем перечисления денежных средств и (или) ценных бумаг, составляющих Размеры взноса, в счет погашения указанной Задолженности.

В случае использования для погашения Задолженности Должника вноса Добросовестного Участника клиринга в Гарантийный фонд участников, выраженного в валюте, отличной от Валюты Доступных средств, в счет погашения указанной Задолженности перечисляется сумма, полученная в результате продажи указанной валюты за Валюту Доступных средств на условиях, указанных в статье 21 настоящих Правил.

В случае использования для погашения Задолженности Должника вноса Добросовестного Участника клиринга в Гарантийный фонд участников в ценных бумагах, в счет погашения указанной Задолженности перечисляется сумма, полученная в результате продажи указанных ценных бумаг за Валюту Доступных средств. КЦ продаёт ценные бумаги за Валюту Доступных средств на условиях, указанных в статье 21 настоящих Правил.

Погашение оставшейся Задолженности Должника осуществляется пропорционально Размеру вноса каждого из Добросовестных Участников клиринга в Гарантийный фонд участников. Вносы Добросовестных Участников клиринга в Гарантийный фонд участников уменьшаются на сумму средств, использованных для погашения Задолженности Должника.

Использование взносов Добросовестных Участников клиринга, помимо Должника, в Гарантийный фонд участников для погашения оставшейся Задолженности Должника осуществляется КЦ без согласия и предварительного уведомления таких Участников клиринга.

22.11. Требования КЦ по Задолженности Должника прекращаются в объеме использованного вноса Должника в Гарантийные фонды, использованных взносов Гарантов в специальный Гарантийный фонд в Размёре взносов и использованных взносов Добросовестных Участников клиринга в Гарантийный фонд участников в Размёре взносов. При этом у Должника возникает обязанность возместить использованные средства Гарантийных фондов.

22.12. Должник обязан возместить использованные средства Гарантийных фондов в течение 2 (двух) Расчетных дней после прекращения требований КЦ по Задолженности Должника в объеме использованных для прекращения Задолженности Должника перед КЦ взносов Добросовестных Участников клиринга и Гарантов.

Уведомление о необходимости возмещения использованных средств Гарантийных фондов, содержащее информацию о сумме использованных средств, подлежащей возмещению Должником, о сроке, в течение которого указанные средства Гарантийных фондов должны быть возмещены, направляется Должнику в форме Электронного документа, подписанного Электронной подписью, и (или) в бумажном виде, не позднее Расчетного дня, следующего за датой использования средств Гарантийных фондов.

В случае нарушения Должником обязанности по возмещению использованных средств Гарантийных фондов КЦ вправе в судебном порядке требовать от Должника возмещения указанных средств и убытков, причиненных нарушением указанной обязанности, в полном размере.

22.13. КЦ использует средства, возмещенные Должником, для увеличения размера взносов в Гарантийные фонды в следующей очередности:

- в первую очередь увеличивается размер взносов Добросовестных Участников клиринга в Гарантийный фонд участников;
- во вторую очередь увеличивается размер взносов Гарантов в специальный Гарантийный фонд. При этом взносы в Гарантийные фонды увеличиваются до Размёра вноса.

Использование средств, возмещенных Должником, для увеличения размера взносов в Гарантийные фонды в рамках каждой последующей очереди осуществляется после надлежащего увеличения размера взносов в рамках предыдущей очереди.

В случае недостаточности средств, возмещенных Должником, для надлежащего увеличения размера взносов всех Добросовестных Участников клиринга в Гарантийный фонд участников в рамках первой очереди, увеличение размера указанных взносов осуществляется пропорционально суммам взносов Добросовестных Участников клиринга, использованным для погашения Задолженности Должника.

В случае недостаточности средств, возмещенных Должником, для надлежащего увеличения размера взносов всех Гарантов в специальный Гарантийный фонд в рамках второй очереди, увеличение размера указанных взносов осуществляется пропорционально суммам взносов Гарантов, использованным для погашения Задолженности Должника.

22.14. В случае если Должник в установленный срок не возместил в полном объеме использованные средства Гарантийного фонда участников, каждое лицо, взносы которого в Гарантийный фонд участников были использованы для погашения Задолженности Должника, обязано в течение 2 (двух) Расчетных дней после направления ему КЦ соответствующего уведомления внести денежные средства и (или) ценные бумаги в счет увеличения своего взноса в Гарантийный фонд участников до Размера взноса.

В случае если Должник в установленный срок не возместил в полном объеме использованные средства специального Гарантийного фонда, Гаранты, взносы которых в специальный Гарантийный фонд были использованы для погашения Задолженности Должника, обязаны в течение 2 (двух) Расчетных дней после направления им КЦ соответствующего уведомления внести денежные средства и (или) ценные бумаги в счет увеличения своего взноса в специальный Гарантийный фонд до Размера взноса, если иное не предусмотрено договором с Гарантом.

22.15. Должник обязан в течение 2 (двух) Расчетных дней после использования для целей погашения Задолженности Должника взносов Добросовестных Участников клиринга в Гарантийный фонд участников, погасить свою Задолженность в объеме, определенном как положительная разность между величиной Задолженности Должника до начала использования взносов в Гарантийные фонды и размером использованных в целях погашения указанной Задолженности взноса Должника в Гарантийный фонд участников, взносов Гарантов в специальный Гарантийный фонд и взносов Добросовестных Участников клиринга в Гарантийный фонд участников.

Уведомление о необходимости погашения Задолженности Должника перед КЦ, содержащее информацию об объеме подлежащей погашению Задолженности, направляется Должнику в форме Электронного документа, подписанного Электронной подписью, и (или) в бумажном виде, не позднее Расчетного дня с момента использования взносов других Участников клиринга, помимо Должника, в Гарантийный фонд участников.

В случае нарушения Должником обязанности по погашению Задолженности Должника в соответствии с настоящим пунктом КЦ вправе в судебном порядке требовать от Должника погашения указанной Задолженности и возмещения причиненных убытков в полном размере.

22.16. В течение 2 (двух) Расчетных дней после погашения Задолженности Должник обязан возместить использованный взнос Должника в Гарантийный фонд участников. Уведомление о необходимости возмещения использованного взноса Должника в Гарантийный фонд участников, содержащее информацию о сумме использованных средств, подлежащей возмещению Должником, о сроке, в течение которого указанные средства Гарантийного фонда должны быть возмещены, направляется Должнику в форме Электронного документа, подписанного Электронной подписью, и (или) в бумажном виде, не позднее Расчетного дня, следующего за датой погашения Задолженности Должником.

22.17. В случае если Должник не погасил Задолженность в соответствии с настоящей статьей, КЦ производит действия, направленные на уменьшение требований Добросовестных Участников клиринга по возврату Средств обеспечения на размер

Задолженности Должника в объеме, определенном как положительная разница между величиной Задолженности Должника до начала использования взносов в Гарантийные фонды и размером использованных в целях погашения указанной Задолженности взноса Должника в Гарантийный фонд участников, взносов Гарантов в специальный Гарантийный фонд, взносов Добросовестных Участников клиринга в Гарантийный фонд участников и Выделенным капиталом КЦ.

Уменьшение требований Добросовестных Участников клиринга к КЦ по возврату Средств обеспечения производится за счет предъявления КЦ к Добросовестным Участникам клиринга требований, включаемых в состав требований по Дополнительному обеспечению и рассчитываемых в связи с превышением Задолженности Должника размера ответственности центрального контрагента, пропорционально стоимости Средств обеспечения каждого Добросовестного Участника клиринга. Указанные требования, включаемые в состав требований по Дополнительному обеспечению, учитываются на ТКС Добросовестных Участников клиринга, предназначенных для учета требований КЦ к Участнику клиринга по Дополнительному обеспечению.

Определение размера требований в соответствии с настоящей статьей Правил производится КЦ не позднее следующего дня после истечения срока погашения Задолженности Должником в соответствии с пунктом 22.15 настоящих Правил.

В процессе клиринга КЦ формирует и предоставляет Участникам клиринга информацию о рассчитанных требованиях по Дополнительному обеспечению в порядке, установленном статьей 43 настоящих Правил.

22.18. В случае погашения Должником Задолженности КЦ прекращает предъявлять требования, определяемые в соответствии с настоящей статьей Правил, к Добросовестным Участникам клиринга.

РАЗДЕЛ IV. ПОРЯДОК ВНЕСЕНИЯ, ИСПОЛЬЗОВАНИЯ И ВОЗВРАТА СРЕДСТВ ОБЕСПЕЧЕНИЯ

Статья 23. Порядок внесения, использования и возврата Средств обеспечения

23.1. В качестве Средств обеспечения могут быть внесены денежные средства в российских рублях и иностранной валюте, а также ценные бумаги, включенные в Перечень ценных бумаг.

Перечень ценных бумаг, а также перечень иностранных валют, которые могут быть внесены в качестве Средств обеспечения, определяются решением КЦ и подлежат опубликованию на Сайте КЦ.

23.2. Предельная доля иностранной валюты, принимаемой в качестве Средства обеспечения, составляет 100%. Указанная доля может быть уменьшена по решению КЦ.

Предельная доля ценных бумаг, включённых в Список ценных бумаг и входящих в Перечень ценных бумаг, включаемых в Средства обеспечения, составляет 100%. Указанная доля может быть уменьшена по решению КЦ. Предельная доля иных ценных бумаг, входящих в Перечень ценных бумаг, включаемых в Средства обеспечения, устанавливается решением КЦ.

23.3. КЦ вправе устанавливать максимальное количество ценных бумаг и максимальную сумму иностранной валюты, принимаемых в качестве Средств обеспечения. Максимальное количество ценных бумаг и иностранной валюты, принимаемых в качестве Средств обеспечения, устанавливается внутренним документом КЦ, определяющим методику выбора и оценки иностранных валют и (или) ценных бумаг, принимаемых в качестве обеспечения.

23.4. Размер требований, предъявляемых КЦ к Участникам клиринга по внесению Средств обеспечения, устанавливается в соответствии с Методикой установления и изменения риск-параметров.

23.5. Средства обеспечения используются:

- для погашения Задолженности;
- для обеспечения исполнения и исполнения обязательств по Договорам / Внебиржевым договорам ОТС, а также обязательств по уплате Клиринговых сборов и Торговых сборов.

23.6. Внесение Средств обеспечения в российских рублях и иностранной валюте Участником клиринга возможно следующими способами:

- путем перевода денежных средств на Клиринговый денежный счет, на котором учитываются денежные средства, составляющие Средства обеспечения;
- путем перевода денежных средств между денежными регистрами на основании поручения на перевод денежных средств, поданного Участником клиринга с использованием Системы;
- путем перевода денежных средств между денежными регистрами на основании заявления на замену валюты денежных средств, учитываемых в качестве Средств обеспечения;
- путем перевода денежных средств между денежными регистрами в связи исполнением итоговых нетто-обязательств / нетто-требований Участниками клиринга в соответствии с настоящими Правилами;
- путем перевода денежных средств между денежными регистрами, открытыми Участникам клиринга в целях отдельного учета имущества клиентов Участников клиринга, являющегося Средствами обеспечения, при осуществлении КЦ действий по переводу долга, уступке требований и передаче имущества в порядке, предусмотренном статьями 45 настоящих Правил.

23.7. Перевод денежных средств Участником клиринга на Клиринговый денежный счет КЦ с целью их последующего учета в качестве Средств обеспечения должен осуществляться с обязательным указанием в назначении платежа цели перевода денежных средств, номера договора об оказании клиринговых услуг и соответствующего ТКС.

КЦ учитывает денежные средства, переведенные на Клиринговый денежный счет, в качестве Средств обеспечения по денежному регистру, который соответствует ТКС Участника клиринга, указанному в назначении платежа, после получения информационного сообщения от Расчетной организации по Клиринговому денежному счету, содержащего информацию об указанном переводе, и осуществляет перерасчет Доступных средств Участника клиринга по ТКС, указанному в назначении платежа, с учетом перечисленной суммы денежных средств.

В случае поступления денежных средств на Клиринговый денежный счет по расчётным документам с неправильно или неполно указанным назначением платежа, эти средства не включаются в состав Средств обеспечения. Плательщик должен предоставить письмо за подписью руководителя и главного бухгалтера организации плательщика, подтверждающего соответствующее назначение платежа по внесению Средств обеспечения.

23.8. Перевод денежных средств между денежными регистрами принимается КЦ к исполнению, если сумма денежных средств в соответствующей валюте, указанная Участником клиринга в поручении, не превышает сумму денежных средств в этой же валюте, учитываемых в качестве Средств обеспечения Участника клиринга по денежному регистру, с которого денежные средства должны быть списаны, и если Доступные средства Участника клиринга по ТКС, соответствующему денежному регистру, с которого денежные средства, учитываемые в качестве Средств обеспечения Участника клиринга, должны быть списаны, в результате такого списания не станут отрицательными, или отрицательные Доступные средства Участника клиринга по ТКС, соответствующему этому денежному регистру, в результате такого списания не уменьшатся.

При исполнении поручения на перевод денежных средств сумма денежных средств Участника клиринга, учитываемых в качестве Средств обеспечения по денежному регистру, с которого списываются денежные средства, уменьшается, а по денежному регистру, на который зачисляются денежные средства, увеличивается на сумму переводимых денежных средств.

23.9. Поручение на списание ценных бумаг, которые не входят в Перечень ценных бумаг, включаемых в Средства обеспечения, в соответствии с настоящей статьей, с Субсчета депо исполняется при условии, что количество ценных бумаг, подлежащих списанию, не превышает значения соответствующей позиции по ценным бумагам Участника клиринга, учитываемой на депо регистре.

Поручение на списание ценных бумаг, которые входят в Перечень ценных бумаг, включаемых в Средства обеспечения, с Субсчета депо исполняется при условии, что:

- количество ценных бумаг, подлежащих списанию, не превышает значения соответствующей позиции по ценным бумагам Участника клиринга;
- величина Доступных средств Участника клиринга по ТКС, в состав которого входит соответствующая позиция по ценным бумагам, а также величина Доступных средств Участника клиринга по всем ТКС, в результате такого списания не станут отрицательными;
- величина оценочной стоимости Средств обеспечения Участника клиринга не станет меньше размера обязательств по передаче Дохода, в случае наличия у Участника клиринга таких обязательств.

Поручение на списание ценных бумаг, которые входят в Перечень ценных бумаг, включаемых в Средства обеспечения, с Субсчета депо не исполняется в случае, если величина Доступных средств Участника клиринга по ТКС, в состав которого входит соответствующая позиция по ценным бумагам, а также величина Доступных средств Участника клиринга по всем ТКС, отрицательна на момент подачи указанного поручения.

Поручение на списание ценных бумаг, включенных в Список ценных бумаг с полным обеспечением, не исполняется также в случае, если в результате его исполнения уменьшится количество ценных бумаг, учитываемых на депо регистре Участника клиринга, с учетом исполнения нетто-обязательств Участника клиринга по указанным ценным бумагам, допущенных к клирингу.

23.10. После зачисления денежных средств на Клиринговый денежный счет и учета их в качестве Средств обеспечения по денежному регистру, у КЦ возникает обязательство вернуть денежные средства Участнику клиринга, учитываемые на соответствующих денежных регистрах.

23.11. Возврат КЦ Участнику клиринга денежных средств, учитываемых в качестве Средств обеспечения, осуществляется на основании поручения на возврат денежных средств.

Денежные средства, учитываемые в качестве Средств обеспечения по денежному регистру Участника клиринга, возвращаются на Счет, зарегистрированный в КЦ для возврата денежных средств.

Поручение на возврат денежных средств должно содержать ТКС Участника клиринга, валюту и сумму денежных средств, которые необходимо вернуть. Поручение на возврат денежных средств направляется Участником клиринга в электронном виде с использованием Системы или в форме Электронного документа, подписанного Электронной подписью.

КЦ вправе потребовать от Участника клиринга, направившего поручение на возврат денежных средств, предоставления документов, требуемых Расчетной организацией при списании денежных средств с Клиринговых денежных счетов.

Возврат КЦ Участнику клиринга денежных средств в соответствии с поручением на возврат денежных средств из Средств обеспечения исполняется при выполнении следующих условий:

- если сумма денежных средств в соответствующей валюте, указанная Участником клиринга в поручении, не превышает сумму денежных средств в этой же валюте, учитываемых в качестве Средств обеспечения Участника клиринга по денежному регистру, с которого денежные средства должны быть списаны;
- если остатка денежных средств на денежном регистре после списания будет достаточно для обеспечения исполнения обязательств по денежным средствам;
- если Доступные средства Участника клиринга по ТКС, соответствующему денежному регистру, с которого денежные средства, учитываемые в качестве Средств обеспечения Участника клиринга, должны быть списаны, а также величина Доступных средств участника клиринга, в результате такого списания не станут отрицательными и величина оценочной стоимости Средств обеспечения Участника клиринга не станет меньше размера обязательств по передаче Дохода, в случае наличия у Участника клиринга таких обязательств.

КЦ может осуществить возврат Участнику клиринга денежных средств в соответствии с поручением на возврат денежных средств при невыполнении указанных условий в пределах суммы, равной величине итогового нетто-требования Участника клиринга по денежным средствам, подлежащего исполнению в дату получения поручения на возврат денежных средств. При этом при наличии условий, указанных в пункте 29.10 настоящих Правил, КЦ осуществляет в отношении указанного Участника клиринга процедуру урегулирования ненадлежащего исполнения обязательств в порядке, определенном статьей 30 настоящих Правил, а при нарушении указанным Участником клиринга Маржинального требования, КЦ применяет к нему процедуру принудительного закрытия в порядке, определенном статьей 21 настоящих Правил.

После исполнения поручения на возврат денежных средств, сумма денежных средств в соответствующей валюте, учитываемая в качестве Средств обеспечения Участника клиринга по денежному регистру, с которого списывались денежные средства, уменьшается на сумму возвращенных денежных средств.

23.12. Сроки предоставления поручений на возврат денежных средств установлены Регламентом клиринга. При предоставлении поручения на возврат денежных средств позднее времени, указанного в Регламенте клиринга, поручение на возврат денежных средств принимается к исполнению в рамках следующего рабочего дня КЦ и Расчетной организации.

23.13.

Валюта денежных средств, учитываемых в качестве Средств обеспечения, может быть заменена на другую валюту денежных средств, учитываемых в качестве Средств обеспечения, на основании заявления на замену валюты денежных средств, учитываемых в качестве Средств обеспечения, подаваемого Участником клиринга в КЦ.

Заявление на замену валюты денежных средств, учитываемых в качестве Средств обеспечения, может быть исполнено КЦ только при условии, что не будет превышено максимальное количество иностранной валюты, принимаемой в качестве Средств обеспечения, установленное КЦ. Исполнение указанного заявления считается согласием КЦ на замену валюты денежных средств, учитываемых в качестве Средств обеспечения.

Замена валюты денежных средств, учитываемых в качестве Средств обеспечения, осуществляется КЦ в следующем порядке:

- Заявление на замену денежных средств, учитываемых в качестве Средств обеспечения, направляется Участником клиринга в форме Электронного документа, подписанного Электронной подписью. Указанное заявление должно содержать указание на валюту и количество денежных средств, учитываемых в качестве Средств обеспечения, подлежащих замене;
- Замена денежных средств, учитываемых в качестве Средств обеспечения, осуществляется КЦ по курсу, установленному КЦ на момент совершения операции.

- КЦ исполняет заявление на замену валюты денежных средств, учитываемых в качестве Средств обеспечения, не позднее сроков, указанных в Регламенте клиринга;
- Полученные в результате продажи валют денежных средства КЦ учитывает в качестве Средств обеспечения по денежному регистру, относящемуся к тому же ТКС, что и денежный регистр, на котором учитывались денежные средства до осуществления процедуры замены валюты денежных средств, учитываемых в качестве Средств обеспечения, и осуществляет перерасчет Доступных средств Участника клиринга по данному ТКС, с учетом измененной валюты денежных средств, учитываемых в качестве Средств обеспечения.

За осуществление процедуры замены денежных средств, учитываемых в качестве Средств обеспечения, КЦ взимает с Участников клиринга плату в соответствии с установленными КЦ тарифами.

23.14. Внесение Средств обеспечения в ценных бумагах возможно путем зачисления ценных бумаг на Субсчет депо.

23.15. Зачисление ценных бумаг на Субсчет депо осуществляется на основании поручения КЦ, поданного в Расчетный депозитарий и составленного на основании поручения Участника клиринга (если Субсчет депо открыт Участнику клиринга либо клиенту или Субклиенту Участника клиринга) или Депозитария (если Субсчет депо открыт Депозитарию), поданного в КЦ. Исполнение поручения КЦ на зачисление ценных бумаг на Субсчет депо осуществляется Расчетным депозитарием в соответствии с внутренними документами Расчетного депозитария.

Зачисление ценных бумаг на Субсчет депо, учитываемый в составе Обособленного ТКС, в случае осуществления КЦ перевода долга, уступки требований и передачи имущества в соответствии со статьей 45 настоящих Правил, осуществляется на основании поручения КЦ, поданного в Расчетный депозитарий, без поручения Участника клиринга или Депозитария.

КЦ учитывает на соответствующих клиринговых регистрах информацию о зачислении ценных бумаг на Субсчет депо после получения от Расчетного депозитария отчета, подтверждающего зачисление ценных бумаг на соответствующие Субсчета депо.

23.16. Списание ценных бумаг с Субсчета депо осуществляется на основании поручения КЦ, поданного в Расчетный депозитарий и составленного на основании поручения Участника клиринга (если Субсчет депо открыт Участнику клиринга либо клиенту или Субклиенту Участника клиринга) или Депозитария (если Субсчет депо открыт Депозитарию). Исполнение поручения КЦ на списание ценных бумаг с Субсчета депо осуществляется Расчетным депозитарием в соответствии с внутренними документами Расчетного депозитария.

Списание ценных бумаг с Субсчета депо, учитываемого в составе Обособленного ТКС в случае осуществления КЦ перевода долга, уступки требований и передачи имущества в соответствии со статьей 45 настоящих Правил, осуществляется на основании поручения КЦ, поданного в Расчетный депозитарий, без поручения Участника клиринга или Депозитария.

КЦ, получив поручение на списание ценных бумаг с Субсчета депо от Участника клиринга или Депозитария, уменьшает Средства обеспечения Участника клиринга, учитываемые на соответствующих клиринговых регистрах, и дает поручение Расчетному депозитарию на списание ценных бумаг с Субсчета депо, при условии, что:

- количество ценных бумаг, подлежащих списанию, не превышает значения соответствующей позиции по ценным бумагам Участника клиринга;
- величина Доступных средств Участника клиринга по ТКС, входящем в Группу ТКС, в состав которого входит соответствующая позиция по ценным бумагам, а также величина Доступных средств участника клиринга по Группе ТКС, в результате такого списания не стали отрицательными;

- если величина Доступных средств Участника клиринга по ТКС, в состав которого входит соответствующая позиция по ценным бумагам, а также величина Доступных средств Участника клиринга, были отрицательными до момента такого списания, то указанные величины Доступных средств, рассчитанные с учетом такого списания, не станут меньше величин Доступных средств, рассчитанных до момента такого списания.

23.17. КЦ вправе потребовать от Участника клиринга, направившего поручение на списание ценных бумаг, предоставления документов и (или) информации, требуемых Расчетным депозитарием при списании ценных бумаг с Субсчета депо. Если Участник клиринга не исполнил надлежащим образом обязанность по предоставлению КЦ указанных документов и (или) информации, то КЦ не несет ответственности за возможное неисполнение Расчетным депозитарием поручения на списание ценных бумаг с Субсчета депо. Порядок и срок предоставления указанных документов и информации указывается КЦ в соответствующем запросе.

23.18. Сроки предоставления поручений на зачисление / на списание ценных бумаг установлены Регламентом клиринга. При предоставлении поручения на зачисление/списание ценных бумаг позднее времени, указанного в Регламенте клиринга, поручение на зачисление/списание ценных бумаг принимается к исполнению в следующий Расчетный день КЦ и рабочий день Расчетного депозитария.

Информация о размере Средств обеспечения и об изменении размера Средств обеспечения передаётся Участнику клиринга в составе сведений, предоставляемых КЦ Участникам клиринга в соответствии со статьей 43 настоящих Правил.

23.19. КЦ вправе в порядке и на условиях, определенных КЦ, брать на себя по требованию Участника клиринга обязательства по организации учета прав на ценные бумаги, учитываемые на Субсчетах депо, открытых этому Участнику клиринга, его клиентам и Субклиентам либо Депозитария, который осуществляет учет прав на ценные бумаги Участника клиринга, его клиентов и Субклиентов, на счетах депо, открытых в определенных депозитариях или иностранных организациях, которые в соответствии с личным законом осуществляют учет прав на ценные бумаги, включая центральный депозитарий Российской Федерации (далее – Место хранения).

Перечень возможных Мест хранения определяется КЦ и публикуется на Сайте КЦ.

Требование Участника клиринга о выборе Места хранения направляется путем подачи заявления по форме, установленной в Регламенте клиринга.

В случае получения указанного заявления КЦ при взаимодействии с Расчетным депозитарием предпринимает все разумные меры по организации учета прав на ценные бумаги Участника клиринга, клиентов и Субклиентов Участника клиринга, учитываемых на соответствующих Субсчетах депо Участника клиринга и (или) Депозитария, в Месте хранения, указанном Участником клиринга в заявлении.

Количество ценных бумаг и условия, в соответствии с которыми КЦ обеспечивает учет прав на ценные бумаги в Месте хранения, определяются в соответствии с выбранным Участником клиринга тарифным планом.

В случае выбора Участником клиринга Места хранения КЦ не отвечает за нарушение своих обязательств в результате действий (бездействия) лица, являющегося Местом хранения.

Статья 24. Порядок внесения и возврата взноса в Гарантйные фонды

24.1. После уведомления КЦ о дате начала формирования Гарантйных фондов и в течение срока, установленного в указанном уведомлении, Участники клиринга и (или) Гаранты обязаны внести денежные средства и (или) ценные бумаги, за счет которых будут сформированы Гарантйные фонды, в сумме, не меньшей установленного КЦ Размера взноса в соответствующий Гарантйный фонд, и указанного в уведомлении.

24.2. Участники клиринга или Гаранты перечисляют денежные средства в российских рублях и (или) иностранной валюте на Клиринговые денежные счета, предназначенные для учета коллективного клирингового обеспечения, с обязательным указанием в назначении платежа слов «Гарантийный фонд», вида Гарантийного фонда (Гарантийный фонд участников или специальные Гарантийный фонд), номера и даты договора об оказании клиринговых услуг (для Участников клиринга) или номера и даты договора, на основании которого Гаранты вносят взносы в специальный Гарантийный фонд (для Гарантов).

КЦ учитывает денежные средства, переведенные на Клиринговый денежный счет, в качестве взноса в соответствующий Гарантийный фонд по денежному регистру, который соответствует ТКС Участника клиринга и (или) Гаранта, открытому для учета средств Гарантийных фондов, после получения от Расчетной организации выписки по Клиринговому денежному счету, содержащей информацию, в том числе о размере взноса и лице, предоставившем указанный взнос.

Внесение денежных средств в качестве взноса в Гарантийный фонд может быть осуществлено путем перевода денежных средств с ТКС, предназначенного для учета Средств обеспечения, с соблюдением условий, предусмотренных пунктом 23.8 настоящих Правил.

24.3. Зачисление ценных бумаг на Субсчет депо, открытый в рамках Клирингового счета депо, предназначенного для учета коллективного клирингового обеспечения, осуществляется на основании поручения КЦ, поданного в Расчетный депозитарий и составленного на основании поручения Участника клиринга, Депозитария или Гаранта, поданного в КЦ. Исполнение поручения КЦ на зачисление ценных бумаг на Субсчет депо осуществляется Расчетным депозитарием в соответствии с внутренними документами Расчетного депозитария.

КЦ учитывает ценные бумаги, переведенные на Субсчет депо, в качестве взноса в соответствующий Гарантийный фонд по депо регистру, который соответствует ТКС Участника клиринга или Гаранта, открытый для учета средств Гарантийных фондов, после получения информации от Расчетного депозитария.

Внесение ценных бумаг в качестве взноса в Гарантийный фонд может быть осуществлено путем перевода ценных бумаг с Субсчета депо, открытого в рамках Клирингового счета депо, предназначенного для учета Средств обеспечения, с соблюдением условий, предусмотренных пунктом 23.9 настоящих Правил.

24.4. Определение стоимости иностранной валюты и (или) ценных бумаг, внесенных в качестве взноса в Гарантийный фонд, производится в соответствии с порядком, установленным Методикой установления и изменения риск-параметров.

В случае если стоимость иностранной валюты и (или) ценных бумаг, внесенных в качестве взноса в Гарантийный фонд, становится меньше Размера взноса, КЦ уведомляет Участника клиринга и (или) Гаранта о необходимости увеличения взноса в Гарантийный фонд участников и (или) специальный Гарантийный фонд. Участник клиринга и (или) Гарант обязаны увеличить свой взнос в Гарантийный фонд до Размера взноса, если иное не предусмотрено договором между КЦ и Гарантом.

В случае внесения Участником клиринга и (или) Гарантом в соответствующий Гарантийный фонд денежных средств и (или) ценных бумаг в сумме, превышающей Размер взноса, в качестве взноса в соответствующий Гарантийный фонд учитывается вся сумма внесённых денежных средств и (или) ценных бумаг. Участник клиринга и (или) Гарант вправе на основании заявления о возврате взноса в Гарантийный фонд потребовать возврата суммы денежных средств и (или) ценных бумаг, в размере превышения Размера взноса.

24.5. В случае поступления денежных средств на Клиринговые денежные счета по платёжным поручениям с неправильно или неполно указанным назначением платежа, эти средства не включаются в состав Гарантийного фонда. Плательщик должен

предоставить письмо за подписью руководителя и главного бухгалтера организации плательщика, подтверждающего соответствующее назначение платежа по внесению средств в состав Гарантйных фондов.

24.6. В случае принятия решения об увеличении Размера взноса КЦ уведомляет Участника клиринга и (или) Гаранта о необходимости внесения дополнительных средств в соответствующие Гарантйные фонды не позднее, чем за 15 (пятнадцать) дней до установленной решением даты увеличения Размера взноса.

Информация об увеличении Размера взноса, о необходимости внесения дополнительных денежных средств в российских рублях и (или) иностранной валюте, а также ценных бумаг для увеличения текущего размера взноса в соответствующий Гарантйный фонд до вновь установленного Размера взноса, а также о сроке вступления измененного Размера взноса в силу размещается на Сайте КЦ, а также направляется каждому Участнику клиринга и (или) Гаранту в форме Электронного документа, подписанного Электронной подписью, и (или) в бумажном виде.

24.7. Дополнительные денежные средства в российских рублях и (или) иностранной валюте, а также ценные бумаги, внесенные Участником клиринга или Гарантом, увеличивают учитываемый КЦ размер взноса Участника клиринга или Гаранта в соответствующий Гарантйный фонд и размер обязательства КЦ по возврату денежных средств в российских рублях и (или) иностранной валюте, а также ценных бумаг в размере взноса, внесенного соответствующим лицом.

24.8. Возврат Участнику клиринга его взноса в соответствующий Гарантйный фонд осуществляется по усмотрению КЦ в виде имущества, составляющего взнос Участника клиринга в соответствующий Гарантйный фонд, или денежных средств, стоимость которых определяется исходя из стоимости имущества, составляющего соответствующий Гарантйный фонд, рассчитанной на день прекращения договора об оказании клиринговых услуг, пропорционально взносу такого Участника клиринга, в порядке, определенном пунктом 11.21 настоящих Правил.

24.9. Участник клиринга и Гарант вправе предоставить КЦ заявление о возврате взноса в Гарантйный фонд.

При получении от Участника клиринга заявления о возврате взноса в Гарантйный фонд участников КЦ незамедлительно информирует об этом Организатора торговли с целью прекращения допуска к участию в Торгах, за исключением случая возврата суммы денежных средств и (или) ценных бумаг, в размере превышения Размера взноса.

Заявление о возврате взноса в Гарантйный фонд участников исполняется КЦ не позднее Расчетного дня, следующего за датой получения указанного заявления от Участника клиринга, при условии, что у Участника клиринга отсутствуют Задолженности и/или неисполненные обязательства, допущенные к клирингу.

Заявление о возврате взноса в специальный Гарантйный фонд исполняется КЦ не позднее Расчетного дня, следующего за датой получения указанного заявления.

Возврат денежных средств и (или) ценных бумаг, являющихся взносом Участника клиринга в Гарантйный фонд осуществляется на счета, предварительно зарегистрированные Участником клиринга в КЦ. Возврат денежных средств и (или) ценных бумаг, являющихся взносом Гаранта в специальный Гарантйный фонд, осуществляется на счета, указанные Гарантом в заявлении о возврате взноса в Гарантйный фонд, или на счета, указанные в договоре между Гарантом и КЦ.

При исполнении заявления о возврате взноса в Гарантйный фонд КЦ уменьшает размер взноса заявителя в соответствующий Гарантйный фонд и размер своего обязательства по возврату заявителю денежных средств и (или) ценных бумаг в размере его взноса в этот Гарантйный фонд на сумму возвращенных денежных средств и (или) ценных бумаг.

24.10. При расторжении договора между КЦ и Гарантом возврат Гаранту его вноса в специальный Гарантийный фонд осуществляется в виде имущества, составляющего взнос Гаранта в специальный Гарантийный фонд, или денежных средств, стоимость которых определяется исходя из стоимости имущества, составляющего специальный Гарантийный фонд, рассчитанной на день прекращения договора между КЦ и Гарантом, пропорционально взносу такого Гаранта, в порядке, определенном пунктом 11.21 настоящих Правил.

РАЗДЕЛ V. ПОРЯДОК И УСЛОВИЯ ДОПУСКА ОБЯЗАТЕЛЬСТВ К КЛИРИНГУ

Статья 25. Порядок взаимодействия с Организатором торговли при подаче Заявок и заключении Договоров. Порядок и условия допуска обязательств к клирингу

25.1. При подаче Участником торгов Заявки осуществляется автоматизированный электронно-цифровой обмен запросами между Системой проведения торгов Организатора торговли и Клиринговой системой в целях проверки, что у Участника торгов, подавшего Заявку, есть действующий допуск к клиринговому обслуживанию, что ценная бумага включена в Список ценных бумаг или что ПФИ включен в Список ПФИ.

При подаче Заявки, за исключением Заявок, в отношении которых Организатором торговли не предусмотрено проведение проверки возможности регистрации в реестре Заявок, и Заявок, указанных в абзацах 5 - 7 настоящего пункта, автоматизированный электронно-цифровой обмен запросами между Системой проведения торгов Организатора торговли и Клиринговой системой осуществляется также в целях проверки, что подача указанной Заявки не приведет к нарушению следующих условий:

- величина Доступных средств Участника клиринга по ТКС, определяемому Поданной Заявкой, а также величина Доступных средств Участника клиринга, рассчитанные с учетом Поданной Заявки, не станут отрицательными;

- если величина Доступных средств по ТКС, определяемому Поданной Заявкой, а также величина Доступных средств Участника клиринга были отрицательными до момента подачи Заявки, то указанные величины Доступных средств, рассчитанные с учетом указанной Поданной Заявки, не станут меньше величин Доступных средств, рассчитанных до момента подачи указанной Заявки.

При подаче Участником торгов Заявки, в которой указан Код расчетов ХО, КЦ проверяет, чтобы размер денежных средств, учитываемых на денежном регистре, входящем в состав ТКС, указанного в данной Заявке, не был меньше размера денежных средств, требуемого для исполнения обязательств, возникающих из Договора, заключенного на основании указанной Заявки.

При подаче Заявки, в которой указан Код расчетов W0, Код расчетов U0 или Код расчетов Y0, КЦ проверяет, чтобы размер денежных средств и количество ценных бумаг, учитываемых на клиринговых регистрах, входящих в состав ТКС, указанного в данной Заявке, не был меньше размера денежных средств и количества ценных бумаг, требуемых для исполнения обязательств, возникающих из Договора, заключенного на основании указанной Заявки.

При подаче Участником клиринга Заявки или Оферты ОТС для заключения Договора (Внебиржевого договора ОТС), предметом которого являются ценные бумаги, включенные в Список ценных бумаг с полным обеспечением, и в котором этот Участник клиринга является продавцом, КЦ проверяет, чтобы суммарно количество ценных бумаг по Договору (Внебиржевому договору ОТС) и объем нетто-требований по ценным бумагам учитываемых на клиринговых регистрах, входящих в состав ТКС, указанного в данной Заявке (Оферте ОТС), не были меньше количества ценных бумаг, требуемых для

исполнения обязательств, возникающих из Договора / Внебиржевого договора ОТС, заключенного на основании указанной Заявки (Оферты ОТС).

При подаче Участником клиринга, являющимся Участником торгов, Заявки на заключение Договора ПФИ, при заключении которого этот Участник клиринга будет являться Покупателем и условия которого предусматривают одновременную уплату денежных средств при его заключении, КЦ дополнительно проверяет, чтобы размер денежных средств, учитываемых на денежном регистре, входящем в состав ТКС, указанного в данной Заявке, не был меньше размера денежных средств, требуемого для исполнения обязательства по уплате Премии в случае, если такая проверка предусмотрена Спецификацией соответствующего ПФИ.

25.2. При выполнении условий, указанных в пункте 25.1 настоящих Правил, КЦ подтверждает возможность регистрации Заявки в реестре Заявок. Такая Заявка считается обеспеченной. В этом случае КЦ в качестве Доступных средств по ТКС, определяемому Поданной Заявкой, а также Доступных средств Участника клиринга учитывает величины, рассчитанные с учетом указанной объявленной Заявки.

При невыполнении хотя бы одного из условий, указанных в пункте 25.1 настоящих Правил, КЦ уведомляет Организатора торговли о невозможности регистрации Поданной Заявки в реестре Заявок. В указанном случае величины Доступных средств Участника клиринга, указанного в Поданной Заявке, не пересчитываются и считаются равными последним рассчитанным величинам.

25.3. Уведомление о возможности или невозможности регистрации Поданной Заявки в реестре Заявок направляется КЦ Организатору торговли в виде электронного сообщения, подписанного АСП.

25.4. В случае отзыва Объявленной Заявки или аннулирования Объявленной Заявки Организатор торговли извещает КЦ об указанном факте. В указанном случае величина Доступных средств по ТКС, определяемому Объявленной Заявкой, подлежащей отзыву или аннулированию, а также величина Доступных средств Участника клиринга, указанного в Заявке, пересчитываются без учета указанной Объявленной Заявки.

25.5. После регистрации Договора в реестре Договоров Организатором торговли осуществляется автоматизированный электронно-цифровой обмен информацией между Системой проведения торгов Организатора торговли и Клиринговой системой КЦ. Организатор торговли направляет в КЦ информацию о регистрации Договора, на основании чего КЦ:

- рассчитывает величину Доступных средств по ТКС, определяемому Объявленной Заявкой, на основании которой был заключен Договор, а также величину Доступных средств Участника клиринга без учета Объявленной Заявки, на основании которой был заключен Договор, но с учетом указанного Договора, за исключением случаев, когда обязательства, возникшие из Договоров, не обеспечиваются индивидуальным клиринговым обеспечением и (или) коллективным клиринговым обеспечением в соответствии с абзацем вторым пункта 16.1 настоящих Правил;

- изменяет с учетом указанного заключенного Договора купли-продажи / Договора репо нетто-обязательство и (или) нетто-требование Участника клиринга из Договоров в российских рублях и (или) иностранной валюте и ценных бумагах с указанием даты исполнения, соответствующей Дате исполнения по заключенному Договору, учитываемые по регистру учета позиций, соответствующему ТКС, определяемому Объявленной Заявкой, на основании которой заключен указанный Договор;

- изменяет с учетом заключенного Договора ПФИ позицию по ПФИ Участника клиринга, а также нетто-обязательство и (или) нетто-требование Участника клиринга из Договоров ПФИ в российских рублях и (или) иностранной валюте с указанием Даты расчетов и Даты исполнения по заключенному Договору ПФИ, учитываемые по регистру

учета позиций, соответствующему ТКС, определяемому Объявленной Заявкой, на основании которой заключен указанный Договор.

25.6. Обязательства, возникшие из Договоров, допускаются к клирингу с момента получения КЦ информации о регистрации соответствующего Договора в реестре Договоров. Указанные обязательства принимаются КЦ к учету с момента их допуска к клирингу на основании информации о регистрации заключенного Договора в реестре Договоров, получаемой КЦ от Организатора торговли.

Статья 26. Прием Поручений на клиринг внебиржевых договоров

26.1. КЦ принимает от Участников клиринга Поручения на клиринг внебиржевых договоров по Внебиржевым договорам в порядке, установленном настоящей статьёй Правил.

26.2. Если иное не установлено настоящей статьёй, для целей осуществления клиринга обязательств, возникающих из Внебиржевых договоров, Участники клиринга направляют в КЦ Поручения на клиринг внебиржевых договоров по формам, установленным в Регламенте клиринга, с использованием Системы. Поручение на клиринг внебиржевых договоров считается полученным КЦ в момент поступления указанного поручения в Систему. Поручения на клиринг внебиржевых договоров подлежат исполнению в дату исполнения, указанную в Поручении на клиринг внебиржевых договоров.

26.3. Поручения на клиринг внебиржевых договоров направляются в КЦ в виде электронного сообщения, подписанного АСП.

26.4. В Поручении на клиринг внебиржевых договоров могут содержаться данные по одному или нескольким Внебиржевым договорам.

26.5. КЦ вправе отказать в приеме Поручения на клиринг внебиржевых договоров в случае, если его исполнение приведет к нарушению требований настоящих Правил.

26.6. КЦ принимает Поручение на клиринг внебиржевых договоров к исполнению от Участников клиринга, если прием указанного поручения к исполнению и (или) его исполнение не приведет к нарушению следующих условий:

- у Участника клиринга, указанного в Поручении на клиринг внебиржевого договора, есть действующий допуск к клиринговому обслуживанию;

- предмет обязательств Внебиржевого договора, указанного в Поручении на клиринг внебиржевого договора, соответствует предмету обязательств, указанному в Списке обязательств;

- дата направления Поручений на клиринг внебиржевых договоров не позднее даты исполнения по Внебиржевому договору;

- реквизиты и условия Внебиржевого договора, содержащиеся в Поручении на клиринг внебиржевых договоров одного Участника клиринга, совпадают с реквизитами и условиями Внебиржевого договора, содержащимися в Поручении на клиринг внебиржевых договоров Участника клиринга – контрагента по данному договору;

- к моменту включения обязательств из Внебиржевых договоров в клиринговый пул по договорам, заключаемым без участия Центрального контрагента, КЦ получил Поручения на клиринг внебиржевых договоров от двух Участников клиринга – сторон по указанному Внебиржевому договору;

- величина Доступных средств Участника клиринга по ТКС, с указанием которого было направлено Поручение на клиринг внебиржевых договоров, а также величина Доступных средств Участника клиринга, рассчитанные с учетом направленного Поручения на клиринг внебиржевых договоров, не стали отрицательными (для случаев, когда Поручением на клиринг внебиржевых договоров предусмотрена проверка достаточности Доступных средств);

- если величина Доступных средств по ТКС, с указанием которого было направлено Поручение на клиринг внебиржевых договоров, а также величина Доступных средств Участника клиринга были отрицательными до момента направления Поручения

на клиринг внебиржевых договоров, то указанные величины Доступных средств, рассчитанные с учетом указанного направленного Поручения на клиринг внебиржевых договоров, не стали меньше величин Доступных средств, рассчитанных до момента направления указанного Поручения на клиринг внебиржевых договоров (для случаев, когда Поручением на клиринг внебиржевых договоров предусмотрена проверка достаточности Доступных средств).

26.7. При выполнении условий, указанных в пункте 26.6 настоящих Правил, КЦ принимает к исполнению Поручение на клиринг внебиржевых договоров и в качестве Доступных средств по ТКС, с указанием которого было направлено Поручение на клиринг внебиржевых договоров, а также Доступных средств Участника клиринга, учитывает величины, рассчитанные с учетом указанного направленного Поручения на клиринг внебиржевых договоров, за исключением случаев, когда Поручением на клиринг внебиржевых договоров не предусмотрена проверка достаточности Доступных средств.

26.8. При невыполнении хотя бы одного из условий, указанных в пункте 26.6 настоящих Правил, Поручение на клиринг внебиржевых договоров к исполнению не принимается. В указанном случае величины Доступных средств Участников клиринга, направивших указанное Поручение на клиринг внебиржевых договоров, не пересчитываются и считаются равными последним рассчитанным величинам.

26.9. После приема Поручения на клиринг внебиржевых договоров к исполнению КЦ:

- рассчитывает величину Доступных средств по ТКС, указанному в Поручении на клиринг внебиржевых договоров, а также величину Доступных средств Участника клиринга, за исключением случаев, когда Поручением на клиринг внебиржевых договоров не предусмотрен расчет величины Доступных средств;

- изменяет с учетом Внебиржевого договора, указанного в Поручении на клиринг внебиржевых договоров, нетто-обязательство и (или) нетто-требование Участника клиринга по Внебиржевым договорам в ценных бумагах, российских рублях или иностранной валюте с указанием даты исполнения в соответствии с условиями Внебиржевого договора, учитываемые по регистру учета позиций, соответствующему ТКС, указанному в Поручении на клиринг внебиржевых договоров, в котором был указан этот Внебиржевой договор.

26.10. КЦ допускает обязательства из Внебиржевого договора, в отношении которого направлено Поручение на клиринг внебиржевых договоров, к клирингу после приема к исполнению указанного Поручения на клиринг внебиржевых договоров. Указанные обязательства принимаются КЦ к учету с момента их допуска к клирингу.

Статья 27. Порядок заключения Внебиржевых договоров ОТС

27.1. Направление Оферт ОТС осуществляется с использованием Системы.

КЦ вправе определить перечень (перечни) ценных бумаг, в отношении которых могут направляться Оферты ОТС, и (или) период (периоды) времени, в течение которого (которых) могут направляться Оферты ОТС, и (или) иные требования, подлежащие соблюдению в связи с направлением Оферт ОТС, которые подлежат опубликованию на Сайте КЦ. Направление Оферт ОТС, не соответствующих установленным требованиям, не допускается.

КЦ вправе приостанавливать или прекращать направление Оферт ОТС, в том числе Оферт ОТС в отношении определенных ценных бумаг и (или) Оферт ОТС, содержащих определенные условия расчетов.

27.2. При направлении Участником клиринга Оферты ОТС КЦ осуществляет проверку следующих условий:

- у Участника клиринга, направившего Оферту ОТС, есть действующий допуск к клиринговому обслуживанию КЦ;

- Оферта ОТС направляется в период времени, который установлен КЦ и в течение которого могут направляться Оферты ОТС;
- ценная бумага, в отношении которой направлена Оферта ОТС, включена в перечень предметов обязательств в Списке обязательств, а также в перечень ценных бумаг, в отношении которых могут направляться Оферты ОТС (в случае его установления);
- Оферта ОТС соответствует иным требованиям, установленным КЦ;
- величина Доступных средств Участника клиринга по ТКС, определяемому направленной Офертой ОТС, а также величина Доступных средств Участника клиринга, рассчитанные с учетом Оферты ОТС, не станут отрицательными;
- если величина Доступных средств по ТКС, определяемому направленной Офертой ОТС, а также величина Доступных средств Участника клиринга, были отрицательными до момента направления Оферты ОТС, то указанные величины Доступных средств, рассчитанные с учетом направленной Оферты ОТС, не станут меньше величин Доступных средств, рассчитанных до момента направления указанной Оферты ОТС.

27.3. При выполнении условий, указанных в пункте 27.2 настоящих Правил, Оферта ОТС считается обеспеченной, и КЦ вправе заключить с Участником клиринга, направившим Оферту ОТС, Внебиржевой договор ОТС, а в случае наличия встречной Оферты ОТС по отношению к направленной Оферте ОТС КЦ обязан заключить Внебиржевой договор ОТС.

При невыполнении хотя бы одного из условий, указанных в пункте 27.2 настоящих Правил, Оферта ОТС не направляется, и КЦ информирует Участника клиринга, направившего Оферту ОТС, о невозможности заключения Внебиржевого договора ОТС. В указанном случае величины Доступных средств Участника клиринга, указанного в направленной Оферте ОТС, не пересчитываются и считаются равными последним рассчитанным величинам.

27.4. Оферты ОТС направляются в Систему в виде электронного сообщения, подписанного АСП, по формам, указанным в Регламенте клиринга.

27.5. В Оферте ОТС могут содержаться данные только по одному или нескольким Внебиржевым договорам ОТС.

27.6. Участник клиринга направляет Оферту ОТС исключительно в адрес КЦ с целью заключения с КЦ Внебиржевого договора ОТС.

27.7. Акцепт ОТС формируется КЦ в Системе.

Внебиржевой договор ОТС заключается в Системе между Участником клиринга, направившим Оферту ОТС, и КЦ.

Информация о заключении Внебиржевого договора ОТС направляется Участнику клиринга посредством Системы.

27.8. Для целей заключения Внебиржевого договора ОТС КЦ вправе использовать информацию о ценах и количестве ценных бумаг, указанных в заявках, поданных на иностранной бирже, полученную от организаций, имеющих право распространять указанную информацию, перечень которых подлежит опубликованию на сайте КЦ в сети Интернет (далее - Информация с иностранной биржи). Перечень показателей, составляющих Информацию с иностранной биржи, время начала и время окончания использования КЦ Информации с иностранной биржи определяется решением КЦ. КЦ вправе использовать Информацию с иностранной биржи в отношении одной или нескольких ценных бумаг.

27.9. Оферта ОТС может содержать Идентификатор Участника клиринга, присвоенный Участнику клиринга, который может направить Оферту ОТС, имеющую противоположенную первоначальной Оферте ОТС направленность (далее - связанная Оферта ОТС). При направлении Оферты ОТС и связанной Оферты ОТС заключаются

одновременно два Внебиржевых договора ОТС между КЦ и каждым из Участников клиринга, направивших Оферту ОТС и связанную Оферту ОТС.

27.10. Если иное не указано в настоящей статье, Внебиржевой договор ОТС заключается между Участником клиринга и КЦ при условии, что Оферта ОТС и Акцепт ОТС одновременно удовлетворяют следующим условиям:

- в Оферте ОТС и в Акцепте ОТС указаны одинаковые коды ценных бумаг, которые будут являться предметом Внебиржевого договора ОТС;
- цена за одну ценную бумагу, указанная в Акцепте ОТС, направленном на покупку ценных бумаг, не меньше, чем цена ценной бумаги, указанная в Оферте ОТС, направленной на продажу ценных бумаг, или
- цена за одну ценную бумагу, указанная в Акцепте ОТС, направленном на продажу ценных бумаг, не больше, чем цена ценной бумаги, указанная в Оферте ОТС, направленной на покупку ценных бумаг (для заключения Внебиржевых договоров купли-продажи ОТС, если в Оферте ОТС указана цена ценной бумаги);
- Ставка репо, указанная в Акцепте ОТС, направленном на покупку ценных бумаг, не больше, чем Ставка репо, указанная в Оферте ОТС, направленной на продажу ценных бумаг, или Ставка репо, указанная в Акцепте ОТС, направленном на продажу ценных бумаг, не меньше, чем Ставка репо, указанная в Оферте ОТС, направленной на покупку ценных бумаг (для заключения Внебиржевых договоров репо ОТС и Пар внебиржевых договоров ОТС);
- цена первой части Внебиржевого договора репо ОТС, указанная в Оферте ОТС, совпадает с ценой первой части Внебиржевого договора репо ОТС, указанной в Акцепте ОТС (для заключения Внебиржевых договоров репо ОТС);
- цена Первого договора, составляющего Пару внебиржевых договоров ОТС, указанная в Оферте ОТС, совпадает с ценой Первого договора, составляющего Пару внебиржевых договоров ОТС, указанной в Акцепте ОТС (для заключения Пар внебиржевых договоров ОТС);
- валюта расчетов, указанная в Оферте ОТС, совпадает с валютой расчетов, указанной в Акцепте ОТС;
- срок исполнения обязательств, возникших из Внебиржевого договора ОТС, указанный в Оферте ОТС, совпадает со сроком исполнения обязательств, возникших из Внебиржевого договора ОТС, указанным в Акцепте ОТС.

Если в Оферте ОТС не указана цена ценной бумаги, то Внебиржевой договор купли-продажи ОТС заключается по лучшей из цен, указанных в Акцептах ОТС. При этом лучшей из цен, указанных в Акцептах ОТС, направленных на покупку ценных бумаг, считается наибольшая из них, а лучшей из цен, указанных в Акцептах ОТС, направленных на продажу ценных бумаг, считается наименьшая из них.

Для целей заключения Внебиржевого договора ОТС под Акцептом ОТС, направленным на покупку ценных бумаг, понимается Акцепт ОТС, представляющий собой согласие КЦ на заключение с Участником клиринга Внебиржевого договора ОТС, в котором КЦ будет являться покупателем по Внебиржевому договору купли-продажи / по первой части Внебиржевого договора репо ОТС.

Для целей заключения Внебиржевого договора ОТС под Акцептом ОТС, направленным на продажу ценных бумаг, понимается Акцепт ОТС, представляющий собой согласие КЦ на заключение с Участником клиринга Внебиржевого договора ОТС, в котором КЦ будет являться продавцом по Внебиржевому договору купли-продажи ОТС / по первой части Внебиржевого договора репо ОТС.

В случае если в Оферте ОТС указан Идентификатор Участника клиринга, присвоенный Участнику клиринга, который может направить связанную Оферту ОТС, Внебиржевой договор ОТС заключается при условии, что Оферта ОТС, связанная Оферта ОТС и Акцепты ОТС одновременно удовлетворяют следующим условиям:

- в Оферте ОТС / связанной Оферте ОТС и в Акцептах ОТС указаны одинаковые коды ценных бумаг, которые будут являться предметом Внебиржевого договора ОТС;
- сроки исполнения обязательств из Внебиржевого договора ОТС, указанные в Оферте ОТС, связанной Оферте ОТС и Акцептах ОТС, совпадают;
- цены за одну ценную бумагу, указанные в Оферте ОТС, связанной Оферте ОТС и Акцептах ОТС, совпадают (для заключения Внебиржевых договоров купли-продажи ОТС);
- Ставка репо, указанная в Оферте ОТС, связанной Оферте ОТС и Акцептах ОТС, совпадают (для заключения Внебиржевых договоров репо ОТС и Пар внебиржевых договоров ОТС);
- цена первой части Внебиржевого договора репо ОТС, указанная в Оферте ОТС, связанной Оферте ОТС и Акцептах ОТС, совпадают (для заключения Внебиржевых договоров репо ОТС);
- цена Первого договора, составляющего Пару внебиржевых договоров ОТС, указанная в Оферте ОТС, связанной Оферте ОТС и Акцептах ОТС, совпадают (для заключения Пар внебиржевых договоров ОТС);
- количество ценных бумаг, указанное в Оферте ОТС, связанной Оферте ОТС и Акцептах ОТС, совпадает;
- валюта расчетов, указанная в Оферте ОТС, связанной Оферте ОТС совпадает с валютой расчетов, указанной в Акцептах ОТС;
- Идентификатор Участника клиринга, указанный в Оферте ОТС и присвоенный Участнику клиринга, который может направить связанную Оферту ОТС, совпадает с Идентификатором Участника клиринга, направившим связанную Оферту ОТС.

27.11. Внебиржевой договор купли-продажи ОТС заключается по цене, указанной в Акцепте ОТС, в отношении меньшего количества ценных бумаг из указанных в Оферте ОТС и Акцепте ОТС.

Внебиржевые договоры купли-продажи ОТС заключаются на основании Оферты ОТС и связанной Оферты ОТС по цене, указанной в Акцептах ОТС, и в количестве, указанном в Акцептах ОТС.

27.12. Внебиржевой договор репо ОТС заключается исходя из Ставки репо, указанной в Акцепте ОТС, в отношении меньшего количества ценных бумаг, из указанных в Оферте ОТС и Акцепте ОТС.

Внебиржевой договор репо ОТС заключается на основании Оферты ОТС и связанной Оферты ОТС исходя из Ставки репо, указанной в Акцептах ОТС, и в количестве, указанном в Акцептах ОТС.

27.13. Пара внебиржевых договоров ОТС заключается исходя из Ставки репо, указанной в Акцепте ОТС, в отношении меньшего количества ценных бумаг, из указанных в Оферте ОТС и Акцепте ОТС.

Пара внебиржевых договоров ОТС заключается на основании Оферты ОТС и связанной Оферты ОТС исходя из Ставки репо, указанной в Акцептах ОТС, и в количестве, указанном в Акцептах ОТС.

27.14. Внебиржевой договор ОТС заключается на следующих условиях:

- цена одной ценной бумаги по Внебиржевому договору ОТС выражается в иностранной валюте;
- обязательства по Внебиржевому договору ОТС включаются в клиринговый пул в соответствии с настоящими Правилами.

27.15. КЦ при заключении Внебиржевого договора ОТС:

- рассчитывает величину Доступных средств по ТКС, указанному в Оферте ОТС/связанной Оферте ОТС, а также величину Доступных средств Участника клиринга;
- изменяет с учетом Внебиржевого договора ОТС, заключенного на основании Оферты ОТС, нетто-обязательство и (или) нетто-требование Участника клиринга по Внебиржевым договорам ОТС в иностранной валюте с указанием даты исполнения в

соответствии с условиями указанных договоров, учитываемые по регистру учета позиций, соответствующему ТКС, указанному в Оферте ОТС / связанной Оферте ОТС.

27.16. КЦ вправе не направлять Акцепт ОТС Участнику клиринга, направившему Оферту ОТС, кроме случая наличия встречной Оферты ОТС по отношению к направленной Оферте ОТС. В случае если КЦ не направил Участнику клиринга Акцепт ОТС, то направленная Участником клиринга Оферта ОТС действует до времени окончания Операционного дня, определенного в соответствии с Методикой установления и изменения риск-параметров.

27.17. Информация об Офертах ОТС, о заключенных Внебиржевых договорах ОТС и об обязательствах, возникших из указанных договоров, предоставляется Участникам клиринга в порядке, установленном статьей 43 настоящих Правил.

27.18. КЦ допускает обязательства из Внебиржевых договоров ОТС к клирингу в момент заключения указанных договоров. Указанные обязательства принимаются КЦ к учету с момента их допуска к клирингу.

27.19. Информация о заключенных Внебиржевых договорах репо ОТС предоставляется в репозиторий - ПАО «Санкт-Петербургская биржа» (далее в целях настоящего пункта - Репозиторий) в соответствии с требованиями и порядком, предусмотренными законодательством Российской Федерации и документами Репозитария. Лицом, представляющим информацию о заключении, изменении и прекращении Внебиржевых договоров репо ОТС в Репозиторий, является КЦ. Участники клиринга, заключая Внебиржевой договор репо ОТС, тем самым предоставляют КЦ своё безотзывное и безусловное согласие на передачу КЦ Репозитарию информации в объеме, установленном нормативными правовыми актами Банка России и документами Репозитария.

Сведения о внесении информации о Внебиржевом договоре репо ОТС в реестр договоров Репозитария предоставляются КЦ Участникам клиринга в сроки и в порядке, установленном статьей 43 настоящих Правил. КЦ также информирует Участников клиринга об изменении кода состояния обязательства, возникшего из Внебиржевого договора репо ОТС, и о прекращении указанного обязательства в сроки и в порядке, установленным статьей 43 настоящих Правил.

27.20. Справедливая (оценочная) стоимость Внебиржевого договора репо ОТС определяется исходя из произведения расчетной цены ценной бумаги, устанавливаемой КЦ в соответствии с Методикой установления и изменения риск-параметров, и количества ценных бумаг, являющихся предметом Внебиржевого договора репо ОТС.

РАЗДЕЛ VI. ПОРЯДОК ВКЛЮЧЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ В КЛИРИНГОВЫЙ ПУЛ. ПОРЯДОК ИСПОЛНЕНИЯ/ПРЕКРАЩЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ

Статья 28. Виды клиринговых пулов. Порядок включения обязательств в клиринговые пулы

28.1. Для целей осуществления клиринга обязательств КЦ формирует следующие клиринговые пулы:

- обязательства, возникшие из Договоров, в которых указан Код расчетов Тп и Код расчетов ТкТп (за исключением обязательств, возникших из Внутриброкерских договоров и Внутриброкерских Внебиржевых договоров ОТС), обязательства по уплате Премии, возникшие из Договоров ПФИ, включаются в клиринговый пул по Договорам в соответствии со статьей 29 настоящих Правил;

- обязательства, возникшие из Внутриброкерских договоров и Внутриброкерских Внебиржевых договоров ОТС, включаются в клиринговый пул по Внутриброкерским договорам в соответствии со статьей 29 настоящих Правил;

- обязательства, возникшие из Договоров, в которых указан Код расчетов Х0 и Код расчетов W0, включаются в клиринговый пул по Договорам размещения и выкупа в соответствии со статьёй 32 настоящих Правил;
- обязательства, возникшие из Договоров, в которых указан Код расчетов On и Код расчетов OkOn, включаются в клиринговый пул по договорам, заключаемым без участия Центрального контрагента, в соответствии со статьёй 33 настоящих Правил;
- обязательства, возникшие из Договоров, в которых указан Код расчетов Y0, включаются в клиринговый пул по Договорам с полным обеспечением с ЦК в соответствии со статьёй 34 настоящих Правил;
- обязательства, возникшие из Договоров, в которых указан Код расчетов U0, включаются в клиринговый пул по Договорам с полным обеспечением без ЦК в соответствии со статьёй 34 настоящих Правил;
- обязательства, возникшие из Внебиржевых договоров ОТС, включаются в клиринговый пул ОТС в соответствии со статьёй 29 настоящих Правил;
- обязательства, возникшие из Внебиржевых договоров, включаются в клиринговый пул по договорам, заключаемым без участия Центрального контрагента, в соответствии со статьёй 33 настоящих Правил;
- обязательства, определенные статьёй 29 настоящих Правил, включаются в расчетный клиринговый пул в соответствии со статьёй 29 настоящих Правил;
- обязательства, указанные в статье 35 настоящих Правил, включаются в клиринговый пул для расчетов по итогам Торгов в соответствии со статьёй 35 настоящих Правил;
- обязательства по единовременной уплате Премии при заключении Договора ПФИ, являющегося опционным договором, включаются в клиринговый пул по уплате Премии в соответствии со статьёй 38 настоящих Правил;
- обязательства по передаче суммы денежных средств при исполнении Договора ПФИ, возникшие из Договоров ПФИ, включаются в клиринговый пул ПФИ в соответствии со статьёй 38 настоящих Правил;
- обязательства по Вариационной марже, возникшие из Договоров ПФИ, включаются в клиринговый пул для расчетов по Вариационной марже в соответствии со статьёй 38 настоящих Правил;
- допущенные к клирингу обязательства Участника клиринга, возникшие из Внебиржевых договоров ОТС, Договоров, за исключением Договоров, в которых указаны Код расчетов Х0, Код расчетов U0, Код расчетов On, Код расчетов OkOn и Код расчетов W0, в случае отзыва Банком России у Участника клиринга - российской кредитной организации лицензии на осуществление банковских операций или в случае введения в отношении Участника клиринга процедур банкротства, включаются в ликвидационный клиринговый пул в соответствии с пунктом 48.2 настоящих Правил;
- допущенные к клирингу обязательства Участника клиринга, возникшие из Внебиржевых договоров, и Договоров, в которых указаны Код расчетов Х0, Код расчетов U0, Код расчетов On, Код расчетов OkOn и Код расчетов W0, в случае отзыва Банком России у Участника клиринга - российской кредитной организации лицензии на осуществление банковских операций или в случае введения в отношении Участника клиринга процедур банкротства, включаются в ликвидационный клиринговый пул в соответствии с пунктом 48.3 настоящих Правил.

В указанные клиринговые пулы не могут быть включены обязательства, не допущенные к клирингу.

28.2. Обязательство, включённое в клиринговый пул, не может быть исключено из соответствующего клирингового пула.

Статья 29. Порядок формирования клирингового пула по Договорам, расчётного клирингового пула, клирингового пула по Внутриброкерским договорам и клирингового пула ОТС. Порядок исполнения / прекращения обязательств, допущенных к клирингу

29.1. Для определения итоговых нетто-обязательств / итоговых нетто-требований по Договорам, в которых указан Код расчетов Тп и Код расчетов ТкТп, а также по Договорам ПФИ КЦ формирует клиринговый пул по Договорам, в который включаются обязательства, возникшие из Договоров, в которых указан Код расчетов Тп и Код расчетов ТкТп, допущенные к клирингу в соответствии со статьей 25 и статьей 39 настоящих Правил, и обязательства из Договоров ПФИ, допущенные к клирингу в соответствии со статьей 25 настоящих Правил, с наступившими Датами исполнения/ Датами расчетов.

29.2. КЦ формирует клиринговый пул по Договорам в срок, установленный Регламентом клиринга:

1) КЦ включает в клиринговый пул по Договорам:

- обязательства / требования Участников клиринга и КЦ по денежным средствам и ценным бумагам, возникшие из Договоров, в которых указаны Код расчетов Тп или Код расчетов ТкТп, с наступившей Датой исполнения;

- обязательства / требования Участников клиринга и КЦ по уплате Премии по Договору ПФИ с наступившей Датой расчетов;

- обязательства по передаче / требования по получению Дохода, размер и срок передачи которых определен в соответствии со статьей 37 настоящих Правил;

2) обязательства, указанные в подпункте 1 настоящего пункта, прекращаются зачетом встречных однородных требований, указанных в подпункте 1 настоящего пункта и учитываемых на тех же регистрах учета позиций, что и указанные обязательства, и КЦ определяет нетто-обязательства / нетто-требования по денежным средствам и ценным бумагам в отношении КЦ и каждого Участника клиринга по каждому денежному регистру / Субсчету депо.

29.3. Для определения итоговых нетто-обязательств / итоговых нетто-требований по Внебиржевым договорам ОТС КЦ формирует клиринговый пул ОТС, в который включаются обязательства, возникшие из Внебиржевых договоров ОТС, допущенные к клирингу в соответствии со статьей 27 настоящих Правил, с наступившими датами исполнения.

29.4. КЦ формирует клиринговый пул ОТС в срок, установленный Регламентом клиринга:

1) КЦ включает в клиринговый пул ОТС:

- обязательства / требования Участников клиринга и КЦ по денежным средствам и ценным бумагам, возникшие из Внебиржевых договоров ОТС, с наступившей датой исполнения;

- обязательства по передаче / требования по получению Дохода;

2) обязательства, указанные в подпункте 1 настоящего пункта, прекращаются зачетом встречных однородных требований, указанных в подпункте 1 настоящего пункта и учитываемых на тех же регистрах учета позиций, что и указанные обязательства, и КЦ определяет нетто-обязательства / нетто-требования по денежным средствам и ценным бумагам в отношении КЦ и каждого Участника клиринга по каждому денежному регистру / Субсчету депо.

29.5. После определения нетто-обязательств / нетто-требований в соответствии с пунктами 29.2 и 29.4 настоящих Правил КЦ формирует расчетный клиринговый пул. В указанный клиринговый пул включаются:

- нетто-обязательства / нетто-требования по денежным средствам / ценным бумагам, определенные в соответствии с подпунктом 2 пункта 29.2 настоящих Правил;

- нетто-обязательства / нетто-требования по денежным средствам / ценным бумагам, определенные в соответствии с подпунктом 2 пункта 29.4 настоящих Правил;

- задолженность по денежному регистру, определенную в соответствии со статьей 36 настоящих Правил по итогам формирования клирингового пула для расчетов по итогам Торгов предыдущего Расчетного дня, в случае принятия соответствующего решения КЦ в соответствии со статьей 36 настоящих Правил.

29.5.1. По обязательствам / требованиям, включенным в расчетный клиринговый пул в соответствии с пунктом 29.5 настоящих Правил, КЦ проводит неттинг (зачет), по итогам которого определяет нетто-обязательства / нетто-требования по денежным средствам и ценным бумагам КЦ в отношении каждого Участника клиринга, а также нетто-обязательства / нетто-требования по денежным средствам и ценным бумагам каждого Участника клиринга в отношении КЦ. Указанные нетто-обязательства / нетто-требования определяются по каждому денежному регистру / Субсчету депо. Определённые в соответствии с настоящим пунктом нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в отношении других Участников клиринга и КЦ совокупно составляют итоговые нетто-обязательства / итоговые нетто-требования такого Участника клиринга.

29.6. Участники клиринга обязаны исполнить свои итоговые нетто-обязательства в срок, установленный Регламентом клиринга.

КЦ вправе установить срок, в течение которого Участники клиринга обязаны исполнить свои итоговые нетто-обязательства, отличный от срока, установленного в Регламенте клиринга, о чем КЦ извещает Участников клиринга посредством Системы, Сайта КЦ и (или) в форме Электронного документа, подписанного Электронной подписью, не менее чем за 1 (один) Расчетный день до даты вступления в силу решения КЦ об изменении указанного срока.

КЦ исполняет свои итоговые нетто-обязательства за счет денежных средств и ценных бумаг, причитающихся ему в результате исполнения итоговых нетто-обязательств Участников клиринга, а также свободных денежных средств и ценных бумаг КЦ, учитываемых на Клиринговых счетах.

Исполнение итоговых нетто-обязательств / итоговых нетто-требований осуществляется в порядке, определенном в пункте 29.9 настоящих Правил.

Итоговые нетто-обязательства / итоговые нетто-требования, возникшие по итогам клиринга обязательств, могут быть включены в другие клиринговые пулы, в том числе в клиринговые пулы, по которым не осуществляется клиринг с участием центрального контрагента.

29.7. Удовлетворение итоговых нетто-требований Участника клиринга, определенных в отношении денежного регистра / Субсчета депо, относящихся к определенному ТКС, возможно только после исполнения этим Участником клиринга итоговых нетто-обязательств, определённых по денежному регистру / Субсчету депо, относящихся к тому же ТКС.

29.8. Для исполнения итогового нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам, учитываемого в отношении определённого денежного регистра / Субсчета депо, используются денежные средства / ценные бумаги, учитываемые по тому же денежному регистру / Субсчету депо.

29.9. Если иное не предусмотрено настоящей статьей, итоговое нетто-обязательство Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам может быть исполнено по денежному регистру / Субсчету депо, в отношении которого оно определено, в случае если сумма денежных средств / количество ценных бумаг, учитываемых по тому же денежному регистру / Субсчету депо, не меньше, чем размер итогового нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам, определённого по денежному регистру / Субсчету депо.

КЦ исполняет итоговые нетто-обязательства / итоговые нетто-требования по денежным средствам и ценным бумагам в следующем порядке:

- итоговое нетто-обязательство по денежным средствам исполняется путем уменьшения размера Средств обеспечения в денежных средствах по денежному регистру, в отношении которого определено исполняемое итоговое нетто-обязательство, на размер этого итогового нетто-обязательства;

- итоговое нетто-требование по денежным средствам исполняется путем увеличения размера Средств обеспечения в денежных средствах по денежному регистру, в отношении которого определено исполняемое итоговое нетто-требование, на размер этого итогового нетто-требования. При этом в случае наличия у Участника клиринга задолженности перед КЦ в российских рублях или иностранной валюте, она уменьшается на величину исполненного итогового нетто-обязательства по денежным средствам;

- для исполнения итоговых нетто-обязательств / итоговых нетто-требований по ценным бумагам КЦ передает в Расчетный депозитарий сводное поручение депо на проведение расчетов по Субсчетам депо. Подтверждением исполнения итоговых нетто-обязательств / итоговых нетто-требований является получение КЦ от Расчетного депозитария отчета, подтверждающего исполнение указанного поручения.

Итоговое нетто-обязательство / итоговое нетто-требование по денежным средствам считается исполненным с момента внесения предусмотренных настоящим пунктом изменений в учете на клиринговых регистрах Участника клиринга.

Итоговое нетто-обязательство / итоговое нетто-требование по ценным бумагам считается исполненным с момента получения КЦ от Расчетного депозитария отчета об исполнении сводного поручения депо на проведение расчетов по Субсчетам депо. Информация об их исполнении отражается в учете на клиринговых регистрах Участника клиринга.

29.10. В случае ненадлежащего исполнения Участником клиринга перед КЦ итогового нетто-обязательства по ценным бумагам, определенного в соответствии с пунктом 29.5 настоящих Правил, в результате недостаточности ценных бумаг, учитываемых на депо регистрах в отношении определенного Субсчета депо, данный Участник клиринга признается недобросовестным Участником клиринга, и КЦ выполняет действия, направленные на исполнение указанного итогового нетто-обязательства, в порядке, определенном статьей 30 настоящих Правил.

29.11. После проведения в соответствии со статьей 30 настоящих Правил процедуры урегулирования исполнения итоговых нетто-обязательств / итоговых нетто-требований по ценным бумагам, по которым Участником клиринга было допущено ненадлежащее исполнение обязательств, КЦ формирует клиринговый пул по Договорам и (или) клиринговый пул ОТС.

В Дату исполнения первой части Договоров, в которых указан Код расчетов ТкТп, в Дату исполнения Первых договоров, составляющих Пары договоров, в дату исполнения первой части Внебиржевых договоров репо ОТС, заключенных в порядке, предусмотренном статьей 30 или статьей 31 настоящих Правил:

1) КЦ включает в клиринговый пул по Договорам:

- обязательства / требования Участников клиринга и КЦ по денежным средствам и ценным бумагам, возникшие из Договоров, в которых указан Код расчетов ТкТп, и из Пар биржевых договоров с наступившей Датой исполнения, заключенных в соответствии со статьей 30 настоящих Правил;

- обязательства / требования Участников клиринга и КЦ по Донорским договорам, являющимся Парами биржевых договоров, с наступившей Датой исполнения (кроме обязательств, указанных в пункте 29.16 настоящих Правил);

2) КЦ включает в клиринговый пул ОТС:

- обязательства / требования Участников клиринга и КЦ по денежным средствам и ценным бумагам по Внебиржевым договорам репо ОТС и по Парам внебиржевых договоров ОТС с наступившей датой исполнения, заключенным в соответствии со статьей 30 настоящих Правил;

- обязательства / требования Участников клиринга и КЦ по Донорским договорам репо, являющимся Внебиржевыми договорами репо ОТС, и по Донорским договорам купли-продажи, являющимся Парами внебиржевых договоров ОТС, заключенным в соответствии со статьей 30 настоящих Правил, с наступившей датой исполнения (кроме обязательств, указанных в пункте 29.16 настоящих Правил);

3) обязательства, указанные в подпункте 1 настоящего пункта, прекращаются зачетом встречных однородных требований, указанных в подпункте 1 настоящего пункта и учитываемых на тех же регистрах учета позиций, что и указанные обязательства, и КЦ определяет нетто-обязательства / нетто-требования по денежным средствам и ценным бумагам в отношении КЦ и каждого Участника клиринга по каждому денежному регистру / Субсчету депо;

4) обязательства, указанные в подпункте 2 настоящего пункта, прекращаются зачетом встречных однородных требований, указанных в подпункте 2 настоящего пункта и учитываемых на тех же регистрах учета позиций, что и указанные обязательства, а в оставшейся части КЦ определяет нетто-обязательства / нетто-требования по денежным средствам и ценным бумагам в отношении КЦ и каждого Участника клиринга по каждому денежному регистру / Субсчету депо;

5) КЦ после проведения действий, указанных в подпунктах 1 - 4 настоящего пункта, формирует расчетный клиринговый пул. В указанный расчетный клиринговый пул включаются:

- нетто-обязательства / нетто-требования по денежным средствам и ценным бумагам, возникшие по итогам клиринга обязательств в клиринговом пуле по Договорам и в клиринговом пуле ОТС в соответствии с подпунктами 1 - 4 настоящего пункта;

- неисполненные итоговые нетто-обязательства / итоговые нетто-требования по денежным средствам и ценным бумагам, определенные в соответствии с пунктом 29.5 настоящих Правил;

- итоговые нетто-требования / итоговые нетто-обязательства по денежным средствам и ценным бумагам, определенные в соответствии с абзацем 3 пункта 29.18 настоящих Правил;

6) по обязательствам / требованиям, включенным в расчетный клиринговый пул, КЦ проводит неттинг (зачет), по итогам которого определяет нетто-обязательства / нетто-требования по денежным средствам и ценным бумагам КЦ в отношении каждого Участника клиринга, а также нетто-обязательства / нетто-требования по денежным средствам и ценным бумагам каждого Участника клиринга в отношении КЦ. Указанные нетто-обязательства / нетто-требования определяются по каждому денежному регистру / Субсчету депо. Определенные в настоящем подпункте нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в отношении других Участников клиринга и КЦ совокупно составляют итоговые нетто-обязательства/итоговые нетто-требования такого Участника клиринга.

7) исполнение итоговых нетто-обязательств / итоговых нетто-требований, определенных в соответствии с подпунктом 6 настоящего пункта, осуществляется в порядке, установленном пунктами 29.6 – 29.9 настоящих Правил.

29.12. В случае недостаточности у Участника клиринга денежных средств для исполнения итогового нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам, определенного в соответствии с пунктом 29.11 настоящих Правил, данный Участник клиринга признается недобросовестным Участником клиринга, и КЦ выполняет действия, направленные на исполнение указанного итогового нетто-обязательства в порядке, определенном статьей 30 настоящих Правил.

29.13. После проведения в соответствии со статьей 30 настоящих Правил процедуры урегулирования исполнения итоговых нетто-обязательств, КЦ формирует клиринговый пул по Договорам и клиринговый пул ОТС.

В Дату исполнения первой части Договоров, в которых указан Код расчётов TkTn, в Дату исполнения Первых договоров, составляющих Пары договоров, в дату исполнения первой части Внебиржевых договоров репо ОТС, заключенных в порядке, предусмотренном статьей 30 или 31 настоящих Правил, в клиринговый пул по Договорам или в клиринговый пул ОТС:

1) КЦ включает в клиринговый пул по Договорам:

- обязательства / требования Участников клиринга и КЦ по денежным средствам и ценным бумагам по Договорам, в которых указан Код расчётов TkTn, и из Пар биржевых договоров с наступившей Датой исполнения, заключенным в соответствии со статьей 30 настоящих Правил;

- обязательства / требования Участника клиринга и КЦ по Донорским договорам, являющимся Парам биржевых договоров, заключенным в соответствии со статьей 31 настоящих Правил, с наступившей Датой исполнения;

2) КЦ включает в клиринговый пул ОТС:

- обязательства / требования Участников клиринга и КЦ по денежным средствам и ценным бумагам по Внебиржевым договорам репо ОТС и по Парам внебиржевых договоров ОТС с наступившей датой исполнения, заключенным в соответствии со статьей 30 настоящих Правил;

- обязательства / требования Участников клиринга и КЦ по Донорским договорам репо, являющимся Внебиржевыми договорами репо ОТС, и по Донорским договорам купли-продажи, являющимся Парам внебиржевых договоров ОТС, заключенным в соответствии со статьей 31 настоящих Правил, с наступившей датой исполнения;

3) обязательства, указанные в подпункте 1 настоящего пункта, прекращаются зачетом встречных однородных требований, указанных в подпункте 1 настоящего пункта и учитываемых на тех же регистрах учета позиций, что и указанные обязательства, а в оставшейся части КЦ определяет нетто-обязательства / нетто-требования по денежным средствам и ценным бумагам в отношении КЦ и каждого Участника клиринга по каждому денежному регистру / Субсчету депо;

4) обязательства, указанные в подпункте 2 настоящего пункта, прекращаются зачетом встречных однородных требований, указанных в подпункте 2 настоящего пункта и учитываемых на тех же регистрах учета позиций, что и указанные обязательства, а в оставшейся части КЦ определяет нетто-обязательства / нетто-требования по денежным средствам и ценным бумагам в отношении КЦ и каждого Участника клиринга по каждому денежному регистру/Субсчету депо.

29.14. После определения нетто-обязательств / нетто-требований в соответствии с пунктом 29.13 настоящих Правил КЦ формирует расчетный клиринговый пул. В указанный расчетный клиринговый пул включаются:

- неисполненные итоговые нетто-обязательства / итоговые нетто-требования по денежным средствам и ценным бумагам, определенные в соответствии с пунктом 29.5.1. настоящих Правил, или неисполненные итоговые нетто-обязательства / итоговые нетто-требования по денежным средствам и ценным бумагам, определенные в соответствии с подпунктом 6 пункта 29.11 настоящих Правил;

- нетто-обязательства / нетто-требования по денежным средствам и ценным бумагам, определенные в соответствии с подпунктами 3 и 4 пункта 29.13. настоящих Правил;

- нетто-обязательства / нетто-требования по денежным средствам и ценным бумагам, определенные в соответствии с абзацем 3 пункта 29.17 настоящих Правил.

По обязательствам / требованиям, включенным в указанный расчетный клиринговый пул, КЦ проводит неттинг (зачет), по итогам которого определяет нетто-обязательства / нетто-требования по денежным средствам и ценным бумагам КЦ в отношении каждого Участника клиринга, а также нетто-обязательства / нетто-требования по денежным средствам и ценным бумагам каждого Участника клиринга в отношении КЦ

и в отношении каждого из остальных Участников клиринга. Указанные нетто-обязательства / нетто-требования определяются по каждому денежному регистру / Субсчету депо. Определённые в соответствии с настоящим пунктом нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в отношении других Участников клиринга и КЦ совокупно составляют итоговые нетто-обязательства / итоговые нетто-требования такого Участника клиринга.

Исполнение итоговых нетто-обязательств / итоговых нетто-требований, определенных в соответствии с настоящим пунктом, осуществляется в порядке, установленном пунктами 29.6 – 29.9 настоящих Правил.

29.15. Если в случаях, предусмотренных пунктом 29.12 настоящих Правил, Участником клиринга не были заключены Договоры репо, Внебиржевые договоры репо ОТС, Пары договоров итоговое нетто-обязательство по денежным средствам исполняется в соответствии с пунктом 29.9 настоящих Правил в пределах суммы денежных средств, учитываемой на том денежном регистре, по которому должно быть исполнено итоговое нетто-обязательство. Величину превышения указанного итогового нетто-обязательства над суммой денежных средств, учитываемой на том денежном регистре, по которому оно должно быть исполнено, КЦ учитывает в качестве задолженности по данному денежному регистру. При этом отдельно учитывается задолженность Участника клиринга перед другими Участниками клиринга и перед КЦ.

29.16. Для определения итоговых нетто-обязательств / итоговых нетто-требований по Внутриброкерским Договорам и (или) по Внутриброкерским Внебиржевым договорам ОТС, за исключением обязательств и требований по денежным средствам и ценным бумагам по Внутриброкерским Договорам и Внутриброкерским Внебиржевым договорам ОТС, заключенным с указанием ТКС, в состав которого входят несколько позиций по ценным бумагам, КЦ формирует клиринговый пул по Внутриброкерским договорам.

В Дату исполнения Внутриброкерских Договоров и (или) в дату исполнения Внутриброкерских Внебиржевых договоров ОТС в клиринговый пул по Внутриброкерским договорам включаются обязательства / требования по денежным средствам и ценным бумагам, возникшие из Внутриброкерских Договоров, допущенные к клирингу в соответствии со статьей 25 настоящих Правил, с наступившими Датami исполнения и из Внутриброкерских Внебиржевых договоров ОТС, допущенных к клирингу в соответствии со статьей 25 настоящих Правил, с наступившими датами исполнения.

Обязательства и требования Участника клиринга и КЦ по денежным средствам и ценным бумагам по Внутриброкерским Договорам и по Внутриброкерским Внебиржевым договорам ОТС прекращаются зачетом в клиринговом пуле по Внутриброкерским договорам.

29.17. Для определения итоговых нетто-обязательств / итоговых нетто-требований по Внутриброкерским Договорам и (или) по Внутриброкерским Внебиржевым договорам ОТС, заключенным с указанием ТКС, в состав которого входят несколько позиций по ценным бумагам, КЦ формирует клиринговый пул по указанным Внутриброкерским договорам.

В Дату исполнения Внутриброкерских Договоров и (или) в дату исполнения Внутриброкерских Внебиржевых договоров ОТС, заключенных с указанием ТКС, в состав которого входят несколько позиций по ценным бумагам, в клиринговый пул по указанным Внутриброкерским договорам включаются обязательства / требования по денежным средствам и ценным бумагам, возникшие из указанных Внутриброкерских Договоров, допущенные к клирингу в соответствии со статьей 25 настоящих Правил, с наступившими Датami исполнения и из указанных Внутриброкерских Внебиржевых договоров ОТС, допущенных к клирингу в соответствии со статьей 25 настоящих Правил, с наступившими датами исполнения.

Обязательства и требования Участника клиринга и КЦ по денежным средствам и ценным бумагам по Внутриброкерским Договорам и по Внутриброкерским Внебиржевым договорам ОТС, заключенных с указанием ТКС, в состав которого входят несколько позиций по ценным бумагам, прекращаются зачетом в клиринговом пуле по указанным Внутриброкерским договорам, а в оставшейся части КЦ определяет нетто-обязательства / нетто-требования по денежным средствам и ценным бумагам в отношении КЦ и каждого Участника клиринга по каждому денежному регистру / Субсчету депо.

Определенные по итогам формирования такого клирингового пула нетто-обязательства / нетто-требования по денежным средствам и ценным бумагам включаются в расчетный клиринговый пул в соответствии с пунктом 29.14 настоящих Правил.

29.18. В случае если Договоры с наступившей Датой исполнения /Внебиржевые договоры ОТС с наступившей датой исполнения допущены КЦ к клирингу после начала формирования клирингового пула по Договорам/ клирингового пула ОТС, в соответствии с пунктами 29.2, 29.4 настоящей статьи КЦ формирует новый клиринговый пул по Договорам, клиринговый пул ОТС и расчетный клиринговый пул в порядке, установленном настоящей статьёй, в срок, установленный Регламентом клиринга.

Исполнение итоговых нетто-обязательств / итоговых нетто-требований, определенных в соответствии с настоящим пунктом, осуществляется в порядке, установленном пунктами 29.6 – 29.9 настоящих Правил.

В случае ненадлежащего исполнения итоговых нетто-обязательств / итоговых нетто-требований срок исполнения указанных итоговых нетто-обязательств / итоговых нетто-требований переносится на следующий Расчетный день и КЦ включает их в состав расчетного клирингового пула, формируемого в этот Расчетный день. При изменении срока исполнения итоговых нетто-обязательств / итоговых нетто-требований КЦ уведомляет Участников клиринга в порядке и в сроки, установленные Регламентом клиринга.

29.19. В процессе клиринга КЦ формирует и предоставляет Участникам клиринга информацию об итоговых нетто-обязательствах / итоговых нетто-требованиях по денежным средствам / ценным бумагам в порядке, установленном статьёй 43 настоящих Правил.

29.20. Обязательства Участника клиринга - кредитной организации, у которой отозвана лицензия на осуществление банковских операций, и обязательства Участника клиринга, который не является кредитной организацией, но в отношении которого введена процедура банкротства, в дату, следующую за датой отзыва Банком России лицензии на осуществление банковских операций, или в дату, следующую за датой принятия арбитражным судом решения о признании Участника клиринга, не являющегося кредитной организацией, банкротом и об открытии конкурсного производства, не включаются в клиринговые пулы, формируемые в соответствии с настоящей статьёй. Прекращение указанных обязательств осуществляется в порядке, предусмотренном статьёй 48 настоящих Правил.

Статья 30 Порядок урегулирования ненадлежащего исполнения обязательств.

30.1. При наличии условий, указанных в пункте 29.10 и (или) 29.12 настоящих Правил, КЦ заключает Договоры репо, Внебиржевые договоры репо ОТС и (или) Пары договоров на условиях и в порядке, определенных настоящей статьёй.

Пара договоров заключается между КЦ и Участником клиринга, если:

- при регистрации или изменении параметров ТКС, по которому учитывается позиция по денежным средствам Участника клиринга или клиента Участника клиринга - доверительного управляющего и позиция по ценным бумагам Участника клиринга или клиента Участника клиринга - доверительного управляющего, Участник клиринга указал, что в случае ненадлежащего исполнения обязательств, учитываемых в отношении

определённого денежного регистра / Субсчета депо, урегулирование указанных обязательств в соответствии с настоящей статьёй производится путем заключения Пары договоров; или

- законодательством Российской Федерации не допускается заключение Договоров репо и Внебиржевых договоров репо ОТС с ценными бумагами, в отношении которых наступили основания для заключения указанных договоров.

Первый договор, составляющий Пару договоров, заключаемую в соответствии с настоящей статьёй, исполняется в день его заключения ($k=0$), а Второй договор исполняется в следующий Расчетный день ($n=1$). В соответствии с настоящей статьёй:

- Договор репо заключается на Торгах без подачи Заявок с обязательным указанием Кода расчетов ТкТп при условии, что исполнение второй части Договора репо осуществляется в Расчетный день, следующий за датой заключения указанного Договора репо;

- Пара биржевых договоров заключается на Торгах без подачи Заявок;

- Внебиржевой договор репо ОТС заключается КЦ в отношении себя лично от имени Участника клиринга без специального полномочия (доверенности), а также без согласия Участника клиринга. При этом исполнение второй части Внебиржевого договора репо ОТС производится в Расчетный день, следующий за датой заключения указанного Внебиржевого договора репо ОТС;

- Пара внебиржевых договоров ОТС заключается КЦ в отношении себя лично от имени Участника клиринга без специального полномочия (доверенности), а также без согласия Участника клиринга.

Договоры, предусмотренные настоящим пунктом, заключаются в соответствии с настоящими Правилами в Дату исполнения по Договорам (дату исполнения по Внебиржевым договорам ОТС), обязательства из которых исполнены ненадлежащим образом.

30.2. Договоры, предусмотренные пунктом 30.1 настоящим Правил, заключаются при соблюдении следующих условий:

- а) у Участника клиринга не приостановлена или не аннулирована лицензия Банка России на осуществление банковских операций, лицензия профессионального участника рынка ценных бумаг на осуществление брокерской деятельности, дилерской деятельности и (или) деятельности по управлению ценными бумагами и (или) лицензия управляющей компании инвестиционных фондов, паевых инвестиционных фондов, негосударственных пенсионных фондов;

- б) у КЦ отсутствует информация об обстоятельствах, которые влекут или могут повлечь прекращение клирингового обслуживания Участника клиринга;

- в) КЦ не менее чем за 4 (четыре) Расчетных дня до даты заключения соответствующего договора не известил Участника клиринга посредством Электронного документа, подписанного Электронной подписью, о незаключении указанных договоров в целях исполнения Участником клиринга итогового нетто-обязательства по денежным средствам или итогового нетто-обязательства по соответствующим ценным бумагам, учитываемого в отношении определенного денежного регистра / Субсчета депо;

- г) отсутствует решение об исключении ценной бумаги, по которой учитывается итоговое нетто-обязательство, из Списка ценных бумаг со следующего Расчетного дня, отсутствует решение об исключении обязательства, являющегося предметом Внебиржевых договоров репо ОТС или Пар внебиржевых договоров, из Списка обязательств со следующего Расчетного дня ;

- д) отсутствует решение КЦ о незаключении указанных договоров в отношении ценной бумаги в связи с консолидацией, дроблением ценных бумаг, в связи с реорганизацией эмитента ценных бумаг в форме слияния, присоединения, выделения или разделения, в связи с изменением параметров ценной бумаги, а также в связи с получением от Организатора торговли уведомления о приостановке торгов ценной

бумагой или о запрете подачи заявок и заключения договоров в отношении ценной бумаги;

е) отсутствует решение эмитента или лица, выдавшего ценные бумаги, о выплате Дохода ценными бумагами.

30.3. Договоры, предусмотренные пунктом 30.1 настоящих Правил, заключаются между КЦ и недобросовестным Участником клиринга на следующих условиях:

- в случае ненадлежащего исполнения Участником клиринга итогового нетто-обязательства по ценным бумагам:

А) по первой части Договора репо, по первой части Внебиржевого договора репо ОТС или по Первому договору, составляющему Пару договоров, КЦ обязан передать Участнику клиринга ценные бумаги, являющиеся предметом итогового нетто-обязательства, в количестве, равном количеству, в отношении которого оно не было исполнено, а Участник клиринга обязан принять их и оплатить. В случае ненадлежащего исполнения нетто-обязательств по ценным бумагам, учитываемым на регистре или регистрах учета позиций по ТКС, в состав которого входят несколько позиций по ценным бумагам, количество ценных бумаг, которое КЦ обязан передать Участнику клиринга, определяется как разница между суммой позиций по ценным бумагам, входящим в состав ТКС, и суммой нетто-обязательств по ценным бумагам, определенным по каждому Субсчету депо, соответствующим депо регистрам, входящим в тот же ТКС;

Б) по второй части Договора репо, по второй части Внебиржевого договора репо ОТС или по Второму договору, составляющему Пару договоров, Участник клиринга обязан передать КЦ ценные бумаги, являющиеся предметом Договора репо, Внебиржевого договора репо ОТС или Пары договоров, в том же количестве, а КЦ обязан принять их и оплатить;

- в случае ненадлежащего исполнения Участником клиринга итогового нетто-обязательства по денежным средствам:

А) по первой части Договора репо, по первой части Внебиржевого договора репо ОТС или по Первому договору, составляющему Пару договоров, Участник клиринга обязан передать КЦ ценные бумаги в количестве, не превышающем количества, определенного исходя из суммы неисполненной части итогового денежного обязательства и цены одной ценной бумаги, а КЦ обязан принять их и оплатить;

Б) по второй части Договора репо, по второй части Внебиржевого договора репо ОТС или по Второму договору, составляющему Пару договоров, КЦ обязан передать Участнику клиринга ценные бумаги, являющиеся предметом Договора репо, Внебиржевого договора репо ОТС или Пары договоров, в том же количестве, а Участник клиринга обязан принять их и оплатить;

В) КЦ по своему усмотрению определяет ценные бумаги, являющиеся предметом Договора репо, Внебиржевого договора репо ОТС или Пары договоров. При этом Участник клиринга считается согласившимся заключить Договор репо, Внебиржевой договор репо ОТС или Пару договоров в отношении таких ценных бумаг;

- цена одной ценной бумаги по первой части Договора репо, по первой части Внебиржевого договора репо ОТС или по Первому договору, составляющему Пару договоров, считается равной цене этой ценной бумаги, определенной КЦ для целей заключения договоров в соответствии с настоящей статьей, а также для заключения Донорских договоров в соответствии с Методикой установления и изменения риск-параметров (далее – Цена урегулирования исполнения обязательств).

- цена одной ценной бумаги по второй части Договора репо, по второй части Внебиржевого договора репо ОТС или по Второму договору, составляющему Пару договоров, определяется исходя из цены одной ценной бумаги по первой части Договора репо, по первой части Внебиржевого договора репо ОТС или по Первому договору, составляющему Пару договоров, сроков исполнения обязательств по передаче ценных бумаг по первой и второй частям Договора репо (Внебиржевого договора репо ОТС) или

по Первому договору и по Второму договору, составляющим Пару договоров, и Ставки репо;

- Ставка репо устанавливается КЦ и раскрывается на Сайте КЦ;
- обязательства по передаче ценных бумаг и их оплате по первой части Договора репо, по первой части Внебиржевого договора репо ОТС или по Первому договору, составляющему Пару договоров, подлежат исполнению в день заключения соответствующего договора;

- обязательства по передаче ценных бумаг и их оплате по второй части Договора репо, по второй части Внебиржевого договора репо ОТС или по Второму договору, составляющему Пару договоров, подлежат исполнению в Расчетный день, следующий за днем заключения соответствующего договора;

- определение и исполнение обязательств по Договору репо, по Внебиржевому договору репо ОТС или по Парам договоров, осуществляется в соответствии с настоящими Правилами.

КЦ взимает штраф с недобросовестного Участника клиринга.

Величина штрафа рассчитывается по следующей формуле:

А) в случае ненадлежащего исполнения Участником клиринга итогового нетто-обязательства по ценным бумагам:

$$\text{Penalty} = \text{Sum} \times \text{fine_short} \times \left(\frac{T_{365}}{365} + \frac{T_{366}}{366} \right),$$

Б) в случае ненадлежащего исполнения Участником клиринга итогового нетто-обязательства по денежным средствам:

$$\text{Penalty} = \text{Sum} \times \text{fine_long} \times \left(\frac{T_{365}}{365} + \frac{T_{366}}{366} \right),$$

где:

Penalty – величина штрафа;

Sum – сумма, рассчитываемая исходя из цены первой части Договора репо, первой части Внебиржевого договора репо ОТС или Первого договора, составляющего Пару договоров, и количества ценных бумаг, являющихся предметом этого договора. При этом, если предметом соответствующего договора являются облигации, в расчете величины Sum учитывается также накопленный купонный доход, рассчитываемый в соответствии с решением о выпуске (дополнительном) выпуске ценных бумаг;

fine_short, fine_long – штрафные ставки, установленные КЦ для каждой ценной бумаги, включенной в Список ценных бумаг / Список обязательств, в соответствии с Методикой установления и изменения риск-параметров;

T_{365} – количество календарных дней между Датой исполнения первой части Договора репо, датой исполнения первой части Внебиржевого договора репо ОТС, Датой исполнения Первого договора, составляющего Пару биржевых договоров, или датой исполнения Первого договора, составляющего Пару внебиржевых договоров ОТС, и соответственно Датой исполнения второй части Договора репо, датой исполнения второй части Внебиржевого договора репо ОТС, Датой исполнения Второго договора, составляющего Пару биржевых договоров, или датой исполнения Второго договора, составляющего Пару внебиржевых договоров ОТС, которое приходится на календарный год, состоящий из 365 дней;

T_{366} - количество календарных дней между Датой исполнения первой части Договора, датой исполнения первой части Внебиржевого договора репо ОТС, Датой исполнения Первого договора, составляющего Пару биржевых договоров, или датой исполнения Первого договора, составляющего Пару внебиржевых договоров ОТС, и соответственно Датой исполнения второй части Договора репо, датой исполнения второй части Внебиржевого договора репо ОТС, Датой исполнения Второго договора, составляющего Пару биржевых договоров, или датой исполнения Второго договора,

составляющего Пару внебиржевых договоров ОТС, которое приходится на календарный год, состоящий из 366 дней.

Обязательство Участника клиринга по уплате штрафа допускается к клирингу в момент его возникновения на основании информации, указанной в настоящем пункте, и включается в клиринговый пул для расчетов по итогам Торгов, формируемый в соответствии со статьей 35 настоящих Правил, в дату заключения Договора репо, Внебиржевого договора репо ОТС или Пары договоров.

При наличии у Участника клиринга итогового нетто-обязательства по денежным средствам, которое не может быть исполнено, и учитываемого в отношении определенного денежного регистра, Договор репо, Внебиржевой договор репо ОТС или Пара договоров в соответствии с настоящим пунктом заключается в отношении ценных бумаг, которые учитываются на депо регистре, входящем в тот же ТКС, что и указанный денежный регистр.

30.4. В случае недостаточности свободных собственных денежных средств и (или) ценных бумаг КЦ, учитываемых на Клиринговых счетах, а также при наличии недобросовестных Участников клиринга, итоговые нетто-требования по денежным средствам / ценным бумагам добросовестных Участников клиринга удовлетворяются или прекращаются КЦ путем выполнения КЦ действий в следующей последовательности:

30.4.1. заключение Донорского договора в соответствии со статьей 31 настоящих Правил;

30.4.2. в случае невозможности заключения Донорского договора - заключение КЦ с добросовестным Участником клиринга без подачи Заявок на Торгах Договоров репо, в которых указывается Код расчетов ТкТп, или Пары биржевых договоров с добросовестным Участником клиринга либо заключение Внебиржевого договора репо ОТС или Пары внебиржевых договоров ОТС, на следующих условиях:

- в случае ненадлежащего исполнения КЦ итогового нетто-обязательства по ценным бумагам:

А) по первой части Договора репо, по первой части Внебиржевого договора репо ОТС или по Первому договору, составляющему Пару договоров, Участник клиринга обязан передать КЦ ценные бумаги, являющиеся предметом итогового нетто-обязательства, в количестве, равном количеству, в отношении которого оно не было исполнено, а КЦ обязан принять их и оплатить;

Б) по второй части Договора репо, по второй части Внебиржевого договора репо ОТС или по Второму договору, составляющему Пару договоров, КЦ обязан передать Участнику клиринга ценные бумаги, являющиеся предметом соответствующего договора, в том же количестве, а Участник клиринга обязан принять их и оплатить;

- в случае ненадлежащего исполнения КЦ итогового нетто-обязательства по денежным средствам:

А) по первой части Договора репо, по первой части Внебиржевого договора репо ОТС или по Первому договору, составляющему Пару договоров, КЦ обязан передать Участнику клиринга ценные бумаги в количестве, не превышающем количества, определенного исходя из суммы неисполненной части итогового денежного обязательства и цены одной ценной бумаги, а Участник клиринга обязан принять их и оплатить;

Б) по второй части Договора репо, по второй части Внебиржевого договора репо ОТС или по Второму договору, составляющему Пару договоров, Участник клиринга обязан передать КЦ ценные бумаги, являющиеся предметом соответствующего договора, в том же количестве, а КЦ обязан принять их и оплатить;

В) КЦ по своему усмотрению определяет ценные бумаги, являющиеся предметом Договора репо, Внебиржевого договора репо ОТС или Пары договоров, при этом Участник клиринга считается согласившимся заключить Договор репо, Внебиржевой договор репо ОТС или Пару договоров в отношении таких ценных бумаг;

- цена одной ценной бумаги по первой части Договора репо, по первой части Внебиржевого договора репо ОТС или по Первому договору, составляющему Пару договоров, считается равной Цене урегулирования исполнения обязательств по этой ценной бумаге.;

- цена одной ценной бумаги по второй части Договора репо, по второй части Внебиржевого договора репо ОТС или по Второму договору, составляющему Пару договоров, определяется исходя из цены одной ценной бумаги по первой части Договора репо, по первой части Внебиржевого договора репо ОТС или по Первому договору, составляющему Пару договоров, сроков исполнения обязательств по передаче ценных бумаг по первой и второй частям Договора репо или Внебиржевого договора репо ОТС либо по Первому договору и Второму договору, составляющим Пару договоров, и Ставки репо;

- Ставка репо устанавливается КЦ и раскрывается на Сайте КЦ;

- обязательства по передаче ценных бумаг и их оплате по первой части Договора репо, по первой части Внебиржевого договора репо ОТС или по Первому договору, составляющему Пару договоров, подлежат исполнению в день заключения соответствующего договора;

- обязательства по передаче ценных бумаг и их оплате по второй части Договора репо, по второй части Внебиржевого договора репо ОТС или по Второму договору, составляющему Пару договоров, подлежат исполнению в Расчетный день, следующий за днем заключения соответствующего договора;

- определение и исполнение обязательств по Договору репо, по Внебиржевому договору репо ОТС или по Паре договоров осуществляется в соответствии с настоящими Правилами.

КЦ уплачивает добросовестному Участнику клиринга штраф.

Величина штрафа рассчитывается по следующей формуле:

А) в случае ненадлежащего исполнения КЦ итогового нетто-обязательства по ценным бумагам:

$$\text{Penalty} = \text{Sum} \times \text{ch_fine_short} \times \left(\frac{T_{365}}{365} + \frac{T_{366}}{366} \right),$$

Б) в случае ненадлежащего исполнения КЦ итогового нетто-обязательства по денежным средствам:

$$\text{Penalty} = \text{Sum} \times \text{ch_fine_long} \times \left(\frac{T_{365}}{365} + \frac{T_{366}}{366} \right),$$

где:

Penalty – величина штрафа;

Sum – сумма, рассчитываемая исходя из цены первой части Договора репо, первой части Внебиржевого договора репо ОТС, Первого договора, составляющего Пару договоров, и количества ценных бумаг, являющихся предметом этого договора. При этом, если предметом соответствующего договора являются облигации, в расчете величины Sum учитывается также накопленный купонный доход, рассчитываемый в соответствии с решением о выпуске (дополнительном) выпуске ценных бумаг;

ch_fine_short, ch_fine_long – штрафные ставки, установленные КЦ для каждой ценной бумаги, включенной в Список ценных бумаг/Список обязательств, в соответствии с Методикой установления и изменения риск-параметров;

T_{365} – количество календарных дней между Датой исполнения первой части Договора репо, датой исполнения первой части Внебиржевого договора репо ОТС, Датой исполнения Первого договора, составляющего Пару биржевых договоров, или датой исполнения Первого договора, составляющего Пару внебиржевых договоров ОТС, и соответственно Датой исполнения второй части Договора репо, датой исполнения второй части Внебиржевого договора репо ОТС, Датой исполнения Второго договора, составляющего Пару биржевых договоров, или датой исполнения Второго договора,

составляющего Пару внебиржевых договоров ОТС, которое приходится на календарный год, состоящий из 365 дней;

T_{366} - количество календарных дней между Датой исполнения первой части Договора, датой исполнения первой части Внебиржевого договора репо ОТС, Датой исполнения Первого договора, составляющего Пару биржевых договоров, или датой исполнения Первого договора, составляющего Пару внебиржевых договоров ОТС, и соответственно Датой исполнения второй части Договора репо, датой исполнения второй части Внебиржевого договора репо ОТС, Датой исполнения Второго договора, составляющего Пару биржевых договоров, или датой исполнения Второго договора, составляющего Пару внебиржевых договоров ОТС, которое приходится на календарный год, состоящий из 366 дней.

Обязательство КЦ по уплате штрафа допускается к клирингу в момент его возникновения и включается в клиринговый пул для расчётов по итогам Торгов, формируемый в соответствии со статьёй 35 настоящих Правил, в дату заключения Договора репо, в котором указан Код расчетов TkTn, Внебиржевого договора репо ОТС или Пары договоров.

30.5. В случае невозможности исполнения Участником клиринга своих итоговых нетто-обязательств по денежным средствам / ценным бумагам вследствие обстоятельств непреодолимой силы и (или) сбоя в платёжной системе Банка России, штраф, определяемый в соответствии с пунктом 30.3 настоящих Правил, не взимается. О возникновении указанных обстоятельств Участник клиринга обязан уведомить КЦ любыми доступными средствами связи до установленного Регламентом клиринга времени исполнения итоговых нетто-обязательств по денежным средствам / ценным бумагам.

Участник клиринга обязан предоставить КЦ документы, подтверждающие наличие обстоятельств непреодолимой силы в течение 7 (семи) дней. В случае непредоставления Участником клиринга в КЦ таких документов в указанный срок КЦ взыскивает с Участника клиринга штраф, определяемый в соответствии с пунктом 30.3 настоящих Правил, в расчёте на количество календарных дней между Датой исполнения первой части Договора репо, датой исполнения первой части Внебиржевого договора репо ОТС, Датой исполнения Первого договора, составляющего Пару биржевых договоров, или датой исполнения Первого договора, составляющего Пару внебиржевых договоров ОТС, и датой расчёта неустойки.

30.6. КЦ вправе, несмотря на наличие обязанности по заключению договоров, предусмотренной пунктом 30.1 настоящих Правил, известить Участников клиринга о незаключении Договоров репо, Внебиржевых договоров репо ОТС или Пары договоров в случаях:

- несоблюдение условий, указанных в пункте 30.2 настоящих Правил;
- принятие решения об исключении ценной бумаги, по которой учитывается итоговое нетто-обязательство, из Списка ценных бумаг и (или) принятие решения об исключении обязательств, возникших из Внебиржевых договоров репо ОТС или Пар внебиржевых договоров, из Списка обязательств со следующего Расчётного дня;
- консолидации, дробления ценных бумаг, реорганизации эмитента ценных бумаг в форме слияния, присоединения, выделения или разделения, изменения параметров ценной бумаги, а также получения от Организатора торговли уведомления о приостановке торгов ценными бумагами или о запрете подачи заявок и заключения договоров в отношении ценной бумаги;
- принятия решения эмитента или лица, выдавшего ценные бумаги, о выплате Дохода ценными бумагами;
- принятия решения КЦ о незаключении Договора репо, Внебиржевого договора репо ОТС, Пар договоров с обязательным уведомлением Участника клиринга за 4 (четыре) Расчётных дня до даты незаключения указанных договоров, посредством Электронного документа, подписанного Электронной подписью.

30.7. В случае принятия решения о незаключении КЦ Договоров репо, Внебиржевых договоров репо ОТС, Пар договоров КЦ осуществляет процедуру принудительного закрытия позиций Участника клиринга, в отношении которого КЦ принял решение о незаключении указанных договоров в соответствии со статьей 21 настоящих Правил. КЦ вправе принять решение о начале процедуры принудительного закрытия за два Расчетных дня до даты, с которой КЦ принял решение о незаключении Договоров репо, Внебиржевых договоров репо ОТС, Пар договоров в случае, если такое решение принято в связи с основаниями, предусмотренными абзацами 3 - 5 пункта 30.6 настоящих Правил.

Принудительное закрытие производится при соблюдении следующих условий:

- Сторонами по Договору, Внебиржевому договору ОТС является КЦ и Участник клиринга, в отношении которого осуществляется принудительное закрытие;
- Дата исполнения и (или) дата исполнения, установленная Внебиржевым договором ОТС, приходится на дату, с которой КЦ принял решение о незаключении Договоров репо, Внебиржевых договоров репо ОТС, Пар договоров;
- цена одной ценной бумаги по Договору / Внебиржевому договору ОТС равна Цене урегулирования исполнения обязательств по данной ценной ;
- в случае заключения Договора / Внебиржевого договора купли-продажи ОТС предметом которого являются ценные бумаги иностранных эмитентов за исключением: 1) финансовых инструментов, квалифицированных в качестве облигаций, номинированных в валюте, отличной от российского рубля; 2) ценных бумаг иностранных эмитентов, личным законом которых является право государств - участников СНГ, за исключением ценных бумаг, квалифицированных в качестве облигаций, номинированных в валюте, отличной от национальной валюты эмитента соответствующих ценных бумаг, КЦ рассчитывает сумму компенсации.

Сумма компенсации рассчитывается по следующей формуле:

$$\text{Refund} = (\text{RefP}_t - \text{PD}) \times Q,$$

где:

Refund – сумма компенсации;

RefP_t – расчетная цена ценной бумаги, являющейся предметом Договора или Внебиржевого договора купли-продажи ОТС, определенная по итогам проведения следующей после заключения Договора / Внебиржевого договора ОТС Клиринговой сессии;

PD – цена одной ценной бумаги по заключённому Договору или Внебиржевому договору купли-продажи ОТС;

Q – количество ценных бумаг, являющихся предметом Договора или Внебиржевого договора купли-продажи ОТС.

Если сумма компенсации, рассчитанная по указанной формуле, является положительной величиной, то в случае наличия у Участника клиринга нетто-обязательства по денежным средствам, в отношении которых осуществляется процедура принудительного закрытия, сумма компенсации зачисляется КЦ указанному Участнику клиринга, а в случае наличия у Участника клиринга, в отношении которого осуществляется процедура принудительного закрытия, нетто-требования по денежным средствам, сумма компенсации подлежит списанию с указанного Участника клиринга в пользу КЦ.

Если сумма компенсации, рассчитанная по указанной формуле, является отрицательной величиной, то в случае наличия у Участника клиринга нетто-обязательства по денежным средствам, в отношении которых осуществляется процедура принудительного закрытия, то абсолютное значение этой величины подлежит списанию с указанного Участника клиринга в пользу КЦ, а в случае наличия у Участника клиринга, в отношении которого осуществляется процедура принудительного закрытия, нетто-

требования по денежным средствам, абсолютное значение суммы компенсации подлежит зачислению КЦ указанным Участником клиринга.

Обязательство по уплате / требование по получению компенсации допускается к клирингу с момента возникновения указанного обязательства. Обязательство по уплате / требование по получению компенсации включается в клиринговый пул для расчетов по итогам Торгов, формируемый в соответствии со статьей 35 настоящих Правил, в дату, следующую за датой заключения Договора или Внебиржевого договора купли-продажи ОТС, указанного в настоящем пункте.

30.8. Обязательства, возникшие из договоров, заключаемых в соответствии с пунктами 30.3, 30.4 и 30.7 настоящих Правил, допускаются к клирингу в момент возникновения указанных обязательств и включаются в клиринговый пул по Договорам в Дату исполнения и (или) в клиринговый пул ОТС в дату исполнения, определяемую условиями Внебиржевого договора купли-продажи ОТС / Внебиржевого договора репо ОТС.

30.9. Для целей урегулирования ненадлежащего исполнения обязательств в соответствии с настоящей статьей, КЦ вправе использовать информацию о кодах клиентов Участников клиринга, предоставленную Участником клиринга по форме, установленной Регламентом клиринга, в виде Электронного документа, подписанного Электронной подписью. Указанная информация может быть также использована для целей принудительного закрытия Участника клиринга.

30.10. В дату заключения Договоров или Внебиржевых договоров ОТС в соответствии с пунктами 30.3, 30.4 и 30.7 настоящих Правил, информация об указанных договорах включается в состав сведений, предоставляемых КЦ Участникам клиринга в соответствии со статьей 43 настоящих Правил.

Статья 31. Донорский договор

31.1. Между Участником клиринга и КЦ может быть заключен Донорский договор, являющийся Договором репо, Внебиржевым договором репо ОТС или Парой договоров.

31.2. Пара договоров, являющаяся Донорским договором, заключается КЦ с Участником клиринга в случае, если:

- при регистрации или изменении параметров ТКС, по которому учитывается позиция по денежным средствам Участника клиринга или клиента Участника клиринга - доверительного управляющего и позиция по ценным бумагам Участника клиринга или клиента Участника клиринга - доверительного управляющего, Участник клиринга указал, что в случае ненадлежащего исполнения обязательств, учитываемых в отношении определённого денежного регистра/ Субсчета депо, урегулирование указанных обязательств в соответствии с настоящей статьей производится путем заключения Пары договоров; или

- законодательством Российской Федерации не допускается заключение Договоров репо и Внебиржевых договоров репо ОТС с ценными бумагами, в отношении которых наступили основания для заключения указанных договоров.

Первый договор, составляющий Пару договоров, заключаемую в соответствии с настоящей статьей, исполняется в день его заключения ($k=0$), а Второй договор исполняется в следующий Расчетный день ($n=1$).

31.3. В соответствии с настоящей статьей:

- Договор репо заключается без подачи Заявок с обязательным указанием Кода расчетов TkTn при условии, что исполнение второй части Договора репо осуществляется в Расчетный день, следующий за датой заключения указанного Договора репо;

- Пара биржевых договоров заключается на Торгах без подачи Заявок;

- Внебиржевой договор репо ОТС заключается КЦ в отношении себя лично от имени Участника клиринга без специального полномочия (доверенности), а также без

согласия Участника клиринга. При этом исполнение второй части Внебиржевого договора репо ОТС производится в Расчетный день, следующий за датой заключения указанного Внебиржевого договора репо ОТС;

- Пара внебиржевых договоров ОТС заключается КЦ в отношении себя лично от имени Участника клиринга без специального полномочия (доверенности), а также без согласия Участника клиринга.

Договоры, предусмотренные настоящим пунктом, заключаются в соответствии с настоящими Правилами в Дату исполнения по Договорам (дату исполнения по Внебиржевым договорам ОТС), обязательства из которых исполнены ненадлежащим образом.

31.4. Предметом Донорского договора могут являться исключительно ценные бумаги, включенные в Список ценных бумаг (если он заключается на Торгах) или в Список обязательств (если он заключается не на Торгах).

31.5. В случае недостаточности у КЦ ценных бумаг для исполнения нетто-обязательств перед добросовестным Участником клиринга, по первой части Договора репо, по первой части Внебиржевого договора репо ОТС или по Первому договору, составляющему Пару договоров, продавцом ценных бумаг является Участник клиринга, а покупателем является КЦ. По второй части Договора репо, по второй части Внебиржевого договора репо ОТС или по Второму договору, составляющему Пару договоров, продавцом ценных бумаг является КЦ, а покупателем является Участник клиринга.

В случае недостаточности у КЦ денежных средств для исполнения нетто-обязательств перед добросовестным Участником клиринга, по первой части Договора репо, по первой части Внебиржевого договора репо ОТС или по Первому договору, составляющему Пару договоров, продавцом ценных бумаг является КЦ, а покупателем является Участник клиринга. По второй части Договора репо, по второй части Внебиржевого договора репо ОТС или по Второму договору, составляющему Пару договоров, продавцом ценных бумаг является Участник клиринга, а покупателем является КЦ.

31.6. Донорский договор может быть заключен с Участником клиринга, который представил соответствующее заявление, при условии, что:

- в заявлении указаны ТКС и объёмы денежных средств и (или) ценных бумаг, доступных для заключения Донорских договоров;
- заявление составлено по форме и в порядке, установленной Регламентом клиринга, в виде Электронного документа, подписанного Электронной подписью;
- заявление действует и не отозвано Участником клиринга.

Участник клиринга, предоставляя указанное заявление КЦ, заверяет о том, что он обладает всеми необходимыми поручениями, полномочиями и корпоративными одобрениями на заключение Донорских договоров в отношении денежных средств и (или) ценных бумаг, учитываемых на Клиринговом денежном счете, Субсчете депо, указанных в предоставляемом заявлении. Указанное заверение является заверением об обстоятельствах по смыслу статьи 431.2 Гражданского кодекса Российской Федерации, которое имеет существенное значение для КЦ и на которое КЦ полагается.

КЦ при заключении Донорских договоров вправе начать использовать информацию о ТКС и об объемах денежных средств и (или) ценных бумаг, указанных в заявлении, в любой момент времени в течение 3 (трех) Расчетных дней с даты получения указанного заявления от Участника клиринга. Выбор Участника клиринга, с которым в случае необходимости заключается Донорский договор, а также определение количества денежных средств и (или) ценных бумаг, выраженное в штуках, в отношении которых заключается Донорский договор, осуществляется КЦ с учетом информации, указанной в заявлении.

31.7. Условия Донорского договора:

- в случае недостаточности у КЦ денежных средств для исполнения итогового нетто-обязательства перед добросовестным Участником клиринга:

А) по первой части Договора репо КЦ, по первой части Внебиржевого договора репо ОТС или по Первому договору, составляющему Пару договоров, КЦ обязан передать Участнику клиринга ценные бумаги, являющиеся предметом итогового нетто-обязательства добросовестного Участника клиринга перед КЦ, в количестве, определенном исходя из суммы нехватки денежных средств КЦ для исполнения итогового нетто-обязательства перед добросовестным Участником клиринга и цены одной ценной бумаги, а Участник клиринга обязан принять их и оплатить;

Б) по второй части Договора репо, по второй части Внебиржевого договора репо ОТС или по Второму договору, составляющему Пару договоров, Участник клиринга обязан передать КЦ ценные бумаги, являющиеся предметом соответствующего договора, в том же количестве, а КЦ обязан принять их и оплатить;

- в случае недостаточности у КЦ ценных бумаг для исполнения итогового нетто-обязательства перед добросовестным Участником клиринга:

А) по первой части Договора репо КЦ, по первой части Внебиржевого договора репо ОТС или по Первому договору, составляющему Пару договоров, Участник клиринга обязан передать КЦ ценные бумаги, являющиеся предметом итогового нетто-обязательства КЦ перед добросовестным Участником клиринга, в количестве, не превышающем объем нехватки ценных бумаг КЦ для исполнения итогового нетто-обязательства перед добросовестным Участником клиринга, а КЦ обязан принять их и оплатить;

Б) по второй части Договора репо, по второй части Внебиржевого договора репо ОТС или по Второму договору, составляющему Пару договоров, КЦ обязан передать Участнику клиринга ценные бумаги, являющиеся предметом соответствующего договора, в том же количестве, а Участник клиринга обязан принять их и оплатить;

- цена одной ценной бумаги по первой части Договора репо, по первой части Внебиржевого договора репо ОТС или по Первому договору, составляющему Пару договоров, считается равной Цене урегулирования исполнения обязательств по этой ценной бумаге;

- цена одной ценной бумаги по второй части Договора репо, по второй части Внебиржевого договора репо ОТС или по Второму договору, составляющему Пару договоров, определяется исходя из цены одной ценной бумаги соответственно по первой части Договора репо, по первой части Внебиржевого договора репо ОТС или по Первому договору, составляющему Пару договоров, из сроков исполнения обязательств по передаче ценных бумаг по первой и второй частям Договора репо КЦ или Внебиржевого договора репо ОТС либо по Первому договору и Второму договору, составляющим Пару договоров, и из Ставки репо;

- Ставка репо устанавливается КЦ и раскрывается на Сайте КЦ;

- обязательства по передаче ценных бумаг и их оплате по первой части Договора репо, по первой части Внебиржевого договора репо ОТС или по Первому договору, составляющему Пару договоров, подлежат исполнению в день заключения соответствующего договора;

- обязательства по передаче ценных бумаг и их оплате по второй части Договора репо, по второй части Внебиржевого договора репо ОТС или по Второму договору, составляющему Пару договоров, подлежат исполнению в Расчетный день, следующий за днем заключения соответствующего договора;

- определение и исполнение обязательств по Донорскому договору осуществляется в соответствии с настоящими Правилами.

КЦ уплачивает Участнику клиринга штраф.

Величина штрафа рассчитывается по следующей формуле:

А) в случае недостаточности у КЦ денежных средств для исполнения итогового нетто-обязательства перед добросовестным Участником клиринга:

$$\text{Penalty} = \text{Sum} \times \text{ch}_{\text{fineborrow_money}} \times \left(\frac{T_{365}}{365} + \frac{T_{366}}{366} \right),$$

Б) в случае недостаточности у КЦ ценных бумаг для исполнения итогового нетто-обязательства перед добросовестным Участником клиринга:

$$\text{Penalty} = \text{Sum} \times \text{ch}_{\text{fineborrow_security}} \times \left(\frac{T_{365}}{365} + \frac{T_{366}}{366} \right),$$

где:

Penalty – величина штрафа;

Sum – сумма, рассчитываемая исходя из цены первой части Договора репо, первой части Внебиржевого договора репо ОТС или Первого договора, составляющего Пару договоров, и количества ценных бумаг, являющихся предметом этого договора. При этом, если предметом соответствующего договора являются облигации, в расчете величины Sum учитывается также накопленный купонный доход, рассчитываемый в соответствии с решением о выпуске (дополнительном) выпуске ценных бумаг;

ch_fine_borrow_money, ch_fine_borrow_security – штрафная ставка, установленная КЦ для каждой ценной бумаги, включенной в Список ценных бумаг/Список обязательств, в соответствии с Методикой установления и изменения риск-параметров;

T₃₆₅ – количество календарных дней между Датой исполнения первой части Договора репо, датой исполнения первой части Внебиржевого договора репо ОТС, Датой исполнения Первого договора, составляющего Пару биржевых договоров, или датой исполнения Первого договора, составляющего Пару внебиржевых договоров ОТС, и соответственно Датой исполнения второй части Договора репо, датой исполнения второй части Внебиржевого договора репо ОТС, Датой исполнения Второго договора, составляющего Пару биржевых договоров, или датой исполнения Второго договора, составляющего Пару внебиржевых договоров ОТС, которое приходится на календарный год, состоящий из 365 дней;

T₃₆₆ – количество календарных дней между Датой исполнения первой части Договора, датой исполнения первой части Внебиржевого договора репо ОТС, Датой исполнения Первого договора, составляющего Пару биржевых договоров, датой исполнения Первого договора, составляющего Пару внебиржевых договоров ОТС, и соответственно Датой исполнения второй части Договора репо, датой исполнения второй части Внебиржевого договора репо ОТС, Датой исполнения Второго договора, составляющего Пару биржевых договоров, или датой исполнения Второго договора, составляющего Пару внебиржевых договоров ОТС, которое приходится на календарный год, состоящий из 366 дней.

Обязательство КЦ по уплате штрафа допускается к клирингу в момент его возникновения и включается в клиринговый пул для расчётов по итогам Торгов, формируемый в соответствии со статьей 35 настоящих Правил, в дату заключения Договора репо, Внебиржевого договора ОТС или Пары договоров.

31.8. КЦ заключает Договоры репо или Пары договоров в объеме не более, чем указано в заявлении на заключение Донорского договора, в случае недостаточности у КЦ ценных бумаг и (или) денежных средств для исполнения итоговых нетто-требований добросовестных Участников клиринга, с Участниками клиринга, предоставившими указанное заявление с использованием ТКС, указанных в данном заявлении, при условии, что на денежном регистре / Субсчете депо, входящем в состав данного ТКС, учитываются недостающие у КЦ ценные бумаги и (или) денежные средства.

Участник клиринга, предоставляя указанное заявление КЦ, заверяет о том, что ценные бумаги, доступные для заключения Донорских договоров, не обременены правами

Участника клиринга и иных лиц. Указанное заверение является заверением об обстоятельствах по смыслу статьи 431.2 Гражданского кодекса Российской Федерации, которое имеет существенное значение для КЦ и на которое КЦ полагается.

31.9. Обязательства, возникшие из Донорских договоров, допускаются к клирингу в момент заключения Донорских договоров в соответствии с настоящей статьей Правил и включаются в клиринговый пул по Договорам или в клиринговый пул ОТС в Дату исполнения / дату исполнения.

31.10. В дату заключения Донорских договоров информация об указанных договорах включается в состав сведений, предоставляемых КЦ Участникам клиринга в соответствии со статьей 43 настоящих Правил.

Статья 32 Порядок формирования клирингового пула по Договорам размещения и выкупа. Порядок исполнения / прекращения обязательств, допущенных к клирингу

32.1. Для определения итоговых нетто-обязательств / нетто-требований по Договорам, в которых указан Код расчетов Х0 и Код расчетов W0, КЦ формирует клиринговый пул по указанным Договорам. В указанный клиринговый пул включаются допущенные к клирингу обязательства и требования, возникшие из указанных Договоров, с наступившими Датой исполнения.

32.2. Сроки, в которые КЦ формирует клиринговый пул по Договорам, в которых указан Код расчетов Х0 и Код расчетов W0, устанавливаются Регламентом клиринга. КЦ вправе установить срок, отличный от срока, установленного в Регламенте клиринга, известив Участников клиринга об изменении срока посредством Системы, Сайта КЦ и (или) в форме Электронного документа, подписанного Электронной подписью, не менее чем за 1 (один) Расчетный день до даты вступления в силу решения КЦ об изменении указанного срока.

32.3. В день формирования клирингового пула по Договорам, в которых указан Код расчетов Х0 и Код расчетов W0:

- КЦ включает в клиринговый пул по Договорам размещения и выкупа, обязательства и требования Участников клиринга по денежным средствам и ценным бумагам по Договорам, в которых указан Код расчетов Х0 и Код расчетов W0, с наступившей Датой исполнения;

- обязательства зачитываются со встречными однородными требованиями Участников клиринга по денежным средствам и ценным бумагам по вышеуказанным Договорам, с наступившей Датой исполнения, а в части, в которой обязательства и встречные однородные требования не были зачтены, КЦ определяет итоговые нетто-обязательства и (или) итоговые нетто-требования по денежным средствам / ценным бумагам каждого Участника клиринга по каждому денежному регистру / позиции по ценным бумагам Участника клиринга – Продавца / Субсчету депо, через которые будет осуществляться исполнение итоговых нетто-обязательств и (или) итоговых нетто-требований.

32.4. Участник клиринга обязан исполнить свои итоговые нетто-обязательства по денежным средствам и (или) ценным бумагам, возникшие по итогам клиринга обязательств из клирингового пула по Договорам размещения и выкупа, в срок, установленный Регламентом клиринга.

КЦ вправе установить срок, в течение которого Участник клиринга обязан исполнить свои итоговые нетто-обязательства по денежным средствам и (или) ценным бумагам, отличный от срока, установленного в Регламенте клиринга, известив Участников клиринга об изменении указанного срока посредством Системы, Сайта КЦ и (или) в форме Электронного документа, подписанного Электронной подписью не позднее окончания периода времени для заключения Договоров размещения и выкупа, установленного Организатором торговли.

32.5. Исполнение итоговых нетто-обязательств и итоговых нетто-требований осуществляется в порядке, определенном в пунктах 32.6 – 32.8 настоящих Правил.

32.6. Исполнение итоговых нетто-обязательств Участника клиринга – Продавца по ценным бумагам, возникших по Договорам, в которых указан Код расчетов X0, возможно только после исполнения итоговых нетто-обязательств Участников клиринга по денежным средствам, возникших по указанным Договорам.

Исполнение итоговых нетто-обязательств Участника клиринга по денежным средствам, возникших по Договорам, в которых указан Код расчетов W0, возможно только после исполнения итоговых нетто-обязательств Участников клиринга по ценным бумагам, возникших по указанным Договорам.

32.7. Для исполнения итогового нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам, учитываемых в отношении определенного денежного регистра / позиции по ценным бумагам Участника клиринга–Продавца / Субсчета депо, используются денежные средства / ценные бумаги, учитываемые по тому же денежному регистру / позиции по ценным бумагам Участника клиринга–Продавца / Субсчета депо.

32.8. Итоговое нетто-обязательство Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам может быть исполнено по денежному регистру / позиции по ценным бумагам Участника клиринга–Продавца / Субсчета депо, в отношении которого оно определено, если размер денежных средств / ценных бумаг, учитываемых по тому же денежному регистру/ позиции по ценным бумагам Участника клиринга–Продавца / Субсчета депо, не меньше, чем итоговое нетто-обязательство Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам, определенное по денежному регистру / позиции по ценным бумагам Участника клиринга–Продавца/Субсчета депо.

Исполнение итоговых нетто-обязательств и итоговых нетто-требований Участников клиринга по денежным средствам осуществляется по денежному регистру, в отношении которого оно определено, путем уменьшения размера Средств обеспечения в денежных средствах по денежному регистру на размер исполняемого итогового нетто-обязательства и увеличения размера Средств обеспечения Участника клиринга, чьи итоговые нетто-требования удовлетворяются, на размер исполняемого итогового нетто-требования. Расчеты по денежным средствам считаются завершенными с момента их отражения в учете на клиринговых регистрах Участника клиринга.

Для исполнения итоговых нетто-обязательств и итоговых нетто-требований по ценным бумагам КЦ передает поручение в Расчетный депозитарий на проведение расчетов по Субсчетам депо. Для исполнения итоговых нетто-обязательств и итоговых нетто-требований, возникших из Договоров, в которых указан Код расчетов X0, КЦ направляет поручение в Расчетный депозитарий только после получения от Расчетного депозитария информации о зачислении всех ценных бумаг, подлежащих размещению, на счет депо номинального держателя Расчетного депозитария, открытый в депозитарии, которому присвоен статус центрального депозитария. Подтверждением исполнения итоговых нетто-обязательств и нетто-требований является получение КЦ от Расчетного депозитария отчета, подтверждающего исполнение направленного в Расчетный депозитарий сводного поручения депо. С момента получения КЦ от Расчетного депозитария указанного отчета расчеты по ценным бумагам считаются завершёнными. Информация о прекращении и об исполнении обязательств отражается в учете на клиринговых регистрах Участника клиринга.

32.9. В процессе клиринга КЦ формирует и предоставляет Участникам клиринга информацию об итоговых нетто-обязательствах / итоговых нетто-требованиях по денежным средствам / ценным бумагам в порядке, установленном статьей 42 настоящих Правил.

32.10. Итоговые нетто-обязательства / итоговые нетто-требования, возникшие в результате осуществления КЦ действий, указанных в настоящей статье, рассчитываются и

подлежат исполнению в валюте, используемой для расчётов по Договорам в соответствии с Правилами торговли.

32.11. Обязательства Участника клиринга - кредитной организации, у которой отозвана лицензия на осуществление банковских операций, и обязательства Участника клиринга, который не является кредитной организацией, но в отношении которого введена процедура банкротства, в дату, следующую за датой отзыва Банком России лицензии на осуществление банковских операций, или в дату, следующую за датой принятия арбитражным судом решения о признании Участника клиринга, не являющегося кредитной организацией, банкротом и об открытии конкурсного производства, не включаются в клиринговые пулы, формируемые в соответствии с настоящей статьёй. Прекращение указанных обязательств осуществляется в порядке, предусмотренном статьёй 48 настоящих Правил.

Статья 33 Порядок формирования клирингового пула по договорам, заключаемым без участия Центрального контрагента. Порядок исполнения / прекращения обязательств, допущенных к клирингу

33.1. Для определения итоговых нетто-обязательств / нетто-требований по Договорам, в которых указан Код расчетов On и Код расчетов OkOn, а также по Внебиржевым договорам КЦ формирует клиринговый пул по договорам, заключаемым без участия Центрального контрагента. В указанный клиринговый пул включаются обязательства, возникшие из указанных Договоров с наступившими Датой исполнения/датами исполнения, определёнными в соответствующих Внебиржевых договорах.

33.2. По наступлении Даты исполнения Договоров, в которых указан Код расчетов On и Код расчетов OkOn, и даты исполнения Внебиржевых договоров в срок, установленный Регламентом клиринга:

1) КЦ включает в клиринговый пул по договорам, заключаемым без участия Центрального контрагента:

- обязательства и требования Участников клиринга по денежным средствам и ценным бумагам по Договорам, в которых указан Код расчетов On и Код расчетов OkOn, с наступившей Датой исполнения;

- обязательства и требования Участников клиринга по денежным средствам и ценным бумагам, возникшие из Внебиржевых договоров, допущенные к клирингу в соответствии со статьёй 26 настоящих Правил, с наступившими датами исполнения;

- обязательства по передаче / требования по получению Дохода, определенные в соответствии со статьёй 37 настоящих Правил;

2) обязательства зачитываются со встречными однородными требованиями Участников клиринга по денежным средствам и ценным бумагам по Договорам, в которых указан Код расчетов On и Код расчетов OkOn, с наступившей Датой исполнения, по Внебиржевым договорам с наступившими датами исполнения, обязательства по которым учитываются на определенных регистрах учета позиций, и по передаче Дохода, определённого в соответствии со статьёй 37 настоящих Правил, а в части, в которой обязательства и требования не были прекращены зачетом, КЦ определяет итоговые нетто-обязательства и (или) итоговые нетто-требования по денежным средствам / ценным бумагам каждого Участника клиринга.

33.3. Исполнение итоговых нетто-обязательств / итоговых нетто-требований, определённых в соответствии с подпунктом 2 пункта 33.2 настоящих Правил, по ценным бумагам / денежным средствам осуществляется Участниками клиринга по счетам депо / лицевым счетам и по расчетным счетам на основании отчетов КЦ, предоставляемых в соответствии со статьёй 43 настоящих Правил.

33.4. В случае если исполнение итоговых нетто-обязательств / итоговых нетто-требований обеспечено индивидуальным клиринговым обеспечением и (или)

коллективным клиринговым обеспечением, Участники клиринга обязаны передать в КЦ отчет об исполнении итоговых нетто-обязательств / итоговых нетто-требований, определённых в соответствии с подпунктом 2 пункта 33.2 настоящих Правил, Участниками клиринга - контрагентами по Внебиржевым договорам (далее – Отчет об исполнении), по форме и в сроки, установленные Регламентом клиринга.

На основании полученного Отчета об исполнении КЦ осуществляет пересчет Доступных средств Участников клиринга без учета обязательств и требований, возникших из Внебиржевых договоров, в отношении которых определены итоговые нетто-обязательства / итоговые нетто-требования.

33.5. В случае если в течение срока, установленного в Регламенте клиринга, Участник клиринга (далее – Добросовестный контрагент) предоставил КЦ уведомление о неисполнении итоговых нетто-обязательств Участником клиринга - контрагентом по Внебиржевым договорам (далее – Уведомление о неисполнении), КЦ уведомляет указанного Участника клиринга-контрагента по Внебиржевым договорам, в отношении которого направлено Уведомление о неисполнении (далее – Недобросовестный контрагент), о получении данного Уведомления о неисполнении.

Если в течение срока, установленного Регламентом клиринга, КЦ не получит от Недобросовестного контрагента возражения относительно неисполнения своих итоговых нетто-обязательств, либо не получит от Добросовестного контрагента Отчет об исполнении, либо если в течение указанного срока КЦ получит от Недобросовестного контрагента подтверждение неисполнения итоговых нетто-обязательств, КЦ признает Недобросовестного контрагента не исполнившим итоговые нетто-обязательства. Одновременно у Недобросовестного контрагента возникает обязанность уплатить штраф, списываемый КЦ в размере, определённом в Поручении на клиринг внебиржевых договоров. Обязательство Участника клиринга по уплате штрафа считается допущенным к клирингу в момент возникновения основания для взимания данного штрафа. Обязательство по уплате штрафа, допущенное к клирингу, включается в клиринговый пул для расчётов по итогам Торгов в дату возникновения указанного обязательства.

Если в течение срока, установленного Регламентом клиринга, КЦ получит от Недобросовестного контрагента возражения относительно неисполнения своих итоговых нетто-обязательств и не получит от Добросовестного контрагента Отчет об исполнении, то КЦ не предпринимает никаких действий до момента получения от Участников клиринга – сторон по Внебиржевому договору, уведомления об исполнении / неисполнении обязательств и требований по указанному договору, или вступившего в силу решения суда, подтверждающего исполнение / неисполнение обязательств и требований по указанному договору, в зависимости от того, какое из событий наступит ранее.

33.6. В процессе клиринга КЦ формирует и предоставляет Участникам клиринга информацию об итоговых нетто-обязательствах / итоговых нетто-требованиях по денежным средствам / ценным бумагам в порядке, установленном статьей 43 настоящих Правил.

33.7. Если иное не установлено настоящими Правилами, итоговые нетто-обязательства / итоговые нетто-требования, возникшие в результате осуществления КЦ действий, указанных в настоящей статье, рассчитываются и подлежат исполнению в валюте, используемой для расчётов по Договорам в соответствии с Правилами торговли и по Внебиржевым договорам в соответствии с условиями этих договоров.

33.8. Обязательства Участника клиринга - кредитной организации, у которой отозвана лицензия на осуществление банковских операций, и обязательства Участника клиринга, который не является кредитной организацией, но в отношении которого введена процедура банкротства, в дату, следующую за датой отзыва Банком России лицензии на осуществление банковских операций, или в дату, следующую за датой принятия арбитражным судом решения о признании Участника клиринга, не являющегося

кредитной организацией, банкротом и об открытии конкурсного производства, не включаются в клиринговые пулы, формируемые в соответствии с настоящей статьей. Прекращение указанных обязательств осуществляется в порядке, предусмотренном статьей 48 настоящих Правил.

Статья 34. Порядок формирования клирингового пула по Договорам с полным обеспечением с ЦК и клирингового пула по Договорам с полным обеспечением без ЦК. Порядок исполнения / прекращения обязательств, допущенных к клирингу

34.1. Для определения итоговых нетто-обязательств / нетто-требований по Договорам, в которых указан Код расчетов Y0, КЦ формирует клиринговый пул по Договорам с полным обеспечением с ЦК, в который включаются обязательства, возникшие из Договоров, в которых указан Код расчетов Y0, допущенные к клирингу в соответствии со статьей 25 настоящих Правил, с наступившими Датами исполнения.

34.2. Сроки, в которые КЦ формирует клиринговый пул по Договорам с полным обеспечением с ЦК, устанавливаются Регламентом клиринга. КЦ вправе установить срок, отличный от срока, установленного в Регламенте клиринга, известив Участников клиринга об изменении срока посредством Системы, Сайта КЦ и (или) в форме Электронного документа, подписанного Электронной подписью, не менее чем за 1 (один) Расчетный день до даты вступления в силу решения КЦ об изменении указанного срока.

34.3. В дату формирования клирингового пула по Договорам с полным обеспечением с ЦК:

- КЦ включает в клиринговый пул по Договорам с полным обеспечением с ЦК обязательства и требования Участников клиринга по денежным средствам и ценным бумагам по Договорам, в которых указан Код расчетов Y0, с наступившей Датой исполнения;

- обязательства зачитываются со встречными однородными требованиями Участников клиринга по денежным средствам и ценным бумагам по вышеуказанным Договорам, с наступившей Датой исполнения, а в части, в которой обязательства и встречные однородные требования не были зачтены, КЦ определяет итоговые нетто-обязательства и (или) итоговые нетто-требования по денежным средствам / ценным бумагам каждого Участника клиринга по каждому денежному регистру / Субсчету депо, через которые будет осуществляться исполнение итоговых нетто-обязательств и (или) итоговых нетто-требований.

34.4. Для исполнения итогового нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам, учитываемых в отношении определенного денежного регистра/ Субсчета депо, используются денежные средства / ценные бумаги, учитываемые по тому же денежному регистру/ Субсчету депо.

34.5. Итоговое нетто-обязательство Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам может быть исполнено по денежному регистру / Субсчету депо, в отношении которого оно определено, если сумма денежных средств / количество ценных бумаг по тому же денежному регистру / Субсчету депо не меньше, чем размер итогового нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам, определенного по тому же денежному регистру / Субсчету депо.

КЦ исполняет итоговые нетто-обязательства / итоговые нетто-требования по денежным средствам и ценным бумагам в следующем порядке:

- итоговое нетто-обязательство по денежным средствам исполняется путем уменьшения размера Средств обеспечения в денежных средствах по денежному регистру, в отношении которого определено исполняемое итоговое нетто-обязательство, на размер этого итогового нетто-обязательства;

- итоговое нетто-требование по денежным средствам исполняется путем увеличения размера Средств обеспечения в денежных средствах по денежному регистру, в

отношении которого определено исполняемое итоговое нетто-требование, на размер этого итогового нетто-требования;

- для исполнения итоговых нетто-обязательств / итоговых нетто-требований по ценным бумагам КЦ передает в Расчетный депозитарий сводное поручение депо на проведение расчетов по Субсчетам депо. Подтверждением исполнения итоговых нетто-обязательств / итоговых нетто-требований является получение КЦ от Расчетного депозитария отчета, подтверждающего исполнение указанного поручения.

Итоговое нетто-обязательство / итоговое нетто-требование по денежным средствам считается исполненным с момента внесения предусмотренных настоящим пунктом изменений в учете на клиринговых регистрах Участника клиринга.

Итоговое нетто-обязательство / итоговое нетто-требование по ценным бумагам считается исполненным с момента получения КЦ от Расчетного депозитария отчета об исполнении сводного поручения депо на проведение расчетов по Субсчетам депо. Информация об их исполнении отражается в учете на клиринговых регистрах Участника клиринга.

34.6. Для определения итоговых нетто-обязательств / нетто-требований по Договорам, в которых указан Код расчетов U0, КЦ формирует клиринговый пул по Договорам с полным обеспечением без ЦК, в который включаются обязательства, возникшие из Договоров, в которых указан Код расчетов U0, допущенные к клирингу в соответствии со статьей 25 настоящих Правил, с наступившими Датой исполнения.

34.7. Сроки, в которые КЦ формирует клиринговый пул по Договорам с полным обеспечением без ЦК, устанавливаются Регламентом клиринга. КЦ вправе установить срок, отличный от срока, установленного в Регламенте клиринга, известив Участников клиринга об изменении срока посредством Системы, Сайта КЦ и (или) в форме Электронного документа, подписанного Электронной подписью, не менее чем за 1 (один) Расчетный день до даты вступления в силу решения КЦ об изменении указанного срока.

34.8. В дату формирования клирингового пула по Договорам с полным обеспечением без ЦК:

- КЦ включает в клиринговый пул по Договорам с полным обеспечением без ЦК обязательства и требования Участников клиринга по денежным средствам и ценным бумагам по Договорам, в которых указан Код расчетов U0, с наступившей Датой исполнения;

- обязательства зачитываются со встречными однородными требованиями Участников клиринга по денежным средствам и ценным бумагам по вышеуказанным Договорам, с наступившей Датой исполнения, а в части, в которой обязательства и встречные однородные требования не были зачтены, КЦ определяет итоговые нетто-обязательства и (или) итоговые нетто-требования по денежным средствам / ценным бумагам каждого Участника клиринга по каждому денежному регистру / Субсчету депо, через которые будет осуществляться исполнение итоговых нетто-обязательств и (или) итоговых нетто-требований.

Исполнение указанных итоговых нетто-обязательств / нетто-требований осуществляется в соответствии с пунктами 34.4 – 34.5 настоящих Правил.

34.9. В процессе клиринга КЦ формирует и предоставляет Участникам клиринга информацию об итоговых нетто-обязательствах / итоговых нетто-требованиях по денежным средствам / ценным бумагам в порядке, установленном статьей 43 настоящих Правил.

34.10. Обязательства Участника клиринга - кредитной организации, у которой отозвана лицензия на осуществление банковских операций, обязательства Участника клиринга, который не является кредитной организацией, но в отношении которого введена процедура банкротства, в дату, следующую за датой отзыва Банком России лицензии на осуществление банковских операций (в дату, следующую за датой принятия арбитражным судом решения о признании Участника клиринга, не являющегося кредитной

организацией, банкротом и об открытии конкурсного производства), не включаются в клиринговые пулы, формируемые в соответствии с настоящей статьей. Прекращение указанных обязательств осуществляется в порядке, предусмотренном статьей 48 настоящих Правил.

Статья 35. Порядок формирования клирингового пула для расчетов по итогам Торгов

35.1. Каждый Расчетный день в сроки, установленные Регламентом клиринга, КЦ формирует клиринговый пул для расчетов по итогам Торгов.

КЦ включает в клиринговый пул для расчетов по итогам Торгов:

- обязательства по уплате сумм, предусмотренных настоящими Правилами и Тарифами, в том числе Торгового сбора и Клирингового сбора, определенных в соответствии со статьей 14 настоящих Правил. Размер обязательств по оплате указанных сумм подлежит математическому округлению с точностью до двух знаков после запятой. При наличии хотя бы одного Договора взимается не менее 0,01 (одной сотой) валюты Торгового сбора, Клирингового сбора;

- обязательства по возмещению КЦ убытков, предусмотренных разделом VI настоящих Правил;

- - обязательства по уплате штрафов, возникшие при нехватке денежных средств Участника клиринга для обеспечения исполнения обязательств по денежным средствам до даты исполнения в соответствии со статьей 16 настоящих Правил;

- обязательства по уплате / требования по получению штрафов и компенсаций, возникших при урегулировании случаев исполнения обязательств в соответствии со статьей 30 настоящих Правил;

- требования по получению штрафов, возникших при заключении Донорских договоров в соответствии со статьей 31 настоящих Правил;

- обязательства по уплате штрафов, возникшие при наличии у Участника клиринга задолженности по денежным регистрам в соответствии со статьей 36 настоящих Правил;

- обязательства по возврату выплаченного и переданного Дохода в соответствии с пунктом 37.10 настоящих Правил.

КЦ зачитывает встречные однородные обязательства и требования Участника клиринга и КЦ по денежным средствам, а в части, в которой обязательства и требования не были зачтены – определяет итоговые нетто-обязательства и (или) итоговые нетто-требования по денежным средствам каждого Участника клиринга и КЦ в отношении каждого Участника клиринга и КЦ соответственно по каждому денежному регистру, через который будет осуществляться исполнение итоговых нетто-обязательств и/или итоговых нетто-требований. Определённые в соответствии с настоящим пунктом нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в отношении других Участников клиринга и КЦ соответственно совокупно составляют итоговые нетто-обязательства / итоговые нетто-требования такого Участника клиринга.

35.2. Для исполнения итогового нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам, учитываемого в отношении определенного денежного регистра, используются денежные средства, учитываемые по тому же денежному регистру.

35.3. Итоговое нетто-обязательство Участника клиринга по денежным средствам в определенной валюте может быть исполнено по денежному регистру, в отношении которого оно определено, если размер денежных средств в той же валюте по тому же денежному регистру не меньше, чем итоговое нетто-обязательство Участника клиринга по денежным средствам, учитываемое по денежному регистру.

35.4. В случае если размер итогового нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам по денежному регистру, в отношении которого определено указанное обязательство, больше размера денежных средств, учитываемых по тому же

денежному регистру, КЦ исполняет итоговое нетто-обязательство в объеме равном размеру учитываемых по указанному денежному регистру денежных средств. При этом в первую очередь исполняются обязательства Участника клиринга перед КЦ, а во вторую очередь - обязательства Участника клиринга перед другими Участниками клиринга. В случае недостаточности денежных средств для полного исполнения обязательств Участника клиринга перед другими Участниками клиринга указанные обязательства исполняются пропорционально их размеру.

Объем неисполненного итогового нетто-обязательства КЦ учитывает в качестве задолженности по данному денежному регистру. КЦ учитывает задолженность Участника клиринга перед другими Участниками клиринга и перед КЦ соответственно.

35.5. В процессе клиринга КЦ формирует и предоставляет Участникам клиринга информацию об итоговых нетто-обязательствах / итоговых нетто-требованиях по денежным средствам / ценным бумагам в порядке, установленном статьей 43 настоящих Правил.

35.6. Обязательства Участника клиринга – кредитной организации, у которого отозвана лицензия на осуществление банковских операций, и обязательства Участника клиринга, не являющегося кредитной организацией, в случае введения в отношении указанного Участника клиринга процедур банкротства, в дату, следующую за датой отзыва Банком России лицензии на осуществление банковских операций, или в дату, следующую за датой принятия арбитражным судом решения о признании Участника клиринга, не являющегося кредитной организацией, банкротом и об открытии конкурсного производства, не включаются в клиринговый пул, формируемый в соответствии с настоящей статьей. Прекращение указанных обязательств осуществляется в порядке, предусмотренном статьей 48 настоящих Правил.

Статья 36. Задолженность по денежному регистру

36.1. В случае если итоговое нетто-обязательство Участника клиринга перед КЦ или перед другим Участником клиринга по денежным средствам, определенное по денежному регистру, в результате проведения клиринга в соответствии со статьями 29 и 35 настоящих Правил, превышает размер денежных средств, учитываемых по тому же денежному регистру, КЦ учитывает такое превышение в качестве задолженности по данному денежному регистру перед КЦ или перед другим Участником клиринга соответственно.

36.2. Участник клиринга погашает возникшую задолженность перед КЦ путем зачисления денежных средств на Клиринговый денежный счет, с указанием ТКС, который соответствует денежному регистру, по которому возникла данная задолженность. Участник клиринга обязан погасить возникшую задолженность перед КЦ до момента начала формирования клирингового пула для расчетов по итогам Торгов следующего Расчетного дня.

36.3. Задолженность Участника клиринга перед другим Участником клиринга должна быть погашена путем зачисления денежных средств на Клиринговый денежный счет, с указанием ТКС, который соответствует денежному регистру, по которому возникла данная задолженность, до момента формирования клирингового пула для расчетов по итогам Торгов следующего Расчетного дня.

36.4. В случае если задолженность по денежному регистру не была погашена в срок, указанный в пункте 36.2 или 36.3 настоящих Правил, КЦ взимает в свою пользу или в пользу Участника клиринга, перед которым возникла задолженность, штраф, рассчитываемый по следующей формуле:

$$\text{Penalty} = \text{Debt} \times \text{fine}_{\text{debt}} \times \left(\frac{T_{365}}{365} + \frac{T_{366}}{366} \right),$$

где:

Penalty – величина штрафа;

Debt – величина задолженности по денежному регистру;

fine_debt – штрафная ставка, установленная КЦ и определенная в соответствии с Методикой установления и изменения риск-параметров;

T₃₆₅ – количество календарных дней между текущим и следующим Расчетным днем, приходящихся на календарный год, состоящий из 365 дней;

T₃₆₆ – количество календарных дней между текущим и следующим Расчетным днем, приходящихся на календарный год, состоящий из 366 дней.

Обязательство Участника клиринга по уплате штрафа допускается к клирингу в момент его возникновения и включается в клиринговый пул для расчётов по итогам Торгов, формируемый в соответствии со статьей 35 настоящих Правил, в дату возникновения указанного обязательства.

КЦ вправе включить обязательство по погашению задолженности по денежному регистру в расчетный клиринговый пул, формируемый в Расчетный день, следующий за Расчетным днем, в котором у Участника клиринга возникла задолженность по денежному регистру.

КЦ вправе потребовать от Участника клиринга, у которого учитывается задолженность перед КЦ по денежному регистру, погасить указанную задолженность в течение одного Расчетного дня с момента получения уведомления КЦ. КЦ направляет Участнику клиринга уведомление в виде Электронного документа, подписанного Электронной подписью, или в бумажном виде.

В случае непогашения Участником клиринга задолженности по денежному регистру в установленный уведомлением срок, КЦ использует для ее погашения Средства обеспечения в соответствии со статьей 21 настоящих Правил.

Статья 37. Порядок передачи Доходов по Договорам репо, Внебиржевым договорам репо ОТС, Парам договоров, Договорам купли-продажи облигаций, Договорам ПФИ

37.1. КЦ определяет обязательства по передаче Дохода, по ценным бумагам, по которым принято решение о выплате Дохода. Обязательства по передаче Дохода возникают:

- из Договоров репо, из Внебиржевых договоров репо ОТС и из Пар договоров, заключенных в соответствии со статьями 30 и 31 настоящих Правил и не исполненных на дату составления списка лиц, имеющих право на получение Дохода;

- из Договоров купли-продажи облигаций, дата исполнения обязательств по которым приходится на период между датой составления списка лиц, имеющих право на получение Дохода и датой окончания купонного периода, не включая указанные даты;

- из Договоров ПФИ, не исполненных на дату составления списка лиц, имеющих право на получение Дохода, в случае, если передача Дохода предусмотрена Спецификацией.

Обязательства по передаче Дохода возникают у покупателя по первой части Договора репо / Внебиржевого договора репо ОТС / Первому договору, составляющему Пару договоров, а также у Продавца по Договору ПФИ. Требования по получению Дохода возникают у продавца по первой части Договора репо / Внебиржевого договора репо ОТС / Первому договору, составляющему Пару договоров, а также у Покупателя по Договору ПФИ. Обязательства по передаче / требования по получению Дохода определяются по каждому Договору репо / Внебиржевому договору репо ОТС / Паре договоров / Договору ПФИ.

Далее в целях настоящей статьи:

- Договор репо и Внебиржевой договор репо ОТС, в которых на дату составления списка лиц, имеющих право на получение Дохода, исполнено обязательство по передаче ценных бумаг по первой части соответствующего договора и не исполнено обязательство

по передаче ценных бумаг по второй части соответствующего договора, совместно именуются неисполненными договорами репо;

- Пары договоров, по которым на дату составления списка лиц, имеющих право на получение Дохода, исполнено обязательство по передаче ценных бумаг по Первому договору, составляющему Пару договоров, и не исполнено обязательство по передаче ценных бумаг по Второму договору, составляющему Пару договоров, совместно именуются неисполненными договорами купли-продажи;

- Договоры купли-продажи облигаций, дата исполнения обязательств по которым приходится на период между датой составления списка лиц, имеющих право на получение Дохода и датой окончания купонного периода, не включая указанные даты, именуются Договорами с обязательством передачи Дохода;

- Договоры ПФИ, не исполненные на дату составления списка лиц, имеющих право на получение Дохода, именуются Договорами ПФИ с обязательством передачи Дохода.

КЦ не позднее Расчетного дня, следующего за Расчетным днем, в который в целях передачи Дохода были определены обязательства в соответствии с настоящей статьей, направляет Участникам клиринга, заключившим неисполненные договоры репо, неисполненные договоры купли-продажи, Договоры с обязательством передачи Дохода или Договоры ПФИ с обязательством передачи Дохода, уведомление в виде Электронного документа, подписанного Электронной подписью, о размере рассчитанных обязательств в порядке, предусмотренном статьей 43 настоящих Правил.

37.2. По Договорам репо, Внебиржевым договорам репо ОТС или Парам договоров, предметом которых являются ценные бумаги российских эмитентов, за исключением облигаций, размер обязательства по передаче Дохода в форме денежных средств рассчитывается по формуле:

$Inc = ROUND(N \times d; 2) - ROUND(N \times d \times tx \times \max((D1 - D2); 0) / D1; 2), \text{ где:}$	
Inc	размер обязательства по передаче Дохода;
N	количество ценных бумаг, подлежащих передаче по Договору репо, Внебиржевому договору репо ОТС, Паре договоров или количество ценных бумаг, являющееся базисным активом Договора ПФИ (в штуках);
d	сумма начисления на одну ценную бумагу, установленная эмитентом ценных бумаг или иным лицом, обязанным по ценным бумагам (в валюте, установленной эмитентом);
tx	налоговая ставка, применяемая к доходам в виде дивидендов по ценным бумагам в соответствии с налоговым законодательством Российской Федерации;
D1	общая сумма дивидендов, подлежащая распределению эмитентом ценных бумаг всем получателям (D1);
D2	общая сумма дивидендов, полученных эмитентом ценных бумаг в текущем отчетном (налоговом) периоде и предыдущих отчетных (налоговых) периодах (за исключением дивидендов, указанных в подпункте 1 пункта 3 статьи 284 Налогового кодекса Российской Федерации) к моменту распределения дивидендов в пользу налогоплательщиков - получателей дивидендов, при условии, что указанные суммы дивидендов ранее не учитывались при определении налоговой базы, определяемой в отношении доходов, полученных российской организацией (эмитентом) в виде дивидендов (D2).

37.3. По Договорам репо, Внебиржевым договорам репо ОТС или Парам договоров, предметом которых являются ценные бумаги иностранных эмитентов, кроме финансовых инструментов, квалифицированных в качестве облигаций, и за исключением ценных бумаг иностранных эмитентов, личным законом которых является право государств - участников СНГ, а также по Договорам ПФИ в случае если эмитентом принято решение о выплате Дохода денежными средствами и (или) ценными бумагами (кроме случая, предусмотренного пунктом 37.5 настоящих Правил), размер обязательства по передаче Дохода в форме денежных средств рассчитывается по формуле:

$Inc = ROUND(N \times d; 2) - ROUND(N \times d \times tx; 2), \text{ где:}$	
Inc	размер обязательства по передаче Дохода;
n	количество ценных бумаг, подлежащих передаче по Договору репо, Внебиржевому договору репо ОТС, Пары договоров или количество ценных бумаг, являющихся базисным активом Договора ПФИ (в штуках);
d	сумма начисления на одну ценную бумагу, установленная эмитентом ценных бумаг или иным лицом, обязанным по ценным бумагам (в валюте, установленной эмитентом);
tx	налоговая ставка, применяемая к доходам в виде дивидендов по ценным бумагам в соответствии с налоговым законодательством страны, резидентом которой является эмитент ценной бумаги.

В случае если валюта сумм начислений, установленная эмитентом, отличается от валюты цены Договора репо, Внебиржевого договора репо ОТС, Пары договоров или Договора ПФИ, КЦ вправе принять решение об определении обязательств по передаче Дохода в валюте цены Договора репо, Внебиржевого договора репо ОТС, Пары договоров или Договора ПФИ, исходя из значения фиксинга на рубль ПАО Московская биржа, определяемого на дату, следующую за датой составления списка лиц, имеющих право на получение Дохода.

Передача указанных в настоящем пункте Доходов осуществляется с учетом положений Регламента налогового администрирования Доходов по Ценным бумагам иностранных эмитентов, являющихся предметом Договоров репо или базисным активом Договоров ПФИ Небанковской кредитной организации - центрального контрагента «Клиринговый центр МФБ» (акционерное общество), который утверждается КЦ и раскрывается на Сайте КЦ (далее – Регламент налогового администрирования).

37.4. По Договорам репо, Внебиржевым договорам репо ОТС, Парам договоров, предметом которых являются облигации, и по Договорам с обязательством передачи Дохода размер обязательства по передаче Дохода в российских рублях рассчитывается по формуле:

$Inc = ROUND(N \times (n+p); 2), \text{ где:}$	
Inc	размер обязательства по передаче Дохода (в российских рублях);
N	количество облигаций, подлежащих передаче по Договору репо, Внебиржевому договору репо ОТС, Пары договоров или Договору с обязательством передачи Дохода (в штуках);
n	размер начисленного купонного дохода на одну облигацию, установленный эмитентом (в российских рублях);
p	размер премии, выплачиваемой эмитентом при досрочном погашении облигации (в российских рублях).

По Договорам репо, Внебиржевым договорам репо ОТС, Парам договоров, предметом которых являются облигации, и по Договорам с обязательством передачи Дохода размер обязательства по передаче Дохода в валюте, отличной от российских рублей, рассчитывается по формуле:

$\text{Inc} = \text{ROUND}(N \times (n + p); 2) - \text{ROUND}(N \times n \times tx; 2), \text{ где:}$	
Inc	размер обязательства по передаче Дохода (в валюте, в которой эмитентом объявлена выплата Дохода);
N	количество облигаций, подлежащих передаче по Договору репо, Внебиржевому договору репо ОТС, Пары договоров, Договорам с обязательством передачи Дохода (в штуках);
n	размер начисленного купонного дохода на одну облигацию, установленный эмитентом ценных бумаг (в валюте, в которой эмитентом объявлена выплата Дохода);
tx	налоговая ставка, применяемая к доходам в виде НКД по ценным бумагам в соответствии с налоговым законодательством страны, резидентом которой является эмитент ценной бумаги
p	размер премии, выплачиваемой эмитентом при досрочном погашении облигации (в валюте, в которой эмитентом объявлена выплата Дохода).

В случае если валюта сумм начислений, установленная эмитентом, отличается от валюты цены Договора репо, Внебиржевого договора репо ОТС, Пары договоров или Договора с обязательством передачи Дохода КЦ вправе принять решение об определении обязательств по передаче Дохода в валюте цены соответствующего договора исходя из значения фиксинга на рубль на торгах иностранной валютой, проводимых ПАО Московская Биржа, определяемого на дату, следующую за датой составления списка лиц, имеющих право на получение Дохода.

37.5. По Договорам репо, Внебиржевым договорам репо ОТС или Парам договоров, предметом которых являются ценные бумаги, а также по Договорам ПФИ, если передача Дохода предусмотрена Спецификацией такого договора, в случае если эмитентом принято решение о выплате Дохода исключительно ценными бумагами, размер обязательства по передаче Дохода определяется исходя из следующих условий:

37.5.1. в случае если ценные бумаги, которые подлежат передаче в виде Дохода, допущены к Торгам, передача Дохода осуществляется в форме ценных бумаг и размер обязательств по передаче указанного Дохода рассчитывается по следующей формуле:

$\text{Inc} = N \times d, \text{ где:}$	
Inc	размер обязательства по передаче Дохода (в штуках);
N	количество ценных бумаг, подлежащих передаче по Договору репо, Внебиржевому договору репо ОТС или Пары договоров (в штуках);
d	определенное эмитентом количество ценных бумаг, составляющих Доход, в расчете на одну ценную бумагу, являющуюся предметом Договора репо или Пары биржевых договоров (в штуках).

37.5.2. в случае если ценные бумаги, которые подлежат передаче в виде Дохода, не допущены к Торгам, но допущены к торгам, проводимым иностранной биржей, передача Дохода осуществляется в форме денежных средств и размер обязательств по передаче указанного Дохода определяется исходя из цены закрытия ценной бумаги, которая подлежит передаче в виде Дохода. Цена закрытия указанной ценной бумаги

определяется на последний день, в который торги по ценной бумаге проводятся на иностранной бирже с правом получения Дохода приобретателем таких ценных бумаг;

37.5.3. в случае если ценные бумаги, которые подлежат передаче в виде Дохода, не допущены к Торгам, и не допущены к торгам, проводимым иностранной биржей, передача Дохода осуществляется в форме денежных средств и размер обязательств по передаче указанного Дохода определяется КЦ с учетом, в частности, предполагаемой денежной оценки размера Дохода, подлежащего выплате, на основании решения эмитента.

37.5.5. Передача указанных в пункте 37.3. и 37.5. Доходов осуществляется с учетом положений Регламента налогового администрирования.

37.6. Передача Дохода, размер которого определяется в соответствии с пунктами 37.2 - 37.5 настоящих Правил, осуществляется в следующие сроки, если решением КЦ не установлено иное:

- передача Дохода по Договорам репо, Внебиржевым договорам репо ОТС или Парам договоров, предметом которых являются ценные бумаги, за исключением облигаций, а также по Договорам ПФИ, если передача Дохода предусмотрена Спецификацией такого договора, осуществляется по истечении 5 (пяти) дней с даты раскрытия эмитентом информации о факте исполнения (полностью или частично) своих обязательств по выплате Дохода;

- передача Дохода по Договорам репо, Внебиржевым договорам репо ОТС, Парам договоров, предметом которых являются облигации, или Договорам с обязательством передачи Доход, осуществляется по истечении 5 (пяти) дней с даты раскрытия эмитентом информации о факте исполнения (полностью или частично) своих обязательств по выплате Дохода.

В случае если дата выплаты Дохода приходится не на рабочий день, то передача Дохода происходит в следующий за ним рабочий день.

37.7. КЦ допускает рассчитанные обязательства по передаче и (или) требования по получению Дохода каждого Участника клиринга к клирингу в следующем порядке:

- обязательства по передаче Дохода, определенные на основании информации о неисполненных договорах репо / неисполненных договорах купли-продажи, предметом которых являются ценные бумаги, за исключением облигаций, и Договорам ПФИ допускаются к клирингу в течение 1 (одного) дня с даты составления списка лиц, имеющих право на получение Дохода. В случае если в указанный срок КЦ не может определить размер обязательств в соответствии с настоящей статьей, обязательства по передаче Дохода допускаются к клирингу сразу после получения КЦ недостающей информации, при этом срок исполнения указанного обязательства не может превышать срок, установленный пунктом 37.6 настоящей статьи;

- обязательства по передаче Дохода, определенные на основании информации о неисполненных договорах репо / неисполненных договорах купли-продажи предметом которых являются облигации, Договорах с обязательством передачи Дохода, допускаются к клирингу в течение 5 (пяти) дней с даты раскрытия эмитентом информации о факте исполнения (полностью или частично) своих обязательств по выплате Дохода.

37.8. В дату, определённую в пункте 37.6 настоящих Правил, обязательства по передаче Дохода включаются в клиринговый пул по Договорам и в клиринговый пул ОТС и исполняются в порядке, установленном статьей 29 настоящих Правил.

38.9. КЦ предоставляет Участникам клиринга информацию о возникновении, прекращении и исполнении обязательств по передаче Доходов, начиная с момента допуска обязательств по передаче Дохода к клирингу и до момента прекращения указанных обязательств в клиринговом пуле в соответствии с настоящими Правилами, по форме, установленной в Регламенте клиринга. КЦ вправе предоставить Участникам клиринга информацию в размере обязательств по передаче Дохода в порядке, установленном Регламентом клиринга.

37.10. В случае если по обстоятельствам, не зависящим от КЦ, суммы выплаченного и переданного Дохода подлежат возврату, Участники клиринга обязаны возвратить соответствующие суммы в срок, определенный КЦ. Соответствующие обязательства допускаются к клирингу в момент принятия решения о возврате Дохода и включаются в клиринговый пул для расчетов по итогам Торгов в день принятия такого решения.

Статья 38. Порядок исполнения обязательств по Договорам ПФИ

38.1. При заключении Договора ПФИ у Участников клиринга в соответствии со Спецификацией возникают следующие обязательства и требования, учитываемые КЦ на регистре учета позиций Участника клиринга, соответствующих ТКС, с указанием которого был заключен Договор ПФИ:

- обязательство Покупателя по уплате Премии Продавцу в Дату расчетов и соответствующее ему требование Продавца (если Договор ПФИ является опционным договором);

- обязательство одной из сторон Договора ПФИ по уплате другой стороне указанного договора Вариационной маржи и соответствующее ему требование последнего к первому (если условиями Договора ПФИ предусмотрена уплата Вариационной маржи);

- обязательство Продавца по уплате Покупателю суммы денежных средств, подлежащей уплате при исполнении Договора ПФИ в размере и сроки, определенные условиями этого договора (если Участник клиринга - Покупатель представил в КЦ заявление на исполнение Договора ПФИ).

38.2. Исполнение обязательств, указанных в пункте 38.1 настоящих Правил, производится в валюте, используемой для расчетов по Договорам ПФИ в соответствии с Правилами торговли, и в сроки, установленные настоящими Правилами, если Спецификацией соответствующего Договора ПФИ не установлено иное.

38.3. В случае если Спецификацией соответствующего Договора ПФИ предусмотрено исполнение обязательства по уплате Премии в момент заключения Договора ПФИ, КЦ проводит проверку достаточности Средств обеспечения Участника клиринга в соответствии с пунктом 25.1 настоящих Правил и формирует клиринговый пул для расчетов по Премии для определения итоговых нетто-обязательств / нетто-требований по указанным Договорам ПФИ.

В случае если Спецификацией соответствующего Договора ПФИ не предусмотрено исполнение обязательства по уплате Премии в момент заключения Договора ПФИ, то обязательства / требования Участников клиринга по уплате Премии включаются КЦ в состав клирингового пула по Договорам, формируемым в соответствии со статьей 29 настоящих Правил в Дату расчетов.

38.4. КЦ формирует клиринговый пул для расчетов по Премии в дату заключения Договора ПФИ после получения информации от Организатора торговли о регистрации Договора ПФИ и допуска обязательств из Договора ПФИ к клирингу в соответствии со статьей 25 настоящих Правил. КЦ включает в клиринговый пул для расчетов по Премии обязательства / требования Участников клиринга, являющихся сторонами заключенного Договора ПФИ, и КЦ по уплате Премии, возникшие в результате заключения указанного Договора ПФИ.

Обязательства зачитываются со встречными однородными требованиями Участников клиринга по денежным средствам по вышеуказанным Договорам ПФИ, в части, в которой обязательства и встречные однородные требования не были зачтены, КЦ определяет итоговые нетто-обязательства / нетто-требования по денежным средствам в отношении КЦ и каждого Участника клиринга по денежному регистру/ТКС.

38.5. КЦ исполняет итоговые нетто-обязательства / нетто-требования по денежным средствам, определенные в соответствии с пунктом 38.4 настоящих Правил, в следующем порядке:

- итоговое нетто-обязательство по денежным средствам исполняется путем уменьшения размера Средств обеспечения в денежных средствах по денежному регистру, в отношении которого определено исполняемое итоговое нетто-обязательство, на размер этого итогового нетто-обязательства;

- итоговое нетто-требование по денежным средствам исполняется путем увеличения размера Средств обеспечения в денежных средствах по денежному регистру, в отношении которого определено исполняемое итоговое нетто-требование, на размер этого итогового нетто-требования.

Итоговое нетто-обязательство / нетто-требование по денежным средствам считается исполненным с момента внесения предусмотренных настоящим пунктом изменений в учет на клиринговых регистрах Участников клиринга.

38.6. Обязательства / требования Участников клиринга и КЦ по передаче / получению суммы денежных средств при исполнении Договора ПФИ (далее - обязательства / требования по исполнению Договоров ПФИ) подлежат исполнению в Дату исполнения Договора ПФИ. Если Спецификацией не установлено иное Дата исполнения Договора ПФИ приходится на второй Расчетный день после получения КЦ от Участника клиринга, являющегося Покупателем, заявления на исполнение Договора ПФИ. Указанное заявление направляется Участником клиринга в КЦ в виде электронного сообщения, подписанного АСП, или в виде Электронного документа, подписанного Электронной подписью.

38.7. В целях определения итоговых нетто-обязательств / нетто-требований по исполнению Договоров ПФИ КЦ формирует клиринговый пул ПФИ, в который включаются обязательства, возникшие из Договоров ПФИ и допущенные к клирингу в соответствии со статьей 25 настоящих Правил, с наступившими Датами исполнения. КЦ формирует клиринговый пул ПФИ в срок, установленный Регламентом клиринга.

КЦ включает в клиринговый пул ПФИ:

- обязательства Участников клиринга, являющихся Продавцами по Договорам ПФИ, и КЦ по денежным средствам в сумме, подлежащей уплате по условиям Договора ПФИ при его исполнении;

- требования Участников клиринга, являющихся Покупателями по Договорам ПФИ, и КЦ по денежным средствам в сумме, причитающейся им по условиям Договора ПФИ при его исполнении.

Обязательства зачитываются со встречными однородными требованиями Участников клиринга по денежным средствам по Договорам ПФИ, а в части, в которой обязательства и встречные однородные требования не были зачтены, КЦ определяет итоговые нетто-обязательства / нетто-требования по денежным средствам в отношении КЦ и каждого Участника клиринга по денежному регистру / ТКС.

38.8. КЦ исполняет итоговые нетто-обязательства / нетто-требования по денежным средствам в соответствии с пунктом 38.5 настоящих Правил с учетом следующего:

- итоговое нетто-обязательство Участника клиринга по денежным средствам исполняется по денежному регистру / ТКС, в отношении которого оно определено, в случае если сумма денежных средств, учитываемых по тому же денежному регистру/ТКС, не меньше, чем размер итогового нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам, определенного по денежному регистру / ТКС;

- если величина исполняемого нетто-обязательства превышает размер денежных средств Участника клиринга, КЦ учитывает такое превышение в качестве задолженности Участника клиринга перед КЦ по соответствующему денежному регистру.

38.9. Обязательства / требования Участников клиринга и КЦ по Вариационной марже, возникшие при заключении Договора ПФИ, условиями которого предусмотрена уплата Вариационной маржи, и допущенные к клирингу в соответствии со статьей 25 настоящих правил, включаются в клиринговый пул для расчетов по Вариационной марже.

КЦ формирует клиринговый пул для расчетов по Вариационной марже в срок, установленный Регламентом клиринга.

КЦ включает в клиринговый пул для расчетов по Вариационной марже обязательства / требования Участников клиринга и КЦ по денежным средствам в размере, определяемом в соответствии со Спецификацией соответствующего Договора ПФИ в качестве обязательства по уплате Вариационной маржи.

Обязательства зачитываются со встречными однородными требованиями Участников клиринга по денежным средствам по Договорам ПФИ, а в части, в которой обязательства и встречные однородные требования не были зачтены, КЦ определяет итоговые нетто-обязательства / нетто-требования по денежным средствам в отношении КЦ и каждого Участника клиринга по денежному регистру / ТКС.

38.10. КЦ исполняет итоговые нетто-обязательства / нетто-требования по денежным средствам в соответствии с пунктом 38.8 настоящих Правил.

38.11. Обязательства Участника клиринга - кредитной организации, у которой отозвана лицензия на осуществление банковских операций, и обязательства Участника клиринга, который не является кредитной организацией, но в отношении которого введена процедура банкротства, в дату, следующую за датой отзыва Банком России лицензии на осуществление банковских операций, или в дату, следующую за датой принятия арбитражным судом решения о признании Участника клиринга, не являющегося кредитной организацией, банкротом и об открытии конкурсного производства, не включаются в клиринговые пулы, формируемые в соответствии с настоящей статьей. Прекращение указанных обязательств осуществляется в порядке, предусмотренном статьей 48 настоящих Правил.

Статья 39. Случаи и порядок заключения Договоров купли-продажи с ЦК без подачи заявок

39.1. В случаях и порядке, предусмотренных настоящей статьей, КЦ заключает с Участниками клиринга Договоры купли-продажи без подачи заявок.

39.2. При наличии согласия Участника клиринга, являющегося Продавцом по Договору ПФИ, если данный Участник клиринга был выбран КЦ в качестве контрагента Участника клиринга, являющегося Покупателем по Договору ПФИ, при получении от указанного Покупателя поручения на исполнение Договора ПФИ КЦ заключает с Участником клиринга - Продавцом по Договору ПФИ Договор купли-продажи с кодом расчетов Тп на следующих условиях:

- Участник клиринга обязан передать КЦ ценные бумаги, являющиеся базисным активом Договоров ПФИ, по которым у данного Участника клиринга учитывается обязательство по исполнению Договора ПФИ;

- КЦ обязан оплатить указанные ценные бумаги по цене, по которой в соответствии с условиями Договора ПФИ этот договор подлежит исполнению (далее в настоящей статье - Цена исполнения);

- количество ценных бумаг, подлежащих передаче по Договору купли-продажи, определяется путем деления размера обязательства Участника клиринга, являющегося Продавцом по Договору ПФИ, по исполнению соответствующего Договора ПФИ, на Цену исполнения. При этом если в результате деления образуется дробная часть, количество ценных бумаг округляется до целого числа в меньшую сторону;

- Договор купли-продажи заключается в период после получения КЦ поручения на исполнение Договора ПФИ и до окончания Торгового дня Организатора торговли, на Торгах которого заключается Договор купли-продажи в соответствии с настоящей статьей.

39.3. Участники клиринга вправе направить согласие на заключение Договоров купли-продажи в соответствии с настоящей статьей в виде Электронного документа, подписанного Электронной подписью по форме, установленной Регламентом клиринга.

Указанное согласие может быть в любой момент отозвано Участником клиринга путем направления КЦ соответствующего заявления. Указанное согласие действует с момента его получения КЦ до момента его отзыва Участником клиринга.

39.4. Договоры купли-продажи, заключенные в соответствии с настоящей статьей, допускаются к клирингу в момент заключения указанных Договоров и включаются в клиринговый пул по Договорам в Дату исполнения в соответствии со статьей 29 настоящих Правил.

РАЗДЕЛ VII. ПОРЯДОК И СПОСОБЫ ВЗАИМОДЕЙСТВИЯ КЦ, УЧАСТНИКОВ КЛИРИНГА, РАСЧЕТНОЙ ОРГАНИЗАЦИИ, РАСЧЕТНОГО ДЕПОЗИТАРИЯ, ОРГАНИЗАТОРА ТОРГОВЛИ. ОТЧЕТЫ КЦ

Статья 40. Порядок взаимодействия КЦ с Расчетной организацией, Расчетным депозитарием

40.1. В целях оказания клиринговых услуг, в том числе для целей открытия и закрытия Субсчетов депо, совершения операций с ценными бумагами, учитываемыми на Субсчетах депо, получения информации о движении ценных бумаг по данным счетам, КЦ взаимодействует с Расчетным депозитарием на основании заключенного договора, внутренних документов Расчетного депозитария и (или) регламента взаимодействия.

40.2. В целях оказания клиринговых услуг, в том числе для открытия и закрытия Клирингового денежного счета и совершения операций по нему, получения информации о движении денежных средств по указанному счету, КЦ взаимодействует с Расчетной организацией в соответствии с заключенными договорами, регламентами взаимодействия и внутренними документами Расчетной организации.

40.3. Порядок взаимодействия с Расчетным депозитарием при открытии Субсчетов депо определяется в статье 7 настоящих Правил.

После открытия каждого Субсчета депо Расчетный депозитарий представляет в КЦ уведомление об открытии соответствующего Субсчета депо.

40.4. За исключением случая закрытия Субсчета депо по инициативе КЦ, закрытие Субсчета депо в Расчетном депозитарии осуществляется на основании поручения КЦ, при условии предоставления лицом, которому открыт указанный Субсчет депо, соответствующего заявления.

40.5. КЦ дает поручение на закрытие Субсчета депо при условии отсутствия открытых позиций по Договорам / Внебиржевым договорам ОТС, учитываемых на регистре учета позиций, и нулевых остатках ценных бумаг, учитываемых на ТКС, в который входит закрываемый Субсчет депо.

40.6. В случае если торговые счета депо Участников клиринга, клиентов Участника клиринга и иных лиц открыты в Депозитарии, открывшем в Расчетном депозитарии Субсчет депо номинального держателя, КЦ соглашается с проведением любых операций по таким торговым счетам депо, включая закрытие таких торговых счетов депо. Указанное согласие КЦ действует до момента его отзыва КЦ в указанном Депозитарии или до момента направления КЦ указанному Депозитарию распоряжения, устанавливающего иные условия проведения операций по таким торговым счетам депо.

40.7. По факту проведения операций, а также в сроки, установленные Регламентом клиринга, Расчетный депозитарий формирует и передает в КЦ выписку о состоянии Субсчетов депо, содержащую информацию о ценных бумагах, учитываемых на Субсчетах депо. На основании полученных от Расчетного депозитария выписок о состоянии Субсчетов депо, КЦ изменяет значения депо регистров.

40.8. Для проведения расчетов по ценным бумагам по результатам клиринга КЦ в сроки, установленные в Регламенте клиринга, направляет в Расчетный депозитарий сводное поручение депо.

40.9. Исполнение сводного поручения депо осуществляется Расчетным депозитарием по Субсчетам депо в корреспонденции с Субсчетом депо КЦ, открытым в рамках Клирингового счета депо в Расчетном депозитарии.

40.10. Расчетный депозитарий в сроки, установленные Регламентом клиринга, предоставляет в КЦ отчет (акт, или иной документ, установленный договором с Расчетным депозитарием), подтверждающий проведение расчетов по итогам клиринга.

40.11. Согласие/поручение КЦ и иные документы, указанные в настоящей статье Правил, предоставляются в электронном виде в форме Электронных документов, подписанных Электронной подписью.

Статья 41. Порядок взаимодействия КЦ с Организатором торговли

41.1. КЦ взаимодействует с Организатором торговли на основании договора.

КЦ уведомляет Организатора торговли об Участниках клиринга, клиентах и Субклиентах Участников клиринга, в том числе о кодах, присвоенных КЦ указанным лицам в соответствии со статьей 11 настоящих Правил, а также о зарегистрированных ТКС.

КЦ может предоставлять Организатору торговли дополнительную информацию.

КЦ направляет уведомления Организатору торговли посредством Системы в виде электронного сообщения, подписанного АСП, или в виде Электронного документа, подписанного Электронной подписью.

41.2. Организатор торговли информирует КЦ о включении / исключении ценной бумаги в / из Список ценных бумаг / Списка ценных бумаг, приостановлении, возобновлении и прекращении Торгов ценной бумагой, а также об установлении и (или) изменении параметров ценной бумаги.

Организатор торговли вправе предоставлять КЦ дополнительную информацию.

Организатор торговли направляет уведомления КЦ в виде Электронного документа, подписанного Электронной подписью, и (или) в бумажном виде.

КЦ не осуществляет клиринг обязательств, возникших из Договоров / Договоров ПФИ, заключенных в отношении ценных бумаг/ ПФИ, о допуске к Торгам которых КЦ не был извещен.

41.3. При получении от Организатора торговли информации о дате допуска ценной бумаги / ПФИ к Торгам, начиная с которой возможно заключение Договоров, КЦ устанавливает риск-параметры для этой ценной бумаги/ПФИ.

КЦ вправе изменять риск-параметры в порядке, установленном Методикой установления и изменения риск-параметров.

41.4. Каждый Расчетный день до начала Торгов у Организатора торговли КЦ передает Организатору торговли посредством Системы в виде электронного сообщения, подписанного АСП, информацию о Средствах обеспечения Участников клиринга, значения Доступных средств, значения расчетной цены по каждой ценной бумаге/ПФИ, значения риск – параметров, рассчитываемых в соответствии с Методикой установления и изменения риск – параметров, а также, по согласованию с Организатором торговли, иную дополнительную информацию.

41.5. В случае изменения значений, перечисленных в пункте 41.4 настоящих Правил, КЦ незамедлительно передает Организатору торговли указанные измененные значения.

Статья 42. Способы получения и передачи документов при взаимодействии КЦ с Участниками клиринга, Организатором торговли, Расчетным депозитарием и Расчетной организацией

42.1. Прием поручений, уведомлений и иных документов от Участников клиринга и предоставление отчетов, уведомлений и иных документов Участникам клиринга может

осуществляться на бумажных носителях или в виде Электронных документов, подписанных Электронной подписью.

42.2. Документооборот между КЦ, Участниками клиринга, Организатором торговли, Расчетной организацией и Расчетным депозитарием (далее – участники электронного документооборота) осуществляется в электронном виде путем направления Электронных документов, подписанных Электронной подписью, если иные способы обмена сообщениями не установлены настоящими Правилами. При этом допускается передача отдельных документов на бумажных носителях.

42.3. Направление Электронных документов, подписанных Электронной подписью, осуществляется при условии получения участниками электронного документооборота доступа к Системе электронного документооборота на основании договора (соглашения), заключенного с техническим центром, определенным КЦ, и информация о котором раскрыта на Сайте КЦ. Порядок формирования и передачи Электронных документов посредством Системы электронного документооборота устанавливается указанным договором (соглашением).

42.4. АСП используется при подаче в Клиринговую систему электронных сообщений, предусмотренных настоящими Правилами, в следующем порядке:

- Электронное сообщение, подписанное АСП, признается Электронным документом, равнозначным документу на бумажном носителе, подписанному Участником клиринга/КЦ.

- Электронное сообщение считается подписанным АСП с момента отправки Участником клиринга/КЦ в Систему такого сообщения при условии успешного прохождения Участником клиринга/КЦ процедуры аутентификации в порядке, предусмотренном настоящей статьёй Правил.

- Присвоение Имени и Пароля Участнику клиринга/КЦ осуществляется техническим центром, определенным КЦ и информация о котором раскрыта на Сайте КЦ, на основании договора (соглашения), заключенного между Участником клиринга/КЦ и техническим центром, посредством внесения указанных Имени и Пароля в базу данных Системы.

- Процедура аутентификации осуществляется техническим центром с использованием Системы при осуществлении технического доступа Участника клиринга/КЦ в Систему путем сопоставления введенных Имени и Пароля соответствующим Имени и Паролю Участника клиринга/КЦ, информация о которых содержится в базе данных Клиринговой системы. В случае успешного прохождения процедуры аутентификации Участник клиринга/КЦ получает возможность осуществления операций в Системе. Аутентификация Участника клиринга/КЦ осуществляется автоматическим способом при каждом входе Участника клиринга/КЦ в Систему.

- Участник клиринга соглашается с тем, что КЦ могут быть изготовлены (распечатаны) копии электронных сообщений, подписанных АСП, на бумажном носителе, которые удостоверяются подписью уполномоченного лица КЦ и являются доказательством факта направления электронного сообщения с использованием Системы, а также подтверждают соответствие электронного сообщения содержанию копии электронного сообщения, изготовленного (распечатанного) на бумажном носителе.

42.5. Участники электронного документооборота соглашаются с тем, что все возникшие конфликтные ситуации, связанные с использованием Электронной подписи и/или АСП, они будут стремиться решить в досудебном порядке.

42.6. КЦ не принимает входящие бумажные документы к исполнению в следующих случаях:

- документ подписан лицом, не имеющим соответствующих полномочий;
- при возникновении обоснованных сомнений в подлинности подписи или оттиска печати на документе;

- если документ оформлен с нарушениями требований настоящих Правил, в случае наличия двусмысленности, неоднозначности и повторов;
- если документ оформлен с помарками или исправлениями.

42.7. Документы, полученные на бумажном носителе, вводятся в Систему сотрудниками КЦ. Дальнейшая обработка документов производится в Системе автоматически.

Статья 43. Отчеты КЦ и иная информация, предоставляемая Участникам клиринга

43.1. В процессе осуществления клиринга КЦ формирует и предоставляет Участнику клиринга отчеты по форме, установленной в Регламенте клиринга, содержащие сведения:

- об обязательствах, допущенных к клирингу;
- об обязательствах, определенных по итогам клиринга;
- об использовании индивидуального клирингового обеспечения, в том числе о его использовании для исполнения обязательств, допущенных к клирингу, и (или) обязательств, определенных по итогам клиринга;
- об изменении суммы денежных средств и (или) количества иного имущества, отраженном в регистрах (разделах регистров) внутреннего учета КЦ, на которых осуществляется учет суммы денежных средств (количество иного имущества), право распоряжения которыми предоставлено КЦ и которые предназначены для исполнения обязательств Участника клиринга, допущенных к клирингу, и (или) являются предметом обеспечения таких обязательств.

43.2. Отчеты, указанные в пункте 43.1 настоящих Правил, предоставляются Участнику клиринга в форме Электронных документов, подписанных Электронной подписью, в течение сроков, определенных Регламентом клиринга.

43.3. КЦ вправе представлять Участнику клиринга дополнительную информацию в виде уведомлений в форме Электронных документов, установленных в Регламенте клиринга и подписанных Электронной подписью. Дополнительная информация в виде уведомлений представляется Участникам клиринга в сроки, установленные в Регламенте клиринга.

РАЗДЕЛ VIII. ПРОЧИЕ УСЛОВИЯ

Статья 44. Порядок действия КЦ при операциях с ценными бумагами вследствие корпоративных событий

44.1. В случае проведения операции объединения дополнительных выпусков эмиссионных ценных бумаг КЦ не позднее даты получения Расчётным депозитарием уведомления держателя реестра о проведённой операции объединения дополнительных выпусков ценных бумаг, получает от Расчетного депозитария уведомление о проведении операции объединения дополнительных выпусков ценных бумаг, которое должно содержать:

- полное наименование эмитента, объединение выпусков которого проведено;
- индивидуальные номера (коды) объединяемых выпусков ценных бумаг и индивидуальный номер (код) объединенного выпуска;
- дату проведения операции объединения выпусков ценных бумаг эмитента.

Не позднее даты получения уведомления Расчетного депозитария о проведённой операции объединения дополнительных выпусков ценных бумаг КЦ направляет уведомление Организатору торговли, которое должно содержать:

- полное наименование эмитента, объединение выпусков которого проведено;
- индивидуальные номера (коды) объединяемых выпусков ценных бумаг и индивидуальный номер (код) объединенного выпуска;

- дату проведения операции объединения выпусков ценных бумаг эмитента.

44.2. В случае проведения операции аннулирования кода дополнительного выпуска эмиссионных ценных бумаг КЦ не позднее даты проведения операции аннулирования кода дополнительного выпуска получает от Расчетного депозитария уведомление о проведении операции аннулирования кода дополнительного выпуска, которое должно содержать:

- полное наименование эмитента;
- индивидуальный номер (код) дополнительного выпуска ценных бумаг и индивидуальный номер (код) выпуска, по отношению к которому данный выпуск является дополнительным;
- дату проведения операции аннулирования кода.

Не позднее дня, следующего за днем получения уведомления от Расчетного депозитария, КЦ направляет Организатору торговли уведомление в виде Электронного документа, подписанного Электронной подписью, которое должно содержать:

- полное наименование эмитента;
- индивидуальный номер (код) дополнительного выпуска ценных бумаг и индивидуальный номер (код) выпуска, по отношению к которому данный выпуск является дополнительным;
- дату проведения операции аннулирования кода.

44.3. Клиринговая система обеспечивает на клиринговых регистрах сохранность информации об учете ценных бумаг и операциях с ними до объединения выпусков и до аннулирования кода дополнительного выпуска.

44.4. После завершения операции объединения выпусков/аннулирования кода дополнительного выпуска и присвоения объединенным выпускам нового номера, поручения Участников клиринга, содержащие старый номер выпуска, не принимаются.

44.5. Операции по объединению выпусков эмиссионных ценных бумаг и/или аннулированию индивидуальных номеров (кодов) дополнительных выпусков эмиссионных ценных бумаг осуществляются в Клиринговой системе на следующий Расчетный день после получения соответствующего уведомления от Расчетного депозитария и по окончании расчетов по Договорам по итогам клиринга этого Расчетного дня. Проведение операций по объединению выпусков эмиссионных ценных бумаг и/или аннулированию индивидуальных номеров (кодов) дополнительных выпусков эмиссионных ценных бумаг в Клиринговой системе сопровождается корректировкой информации по Договорам, Дата исполнения которых еще не наступила. Коды объединяемых выпусков ценных бумаг в реквизитах указанных Договоров заменяются кодом объединенного выпуска, а аннулируемый код дополнительного выпуска ценных бумаг - кодом выпуска, по отношению к которому данный выпуск является дополнительным.

44.6. Если иное не предусмотрено настоящими Правилами, информация по Договорам, предметом которых являются ценные бумаги, в отношении которых была осуществлена процедура дробления и (или) консолидации, может быть скорректирована с учетом проведенной процедуры, в течение Торгового дня, следующего за днем проведения процедуры дробления и (или) консолидации соответственно, на основании информации, полученной от эмитента ценных бумаг.

44.7. В случае если между датой заключения Договора и Датой исполнения Договора в отношении ценных бумаг, которые являются предметом Договора купли-продажи/ Договора репо, или базисным активом Договора ПФИ, происходят корпоративные события, включающие в том числе реорганизацию эмитента ценных бумаг, конвертацию и (или) дробление ценных бумаг, проводимую без реорганизации эмитента ценных бумаг, или иные действия, влияющие на исполнение обязательств по Договору купли-продажи / Договору репо / Договору ПФИ, в том числе которые приводят к изменению предмета Договора купли-продажи / Договора репо или базисного актива

Договора ПФИ, КЦ вправе принять в отношении указанного Договора одно из следующих решений:

44.7.1. об изменении КЦ в одностороннем порядке условий Договоров, обязательства по которым не исполнены, и (или) порядка исполнения обязательств по Договорам, с учетом условий реорганизации эмитента ценных бумаг или условий иных действий (событий), происходящих с эмитентом и (или) ценными бумагами эмитента;

44.7.2. о признании наступившей Даты исполнения Договора в Расчетный день, предшествующий дню приостановления операций с ценными бумагами по счетам депо, проводимого в связи с корпоративными действиями, в случае если информация о таком приостановлении получена КЦ от Расчетного депозитария и (или) из иных доступных источников информации.

44.8. КЦ при совершении действия, указанного в пункте 44.7.2 настоящих Правил, осуществляет действия, направленные на определение подлежащих исполнению обязательств в соответствии с настоящими Правилами.

44.9. Информация о решении, принятом КЦ в соответствии с пунктом 44.7 настоящих Правил, раскрывается на Сайте КЦ, а также направляется Участникам клиринга в виде Электронного документа, подписанного Электронной подписью.

Статья 45. Порядок перевода обязательств и передачи имущества Обособленного клиента

45.1. КЦ вправе перевести долг / уступить требования Участника клиринга по допущенным к клирингу обязательствам, возникшим в результате заключения Договоров / Внебиржевых договоров / Внебиржевых договоров ОТС за счет клиента или Субклиента Участника клиринга, для которого зарегистрирован Обособленный ТКС, а также передать имущество, являющееся предметом обеспечения исполнения обязательств и учитываемое по указанному ТКС, другому Участнику клиринга. КЦ осуществляет перевод долга, уступку требований и передачу имущества в сроки, установленные настоящими Правилами и Регламентом клиринга.

45.2. КЦ вправе осуществить перевод долга / уступку требования и передачу имущества только в случае получения от клиента или Субклиента Участника клиринга, за счет которого исполняются обязательства и (или) обеспечивается исполнение обязательств, и Участника клиринга, которому переводится долг / уступаются требования и передаётся имущество, согласия на такой перевод долга / уступку требований и передачу имущества. Согласие указанных лиц считается полученным, если КЦ получил уведомления в соответствии с пунктом 45.3 настоящих Правил.

45.3. КЦ осуществляет перевод долга, уступку требований и передачу имущества только при соблюдении следующих условий:

- клиент или Субклиент Участника клиринга, за счет которого исполняются обязательства и (или) обеспечивается исполнение обязательств, направил в КЦ уведомление в бумажной форме о необходимости произвести действия по переводу долга, уступке требований и передаче имущества с указанием ТКС, зарегистрированного для данного клиента, и с указанием ТКС, зарегистрированного другим Участником клиринга для указанного клиента или Субклиента;

- Участник клиринга, которому переводится долг, уступаются требования и передаётся имущество, направил в КЦ уведомление в бумажной форме, содержащее согласие на осуществление указанных действий. В данном уведомлении должно содержаться указание на ТКС, открытый данным Участником клиринга, на который будет осуществлён перевод долга, уступка требований и передача имущества клиента Участника клиринга;

- Участник клиринга, которому переводится долг, уступаются требования и передается имущество, осуществил регистрацию своего клиента или Субклиента, за счет которого исполняются обязательства и (или) обеспечивается исполнение таких

обязательств, по которым переводится долг, уступаются требования и передается имущество, а также зарегистрировал ТКС для этого клиента или Субклиента.

45.4. КЦ для проведения процедуры перевода долга, уступки требований и передачи имущества в сроки, установленные в Регламенте клиринга:

- осуществляет перевод допущенных к клирингу обязательств и требований по денежным средствам и ценным бумагам, учитываемых в отношении денежного регистра / депо регистра / Субсчета депо, относящимся к ТКС, указанному в уведомлении для перевода долга и уступки требований, по каждому Договору / Внебиржевому договору / Внебиржевому договору ОТС, заключенному с указанием данного ТКС, на ТКС Участника клиринга, которому переводится долг и уступаются требования. В результате такого перевода обязательства и требования по денежным средствам и ценным бумагам, учитываемые в отношении денежного регистра / депо регистра / Субсчета депо, относящимся к ТКС Участника клиринга, с которого был осуществлён перевод долга / уступка требований, прекращаются и начинают учитываться в отношении денежного регистра / депо регистра / Субсчета депо, относящемуся к ТКС Участника клиринга, на который был осуществлён перевод долга / уступка требований;

- осуществляет передачу имущества, являющегося Средствами обеспечения в российских рублях и (или) иностранной валюте, учитываемых в отношении денежного регистра, относящегося к ТКС, указанного в уведомлении для передачи имущества, на ТКС Участника клиринга, которому передаётся указанное имущество. При этом размер Средств обеспечения в российских рублях и (или) иностранной валюте, учитываемых в отношении денежного регистра, относящегося к ТКС Участника клиринга, с которого передается имущество, уменьшается на величину этих Средств обеспечения, а размер Средств обеспечения в российских рублях и (или) иностранной валюте, учитываемых в отношении денежного регистра, относящегося к ТКС Участника клиринга, которому передается имущество, увеличивается на указанную величину;

- осуществляет передачу имущества, являющегося Средствами обеспечения в ценных бумагах, учитываемых на Субсчете депо, относящемся к ТКС, указанному в уведомлении для передачи имущества, на ТКС Участника клиринга, которому передаётся указанное имущество. С целью осуществления передачи ценных бумаг КЦ подает в Расчетный депозитарий поручение, в соответствии с которым производится списание ценных бумаг в количестве, учитываемом на данном Субсчете депо, и их зачисление в том же количестве на Субсчет депо, относящийся к ТКС Участника клиринга, которому передается имущество. После получения от Расчетного депозитария отчета, подтверждающих исполнение поданного поручения, КЦ уменьшает Средства обеспечения Участника клиринга, учитываемые на клиринговых регистрах, соответствующих Субсчету депо, с которого производится списание ценных бумаг, на списанное количество ценных бумаг, и увеличивает Средства обеспечения Участника клиринга, учитываемые на клиринговых регистрах, соответствующих Субсчету депо, на который производится зачисление ценных бумаг, на количество зачисленных ценных бумаг.

45.5. Перевод долга, уступка требований и передача имущества от одного Участника клиринга другому Участнику клиринга считается завершённым с момента отражения указанных операций на клиринговых регистрах данных Участников клиринга.

45.6. В случае если в период осуществления КЦ действий, направленных на перевод долга, уступку требований и передачу имущества будет подана Заявка / направлено Поручение на клиринг внебиржевых договоров / направлена Оферта ОТС с указанием ТКС, с которого осуществляется перевод долга, уступка требований и передача имущества, КЦ уведомляет Организатора торговли о невозможности регистрации такой Заявки в реестре Заявок, Участника клиринга о невозможности акцепта Оферты ОТС и о невозможности принятия Поручения на клиринг внебиржевых договоров к исполнению.

45.7. По завершении перевода долга, уступки требований и передачи имущества КЦ аннулирует ТКС, на котором учитывались обязательства, по которым был осуществлён перевод долга и уступка требований, и переданное имущество.

Статья 46. Взаимодействие КЦ и Участников клиринга при исполнении налоговых обязательств по Доходам, полученным по Ценным бумагам эмитентов США и Ценным бумагам эмитентов ФРГ

46.1. В целях исполнения требований Закона США «О налогообложении иностранных счетов» (Foreign Account Tax Act, FATCA), Налогового кодекса ФРГ, Стандарта по автоматическому обмену информацией о финансовых счетах (Common Reporting Standard) и иных законодательных актов в сфере налогообложения Доходов в виде дивидендов по Ценным бумагам эмитентов США и Ценным бумагам эмитентов ФРГ (далее для целей настоящей статьи, информации, связанной с настоящей статьей, приведенной в иных статьях настоящих Правил, и иных принятых в соответствии с настоящей статьей документов – Ценные бумаги иностранных эмитентов), а также обеспечения возможности получения Участниками клиринга, клиентами (Субклиентами) Участников клиринга налоговых льгот в отношении Доходов в виде дивидендов по Ценным бумагам иностранных эмитентов, Участники клиринга обязаны направлять в КЦ документы и информацию, определенные Регламентом налогового раскрытия по Ценным бумагам иностранных эмитентов Небанковской кредитной организации - центрального контрагента «Клиринговый центр МФБ» (акционерное общество) который утверждается КЦ и раскрывается на Сайте КЦ (далее – Регламент налогового раскрытия), в порядке определенном Регламентом налогового раскрытия.

46.2. КЦ, являясь Квалифицированным дилером деривативов, обеспечивает возможность получения Участниками клиринга, клиентами (Субклиентами) Участников клиринга налоговых льгот по Дивидендным эквивалентам, величина которых зависит от Дохода по Ценным бумагам эмитентов США. КЦ также обеспечивает возможность получения Участниками клиринга, клиентами (Субклиентами) Участников клиринга налоговых льгот по Дивидендным эквивалентам, величина которых зависит от Дохода по Ценным бумагам эмитентов ФРГ. В целях обеспечения возможности получения налоговых льгот по Доходам в виде Дивидендных эквивалентов по Ценным бумагам иностранных эмитентов, Участники клиринга обязаны предоставлять в КЦ документы и информацию, определенные Регламентом налогового администрирования, в порядке, определенном Регламентом налогового администрирования.

46.3. Права, обязанности и ответственность Участников клиринга при взаимодействии с КЦ при исполнении налоговых обязательств по Доходам, полученным по Ценным бумагам иностранных эмитентов, определены Регламентом налогового раскрытия и Регламентом налогового администрирования.

Статья 47. Хранение и учет документов и информации внутреннего учета

47.1. КЦ осуществляет хранение и учет документов, связанных с осуществлением клиринговой деятельности, и информации внутреннего учета, связанных с осуществлением внутреннего учета, в том числе:

- документов и (или) информации, полученных от Организатора торговли;
- документов, полученных от Участников клиринга и иных лиц (договоры, поручения, иные документы);
- документов, полученных от Расчетной организации и Расчетного депозитария;
- копий поручений КЦ, направленных Расчетной организации и Расчетному депозитарию;
- документов и (или) информации о денежных средствах и ценных бумагах, которые предназначены для исполнения обязательств, допущенных к клирингу;

- документов и (или) информации о денежных средствах и ценных бумагах, которые являются предметом обеспечения обязательств, допущенных к клирингу;
- иных документов и информации по усмотрению КЦ.

47.2. КЦ ведет следующие регистрационные журналы и реестры:

- журналы регистрации документов, для регистрации поступающих в КЦ и направляемых КЦ документов, связанных с осуществлением клиринговой деятельности (ведение журналов может осуществляться по разным видам клиринга, видам документов, группам видов документов и (или) направлению документов);
- реестр Участников клиринга, клиентов и Субклиентов в соответствии со статьей 11 настоящих Правил;
- иные реестры и журналы, ведение которых позволяет группировать документы и информацию внутреннего учета.

47.3. КЦ хранит документы, связанные с осуществлением им клиринговой деятельности, в течение 10 лет. При этом указанный срок в отношении документов, связанных с клирингом обязательств, исчисляется с даты прекращения и (или) исполнения этого обязательства по итогам клиринга.

47.4. Ведение реестров и журналов осуществляется в электронной форме и позволяет составлять списки и выписки из них за любой календарный день и за любой период, в пределах срока хранения информации. КЦ осуществляет ежедневное резервное копирование информации, содержащейся в регистрах и реестрах.

Статья 48. Порядок урегулирования неисполненных обязательств в случае прекращения клирингового обслуживания

48.1. В случае отзыва Банком России у Участника клиринга - российской кредитной организации лицензии на осуществление банковских операций или в случае введения в отношении Участника клиринга процедур банкротства (далее в настоящей статье - Ликвидант) Даты исполнения обязательств из Договоров, Даты расчетов по Договорам ПФИ, Даты исполнения обязательств из Внебиржевых договоров и Внебиржевых договоров ОТС считаются наступившими, и обязательства и требования, возникшие из указанных договоров, прекращаются в дату включения указанных обязательств в клиринговые пулы, формируемые в соответствии с настоящей статьей. При этом прекращаются все обязательства Ликвиданта, допущенные к клирингу.

Подтверждением факта отзыва лицензии на осуществление банковских операций является письменное уведомление Банка России, направленное КЦ, в том числе посредством факсимильной связи, и (или) размещенная пресс-центром Банка России на сайте Банка России в сети Интернет информация о решении Банка России об отзыве указанной лицензии.

Допущенные к клирингу обязательства Ликвиданта, возникшие из Внебиржевых договоров ОТС, Договоров, за исключением Договоров, в которых указаны Код расчетов X0, Код расчетов U0, Код расчетов On, Код расчетов OkOn и Код расчетов W0, включаются в ликвидационный клиринговый пул и подлежат прекращению в указанном пуле, формируемом в соответствии с пунктом 48.2 настоящих Правил, а допущенные к клирингу обязательства Ликвиданта, возникшие из Внебиржевых договоров, и из Договоров, в которых указаны Код расчетов X0, Код расчетов U0, Код расчетов On, Код расчетов OkOn и Код расчетов W0 (далее в настоящей статье - Договоры, заключаемые без участия Центрального контрагента), включаются в ликвидационный клиринговый пул без Центрального контрагента и подлежат прекращению в указанном пуле, формируемом в порядке, предусмотренном пунктом 48.3 настоящих Правил. При этом обязательства Ликвиданта, возникшие из Договоров, за исключением Договоров, заключаемых без участия Центрального контрагента, прекращаются возникновением нетто-обязательства Ликвиданта в отношении КЦ, рассчитанного в соответствии с пунктом 48.2 настоящих Правил, а обязательства Ликвиданта из Договоров, заключаемых без участия

Центрального контрагента, прекращаются возникновением нетто-обязательств Ликвиданта в отношении других Участников клиринга – его контрагентов по указанным договорам, размер которых рассчитывается в соответствии с пунктом 48.3 настоящих Правил. При этом в указанные клиринговые пулы не включаются обязательства по возмещению убытков в форме упущенной выгоды и по уплате неустоек (штрафов, пеней).

В случаях, предусмотренных настоящим пунктом, Договоры / Договоры, заключаемые без участия Центрального контрагента, которые были заключены Ликвидантом в дату отзыва лицензии или в дату принятия арбитражным судом решения о признании Участника клиринга банкротом и об открытии конкурсного производства, или после указанной даты, могут быть признаны недействительными в случаях, предусмотренных законодательством Российской Федерации, и к ним могут быть применены последствия недействительности в соответствии с законодательством Российской Федерации. КЦ или Участник клиринга - контрагент Ликвиданта по Договорам, заключаемым без участия Центрального контрагента, вправе предъявить требование о возмещении убытков, связанных с недействительностью Договоров (Договоров, заключенных без участия Центрального контрагента), а также об уплате неустоек (штрафов, пеней) в общем порядке, предусмотренном законодательством Российской Федерации о несостоятельности (банкротстве).

КЦ направляет Ликвиданту уведомление о прекращении обязательств по Договорам / Договорам, заключаемым без участия Центрального контрагента, в форме Электронного документа, подписанного Электронной подписью, в течение 2 (двух) Расчетных дней, следующих за датой отзыва лицензии на осуществление банковских операций или за датой принятия арбитражным судом решения о признании Ликвиданта банкротом и об открытии конкурсного производства. Указанное уведомление содержит информацию о рассчитанных в соответствии с пунктами 48.2 и 48.3. настоящих Правил нетто-обязательствах Ликвиданта в отношении КЦ или в отношении Участника клиринга – контрагента по Договорам, заключаемым без участия Центрального контрагента. Одновременно с указанным уведомлением КЦ также направляет Ликвиданту в форме Электронного документа, подписанного Электронной подписью, уведомление о прекращении действия заключенного с ним договора об оказании клиринговых услуг.

Уведомления о прекращении обязательств по Договорам, заключённым без участия Центрального контрагента, содержащие информацию о рассчитанных в соответствии с настоящей статьей нетто-обязательствах / нетто-требованиях Участников клиринга - контрагентов по указанным договорам, направляются указанным Участникам клиринга – контрагентам в том же порядке и в те же сроки.

Возврат денежных средств Ликвиданту осуществляется КЦ не позднее 3 (трех) рабочих дней с даты прекращения действия заключенного с ним договора об оказании клиринговых услуг. При этом средства в российских рублях перечисляются на корреспондентский счет Ликвиданта, открытый в Банке России (если Ликвидант является кредитной организацией), а в иностранной валюте или в случае если Ликвидант не является кредитной организацией, в российских рублях - на Счет, открытый Ликвиданту и зарегистрированный для возврата денежных средств в соответствующей валюте, либо по реквизитам, указанным в письме Ликвиданта о возврате денежных средств, содержащем платежные реквизиты, при условии предоставления КЦ документов, подтверждающих полномочия лица, подписавшего письмо от имени Ликвиданта, при условии, что такое письмо получено КЦ до перечисления денежных средств.

Денежные средства в российских рублях/денежные средства в иностранной валюте / ценные бумаги Ликвиданта, оставшиеся у КЦ после исполнения нетто-обязательств, определенных в соответствии с пунктом 48.2 или 48.3 настоящих Правил, подлежат возврату КЦ Ликвиданту / включению в конкурсную массу в сумме / количестве, оставшемся после исполнения соответствующего нетто-обязательства. Ценные бумаги Ликвиданта, оставшиеся после исполнения его нетто-обязательств в

порядке, предусмотренном пунктом 48.2 или 48.3 настоящих Правил, возвращаются Участнику клиринга путем предоставления КЦ поручения на списание ценных бумаг - при выводе ценных бумаг с Субсчета депо. В случае нехватки Средств обеспечения Ликвиданта и (или) его вноса в Гарантийный фонд участников для исполнения нетто-обязательства, определённого в соответствии с пунктом 48.2 или 48.3 настоящих Правил, КЦ вправе предъявить к Ликвиданту требование об исполнении указанного нетто-обязательства в общем порядке, предусмотренном законодательством о несостоятельности (банкротстве). 48.2. В целях определения нетто-обязательства Ликвиданта КЦ осуществляет следующие действия.

48.2.1. Не позднее окончания рабочего дня, следующего за датой отзыва у Ликвиданта лицензии на осуществление банковских операций или за датой принятия арбитражным судом решения о признании Ликвиданта банкротом и об открытии конкурсного производства, по всем Договорам, заключённым Ликвидантом:

1) КЦ включает в ликвидационный клиринговый пул:

- обязательства и требования по денежным средствам и ценным бумагам по Договорам, не исполненные по состоянию на день отзыва у Ликвиданта лицензии на осуществление банковских операций или на день принятия арбитражным судом решения о признании Ликвиданта банкротом и об открытии конкурсного производства;

- обязательства и требования по денежным средствам и ценным бумагам по Внебиржевым договорам ОТС и Внебиржевым договорам репо ОТС, не исполненные по состоянию на день отзыва у Ликвиданта лицензии на осуществление банковских операций или на день принятия арбитражным судом решения о признании Ликвиданта банкротом и об открытии конкурсного производства;

- обязательства по уплате Задолженности или задолженности, определённой в соответствии со статьёй 36 настоящих Правил, не исполненные по состоянию на день отзыва у Ликвиданта лицензии на осуществление банковских операций или на день принятия арбитражным судом решения о признании Ликвиданта банкротом и об открытии конкурсного производства;

- обязательства Ликвиданта по передаче КЦ Дохода, не исполненные по состоянию на день отзыва у Ликвиданта лицензии на осуществление банковских операций или на день принятия арбитражным судом решения о признании Ликвиданта банкротом и об открытии конкурсного производства;

- обязательства/требования Ликвиданта по уплате Премии / Вариационной маржи по Договорам ПФИ, не исполненные по состоянию на день отзыва у Ликвиданта лицензии на осуществление банковских операций или на день принятия арбитражным судом решения о признании Ликвиданта банкротом и об открытии конкурсного производства. Размер обязательства/требования по Вариационной марже рассчитывается как разница между Верхней (Нижней) ценой принудительного закрытия соответствующего Договора ПФИ и расчетной ценой данного Договора ПФИ, определённой в рамках последней Клиринговой сессии. При этом Верхняя цена принудительного закрытия используется при определении размера обязательства по Вариационной марже Ликвиданта, являющегося Продавцом, Нижняя цена принудительного закрытия используется при определении размера требования по Вариационной марже Ликвиданта, являющегося Покупателем;

- обязательства / требования Ликвиданта по исполнению Договоров ПФИ, не исполненные по состоянию на день отзыва у Ликвиданта лицензии на осуществление банковских операций или на день принятия арбитражным судом решения о признании Ликвиданта банкротом и об открытии конкурсного производства. Размер обязательства/требования Ликвиданта по исполнению Договора ПФИ равен Верхней (Нижней) цене принудительного закрытия соответствующего Договора ПФИ. При этом Верхняя цена принудительного закрытия используется для определения размера обязательства Ликвиданта, являющегося Продавцом, Нижняя цена принудительного

закрытия используется для определения размера требования Ликвиданта, являющегося Покупателем.

2) не исполненные по состоянию на дату формирования ликвидационного клирингового пула обязательства по передаче ценных бумаг, в том числе обязательства по передаче Дохода в форме ценных бумаг, зачитываются со встречными однородными требованиями по получению ценных бумаг, и в части, в которой обязательства не были прекращены зачетом, КЦ определяет итоговые обязательства (требования) Ликвиданта по ценным бумагам;

3) итоговые обязательства (требования) Ликвиданта по ценным бумагам, определённые в соответствии с подпунктом 2 настоящего пункта, переводятся в валюту расчётов путем умножения количества ценных бумаг, составляющих указанное итоговое обязательство (требование), на Верхнюю (Нижнюю) цену принудительного закрытия, определенную в рамках последней Клиринговой сессии в соответствии с Методикой установления и изменения риск-параметров. При этом Верхняя цена принудительного закрытия используется в целях перевода в валюту расчетов итогового обязательства Ликвиданта, а Нижняя цена принудительного закрытия - в целях перевода в валюту расчетов итогового требования Ликвиданта;

4) в целях определения нетто-обязательства Ликвиданта размер обязательств по передаче Дохода в форме денежных средств определяется в соответствии со статьей 37 настоящих Правил;

5) обязательства по денежным средствам, определённые в соответствии с подпунктами 1 - 4 настоящего пункта, зачитываются со встречными однородными требованиями по денежным средствам, определёнными в соответствии с подпунктами 1 - 4 настоящего пункта, и в части, в которой указанные обязательства не были прекращены зачетом, КЦ определяет итоговые обязательства (требования) Ликвиданта по денежным средствам;

6) итоговые обязательства (требования) Ликвиданта по денежным средствам, определённые в соответствии с подпунктом 5 настоящего пункта, выраженные в иностранной валюте, определяются в российских рублях по курсу, установленному Центральным банком Российской Федерации, на дату формирования в соответствии с настоящим пунктом ликвидационного клирингового пула.

48.2.2. Нетто-обязательство Ликвиданта по денежным средствам исполняется за счет его Средств обеспечения и его взноса в Гарантийный фонд участников в срок, не превышающий 2 (двух) рабочих дней с даты определения указанного нетто-обязательства, в следующем порядке:

1) исполнение нетто-обязательства по денежным средствам осуществляется путем уменьшения размера Средств обеспечения в российский рубль на размер исполняемого нетто-обязательства;

2) использование взноса Ликвиданта в Гарантийный фонд участников в российских рублях осуществляется путем перечисления денежных средств, составляющих взнос Ликвиданта в Гарантийный фонд участников, в счет исполнения его нетто-обязательства;

3) замена Средств обеспечения Ликвиданта в иностранной валюте на российские рубли по курсу, установленному КЦ в момент совершения операции ;

4) замена иностранной валюты, составляющей взнос Ликвиданта в Гарантийный фонд участников, на российские рубли по курсу, установленному КЦ в момент совершения операции.;

5) осуществление действий, направленных на продажу КЦ ценных бумаг, составляющих Средства обеспечения Ликвиданта. В случае если в результате указанной продажи КЦ получены денежные средства, выраженные в иностранной валюте, то КЦ осуществляет замену указанной иностранной валюты на российские рубли по курсу, устанавливаемому КЦ.. Сумма денежных средств, полученная в результате указанных

действий, используется КЦ для прекращения нетто-обязательства Ликвиданта по денежным средствам.

Размер Средств обеспечения Ликвиданта в денежных средствах, размер его Средств обеспечения в ценных бумагах, а также его взнос в Гарантийный фонд участников уменьшаются на сумму использованных денежных средств/ценных бумаг из указанных Средств обеспечения / Гарантийного фонда участников из Размера вноса Ликвиданта.

Расчеты по денежным средствам считаются завершёнными с момента их отражения в учете на клиринговых регистрах Ликвиданта.

Если в результате действий, указанных в подпунктах 1 - 5 настоящего пункта, нетто-обязательство Ликвиданта не прекратилось в полном объеме, Ликвидант признается не исполнившим нетто-обязательство по денежным средствам. КЦ учитывает не прекращенное нетто-обязательство Ликвиданта как Задолженность Ликвиданта и осуществляет действия по погашению Задолженности в общем порядке, предусмотренном законодательством о несостоятельности (банкротстве).

КЦ при проведении действий в соответствии с настоящей статьей Правил с целью минимизации рисков центрального контрагента вправе заключать Договоры/Внебиржевые договоры ОТС с Участниками клиринга на торгах организатора торговли и (или) на внебиржевых торгах. В случае невозможности заключения Договоров/Внебиржевых договоров ОТС на торгах организатора торговли и (или) на внебиржевых торгах КЦ вправе заключать Договоры/Внебиржевые договоры ОТС с Участниками клиринга без подачи Заявок, без направления Оферт ОТС и Акцептов ОТС в соответствии со статьей 21 настоящих Правил.

48.3. КЦ рассчитывает размер нетто-обязательства Ликвиданта по Договорам, заключённым без участия Центрального контрагента, в отношении других Участников клиринга – его контрагентов в следующем порядке:

48.3.1. не позднее окончания рабочего дня, следующего за датой отзыва у Ликвиданта лицензии на осуществление банковских операций или за датой принятия арбитражным судом решения о признании Ликвиданта банкротом и об открытии конкурсного производства, по всем Договорам, заключённым без участия Центрального контрагента, КЦ включает в ликвидационный клиринговый пул без Центрального контрагента обязательства и требования по денежным средствам и ценным бумагам по указанным договорам, не исполненные по состоянию на дату формирования ликвидационного клирингового пула без Центрального контрагента.

48.3.2. обязательства по ценным бумагам из Внебиржевых договоров и из Договоров, в которых указаны Код расчетов X0, Код расчетов U0, Код расчетов On, Код расчетов OkOn и Код расчетов W0, не исполненные по состоянию на дату формирования указанного клирингового пула без Центрального контрагента, прекращаются с одновременным возникновением обязательства по денежным средствам, размер которого определяется путем умножения количества ценных бумаг, составляющих обязательства Ликвиданта по ценным бумагам, на рыночную цену соответствующей ценной бумаги, определённую на организованных торгах ценными бумагами, а в случае отсутствия указанной цены, на цену Договора, предметом которого является соответствующая ценная бумага.

48.3.3. обязательства, определённые в соответствии с подпунктами 48.3.1 – 48.3.2 настоящего пункта, зачитываются со встречными однородными требованиями по денежным средствам, и в части, в которой обязательства и требования не были прекращены зачетом, КЦ определяет нетто-обязательства Ликвиданта по денежным средствам.

48.3.4. нетто-обязательства Ликвиданта по денежным средствам, выраженные в иностранной валюте, подлежат определению в российских рублях по курсу, установленному Центральным банком Российской Федерации, на дату формирования в

соответствии с настоящим пунктом ликвидационного клирингового пула без Центрального контрагента.

48.4. Для целей определения нетто-обязательства Ликвиданта по уплате Торгового сбора КЦ не позднее окончания рабочего дня, следующего за датой отзыва у Ликвиданта лицензии на осуществление банковских операций или за датой принятия арбитражным судом решения о признании Ликвиданта банкротом и об открытии конкурсного производства, включает в ликвидационный клиринговый пул по Торговому сбору обязательства Ликвиданта по уплате Торгового сбора, не исполненные на дату формирования клирингового пула и определяемые на основании информации о размере Торгового сбора и информации, полученной КЦ от Организатора торговли.

Нетто-обязательства Ликвиданта по денежным средствам, выраженные в иностранной валюте, подлежат определению в российских рублях по курсу, установленному Центральным банком Российской Федерации на дату формирования в соответствии с настоящим пунктом ликвидационного клирингового пула по уплате Торгового сбора.

Нетто-обязательство Ликвиданта по уплате Торгового сбора исполняется за счет Средств обеспечения Ликвиданта и вноса Ликвиданта в Гарантийный фонд участников в срок, не превышающий 2 (двух) Расчётных дней с даты определения указанного нетто-обязательства.

**Приложение № 1 к Правилам осуществления клиринговой деятельности на
рынке ценных бумаг и на рынке производных финансовых инструментов**

**Перечень документов, необходимых для регистрации Заявителя в качестве
Участника клиринга**

**1. Перечень документов, необходимых для регистрации Заявителя –
юридического лица, созданного в соответствии с законодательством Российской
Федерации, в качестве Участника клиринга**

№	Наименование документа	Форма предоставления
1	Зарегистрированные учредительные документы Заявителя с действующими изменениями и дополнениями.	Нотариально заверенная копия, или копия, заверенная уполномоченным сотрудником Заявителя (при представлении КЦ оригинала документа), или копия, заверенная уполномоченным сотрудником КЦ (при наличии оригинала).
2	Свидетельство и (или) лист записи Единого государственного реестра юридических лиц о внесении записи о государственной регистрации изменений, вносимых в учредительные документы Заявителя.	Нотариально заверенная копия, или копия, заверенная уполномоченным сотрудником Заявителя (при представлении КЦ оригинала документа), или копия, заверенная уполномоченным сотрудником КЦ (при наличии оригинала).
3	Документ, подтверждающий факт избрания (назначения) на должность единоличного исполнительного органа Заявителя.	Оригинал, или нотариально заверенная копия, или копия, заверенная уполномоченным сотрудником Заявителя (при представлении КЦ оригинала документа), или копия, заверенная уполномоченным сотрудником КЦ (при наличии оригинала).
4	Приказ о вступлении в должность единоличного исполнительного органа Заявителя с указанием даты вступления в должность.	Оригинал, или нотариально заверенная копия, или копия, заверенная уполномоченным сотрудником Заявителя (при представлении КЦ оригинала документа), или копия, заверенная уполномоченным сотрудником КЦ (при наличии оригинала).
5	Документ, удостоверяющий личность лица, назначенного (избранного) на	Нотариально заверенная копия, или копия, заверенная уполномоченным

	должность единоличного исполнительного органа. В случае если лицо, избранное (назначенное) единоличным исполнительным органом, является иностранным гражданином или лицом без гражданства, то указанное лицо дополнительно представляет КЦ следующие документы (если их наличие предусмотрено законодательством Российской Федерации): - миграционная карта; - документ, подтверждающий право иностранного гражданина или лица без гражданства на пребывание (проживание) в Российской Федерации.	сотрудником Заявителя (при представлении КЦ оригинала документа), или копия, заверенная уполномоченным сотрудником КЦ (при наличии оригинала).
6	Трудовой договор (контракт, соглашение) единоличного исполнительного органа. Указанный документ представляется КЦ исключительно в случае отсутствия в учредительных документах Заявителя или в документе об избрании (назначении) на должность единоличного исполнительного органа указания на срок, на который избирается единоличный исполнительный орган.	Нотариально заверенная копия, или копия, заверенная уполномоченным сотрудником Заявителя (при представлении КЦ оригинала документа), или копия, заверенная уполномоченным сотрудником КЦ (при наличии оригинала).
7	Доверенность, подтверждающая полномочия лиц, в отношении которых заполнены разделы «Сведения о представителях (физических лицах)» и «Сведения о представителях (юридических лицах, трастах и иных иностранных структурах без образования юридического лица)» Анкеты Заявителя и / или предоставлена «Анкета представителя клиента – юридического лица» / «Анкета представителя клиента – физического лица» за исключением единоличного исполнительного органа Заявителя.	Оригинал, или нотариально заверенная копия, или копия, заверенная уполномоченным сотрудником Заявителя (при представлении КЦ оригинала документа), или копия, заверенная уполномоченным сотрудником КЦ (при наличии оригинала).
8	Документ, удостоверяющий личность физического лица, указанного в пункте 8 настоящей таблицы. В случае, если указанным лицом является иностранный гражданин или лицо без гражданства, то указанное лицо дополнительно представляет КЦ следующие документы (если их наличие предусмотрено законодательством	Нотариально заверенная копия, или копия, заверенная уполномоченным сотрудником Заявителя (при представлении КЦ оригинала документа), или копия, заверенная уполномоченным сотрудником КЦ (при наличии оригинала).

	Российской Федерации): - миграционная карта; - документ, подтверждающий право иностранного гражданина или лица без гражданства на пребывание (проживание) в Российской Федерации. Документы, подтверждающие сведения, указанные в разделе «Сведения о представителях (юридических лицах, трастах и иных иностранных структурах без образования юридического лица)» Анкеты Заявителя и / или в «Анкете представителя клиента – юридического лица», если представитель является нерезидентом.	
9	Документы управляющей организации. В случае, если полномочия единоличного исполнительного органа Заявителя и права подписи переданы управляющей организации, то КЦ представляются документы, подтверждающие правоспособность указанной управляющей организации, указанные в подпунктах 2 – 4 пункта 11.2.1 Правил клиринга, пунктах 1-9 настоящей таблицы.	Оригинал, или нотариально заверенная копия, или копия, заверенная уполномоченным сотрудником Заявителя (при представлении КЦ оригинала документа), или копия, заверенная уполномоченным сотрудником КЦ (при наличии оригинала).
10	Структура собственности Заявителя Структура собственности Заявителя раскрывается до физических лиц, которые в конечном счете прямо или косвенно (через третьих лиц) владеют (имеют преобладающее участие более 25 процентов в капитале Заявителя) либо имеют возможность контролировать действия Заявителя. Указывается ИНН и/или ОГРН российских юридических и ИНН физических лиц из структуры собственности. В отношении иностранных юридических и физических лиц из структуры собственности указывается страна их регистрации/инкорпорации (гражданство). Структура собственности Заявителя не представляется: - органами государственной власти, иными государственными органами, органами местного самоуправления, учреждениями, находящимися в их ведении, государственными внебюджетными фондами, государственными корпорациями или	Оригинал.

	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; - кредитными организациями, при условии размещения структуры собственности на сайте Банка России.	
11	Лицензия на осуществление банковских операций (для кредитных организаций). Не предоставляется при условии размещения информации о лицензии на сайте Банка России.	Нотариально заверенная копия, или копия, заверенная уполномоченным сотрудником Заявителя (при представлении КЦ оригинала документа), или копия, заверенная уполномоченным сотрудником КЦ (при наличии оригинала).
12	Лицензия профессионального участника рынка ценных бумаг на осуществление брокерской деятельности, на осуществление дилерской деятельности, на осуществление деятельности по управлению ценными бумагами (для брокеров, дилеров и управляющих). Не предоставляется при условии размещения информации о лицензии на сайте Банка России.	Нотариально заверенная копия, или копия, заверенная уполномоченным сотрудником Заявителя (при представлении КЦ оригинала документа), или копия, заверенная уполномоченным сотрудником КЦ (при наличии оригинала).
13	Лицензия управляющей компании на осуществление деятельности по управлению инвестиционными фондами, паевыми инвестиционными фондами и негосударственными пенсионными фондами (для управляющих компаний инвестиционных фондов, паевых инвестиционных фондов, негосударственных пенсионных фондов). Не предоставляется при условии размещения информации о лицензии на сайте Банка России.	Нотариально заверенная копия, или копия, заверенная уполномоченным сотрудником Заявителя (при представлении КЦ оригинала документа), или копия, заверенная уполномоченным сотрудником КЦ (при наличии оригинала).
14	Сведения о деловой репутации Заявителя в форме отзывов о Заявителе других Участников клиринга, имеющих с ним деловые отношения, или отзывов от кредитных организаций, в которых Заявитель находился или находится на	Оригинал.

	обслуживании, с информацией этих организаций об оценке деловой репутации Заявителя. В случае если получение отзывов от указанных лиц невозможно, Заявитель предоставляет в КЦ соответствующее письменное пояснение и в этом случае Заявитель предоставляет отзывы от его контрагентов и/или от ассоциаций, союзов, саморегулируемых организаций или иных объединений, членом которых является Заявитель. Если с даты государственной регистрации Заявителя прошло менее трех месяцев, вместо сведений о его деловой репутации могут быть предоставлены сведения о деловой репутации его бенефициарных владельцев и/или его участников/акционеров с долей участия в капитале Заявителя, составляющей не менее 25 процентов от общего размера его уставного капитала. Отзыв о деловой репутации Заявителя составляется в произвольной письменной форме и должен содержать следующую информацию: - наименование Заявителя и его ИНН; - характер заключенных договорных отношений с лицом, выдавшим отзыв (например, Заявитель находится на расчетном/брокерском/депозитарном обслуживании у лица, выдавшего отзыв и т.д.); - субъективное мнение лица, выдавшего отзыв, о деловой репутации Заявителя (например, характеристика Заявителя как добросовестного и надежного партнера).	
--	---	--

2. Перечень документов, необходимых для регистрации Заявителя – иностранного лица, созданного в соответствии с законодательством иностранного государства, в качестве Участника клиринга

Документы, составленные полностью или в какой-либо их части на иностранном языке (за исключением документов, удостоверяющих личность физического лица, выданных компетентными органами иностранных государств, составленных на нескольких языках, включая русский язык), представляются в КЦ с надлежащим образом заверенным переводом на русский язык. Документы, выданные компетентными органами иностранных государств, подтверждающие статус юридических лиц - нерезидентов, иностранных структур без образования юридического лица, принимаются КЦ при условии их легализации (указанные документы могут быть представлены без их легализации в случаях, предусмотренных международными договорами Российской Федерации).

Требование о представлении в КЦ документов с надлежащим образом заверенным переводом на русский язык не распространяется на документы, выданные компетентными органами иностранных государств, удостоверяющие личность физического лица, при условии наличия у физического лица документа, подтверждающего право законного пребывания на территории Российской Федерации (например, виза, миграционная карта).

№	Наименование документа	Форма предоставления
1	Учредительные документы со всеми действующими зарегистрированными изменениями (устав, учредительный договор или иной документ, предусмотренный законодательством страны регистрации нерезидента).	Нотариально заверенная копия или копия, заверенная уполномоченным сотрудником КЦ (при наличии оригинала).
2	Свидетельство о постановке Заявителя на учет в налоговом органе на территории Российской Федерации в случаях, предусмотренных законодательством Российской Федерации.	Нотариально заверенная копия, или копия, заверенная уполномоченным сотрудником Заявителя (при представлении КЦ оригинала документа), или копия, заверенная уполномоченным сотрудником КЦ (при наличии оригинала).
3	Свидетельство о постановке Заявителя на учет в налоговом органе или иной документ, выданный налоговым органом в соответствии с законодательством страны регистрации Заявителя.	Нотариально заверенная копия, или копия, заверенная уполномоченным сотрудником КЦ (при наличии оригинала).
4	Документ, подтверждающий государственную регистрацию Заявителя: выписка из торгового реестра страны регистрации Заявителя или иной документ, подтверждающий правовой статус Заявителя в соответствии с законодательством страны его регистрации.	Нотариально заверенная копия, или копия, заверенная уполномоченным сотрудником КЦ (при наличии оригинала).
5	Документ, подтверждающий избрание (назначение) единоличного исполнительного органа (руководителя) Заявителя, или лиц, наделённых полномочиями единоличного исполнительного органа Заявителя.	Нотариально заверенная копия, или копия, заверенная уполномоченным сотрудником КЦ (при наличии оригинала).
6	Трудовой договор (соглашение, контракт), единоличного исполнительного органа (руководителя) Заявителя или в случае если функции единоличного исполнительного органа выполняют несколько лиц, то на всех лиц, наделённых	Нотариально заверенная копия, или копия, заверенная уполномоченным сотрудником КЦ (при наличии оригинала).

	полномочиями единоличного исполнительного органа Заявителя в соответствии с учредительными документами Заявителя. Указанный документ представляется КЦ исключительно в случае отсутствия в учредительных документах или в документах об избрании (назначении) единоличного исполнительного органа Заявителя указания на срок, на который избираются (назначаются) вышеуказанные лица.	
7	Документ, удостоверяющий личность лица (лиц), указанного в пункте 5 настоящей таблицы. В случае, если указанным лицом является иностранный гражданин или лицо без гражданства, то указанное лицо дополнительно представляет КЦ следующие документы (если их наличие предусмотрено законодательством Российской Федерации): - миграционная карта; - документ, подтверждающий право иностранного гражданина или лица без гражданства на пребывание (проживание) в Российской Федерации.	Нотариально заверенная копия, или копия, заверенная уполномоченным сотрудником КЦ (при наличии оригинала).
8	Доверенность, подтверждающая полномочия лиц, в отношении которых заполнены разделы «Сведения о представителях (физических лицах)» и «Сведения о представителях (юридических лицах, трастах и иных иностранных структурах без образования юридического лица)» Анкеты Заявителя и / или предоставлена «Анкета представителя клиента – физического лица» / «Анкета представителя клиента – юридического лица» за исключением единоличного исполнительного органа Заявителя.	Оригинал, или нотариально заверенная копия, или копия, заверенная уполномоченным сотрудником КЦ (при наличии оригинала).
9	Документ, удостоверяющий личность физического лица, указанного в пункте 8 настоящей таблицы. В случае если указанным лицом является иностранный гражданин или лицо без гражданства, то указанное лицо дополнительно представляет КЦ следующие документы (если их наличие предусмотрено законодательством Российской Федерации):	Нотариально заверенная копия, или копия, заверенная уполномоченным сотрудником КЦ (при наличии оригинала).

	- миграционная карта; - документ, подтверждающий право иностранного гражданина или лица без гражданства на пребывание (проживание) в Российской Федерации. Документы, подтверждающие сведения, указанные в разделе «Сведения о представителях (юридических лицах, трастах и иных иностранных структурах без образования юридического лица)» Анкеты Заявителя и / или в «Анкету представителя клиента – юридического лица», если представитель является нерезидентом.	
10	Структура собственности Заявителя (раскрывается до физических лиц, которые, в конечном счете, прямо или косвенно (через третьих лиц) владеют (имеют преобладающее участие более 25 процентов в капитале) либо имеют возможность контролировать действия Заявителя). Указывается ИНН или ОГРН российских юридических и ИНН российских физических лиц из Структуры собственности. Указывается страна регистрации / инкорпорации (гражданство) иностранных юридических и физических лиц из Структуры собственности. Информацию о структуре собственности не предоставляют: - международные организации; - эмитенты ценных бумаг, допущенные к организованным торгам, которые раскрывают информацию в соответствии с законодательством Российской Федерации о ценных бумагах; - иностранные организации, ценные бумаги которых прошли процедуру листинга на иностранной бирже, входящей в перечень, утвержденный Банком России.	Оригинал.
11	Карточка с образцами подписей лиц, имеющих право подписи от имени иностранного лица.	Нотариально заверенная копия или копия, заверенная уполномоченным сотрудником КЦ (при наличии оригинала).
12	Положение о представительстве или филиале Заявителя. Предоставляется при наличии у Заявителя	Нотариально заверенная копия или копия, заверенная уполномоченным сотрудником КЦ (при наличии

	обособленного подразделения (представительства, филиала), созданного на территории Российской Федерации.	оригинала).
13	Свидетельство о постановке филиала или представительства Заявителя на учет в налоговом органе по месту нахождения на территории Российской Федерации. Предоставляется при наличии у Заявителя обособленного подразделения (представительства, филиала), созданного на территории Российской Федерации.	Нотариально заверенная копия или копия, заверенная уполномоченным сотрудником КЦ (при наличии оригинала).
14	Документ, подтверждающий полномочия руководителя филиала или представительства Заявителя. Предоставляется при наличии у Заявителя обособленного подразделения (представительства, филиала), созданного на территории Российской Федерации.	Нотариально заверенная копия или копия, заверенная уполномоченным сотрудником КЦ (при наличии оригинала).
15	Документы, свидетельствующие о внесении записи в сводный государственный реестр аккредитованных на территории Российской Федерации представительств иностранных компаний или государственный реестр филиалов иностранных юридических лиц, аккредитованных на территории Российской Федерации (в случаях, предусмотренных законодательством Российской Федерации) Предоставляется при наличии у Заявителя обособленного подразделения (представительства, филиала), созданного на территории Российской Федерации.	Нотариально заверенная копия, или копия, заверенная уполномоченным сотрудником Заявителя (при представлении КЦ оригинала документа), или копия, заверенная уполномоченным сотрудником КЦ (при наличии оригинала).
16	Сведения о деловой репутации Заявителя в форме отзывов о Заявителе других Участников клиринга, имеющих с ним деловые отношения, или отзывов от кредитных организаций, в которых Заявитель находился или находится на обслуживании, с информацией этих организаций об оценке деловой репутации Заявителя. В случае если получение отзывов от указанных лиц невозможно, Заявитель предоставляет в КЦ соответствующее письменное пояснение и в этом случае Заявитель предоставляет отзывы от его контрагентов и/или от ассоциаций, союзов, саморегулируемых	Оригинал.

	организаций или иных объединений, членом которых является Заявитель. Если с даты государственной регистрации Заявителя прошло менее трех месяцев, вместо сведений о его деловой репутации могут быть предоставлены сведения о деловой репутации его бенефициарных владельцев и/или его участников/акционеров с долей участия в капитале Заявителя, составляющей не менее 25 процентов от общего размера его уставного капитала. Отзыв о деловой репутации Заявителя составляется в произвольной письменной форме и должен содержать следующую информацию: - наименование Заявителя и его ИНН; - характер заключенных договорных отношений с лицом, выдавшим отзыв (например, Заявитель находится на расчетном/брокерском/депозитарном обслуживании у лица, выдавшего отзыв и т.д.); - субъективное мнение лица, выдавшего отзыв, о деловой репутации Заявителя (например, характеристика Заявителя как добросовестного и надежного партнера).	
--	---	--

**Приложение № 2 к Правилам осуществления клиринговой деятельности на
рынке ценных бумаг и на рынке производных финансовых инструментов**

**Финансовая отчетность, предоставляемая Участниками клиринга (Заявителями) в
КЦ, и сроки её предоставления**

1. Отчетность Участников клиринга (Заявителей), являющихся кредитными организациями, созданными в соответствии с законодательством Российской Федерации:⁴

Наименование и форма отчетности	Периодичность предоставления	Сроки предоставления
Оборотная ведомость по счетам бухгалтерского учета кредитной организации (форма 0409101).	При подаче Заявителем в КЦ документов для регистрации в качестве Участника клиринга – за 15 отчетных периодов, предшествующих дате подачи документов. После регистрации в качестве Участника клиринга – ежемесячно.	Заявителями - при подаче в КЦ документов для регистрации в качестве Участника клиринга. После регистрации в качестве Участника клиринга - не позднее 1 (одного) календарного месяца, следующего за отчетным месяцем.
Отчет о финансовых результатах кредитной организации (форма 0409102).	При подаче Заявителем в КЦ документов для регистрации в качестве Участника клиринга – за 5 отчетных периодов, предшествующих дате подачи документов. После регистрации в качестве Участника клиринга – ежеквартально.	Заявителями - при подаче в КЦ документов для регистрации в качестве Участника клиринга. После регистрации в качестве Участника клиринга - не позднее 1 (одного) календарного месяца, следующего за отчетным кварталом.
Расчет собственных средств (капитала) («Базель III») (форма 0409123).	При подаче Заявителем в КЦ документов для регистрации в качестве Участника клиринга – за 15 отчетных периодов, предшествующих дате подачи документов. После регистрации в качестве Участника клиринга – ежемесячно.	Заявителями - при подаче в КЦ документов для регистрации в качестве Участника клиринга. После регистрации в качестве Участника клиринга - не позднее 1 (одного) календарного месяца, следующего за отчетным месяцем.
Информация об обязательных нормативах и о других показателях деятельности кредитной организации (форма 0409135).		

⁴ КЦ, при необходимости, имеет право запросить у Участника клиринга дополнительные документы, характеризующие его финансовое состояние.

Информация о наличии / отсутствии у Заявителя / Участника клиринга существенной по суммам и (или) срокам задолженности перед федеральным бюджетом, бюджетами субъектов Российской Федерации, местными бюджетами и внебюджетными фондами, с учетом причин их возникновения.	По запросу КЦ по состоянию на последнюю отчетную дату или на дату составления документа.	В срок, указанный в запросе.
Информация о наличии / отсутствии у Заявителя / Участника клиринга просроченной задолженности перед работниками по заработной плате.	По запросу КЦ по состоянию на последнюю отчетную дату или на дату составления документа.	В срок, указанный в запросе.
Информация о наличии / отсутствии у Заявителя / Участника клиринга просроченной задолженности перед Банком России по привлеченным кредитам.	По запросу КЦ по состоянию на последнюю отчетную дату или на дату составления документа.	В срок, указанный в запросе.

2. Отчетность Участников клиринга (Заявителей), являющихся юридическими лицами (некредитными организациями), созданными в соответствии с законодательством Российской Федерации:⁵

Наименование и форма отчетности	Периодичность предоставления	Сроки предоставления
Годовая бухгалтерская (финансовая) отчетность некредитной финансовой организации в полном объеме, составленная на основании образцов форм, утвержденных Положением Банка России от 03.02.2016 г. № 532-П «Отраслевой стандарт	При подаче Заявителем в КЦ документов для регистрации в качестве Участника клиринга – за 3 отчетных периода, предшествующих дате подачи документов. После регистрации в качестве Участника	Заявителями - при подаче в КЦ документов для регистрации в качестве Участника клиринга. После регистрации в качестве Участника клиринга – не позднее 30 марта года, следующего за отчетным годом.

⁵ КЦ, при необходимости, имеет право запросить у Участника клиринга дополнительные документы, характеризующие его финансовое состояние, включая, но не ограничиваясь сведениями, представляемыми в составе форм федерального статистического наблюдения в Федеральную службу государственной статистики (Росстат), а также данными по формам налоговой отчетности, представляемыми в налоговые органы

бухгалтерского учета «Порядок составления бухгалтерской (финансовой) отчетности профессиональных участников рынка ценных бумаг, акционерных инвестиционных фондов, организаторов торговли, центральных контрагентов, клиринговых организаций, специализированных депозитариев инвестиционного фонда, паевого инвестиционного фонда и негосударственного пенсионного фонда, управляющих компаний инвестиционного фонда, паевого инвестиционного фонда и негосударственного пенсионного фонда, бюро кредитных историй, кредитных рейтинговых агентств, страховых брокеров».	клиринга – ежегодно.	
Промежуточная бухгалтерская (финансовая) отчетность некредитной финансовой организации в полном объеме, составленная на основании образцов форм, утвержденных Положением Банка России от 03.02.2016 г. №532-П «Отраслевой стандарт бухгалтерского учета «Порядок составления бухгалтерской (финансовой) отчетности профессиональных участников рынка ценных бумаг, акционерных инвестиционных фондов, организаторов торговли, центральных контрагентов, клиринговых организаций, специализированных депозитариев инвестиционного фонда, паевого инвестиционного фонда и негосударственного	При подаче Заявителем в КЦ документов для регистрации в качестве Участника клиринга – за 5 отчетных периодов, предшествующих дате подачи документов. После регистрации в качестве Участника клиринга – ежеквартально.	Заявителями - при подаче в КЦ документов для регистрации в качестве Участника клиринга. После регистрации в качестве Участника клиринга - не позднее 1 (одного) календарного месяца, следующего за отчетным кварталом.

пенсионного фонда, управляющих компаний инвестиционного фонда, паевого инвестиционного фонда и негосударственного пенсионного фонда, бюро кредитных историй, кредитных рейтинговых агентств, страховых брокеров».		
Расчет собственных средств профессионального участника, составленный на основании образца формы, утвержденной Указанием Банка России от 04.04.2019 г. N 5117-У «О формах, сроках и порядке составления и представления отчетности профессиональных участников рынка ценных бумаг, организаторов торговли, клиринговых организаций и лиц, осуществляющих функции центрального контрагента, а также другой информации в Центральный банк Российской Федерации».	При подаче Заявителем в КЦ документов для регистрации в качестве Участника клиринга – за 15 отчетных периодов, предшествующих дате подачи документов. После регистрации в качестве Участника клиринга – ежемесячно.	Заявителями - при подаче в КЦ документов для регистрации в качестве Участника клиринга. После регистрации в качестве Участника клиринга - не позднее 1 (одного) календарного месяца, следующего за отчетным месяцем.
Информация о наличии / отсутствии существенной по суммам и (или) срокам текущей картотеки неоплаченных расчетных документов к банковским счетам Заявителя / Участника клиринга.	По запросу КЦ по состоянию на последнюю отчетную дату или на дату составления документа.	В срок, указанный в запросе.
Информация о наличии / отсутствии у Заявителя / Участника клиринга существенной по суммам и (или) срокам задолженности перед федеральным бюджетом, бюджетами субъектов Российской Федерации, местными бюджетами и внебюджетными фондами, с учетом причин их возникновения.	По запросу КЦ по состоянию на последнюю отчетную дату или на дату составления документа.	В срок, указанный в запросе.

Информация о наличии / отсутствии у Заявителя / Участника клиринга просроченной задолженности перед работниками по заработной плате.	По запросу КЦ по состоянию на последнюю отчетную дату или на дату составления документа.	В срок, указанный в запросе.
--	--	------------------------------

3. Отчетность Участников клиринга (Заявителей) - иностранных лиц, созданных в соответствии с законодательством иностранных государств:⁶

Отчетность, составленная на английском языке в соответствии с требованиями, определенными Международными стандартами финансовой отчетности.

⁶ КЦ, при необходимости, имеет право запросить у Участника клиринга дополнительные документы, характеризующие его финансовое состояние