

УТВЕРЖДЕНО
советом директоров
Небанковской кредитной организации - центрального контрагента
«СПБ Клиринг»
(акционерное общество)
(протокол № 13/2022 от «29» июля 2022)

**ПРАВИЛА ОСУЩЕСТВЛЕНИЯ
КЛИРИНГОВОЙ ДЕЯТЕЛЬНОСТИ**
на рынке финансовых инструментов
Небанковской кредитной организации-центрального контрагента
«СПБ Клиринг» (акционерное общество)

Москва,
2022 год

Оглавление

РАЗДЕЛ I. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ	5
Статья 1. Термины и определения	5
Статья 2. Общие положения	12
Статья 3. Порядок проведения клиринга	14
Статья 4. Взаимодействие КЦ с Организатором торговли, Торговой площадкой, Расчетной организацией, Расчетным депозитарием и Техническим центром.....	16
Статья 5. Общие правила использования информации	17
Статья 6. Клиринговые регистры	17
Статья 7. Виды клиринговых и иных счетов	25
Статья 8. Порядок регистрации Торгово-клиринговых счетов	29
РАЗДЕЛ II. ПРАВА И ОБЯЗАННОСТИ КЦ И УЧАСТНИКОВ КЛИРИНГА. ТРЕБОВАНИЯ К УЧАСТНИКАМ КЛИРИНГА.....	33
Статья 9. Права, обязанности и ответственность КЦ и Участников клиринга	33
Статья 10. Требования к Участникам клиринга, допущенным к клиринговому обслуживанию	34
Статья 11. Регистрация в качестве Участника клиринга	36
Статья 12. Требования к Участникам клиринга по предоставлению финансовой отчетности в КЦ и их финансовой устойчивости.....	42
Статья 13. Допуск к клиринговому обслуживанию, приостановление, возобновление и прекращение допуска к клиринговому обслуживанию.....	44
Статья 14. Оплата услуг КЦ, Организатора торговли, Торговой площадки	47
РАЗДЕЛ III. МЕРЫ, НАПРАВЛЕННЫЕ НА УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ.....	49
Статья 15. Способы снижения рисков при осуществлении клиринга.....	49
Статья 16. Обеспечение исполнения обязательств Участников клиринга. Условия соглашения об индивидуальном клиринговом обеспечении и коллективном клиринговом обеспечении	50
Статья 17. Ограничение ответственности центрального контрагента (уровни защиты центрального контрагента).....	53
Статья 18. Гарантийные фонды	54
Статья 19. Порядок расчета величины Доступных средств	55
Статья 20. Маржинальные требования	57
Статья 21. Последствия нарушения Маржинального требования	58
Статья 22. Порядок использования и возмещения Гарантийных фондов и использования Выделенного капитала	62
РАЗДЕЛ IV. ПОРЯДОК ВНЕСЕНИЯ, ИСПОЛЬЗОВАНИЯ И ВОЗВРАТА СРЕДСТВ ОБЕСПЕЧЕНИЯ.....	66
Статья 23. Порядок внесения, использования и возврата Средств обеспечения.....	66

Статья 24. Порядок внесения и возврата вклада в Гарантийные фонды.....	73
РАЗДЕЛ V. ПОРЯДОК И УСЛОВИЯ ДОПУСКА ОБЯЗАТЕЛЬСТВ К КЛИРИНГУ	75
Статья 25. Порядок взаимодействия с Организатором торговли / Торговой площадкой при подаче Заявок / Заявок Торговой площадки и заключении Договоров / Внебиржевых договоров ОТС. Порядок и условия допуска обязательств к клирингу.....	75
Статья 26. Прием Поручений на клиринг внебиржевых договоров.....	78
Статья 27. Порядок заключения Внебиржевых договоров ОТС на основании Оферт ОТС.....	79
РАЗДЕЛ VI. ПОРЯДОК ВКЛЮЧЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ В КЛИРИНГОВЫЙ ПУЛ. ПОРЯДОК ИСПОЛНЕНИЯ/ПРЕКРАЩЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ	84
Статья 28. Виды клиринговых пулов. Порядок включения обязательств в клиринговые пулы.....	84
Статья 29. Порядок формирования клирингового пула по Договорам, расчётного клирингового пула, клирингового пула по Внутриброкерским договорам, клирингового пула DVP и клирингового пула ОТС. Порядок исполнения / прекращения обязательств, допущенных к клирингу	85
Статья 30. Порядок урегулирования ненадлежащего исполнения обязательств.	94
Статья 31. Донорский договор.....	105
Статья 32. Порядок формирования клирингового пула по Договорам размещения и выкупа. Порядок исполнения / прекращения обязательств, допущенных к клирингу	112
Статья 33. Порядок формирования клирингового пула по договорам, заключаемым без участия Центрального контрагента. Порядок исполнения / прекращения обязательств, допущенных к клирингу	114
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	116
Статья 35. Порядок формирования клирингового пула для расчетов по итогам Торгов	118
Статья 36. Задолженность по денежному регистру	119
Статья 37. Порядок передачи Доходов по Договорам репо, Внебиржевым договорам репо ОТС, Парам договоров, Договорам купли-продажи облигаций.....	120
Статья 38. Порядок исполнения обязательств по Договорам ПФИ.....	125
Статья 39. Случаи и порядок заключения Договоров купли-продажи и Договоров репо (Внебиржевых договоров репо ОТС) с ЦК без подачи заявок	129
РАЗДЕЛ VII. ПОРЯДОК И СПОСОБЫ ВЗАИМОДЕЙСТВИЯ КЦ, УЧАСТНИКОВ КЛИРИНГА, РАСЧЕТНОЙ ОРГАНИЗАЦИИ, РАСЧЕТНОГО ДЕПОЗИТАРИЯ, ОРГАНИЗАТОРА ТОРГОВЛИ, ТОРГОВОЙ ПЛОЩАДКИ. ОТЧЕТЫ КЦ	131
Статья 40. Порядок взаимодействия КЦ с Расчетной организацией, Расчетным депозитарием	131
Статья 41. Порядок взаимодействия КЦ с Организатором торговли / Торговой площадкой.....	132
Статья 42. Способы получения и передачи документов при взаимодействии КЦ с Участниками клиринга, Организатором торговли, Торговой площадкой, Расчетным депозитарием и Расчетной организацией.....	133

Статья 43. Отчеты КЦ и иная информация, предоставляемая Участникам клиринга	134
РАЗДЕЛ VIII. ПРОЧИЕ УСЛОВИЯ	135
Статья 44. Порядок действия КЦ при операциях с ценными бумагами / НФИ вследствие корпоративных событий	135
Статья 45. Порядок перевода обязательств и передачи имущества Обособленного клиента	137
Статья 46. Взаимодействие КЦ и Участников клиринга при исполнении налоговых обязательств по Доходам, полученным по Ценным бумагам эмитентов США и Ценным бумагам эмитентов ФРГ, а также обязательств по уплате Транзакционного налога	138
Статья 47. Хранение и учет документов и информации внутреннего учета	140
Статья 48. Порядок урегулирования неисполненных обязательств в случае прекращения клирингового обслуживания Участника клиринга	141
Статья 49. Существенные события	146

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 / 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.

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

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.

Валютный своп – валютный своп, заключаемый на Торгах в соответствии с Правилами торговли и настоящими Правилами.

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 валютный своп ОТС - валютный своп, заключаемый с КЦ не на Торгах в порядке и на условиях, определенных настоящими Правилами и Правилами Торговой площадки.

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 купли-продажи иностранной валюты ОТС или Внебиржевой договор репо ОТС или Внебиржевой валютный своп ОТС.

Внебиржевой договор купли-продажи ОТС - договор купли-продажи ценных бумаг, а также НФИ, заключаемый с КЦ не на Торгах в порядке и на условиях, определенных настоящими Правилами и (или) Правилами Торговой площадки.

Внебиржевой договор купли-продажи иностранной валюты ОТС - договор купли-продажи иностранной валюты, заключаемый с КЦ на Торгах Торговой площадки в порядке и на условиях, определенных настоящими Правилами и Правилами Торговой площадки.

Внебиржевой договор репо ОТС – договор репо, заключаемый с КЦ не на Торгах в порядке и на условиях, определенных настоящими Правилами, Правилами Торговой площадки, и, в случаях, установленных настоящими Правилами, условиями Генерального соглашения о договорах репо.

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.

Генеральное соглашение о договорах репо – соглашение, определяющие общие условия Договоров репо и Внебиржевых договоров репо ОТС, предметом которых являются Ценные бумаги эмитентов Гонконга, заключаемое между КЦ и Участником клиринга по форме, утвержденной КЦ и размещенной на Сайте КЦ.

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 Договор купли-продажи иностранной валюты, или Валютный своп, или Донорский договор.

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

Договор купли-продажи иностранной валюты – договор купли-продажи иностранной валюты, заключаемый на Торгах в соответствии с Правилами торговли и настоящими Правилами.

Договор репо - договор репо, заключаемый на Торгах в соответствии с Правилами торговли, настоящими Правилами и, в случаях, установленных настоящими Правилами, условиями Генерального соглашения о договорах репо.

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

Донорский договор - Донорский договор купли-продажи, Донорский договор репо, Донорский валютный своп или Донорский внебиржевой валютный своп ОТС.

Донорский валютный своп - Валютный своп, заключаемый в случаях и в порядке, указанных в статье 31 настоящих Правил.

Донорский внебиржевой валютный своп ОТС – Внебиржевой валютный своп ОТС, заключаемый в случаях и в порядке, указанных в статье 31 настоящих Правил.

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 и рассчитываемая в соответствии с Методикой расчета гарантийного обеспечения.

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 «СПБ Клиринг» (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 определения внутренних рейтингов Контрагентов - внутренний документ КЦ, утверждаемый единоличным исполнительным органом КЦ и устанавливающий порядок оценки финансового положения Участников клиринга и иных контрагентов КЦ.

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.

Неквалифицированные финансовые инструменты (НФИ) - иностранные финансовые инструменты, не квалифицированные в качестве ценных бумаг в соответствии с законодательством Российской Федерации.

Оператор Счета учета НФИ – юридическое лицо, являющееся уполномоченным представителем лица, в отношении которого открыт Счет учета НФИ, имеющее право на основании поручения или доверенности отдавать распоряжения в Расчетный депозитарий на выполнение операций по Счету учета НФИ в рамках установленных полномочий.

Организатор торговли – Публичное акционерное общество «СПБ Биржа».

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 иностранных валют – перечень иностранных валют, которые могут вноситься в качестве Средств обеспечения.

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 торгов Торговой площадки – внутренний документ (внутренние документы) Торговой площадки, в котором (которых) установлен порядок оказания услуг по проведению торгов ценными бумагами.

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

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 Compliance 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, в которой открыт Клиринговый денежный счет или Банковский счет КЦ, 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 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.

Регламент обмена информацией - Регламент обмена информацией в целях исполнения Закона США «О налогообложении иностранных счетов» (ФАТСА), Налогового кодекса ФРГ и иных законодательных актов в сфере налогообложения Доходов по Ценным бумагам иностранных эмитентов Небанковской кредитной организации - центрального контрагента «СПБ Клиринг» (акционерное общество), который утверждается КЦ и раскрывается на Сайте КЦ.

Сайт КЦ – сайт в сети Интернет по адресу <https://spbclearing.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 валют - перечень валют, являющихся предметом обязательств из Договоров купли-продажи иностранной валюты и Валютных свопов, клиринг которых осуществляет КЦ.

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, являющихся предметом обязательств из Договоров ПФИ, клиринг которых осуществляет КЦ.

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

Средства обеспечения - имущество, являющееся предметом индивидуального клирингового обеспечения, и (или) имущество, являющееся иным обеспечением, которое может быть использовано для обеспечения и (или) исполнения обязательств Участника клиринга по Договорам, Внебиржевым договорам, Внебиржевым договорам ОТС и других обязательств, допущенных к клирингу в соответствии с настоящими Правилами.

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).

Ставка своп - величина, выраженная в процентах годовых и используемая для расчета цены Второго договора купли-продажи иностранной валюты, составляющего Валютный своп / Второго договора купли-продажи иностранной валюты ОТС, составляющего Внебиржевой валютный своп ОТС.

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.

Счет учета НФИ – счет, открываемый Расчетным депозитарием Участнику клиринга, клиенту или Субклиенту Участника клиринга, Депозитарию, предназначенный для учета прав на НФИ и проведения расчетов по НФИ по итогам клиринга обязательств из Внебиржевых договоров ОТС.

Технический центр – организация, обеспечивающая Участникам клиринга технический доступ к Системе и (или) обеспечивающая технический доступ Организатору торговли / Торговой площадке к Клиринговой системе, а также организация, обеспечивающая Участникам клиринга доступ к Системе электронного документооборота, информация о которых раскрыта на Сайте КЦ.

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

Торги Торговой площадки – торги ценными бумагами, проводимые Торговой площадкой в соответствии с требованиями Правил торгов Торговой площадки и настоящих Правил.

Торговая площадка – лицо, являющееся нерезидентом, которое в соответствии с законодательством государства учреждения вправе оказывать услуги по проведению торгов, и клиринг договоров, заключаемых на указанных торгах, осуществляет КЦ.

ТКС (Торгово-клиринговый счет) - группа клиринговых регистров, предназначенных для учета объектов внутреннего учета КЦ, объединяемая во внутреннем учете КЦ общим признаком.

Транзакционный налог – налог, сбор или иной платеж, взимание которого предусмотрено положениями законодательства юрисдикции регистрации или места учреждения эмитентов ценных бумаг и (или) юрисдикции их первоначального листинга при заключении Договоров или Внебиржевых договоров ОТС, предметом которых являются указанные ценные бумаги или при иных способах передачи и осуществления прав на такие ценные бумаги.

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

Цена урегулирования исполнения обязательств - цена ценной бумаги / НФИ / иностранной валюты / национальной валюты Российской Федерации, определенная КЦ для целей заключения договоров в соответствии со статьей 30 настоящих Правил, а также для заключения Донорских договоров, в соответствии с Методикой установления и изменения риск-параметров.

Ценные бумаги эмитентов Гонконга – ценные бумаги иностранных эмитентов, прошедшие листинг на фондовой бирже, созданной в Гонконге в соответствии с требованиями его локального законодательства отличного от законодательства Китайской Народной Республики (Гонконгская фондовая биржа / The Stock Exchange of Hong Kong).

Ценные бумаги эмитентов США – ценные бумаги и НФИ, 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 / Счетах учета НФИ.

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

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», или документированная информация, представленная в электронной форме, то есть в виде, пригодном для восприятия с использованием электронных вычислительных машин, а также для передачи по информационно-телекоммуникационным сетям или обработки в Системе электронного документооборота.

Электронная подпись – электронная подпись в значении, установленном Федеральным законом «Об электронной подписи», или информация в электронной форме, которая присоединена к другой информации в электронной форме (подписываемой информации) или иным образом связана с такой информацией и которая используется для определения лица, подписывающего информацию.

Термины, специально не определенные в настоящих Правилах, используются в значениях, установленных Правилами торговли и (или) Правилами торгов Торговой площадки и (или) документами Расчетной организации / Расчетного депозитария 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 статьей 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 статьей 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.

2.7. В случае, если положения Генерального соглашения о договорах репо противоречат положениям Правил торговли / Правил торгов Торговой площадки и (или) положениям настоящих Правил, то применению подлежат, соответственно, положения Правил торговли / Правил торгов Торговой площадки и (или) Положения настоящих правил.

2.8. Рынком КЦ является совокупность видов договоров и Организатора торговли / Торговых площадок, на котором (которых) могут заключаться указанные договоры, для которой КЦ:

- устанавливает отдельную систему управления рисками (систему гарантий исполнения обязательств), включающую обособленный от других рынков КЦ учет Средств обеспечения и расчет Доступных средств;

- формирует отдельные Гарантийные фонды, использование которых возможно только на таком рынке КЦ;

- устанавливает отдельную сумму Выделенного капитала, использование которой возможно только на таком рынке КЦ.

Рынками КЦ являются:

- рынок СПб – Договоры, заключаемые на Торгах Организатора торговли, Внебиржевые договоры ОТС, заключаемые на основании Оферт ОТС, Внебиржевые договоры;
- рынок Казахстан – Внебиржевые договоры ОТС, заключаемые на Торгах Торговой площадки International Trading System Limited.

Статья 3. Порядок проведения клиринга

3.1. КЦ устанавливает требования к порядку, размеру и срокам предоставления индивидуального клирингового обеспечения и (или) иного обеспечения, осуществляет контроль достаточности предоставленного индивидуального клирингового обеспечения и (или) иного обеспечения в целях подачи Заявок на заключение Договоров, подачи заявок на Торговой площадке в соответствии с Правилами торгов Торговой площадки (далее – Заявка Торговой площадки) и (или) Оферт ОТС на заключение Внебиржевых договоров ОТС и приема Поручений на клиринг внебиржевых договоров к исполнению в порядке, предусмотренном настоящими Правилами. КЦ контролирует достаточность предоставленного индивидуального клирингового обеспечения и (или) иного обеспечения для проведения расчетов по денежным средствам, ценным бумагам и НФИ в порядке и сроки, установленные настоящими Правилами.

Договоры на Торговой площадке (далее – Договоры Торговой площадки) заключаются на основании Заявок Торговой площадки, подаваемых участниками Торговой площадки, допущенными к Торгам Торговой площадки в соответствии с документами Торговой площадки (далее – Участники торгов Торговой площадки). Договоры Торговой площадки являются Внебиржевыми договорами ОТС.

3.2. По обязательствам, возникшим из Договоров купли-продажи и Договоров репо, в которых указан Код расчетов Тп, Код расчетов ТкТп и Код расчетов У0, а также по обязательствам, возникшим из Договоров ПФИ, Договоров купли-продажи иностранной валюты и Валютного свопа, КЦ осуществляет клиринг с участием центрального контрагента.

По обязательствам, возникшим из Договоров купли-продажи и Договоров репо, в которых указан Код расчетов Х0, Код расчетов U0, Код расчетов W0, Код расчетов Оп и Код расчетов OkOp, 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, НФИ 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 / Внебиржевых договоров ОТС, заключенных на Торговой площадке, осуществляется на основании документов от Организатора торговли / Торговой площадки, без получения от Участников клиринга подтверждений о заключении Договоров / Внебиржевых договоров ОТС. КЦ не осуществляет клиринг по Договорам / Внебиржевым договорам ОТС, заключённым на Торгах / Торгах Торговой площадки, с нарушением требований, установленных настоящими Правилами. КЦ не осуществляет клиринг по Договорам / Внебиржевым договорам ОТС на основании документов от Организатора торговли / Торговой площадки, в случае нарушения требований к составу и (или) формам представления информации, содержащейся в указанных документах, установленных договором, заключённым между КЦ и Организатором торговли / Торговой площадкой.

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

Клиринг обязательств, возникших из Внебиржевых договоров ОТС, заключенных на основании Оферт 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, НФИ на Счетах учета НФИ 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, НФИ и денежных средствах, являющихся предметом индивидуального клирингового обеспечения и (или) иного обеспечения.

3.10. КЦ осуществляет клиринг обязательств из Договоров купли-продажи и Договоров репо, заключенных в отношении ценных бумаг, включенных в Список ценных бумаг. КЦ осуществляет клиринг обязательств из Договоров купли-продажи иностранной валюты и Валютного свопа, заключенных в отношении иностранных валют (национальной валюты Российской Федерации), включенных в Список валют. КЦ осуществляет клиринг обязательств из Договоров ПФИ, заключенных в отношении ПФИ, включенных в Список ПФИ. Порядок и условия формирования и изменения указанных списков определяются в договоре, заключенном между КЦ и Организатором торговли.

КЦ осуществляет клиринг обязательств из Внебиржевых договоров и Внебиржевых договоров ОТС 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/НФИ в результате совершения сделок на организованных торгах, проводимых иностранными биржами, или 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, Торговой площадкой, Расчетной организацией, Расчетным депозитарием и Техническим центром

4.1. Перечень Организаторов торговли, Торговых площадок, 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, Торговой площадкой, 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, Правилами торговли, Правилами торгов Торговой площадки 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 Банк России, Организатора торговли, Торговую площадку, 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, Торговую площадку, 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, указанной в подпункте 2) пункта 2.1.1 и подпункте 2) пункта 2.1.2 Регламента клиринга (далее - 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, Торговой площадкой 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/Счетах учета НФИ, об операциях по указанным Субсчетам/Счетам учета НФИ и об операциях с денежными средствами по денежным регистрам, а также иная информация, 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 или ее часть может быть предоставлена Расчетной организации, Расчетному депозитарию, Техническому центру, Торговой площадке и (или) Организатору торговли.

КЦ, в частности, передает:

- Расчетному депозитарию поручения на операции по Субсчетам депо/Счетам учета НФИ, в том числе на зачисление и списание ценных бумаг с Субсчета депо/ НФИ со Счетов учета НФИ по инициативе Участника клиринга, его клиентов и (или) Субклиентов, а также при проведении расчетов по итоговым нетто-обязательствам и итоговым нетто-требованиям, определенным по обязательствам, возникшим из Договоров, Внебиржевых договоров ОТС, Внебиржевых договоров;

- Расчетной организации поручения на возврат денежных средств Участника клиринга, его клиентов и (или) Субклиентов с Клирингового денежного счета;

- Организатору торговли и Торговой площадке информацию об остатках денежных средств и об операциях с денежными средствами по денежным регистрам;

- Организатору торговли, Торговой площадке и Техническому центру информацию о регистрации, изменении параметров и удалении ТКС Участников клиринга;

- Техническому центру информацию о заключенных Внебиржевых договорах ОТС.

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;

- регистры учета, на которых учитываются позиции по НФИ;

- 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 (в иностранной валюте), на которых учитываются денежные средства в иностранной валюте, учет которой в качестве Средств обеспечения прекращен решением КЦ, принятым в соответствии со статьей 49 настоящих Правил (далее - Блокировочные регистры);

- 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;

- регистр лимита обеспечения, на котором учитывается сумма лимита обеспечения в Валюте Доступных средств.

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 НФИ. Указанные позиции учитываются на регистрах учета НФИ. Позиция по НФИ рассчитывается для каждого Счета учета НФИ и по каждому идентификационному коду / коду НФИ на основании информации об остатках НФИ на Счетах учета НФИ, полученной от Расчетного депозитария;

- 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 / НФИ из Договоров / Внебиржевых договоров / Внебиржевых договоров ОТС в разрезе денежных регистров/ связанных с ним депо регистров / регистров учета, на которых учитываются позиции по НФИ, 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 ТкТп и которые заключены на основании Заявок, в которых указаны одинаковые ТКС (далее - Внутриброкерские договоры) и по Внебиржевым договорам ОТС, которые заключены на основании Заявок Торговой площадки, в которых указаны одинаковые ТКС, или 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 / регистров учета, на которых учитываются позиции по НФИ / 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;

- сумма лимита обеспечения в Валюте Доступных средств. Сумма лимита обеспечения в Валюте Доступных средств может быть как положительной, так и отрицательной. Лимит обеспечения используется при расчете Доступных средств, увеличивая (при положительном значении) или уменьшая (при отрицательном значении) величину Доступных средств.

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 / НФИ (какой стороной в обязательстве по передаче ценных бумаг / НФИ 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 / НФИ, в отношении которых заключен договор;

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

- ТКС, с указанием которого заключен договор;

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

- суммой денежных средств, соответствующей размеру обязательства по оплате ценных бумаг / НФИ 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 видов Договоров ПФИ, 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. Закрытие 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. Договоры купли-продажи иностранной валюты / Валютный своп / Внебиржевые договоры купли-продажи иностранной валюты ОТС / Внебиржевой валютный своп ОТС / 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);

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

- валютой, в отношении которой заключен Договор купли-продажи иностранной валюты / Валютный своп / Внебиржевой договор купли-продажи иностранной валюты ОТС / Внебиржевой валютный своп ОТС / Внебиржевой договор;

- датой исполнения обязательств по Договору купли-продажи иностранной валюты / Валютному свопу / Внебиржевому договору купли-продажи иностранной валюты ОТС / Внебиржевому валютному свопу ОТС / Внебиржевому договору;

- ТКС, с указанием которого заключен Договор купли-продажи иностранной валюты / Валютный своп / Внебиржевой договор купли-продажи иностранной валюты ОТС / Внебиржевой валютный своп ОТС / ТКС, указанным в Поручении на клиринг внебиржевых договоров;

- суммой денежных средств в соответствующей валюте, соответствующей размеру денежного обязательства по Договору купли-продажи иностранной валюты / Валютному свопу / Внебиржевому договору купли-продажи иностранной валюты ОТС / Внебиржевому валютному свопу ОТС / 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 Гарантийные фонды;
- денежная позиция Гаранта по учету средств, внесенных в специальный Гарантийный 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.

Позиции по НФИ могут иметь следующие типы:

- позиция КЦ;
- позиция Участника клиринга - владельца;
- позиция Участника клиринга – номинального держателя;
- позиция клиента Участника клиринга, имеющего отдельный Счет учета НФИ;
- позиция Субклиента Участника клиринга, имеющего отдельный Счет учета НФИ;
- 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.

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 НФИ. Указанные позиции учитываются на регистрах учета НФИ. Позиция по НФИ рассчитывается для каждого Счета учета НФИ и по каждому идентификационному коду НФИ на основании информации об остатках НФИ на Счетах учета НФИ, 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 Договора купли-продажи иностранной валюты / Валютного свопа / Внебиржевого договора купли-продажи иностранной валюты ОТС / Внебиржевого валютного свопа ОТС, 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 X0 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 расчётов по итогам Торгов. Указанные обязательства и 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 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 заключённых 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 НФИ, 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, ценных бумаг и НФИ, 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 и иных 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.

Для внесения иного обеспечения в иностранной валюте используются Банковские счета КЦ.

Для внесения НФИ, составляющего иное обеспечение, используются Счета учета НФИ, открываемые в порядке, определенном настоящей статьёй.

7.2. Условием заключения Участником клиринга от своего имени и за свой счет Договоров, за исключением:

- Договоров, заключенных с указанием ТКС-DVP;
- Договоров купли-продажи иностранной валюты;
- Валютного свопа;
- Внебиржевых договоров купли-продажи иностранной валюты ОТС;
- Внебиржевого валютного свопа ОТС;

является открытие этому Участнику клиринга Субсчета депо владельца. Условием заключения Участником клиринга от своего имени и за свой счет Внебиржевых договоров ОТС, за исключением Внебиржевых договоров ОТС, предметом которых являются НФИ, и Внебиржевых договоров ОТС, заключенных с указанием ТКС-DVP, является открытие этому Участнику клиринга Субсчета депо владельца.

Условием заключения Участником клиринга в интересах и за счет клиентов или Субклиентов Участника клиринга Договоров, за исключением;

- Договоров, заключенных с указанием ТКС-DVP;
- Договоров купли-продажи иностранной валюты;
- Валютного свопа;
- Внебиржевых договоров купли-продажи иностранной валюты ОТС;
- Внебиржевого валютного свопа ОТС;

, 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. Условием заключения Участником клиринга в интересах и за счет клиентов или Субклиентов Участника клиринга Внебиржевых договоров ОТС, за исключением Внебиржевых договоров ОТС, заключенных с указанием ТКС-DVP, и Внебиржевых договоров ОТС, предметом которых являются НФИ, 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 Договоров, за исключением:

- Договоров, заключенных с указанием ТКС-DVP;
- Договоров купли-продажи иностранной валюты;
- Валютного свопа;
- Внебиржевых договоров купли-продажи иностранной валюты ОТС;
- Внебиржевого валютного свопа ОТС;

, является открытие такому Участнику клиринга Субсчета депо доверительного управляющего. Условием заключения Участником клиринга, являющимся доверительным управляющим, в интересах и за счет его клиентов Внебиржевых договоров ОТС, за исключением Внебиржевых договоров ОТС, заключенных с указанием ТКС-DVP, и Внебиржевых договоров ОТС, предметом которых являются НФИ, 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.

Участнику клиринга, его клиенту или Субклиенту могут быть открыты иные виды Субсчетов депо, открытие которых допускается действующими нормативно-правовыми актами, в том числе Субсчета депо иностранного номинального держателя и Субсчета депо иностранного уполномоченного держателя.

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. Документы для открытия Субсчета депо Участнику клиринга, его клиенту или Субклиенту, а также Депозитарию предоставляются лицом, которому открывается Субсчет депо, либо его уполномоченным представителем.

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.

7.8. Подача лицом, которому открыт Субсчет депо, или его уполномоченным представителем в КЦ поручения на зачисление ценных бумаг на Субсчет депо считается заверением 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 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 уполномоченным представителем лица, которому открыт Субсчет депо, в КЦ поручения на зачисление ценных бумаг на Субсчет депо или поручения на списание ценных бумаг с такого Субсчета депо считается заверением уполномоченного лица 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 обеспечить, чтобы он, его клиенты и Субклиенты надлежащим образом исполняли все обязанности, связанные с уплатой Транзакционного налога самостоятельно и (или) с привлечением иных лиц, в том числе КЦ согласно статье 46 настоящих Правил, 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.

7.10. Для учета и проведения расчетов по Внебиржевым договорам ОТС, предметом которых являются НФИ, используются Счета учета НФИ. Проведение операций Расчетным депозитарием по Счетам учета НФИ осуществляется на основании поручений КЦ, являющегося Оператором Счета учета НФИ, а также лиц, которым открыты Счета учета НФИ по согласованию с КЦ, в соответствии с требованиями, установленными внутренними документами Расчетного депозитария, в котором открыт соответствующий Счет учета НФИ, и настоящими Правилами.

Расчетный депозитарий вправе открыть следующие типы Счетов учета НФИ: Счет учета НФИ владельца, Счет учета НФИ номинального держателя, Счет учета НФИ доверительного управляющего, Счет учета НФИ иностранного уполномоченного держателя, Счет учета НФИ иностранного номинального держателя. Тип открываемого Счета учета НФИ должен соответствовать типу открытого в отношении этого лица Субсчета депо.

7.11. Условием открытия Счета учета НФИ является представление Расчетному депозитарию поручения на открытие дополнительного счета НФИ, составленного по форме, определенной Регламентом клиринга в виде Электронного документа, подписанного Электронной подписью. Счет учета НФИ может быть открыт только при условии наличия у лица, в отношении которого осуществляется открытие Счета учета НФИ, Субсчета депо. При открытии Счета учета НФИ лицо, которому осуществляется открытие указанного Счета учета НФИ, обязано назначить КЦ Оператором Счета учета НФИ, проставив соответствующую отметку в заявлении об открытии Счета учета НФИ.

Поручение на открытие дополнительного счета НФИ может быть представлено непосредственно в Расчетный депозитарий или в КЦ, за исключением случая, если Расчетным депозитарием является Участник клиринга. КЦ, получив документы для открытия Счета учета НФИ, передает их в Расчетный депозитарий.

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

7.12. Документы для открытия Счета учета НФИ Участнику клиринга, его клиенту или Субклиенту, а также Депозитарию предоставляются лицом, которому открывается Счет учета НФИ, либо его уполномоченным представителем.

7.13. Закрытие Счета учета НФИ возможно по инициативе лица, которому открыт указанный Счет учета НФИ, или его уполномоченного представителя. Закрытие осуществляется только в случае отсутствия НФИ на Счете учета НФИ.

Для закрытия Счета учета НФИ по инициативе лица, которому открыт указанный Счет учета НФИ, или его уполномоченного представителя, соответствующее лицо должно подать в КЦ заявление на закрытие Счета учета НФИ в свободной форме.

Закрытие Счета учета НФИ Участника клиринга, его клиента или Субклиента, а также Депозитария осуществляется Расчетным депозитарием без получения заявления на закрытие Счета учета НФИ от лица, которому открыт указанный Счет учета НФИ, или его

уполномоченного представителя при закрытии Субсчета депо соответствующего ему типа, открытого в отношении указанного лица.

Статья 8. Порядок регистрации Торгово-клиринговых счетов

8.1. Участник клиринга регистрирует Торгово-клиринговый счет путем подачи в КЦ заявления на регистрацию Торгово-клирингового счета.

Заявление на регистрацию Торгово-клирингового счета должно содержать указание на Идентификатор Участника клиринга. Указанный Идентификатор Участника клиринга определяет, для какого рынка КЦ зарегистрирован данный ТКС.

Субсчет депо / Счет учета НФИ, не зарегистрированный в составе ТКС, не используется для целей заключения договоров и проведения клиринга обязательств по договорам.

В рамках зарегистрированного ТКС открываются клиринговые регистры, предусмотренные статьей 6 настоящих Правил, на которых КЦ производит учет Объектов учета.

Участник клиринга, не являющийся Расчетным депозитарием, при регистрации ТКС вправе указать один Субсчет депо/Счет учета НФИ, в соответствии с остатками ценных бумаг/НФИ на которых КЦ будет производить учет позиции по ценным бумагам/позиции по НФИ Участника клиринга. Участник клиринга, являющийся Расчетным депозитарием, при регистрации ТКС вправе указать несколько Субсчетов депо/Счетов учета НФИ, в соответствии с остатками ценных бумаг/ НФИ на которых КЦ будет производить учет позиций по ценным бумагам/позиций по НФИ Участника клиринга.

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 Гарантийные 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 – владельца по ценным бумагам / НФИ и (или) позиция Участника клиринга по денежным средствам;

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

- ТКС доверительного управляющего, в который входят позиция по ценным бумагам / НФИ Участника клиринга - доверительного управляющего и (или) позиция по денежным средствам Участника клиринга - доверительного управляющего;

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

- клиентский ТКС, в который входят позиция по ценным бумагам / НФИ клиента или Субклиента Участника клиринга, которому открыт Субсчет депо иностранного номинального держателя / Счет учета НФИ иностранного номинального держателя и (или) клиентская позиция по денежным средствам;

- клиентский ТКС, в который входят позиция по ценным бумагам / НФИ клиента или Субклиента Участника клиринга, которому открыт Субсчет депо иностранного

уполномоченного держателя / Счет учета НФИ иностранного уполномоченного держателя и (или) клиентская позиция по денежным средствам;

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

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

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

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

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

- 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;

- собственный ТКС Участника клиринга для учета требований КЦ к Участнику клиринга по Дополнительному обеспечению;

- собственный ТКС Участника клиринга, в который входят собственная позиция Участника клиринга по денежным средствам, денежный счет, предназначенный для проведения расчетов по денежным средствам по итогам клиринга (далее – денежный счет DVP) и счет депо, предназначенный для проведения расчетов по ценным бумагам по итогам клиринга (далее – счет депо DVP). Указанный ТКС именуется собственным ТКС-DVP;

- клиентский ТКС, в который входят клиентская позиция по денежным средствам, денежный счет DVP и счет депо DVP (далее – клиентский ТКС-DVP)

- ТКС доверительного управляющего, в который входят позиция по денежным средствам Участника клиринга - доверительного управляющего, денежный счет DVP и счет депо DVP (далее - ТКС-DVP Участника клиринга - доверительного управляющего);

- клиентский ТКС, в который входят позиция по денежным средствам клиента - доверительного управляющего, денежный счет DVP и счет депо DVP (далее - ТКС-DVP клиента - доверительного управляющего).

Собственный ТКС-DVP, клиентский ТКС-DVP, ТКС-DVP Участника клиринга - доверительного управляющего, ТКС-DVP клиента - доверительного управляющего совместно именуется ТКС-DVP.

КЦ вправе установить требования к Участникам клиринга, которые могут зарегистрировать ТКС-DVP, и условия регистрации ТКС-DVP. Указанные требования и условия устанавливаются Регламентом клиринга.

С указанием ТКС-DVP не допускается заключение Договора купли-продажи иностранной валюты, Валютного свопа, Внебиржевого договора купли-продажи иностранной валюты ОТС, Внебиржевого валютного свопа ОТС.

При регистрации ТКС, не являющимся ТКС-DVP, не должны указываться счет депо DVP и денежный счет DVP. При регистрации ТКС-DVP должны быть указаны счет

депо DVP и денежный счет DVP и не должны указываться Субсчет депо и (или) Счет учета НФИ.

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, а также НФИ этого клиента или Субклиента, 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 OkOp, а также Договоров купли-продажи иностранной валюты, Валютных свопов, Внебиржевых договоров купли-продажи иностранной валюты ОТС, Внебиржевых валютных свопов ОТС, 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, на условиях и в порядке, предусмотренном в пунктах 11.11, 11.16, 13.7. и 13.10 настоящих Правил. В этом случае КЦ аннулирует регистрацию всех ТКС Участника клиринга;
- в случае принятия Банком России решения об аннулировании у Участника клиринга лицензии профессионального участника рынка ценных бумаг на осуществление брокерской деятельности. В этом случае в дату прекращения действия указанной лицензии КЦ аннулирует регистрацию всех клиентских ТКС Участника клиринга, кроме

ТКС, предназначенных исключительно для заключения Договоров купли-продажи иностранной валюты / Валютных свопов / Внебиржевых договоров купли-продажи иностранной валюты ОТС / Внебиржевых валютных свопов ОТС;

- в случае принятия Банком России решения об аннулировании у Участника клиринга лицензии профессионального участника рынка ценных бумаг на осуществление дилерской деятельности. В этом случае в дату прекращения действия указанной лицензии КЦ аннулирует регистрацию всех собственных ТКС Участника клиринга, кроме ТКС, предназначенных исключительно для заключения Договоров купли-продажи иностранной валюты/ Валютных свопов / Внебиржевых договоров купли-продажи иностранной валюты ОТС / Внебиржевых валютных свопов ОТС, и ТКС для учета требований КЦ к Участнику клиринга по Дополнительному обеспечению;

- в случае прекращения действия у Участника клиринга лицензии профессионального участника рынка ценных бумаг на осуществление деятельности по управлению ценными бумагами. В этом случае в дату прекращения действия указанной лицензии КЦ аннулирует регистрацию всех ТКС доверительного управляющего Участника клиринга, кроме ТКС, предназначенных исключительно для заключения Договоров купли-продажи иностранной валюты/ Валютных свопов / Внебиржевых договоров купли-продажи иностранной валюты ОТС / Внебиржевых валютных свопов ОТС;

- 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.

Аннулирование регистрации ТКС производится при условии, что на клиринговых регистрах, открытых в рамках данного ТКС, на дату аннулирования регистрации ТКС не учитываются Объекты учета. В случае если на указанную дату на ТКС, в отношении которого было принято решение об аннулировании регистрации, учитываются Объекты учета, КЦ осуществляет перевод денежных средств на счет, зарегистрированный Участником клиринга для вывода денежных средств, ценных бумаг на счет депо, зарегистрированный Участником клиринга для вывода ценных бумаг в соответствии с пунктами 8.8 и 8.11 настоящих Правил, и осуществляет обратные изменения суммы лимита обеспечения по данному ТКС в сочетании с ТКС, с которыми были осуществлены первоначальные изменения суммы лимита в соответствии с пунктом 19.8 настоящих Правил.

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/корреспондентский счет в российских рублях и (или) иностранной валюте соответственно (далее – Счет). При этом в качестве Счета может быть зарегистрирован только расчетный/корреспондентский 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, лицами, в которых открыты денежные счета Расчетной организации или счета депо Расчетного депозитария, Техническим центром и (или) иными лицами своих обязанностей, в том числе в случае приостановления или прекращения

операций с денежными средствами и (или) ценными бумагами (кроме случаев, когда указанное неисполнение или ненадлежащее исполнение допущено по вине КЦ);

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

- приостановлением или прекращением Торгов Организатором торговли / Торговой площадкой;

- решения и действия органов государственной власти, Банка России, иных органов, учреждений и организаций Российской Федерации (в том числе внесение изменений в законодательство Российской Федерации, издание предписания Банка России в отношении КЦ) и (или) органов государственной власти, регуляторов на финансовом рынке, учреждений, организаций иных государств.

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 статьей 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) Если иное не предусмотрено настоящими Правилами, в случае заключения договоров, предметом которых являются ценные бумаги / НФИ / ПФИ, 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. В случае заключения Участником клиринга исключительно Договоров купли-продажи иностранной валюты / Валютного свопа / Внебиржевых договоров купли-продажи иностранной валюты ОТС / Внебиржевого валютного свопа ОТС, а также Договоров и Внебиржевых договоров ОТС с указанием ТКС-DVP, Участник клиринга может не открывать Субсчет депо, а обязан только зарегистрировать в КЦ ТКС;

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 на основании Оферт ОТС);

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

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 партнёрство 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 – резидент 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 документы, указанные в Регламенте клиринга.

Участники клиринга обязаны обновлять определенные настоящим пунктом документы в порядке, указанном в Регламенте клиринга. 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. 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.

11.4. КЦ принимает решение о регистрации Заявителя в качестве Участника клиринга, если соблюдаются требования, являющиеся условием такой регистрации.

11.5. 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 в срок не позднее 1 (одного) рабочего дня после принятия КЦ решения о регистрации (отказе в регистрации) Заявителя в качестве Участника клиринга.

11.6. 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.

11.7. 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.

11.8. При регистрации Заявителя в качестве Участника клиринга ему присваивается одна или несколько следующих категорий:

- категория А - участник клиринга, являющийся Расчетным депозитарием, и заключивший с Организатором торговли или Торговой площадкой договор об оказании услуг по поддержанию цен, спроса, предложения и (или) объема торгов ценными бумагами (далее – Маркет-мейкер);

- категория Б - участник клиринга, не входящий в категорию А, В или Г;

- категория В – участник клиринга – Маркет-мейкер;

- категория Г – участник клиринга, являющийся Расчетным депозитарием.

При получении КЦ от Организатора торговли или Торговой площадки уведомления, указанного в пункте 41.2 настоящих Правил, КЦ присваивает ранее зарегистрированному Участнику клиринга категорию В, если Участник клиринга не является Расчетным депозитарием, или категорию А, если Участник клиринга является Расчетным депозитарием (если указанные действия не были осуществлены при регистрации Участника клиринга).

11.9. 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 присвоено несколько Идентификаторов Участника клиринга. Дополнительный Идентификатор Участника клиринга присваивается на основании подаваемого Участником клиринга в КЦ заявления по форме, предусмотренной Регламентом клиринга.

Документы, на основании которых КЦ присваивает Идентификатор Участника клиринга, должны содержать указание на рынок КЦ. Идентификаторы Участника клиринга, присвоенные на основании документов, в которых отсутствует указание на рынок КЦ, считаются присвоенными с указанием на рынок СПБ.

КЦ информирует Заявителя о присвоенном ему Идентификаторе (Идентификаторах) Участника клиринга и соответствующем рынке (соответствующих рынках) КЦ путем указания данного кода (кодов) и рынка (рынков) КЦ в уведомлении.

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

11.10. 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 по результатам рассмотрения предоставленных документов, указанных в Регламенте клиринга.

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 документов, определенных Регламентом клиринга (при отсутствии оснований для отказа в регистрации).

При регистрации клиента или Субклиента Участника клиринга КЦ присваивает им также краткие коды клиентов Участника клиринга, соответствующие Идентификатору (Идентификаторам) Участника клиринга. Краткий код клиента Участника клиринга присваивается на основании информации, указанной в заявлении на регистрацию клиентов Участника 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 в течение 1 (одного) рабочего дня после окончания процедуры регистрации клиента или Субклиента Участника клиринга.

Регистрация клиентов и Субклиентов Участника клиринга может осуществляться КЦ на основании информации, полученной от Организатора торговли и (или) Торговой площадки 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) Торговой площадки 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).

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.

11.11. Если законодательством Российской Федерации не установлено иное, КЦ не осуществляет регистрацию Заявителя, не осуществляет регистрацию (приостанавливает или прекращает действие регистрации) клиента или Субклиента Участника клиринга, а также вправе 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 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 / Расчетного депозитария / Расчетной организации;

- 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.

11.12. 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.

11.13. 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.

11.14. 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).

11.15. 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.

11.16. 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.

11.17. 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.

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

11.19. 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.

11.20. 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 Гарантийный 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 Гарантийный фонд начисляются проценты, которые включаются в состав взноса в Гарантийный 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. Порядок определения размера процентов, начисленных, но не выплаченных Участнику клиринга, устанавливается решением КЦ о начислении процентов по взносам Участников клиринга в Гарантийный фонд и раскрываются на Сайте КЦ. Проценты начисленные, но не выплаченные на день прекращения договора об оказании клиринговых услуг, включаются в состав взноса Участника клиринга в Гарантийный 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 Гарантийного 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 или невозможности возврата денежных средств на указанный Счет, КЦ осуществляет возврат денежных средств на банковский счет Участника клиринга, указанный в заявлении об изменении данных Участника клиринга.

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 Гарантийного 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 №7 к Регламенту клиринга, 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 раскрывается: 1) в соответствии с требованиями Банка России на официальном сайте Банка России или на сайте Участника клиринга при условии, что адрес такого сайта указан в заявлении на регистрацию в качестве Участника клиринга / заявлении об изменении данных Участника клиринга, предоставленном в КЦ; 2) в соответствии с действующими нормативно-правовыми актами на иных сайтах, предназначенных для раскрытия бухгалтерской (финансовой) отчетности, то указанная отчетность или иная информация считается предоставленной КЦ с момента ее размещения на указанных сайтах (для Участников клиринга, являющихся российскими кредитными организациями);

- если отчетность или иная информация раскрывается: 1) в соответствии с требованиями Банка России на сайте Участника клиринга при условии, что адрес такого сайта указан в заявлении на регистрацию в качестве Участника клиринга / заявлении об изменении данных Участника клиринга, предоставленном в КЦ; 2) в соответствии с

действующими нормативно-правовыми актами на иных сайтах, предназначенных для раскрытия бухгалтерской (финансовой) отчетности, то указанная отчетность или иная информация считается предоставленной КЦ с момента ее размещения на указанных сайтах при условии, что адрес такого сайта указан в Анкете Заявителя, предоставленной в КЦ.(для Участников клиринга, являющихся российскими некредитными организациями).

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 (краткие коды) Участника клиринга. Один краткий код Участника клиринга соответствует одному Идентификатору Участника клиринга.

Краткий код Участника клиринга присваивается КЦ Участнику клиринга при присвоении дополнительного Идентификатора Участника клиринга. Такой краткий код соответствует только присвоенному Идентификатору Участника клиринга.

Участник клиринга вправе зарегистрировать дополнительные краткие коды Участника клиринга, соответствующие Идентификатору (Идентификаторам) 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 статьей 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 Организатора торговли / Торговой площадки о приостановлении допуска к участию в Торгах / Торгах Торговой площадки Участника клиринга, являющегося Участником торгов / Участником торгов Торговой площадки;
- в случае получения от Организатора торговли / Торговой площадки уведомления о прекращении допуска Участника клиринга, являющегося Участником торгов / Участником торгов Торговой площадки, к участию в Торгах / в Торгах Торговой площадки;
- при отсутствии у Участника клиринга хотя бы одного 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 статьей 10 настоящих Правил.

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

- в случае неисполнения требований, предусмотренных статьей 10 настоящих Правил, в течение 6 (шести) месяцев подряд;
- в случае получения от Организатора торговли / Торговой площадки уведомления о прекращении допуска Участника клиринга, являющегося Участником торгов / Участником торгов Торговой площадки, к участию в Торгах / Торгах Торговой площадки;

- в случае получения от Участника клиринга заявления о прекращении клирингового обслуживания;

- в случае приостановки действия у Участника клиринга статуса, признанного иностранным органом, регулирующим деятельность участников торгов на проводимых торгах Торговой площадки, и позволяющего совершать операции на указанных торгах Торговой площадки;

- в случае наложения иностранным органом, регулирующим деятельность участников торгов на проводимых торгах Торговой площадки, на Участника клиринга ограничений, связанных с возможностью совершать определенного вида сделки.

КЦ прекращает допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию в следующих случаях:

- 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 отзыва у Участника клиринга статуса, признанного иностранным органом, регулирующим деятельность участников торгов на проводимых торгах Торговой площадки, и позволяющего совершать операции на указанных торгах Торговой площадки

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 / Торговую площадку 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 / Торговой площадки 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, Организатора торговли, Торговой площадки

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).

КЦ рассчитывает и уплачивает Торговой площадке за Участников клиринга сумму платы за оказание услуг по заключению Договоров Торговой площадки, а также иные платежи в пользу Торговой площадки, предусмотренные Правилами торгов Торговой площадки или тарифами Торговой площадки (далее – Сбор Торговой площадки). При возникновении у Участника клиринга обязательства по уплате Сбора Торговой площадки, которое должно исполняться КЦ, у Участника клиринга возникает обязательство по уплате КЦ суммы, равной сумме указанного платежа. Указанное обязательство допускается к клирингу в момент возникновения и подлежит включению в клиринговый пул, формируемый в порядке, определенном статьей 35 настоящих Правил.

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, Счетов учета НФИ, в том числе расходов, связанных с возмещением Расчетным депозитарием затрат депозитариям или иностранным лицам, осуществляющим учет прав на ценные бумаги, НФИ, которыми Расчетному депозитарию открыты счета, на которых учитываются ценные бумаги, НФИ, учитываемые на Субсчетах депо и Счетах учета НФИ;

- 2) расходов, связанных с передачей и 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) расходов, связанных с уплатой Транзакционного налога и суммы, эквивалентной сумме Транзакционного налога, в соответствии с пунктом 46.5 настоящих Правил. Указанные расходы определяются в соответствии с Регламентом налогового администрирования по транзакционным налогам Небанковской кредитной организации - центрального контрагента «СПБ Клиринг» (акционерное общество) (далее - Регламент налогового администрирования по транзакционным налогам);

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

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

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 / Торговой площадки. При этом обязательства по уплате сборов, связанных с заключением Договоров / Внебиржевых договоров ОТС, допускаются к клирингу с момента получения КЦ информации о регистрации соответствующего Договора в реестре Договоров / Договора Торговой площадки в реестре Договоров Торговой площадки, 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 / Валютных свопов / Внебиржевых валютных свопов ОТС включаются в клиринговый пул для расчетов по итогам Торгов в дату заключения Пары договоров / Валютного свопа / Внебиржевого валютного свопа ОТС 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. При этом обязательства по уплате сборов, взимаемых в связи с заключением Участниками клиринга Пар договоров / Валютных свопов / Внебиржевых валютных

свопов ОТС включаются в клиринговый пул для расчетов по итогам торгов в дату исполнения Второго договора, составляющего Пару договоров / Второго договора купли-продажи иностранной валюты / Второго договора купли-продажи иностранной валюты ОТС.

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, выставяемых 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, подаче Заявок Торговой площадки на заключение Договоров Торговой площадки, 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, подаче Заявок Торговой площадки, 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 вноса 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 клиринга 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, коллективным клиринговым обеспечением и иным 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, коллективным клиринговым обеспечением и иным 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 и (или) НФИ на счетах учета НФИ для прохождения процедуры контроля обеспечения в порядке, определенном статьями 25 и 27 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.

Для целей обеспечения исполнения и (или) исполнения обязательств по НФИ, возникающих из Внебиржевых договоров ОТС, Участник клиринга предоставляет в качестве Средств обеспечения НФИ, являющийся предметом соответствующего Внебиржевого договора ОТС.

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 бумаг и (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:

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

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;

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 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. Имущество, являющееся иным обеспечением, могут составлять исключительно НФИ.

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. Имущество, являющееся иным обеспечением, может использоваться для обеспечения исполнения и (или) исполнения обязательств, возникших из Внебиржевых договоров ОТС, предметом которых являются НФИ, допущенных к клирингу, в том числе итоговых нетто-обязательств.

16.5. Условием обеспечения исполнения обязательств Участника клиринга является передача имущества, составляющего индивидуальное клиринговое обеспечение и иное обеспечение, до заключения Договоров / Внебиржевых договоров ОТС / Внебиржевых договоров.

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. Иное обеспечение учитывается на Банковских счетах КЦ и Счетах учета НФИ.

16.8. Передача имущества, предназначенного для индивидуального клирингового обеспечения, осуществляется путем зачисления денежных средств на Клиринговые денежные счета, а ценных бумаг - на Субсчета депо. Передача имущества, предназначенного для иного обеспечения, осуществляется путем зачисления денежных средств в иностранной валюте на Банковский счет КЦ и НФИ на Счета учета НФИ.

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

16.9. Объем имущества, передаваемого в индивидуальное клиринговое обеспечение/иное 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 / Заявка Торговой площадки, поданная Участником клиринга, не регистрируется в реестре Заявок / реестре Заявок Торговой площадки, 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/иным 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/НФИ в размере нетто-обязательства - ценными бумагами или НФИ того же эмитента, вида, категории, типа, выпуска.

16.10. Обязанность по представлению КЦ достаточного количества имущества, являющегося индивидуальным клиринговым обеспечением/иным 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), учитываемые на клиринговых регистрах ТКС, зарегистрированного для какого-либо рынка КЦ, КЦ использует имущество и меры в следующей очередности:

- Средства обеспечения Должника на этом рынке КЦ;- взносы Должника в Гарантийные фонды на этом рынке КЦ;

- Средства обеспечения Должника на других рынках КЦ (в рамках процедуры кросс-дефолта);

- взносы Должника в Гарантийные фонды на других рынках КЦ (в рамках процедуры кросс-дефолт);

- собственные средства КЦ в размере Выделенного капитала на этом рынке КЦ;
- взносы Гарантов в специальный Гарантийный фонд на этом рынке КЦ;
- взносы Участников клиринга, не являющихся Должниками (далее - Добросовестные Участники клиринга), в Гарантийные фонды на этом рынке КЦ;
- уменьшение размера обязательства по возврату Средств обеспечения Добросовестным Участникам клиринга на этом рынке КЦ на общую сумму, равную оставшейся непогашенной Задолженности Должника, путем увеличения требований по Дополнительному обеспечению Добросовестных Участников клиринга на этом рынке КЦ.

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 рынка СПБ составляет 500 (пятьсот) миллионов рублей.

Размер Выделенного капитала КЦ рынка Казахстан составляет 3 (три) миллиона долларов США.

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

Статья 18. Гарантийные фонды

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

18.2. КЦ вправе формировать следующие Гарантийные фонды для каждого рынка КЦ:

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

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

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

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

Имущество, обремененное залогом, не может составлять Гарантийные фонды.

18.5. Перечень иностранных валют и (или) ценных бумаг, внесение которых возможно в качестве взносов в Гарантийные 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 Гарантийные фонды, составляет 100%. Указанная доля может быть уменьшена по решению КЦ.

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

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

18.7. Совокупный размер Гарантийных 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 / Заявок Торговой площадки в целях заключения Договоров / Внебиржевых договоров ОТС, 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. Величина Доступных средств Участника клиринга рассчитывается КЦ для каждого рынка КЦ.

19.2. КЦ рассчитывает величину Доступных средств при изменении размера Средств обеспечения Участника клиринга, при подаче Участником клиринга Заявок / Заявок Торговой площадки на заключение Договоров / Внебиржевых договоров ОТС, отзыве или аннулировании таких Заявок / Заявок Торговой площадки, при заключении Участником клиринга Договоров / Внебиржевых договоров ОТС, 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 / Заявок Торговой площадки, 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:

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

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;

LIM_{TCA} – сумма лимита обеспечения в Валюте доступных средств;

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 на рынке КЦ:

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

где:

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

AF_{TCA} - величина Доступных средств по ТКС Участника клиринга, зарегистрированным для рынка КЦ, в Валюте Доступных средств;

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

$\sum_{TCA \in B}$ – сумма Доступных средств по всем Обособленным ТКС Участника клиринга, зарегистрированным для рынка КЦ;

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

19.5. Величина Гарантийного обеспечения и величина Дополнительного обеспечения рассчитываются по совокупности позиций и объявленных Заявок / Заявок

Торговой площадки, 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.

19.8. Лимит обеспечения для ТКС, входящих в Группу ТКС, может быть установлен / изменен Участником клиринга путем подачи заявления в КЦ. Указанное заявление передается посредством Системы в виде электронного сообщения, подписанного АСП, или в виде Электронного документа, подписанного Электронной подписью.

В указанном заявлении Участник клиринга указывает:

- сумму лимита обеспечения;
- ТКС, лимит обеспечения для которого уменьшается на указанную сумму;
- ТКС, лимит обеспечения для которого увеличивается на указанную сумму.

Статья 20. Маржинальные требования

20.1. По каждому рынку КЦ 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 Размере 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 на рынке КЦ возникает у КЦ к Участнику клиринга, если рассчитанная в соответствии с приведенной ниже формулой величина является отрицательной величиной:

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

где:

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

AF_{TCA} - величина Доступных средств по ТКС Участника клиринга, зарегистрированным для рынка КЦ, в Валюте Доступных средств;

$\sum_{TCA \in B}$ - сумма Доступных средств по Группе ТКС;

$\sum_{TCA \in B}$ - сумма Доступных средств по всем Обособленным ТКС Участника клиринга, зарегистрированным для рынка КЦ;

AdM - величина Дополнительного обеспечения, учитываемая в качестве требования КЦ к Участнику клиринга, на рынке КЦ 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 Участника клиринга считается исполненным, когда величина Маржинального требования, рассчитанная в соответствии с формулой, указанной в пункте 20.2 настоящих Правил станет неотрицательной величиной.

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 / Заявок Торговой площадки / 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 на каком-либо рынке КЦ к такому Участнику клиринга КЦ применяет процедуру принудительного закрытия на таком рынке КЦ в соответствии с настоящей статьей.

КЦ уведомляет Организатора торговли / Торговую площадку о невозможности регистрации новых Заявок / Заявок Торговой площадки, подаваемых Должником.

КЦ уведомляет Должника о невозможности акцепта направленных Оферт ОТС и о невозможности принятия Поручений на клиринг внебиржевых договоров к исполнению.

КЦ уведомляет Организатора торговли / Торговую площадку о необходимости удаления зарегистрированных Заявок / Заявок Торговой площадки, поданных Должником.

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 в отношении Обособленного ТКС Доступные средства данного Обособленного ТКС перестали быть отрицательными, но Маржинальное требование к Участнику клиринга осталось неисполненным, КЦ осуществляет принудительное закрытие в отношении 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 / Договоры купли-продажи иностранной валюты / Внебиржевые договоры купли-продажи иностранной валюты 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 / Договоры купли-продажи иностранной валюты / Внебиржевые договоры купли-продажи иностранной валюты ОТС без подачи Заявок / Заявок Торговой площадки, без направления Оферт ОТС и Акцептов ОТС.

21.3. Заключение Договоров купли-продажи / Договоров ПФИ / Внебиржевых договоров купли-продажи ОТС / Договоров купли-продажи иностранной валюты / Внебиржевых договоров купли-продажи иностранной валюты ОТС без подачи Заявок / Заявок Торговой площадки, 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 / Договоры купли-продажи иностранной валюты / Внебиржевые договоры купли-продажи иностранной валюты 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 / Договоры купли-продажи иностранной валюты / Внебиржевые договоры купли-продажи иностранной валюты ОТС без подачи Заявок / Заявок Торговой площадки (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 / НФИ / ПФИ / иностранной валюте (национальной валюте Российской Федерации) каждого Участника клиринга, с которым КЦ заключает договоры;

- в случае невозможности заключения Договора купли-продажи / Договора ПФИ / Внебиржевого договора купли-продажи ОТС / Договора купли-продажи иностранной валюты / Внебиржевого договора купли-продажи иностранной валюты ОТС в соответствии с абзацем третьим настоящего пункта КЦ заключает соответствующие договоры без подачи Заявок / Заявок Торговой площадки (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 / Договоров купли-продажи иностранной валюты / Внебиржевых договоров купли-продажи иностранной валюты 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 Договора купли-продажи иностранной валюты / Внебиржевого договора купли-продажи иностранной валюты 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 / Договоры купли-продажи иностранной валюты / Внебиржевые договоры купли-продажи иностранной валюты ОТС, заключаемые при применении процедуры принудительного закрытия, учитываются при расчете нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам / НФИ 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 на том же рынке КЦ, на котором учитывается Маржинальное требование, а Участник клиринга признается Должником.

21.6. КЦ, в целях погашения Задолженности на рынке КЦ, использует Средства обеспечения Должника на этом рынке КЦ. 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. Если после указанного использования Средств обеспечения сохраняется отрицательное значение Доступных средств по такому Обособленному ТКС, то погашение Задолженности Должника в размере, равном абсолютному значению указанных отрицательных Доступных средств, производится за счет Средств обеспечения, учитываемых на собственных ТКС Участника клиринга. При этом КЦ вправе осуществлять процедуру принудительного закрытия в отношении собственных ТКС Участника клиринга.

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 / Торгах Торговой площадки путем заключения Договоров / Внебиржевых договоров ОТС, 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 / Правилами торгов Торговой площадки.

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, Заявок Торговой площадки, 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) Торгах Торговой площадки и (или) путем заключения Внебиржевых договоров купли-продажи ОТС на основании Оферт 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 предпринять действия в соответствии со статьями 22 настоящих Правил и (или) вправе требовать от такого Должника погашения Задолженности в судебном порядке.

Статья 22. Порядок использования и возмещения Гарантийных фондов и использования Выделенного капитала

22.1. Средства Гарантийных фондов и Выделенного капитала используются для погашения Задолженности Должника.

22.2. Взнос Должника в Гарантийный фонд участников на рынке КЦ, на котором учитывается Задолженность, 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 принудительное закрытие Должника по Обособленным 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 производит следующие действия:

- производит принудительное закрытие Должника по ТКС, входящим в Группу ТКС, а также по Обособленным ТКС;

- использует Средства обеспечения, учитываемые на ТКС, входящих в Группу ТКС, в размере превышения величины Дополнительного обеспечения над величиной Доступных средств по собственным ТКС. Доступные средства по собственным ТКС определяются как сумма Доступных средств по всем собственным ТКС.

Величина Дополнительного обеспечения и величина Доступных средств по собственным ТКС определяются на момент начала выполнения действий, указанных в пункте 21.1 настоящих Правил.

22.8. Если после использования вклада Должника в Гарантийный фонд участников и осуществления КЦ всех действий, предусмотренных пунктами 22.6 и 22.7 настоящих Правил, Задолженность не погашена полностью, КЦ осуществляет в отношении Должника процедуру кросс-дефолта. Процедура кросс-дефолта на другом рынке КЦ применяется к Должнику при наличии допуска Должника к клиринговому обслуживанию на таком рынке КЦ и отсутствии оснований для применения к Должнику

на таком рынке КЦ действий, предусмотренных статьями 21, 22 настоящих Правил. При наличии оснований для применения к Должнику на таком рынке КЦ действий, предусмотренных статьями 21, 22 настоящих Правил, КЦ вправе применить процедуру кросс-дефолта после прекращения оснований для применения к Должнику на таком рынке КЦ действий, предусмотренных статьями 21, 22 настоящих Правил.

22.8.1. В ходе процедуры кросс-дефолта для погашения Задолженности КЦ вправе:

- использовать Средства обеспечения Должника на собственных ТКС на другом рынке КЦ;

- использовать Средства обеспечения, учитываемые на ТКС, входящих в Группу ТКС, в размере превышения величины Дополнительного обеспечения над величиной Доступных средств по собственным ТКС. При этом величина Дополнительного обеспечения и величина Доступных средств по собственным ТКС определяются на момент начала выполнения процедуры кросс-дефолта;

 - использовать взносы Должника в Гарантийные фонды на другом рынке КЦ;

- осуществлять процедуру принудительного закрытия в отношении Должника на другом рынке КЦ.

22.8.2. КЦ по своему усмотрению определяет последовательность выбора рынков КЦ для выполнения процедуры кросс-дефолта.

22.8.3. Использование Средств обеспечения Должника на другом рынке КЦ в валюте, отличной от Валюты Доступных средств, для погашения Задолженности осуществляется в порядке, указанном в пунктах 21.7 – 21.10 настоящих Правил.

22.8.4. Использование взносов Должника в Гарантийные фонды на другом рынке КЦ осуществляется в порядке, указанном в пунктах 22.2, 22.3 настоящих Правил.

22.9. В случае если после выполнения процедуры кросс-дефолта Задолженность не погашена полностью, КЦ уменьшает величину Выделенного капитала на рынке КЦ, на котором учитывается Задолженность, на сумму оставшейся Задолженности Должника.

22.10. В случае если после уменьшения величины Выделенного капитала КЦ на рынке КЦ, на котором учитывается Задолженность, в соответствии с пунктом 22.9 настоящих Правил, для полного погашения Задолженности Должника, КЦ использует для ее погашения взносы Гарантов в Размере взносов в специальный Гарантийный фонд на рынке КЦ, на котором учитывается Задолженность, 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 Размёру 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 на рынке КЦ, на котором учитывается Задолженность, уменьшаются на сумму средств, использованную для погашения Задолженности Должника.

22.11. В случае недостаточности взноса Должника в Гарантийные фонды, Выделенного капитала КЦ на рынке КЦ, на котором учитывается Задолженность, и взносов Гарантов в специальный Гарантийный фонд на рынке КЦ, на котором учитывается Задолженность, для полного погашения Задолженности Должника, КЦ в целях ее погашения использует взносы Добросовестных Участников клиринга в Гарантийный фонд участников на рынке КЦ, на котором учитывается Задолженность, в Размёре 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 взноса 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 взноса 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 Размёру взноса каждого из Добросовестных Участников клиринга в Гарантийный фонд участников. Взносы 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.

22.12. Требования КЦ по Задолженности Должника прекращаются в объёме использованного взноса 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.

22.13. Должник обязан возместить использованные средства Гарантийных фондов в течение 2 (двух) Расчетных дней после прекращения требований КЦ по Задолженности Должника в объёме 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.

22.14. 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 Размера взноса.

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.

22.15. 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.

22.16. 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.

22.17. В течение 2 (двух) Расчетных дней после погашения Задолженности Должник обязан возместить использованный взнос Должника в Гарантийный фонд участников. Уведомление о необходимости возмещения использованного вклада 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.

22.18. 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 рынке КЦ, на котором учитывается Задолженность, на размер Задолженности Должника в объеме, определенном как положительная разница между величиной Задолженности Должника до начала использования взносов Добросовестных Участников клиринга и Гарантов в Гарантийные фонды и размером использованных в целях погашения указанной Задолженности взносов Гарантов в специальный Гарантийный фонд, взносов Добросовестных Участников клиринга в Гарантийный фонд участников.

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 на рынке КЦ, на котором учитывается Задолженность, 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 на рынке КЦ, на котором учитывается Задолженность.

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 22.16 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.

22.19. 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, включенные в Перечень иностранных валют, ценные бумаги, включенные в Перечень ценных бумаг, а также НФИ, включенные в Список обязательств.

Перечень ценных бумаг, НФИ, 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 ценных бумаг, входящих в Перечень ценных бумаг и не входящих в Список ценных бумаг, включаемых в Средства обеспечения, устанавливается решением КЦ. КЦ не устанавливает предельную долю НФИ, включаемых в Средства обеспечения.

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 обеспечения исполнения и (или) исполнения обязательств по Договорам, Внебиржевым договорам ОТС, Внебиржевым договорам, а также обязательств по уплате Клиринговых сборов и Торговых сборов;

- для обеспечения исполнения и (или) исполнения иных обязательств, допущенных к клирингу в соответствии с настоящими Правилами.

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

- путем перевода денежных средств на Клиринговый денежный счет;

- путем перевода денежных средств в иностранной валюте на Банковский счет КЦ;

- 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 статьей 45 настоящих Правил.

23.7. Перевод денежных средств Участником клиринга на Клиринговый денежный счет или Банковский 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 или Банковский счет КЦ, 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 или по Банковскому счету КЦ, 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 или Банковский счет КЦ по расчётным документам с неправильно или неполно указанным назначением платежа, эти средства не включаются в состав Средств обеспечения. Плательщик должен предоставить письмо, подтверждающее соответствующее назначение платежа по внесению Средств обеспечения в виде Электронного документа, подписанного Электронной подписью. Указанное в настоящем абзаце письмо может быть направлено в КЦ банком, являющимся отправителем денежных средств по расчётным документам с неправильно или неполно указанным назначением платежа с использованием системы SWIFT.

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

23.10. 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 или с Банковских счетов КЦ.

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, в том числе для обеспечения исполнения обязательств по денежным средствам, исполнение которых производится в порядке, указанном в пункте 29.18 настоящих Правил;

- если величина Доступных средств 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 на рынке КЦ, для которого зарегистрирован этот ТКС, 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;

- если величина Доступных средств 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 на рынке КЦ, для которого зарегистрирован этот ТКС, 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.

В случае предоставления Участником клиринга заявления в произвольной форме КЦ осуществляет указанную в двух предыдущих абзацах проверку не в отношении ТКС, соответствующему денежному регистру, с которого денежные средства, учитываемые в качестве Средств обеспечения Участника клиринга, должны быть списаны, а в отношении Группы ТКС Участника клиринга, в которую входит этот ТКС, с последующей проверкой достаточности Доступных средств Участника клиринга на рынке КЦ, для которого зарегистрирован этот ТКС, для осуществления возврата денежных средств в указанном в настоящем абзаце порядке.

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 списания денежных средств с клирингового денежного счета/ Банковского счета КЦ Расчетной организацией поручение на возврат денежных средств считается исполненным, 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, обязательство КЦ по возврату денежных средств в сумме списания считается прекращенным.

23.11. 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.

23.12. 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.

23.13. Внесение Средств обеспечения в ценных бумагах / НФИ возможно путем зачисления ценных бумаг на Субсчет депо / НФИ на Счет учета НФИ.

23.14. Зачисление ценных бумаг на Субсчет депо / НФИ на Счет учета НФИ осуществляется на основании поручения КЦ, поданного в Расчетный депозитарий и составленного на основании поручения лица, которому открыт Субсчет депо / Счет учета НФИ, либо его уполномоченного представителя, поданного в КЦ. Исполнение поручения КЦ на зачисление ценных бумаг на Субсчет депо / НФИ на Счет учета НФИ осуществляется Расчетным депозитарием в соответствии с внутренними документами Расчетного депозитария.

Зачисление ценных бумаг на Субсчет депо / НФИ на Счет учета НФИ, 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 лица, которому открыт Субсчет депо/Счет учета НФИ, либо его уполномоченного представителя.

КЦ учитывает на соответствующих клиринговых регистрах информацию о зачислении ценных бумаг на Субсчет депо / НФИ на Счет учета НФИ после получения от Расчетного депозитария отчета, подтверждающего зачисление ценных бумаг на соответствующий Субсчет депо / НФИ на соответствующий Счет учета НФИ.

После зачисления ценных бумаг на Субсчет депо / НФИ на Счет учета НФИ и учета их в качестве Средств обеспечения на соответствующих клиринговых регистрах у

КЦ возникает обязательство вернуть ценные бумаги / НФИ Участнику клиринга, учитываемые на соответствующих клиринговых регистрах.

23.15. Списание ценных бумаг с Субсчета депо/НФИ со Счета учета НФИ осуществляется на основании поручения КЦ, поданного в Расчетный депозитарий и составленного на основании поручения лица, которому открыт Субсчет депо/Счет учета НФИ, либо его уполномоченного представителя, поданного в КЦ. Исполнение поручения КЦ на списание ценных бумаг с Субсчета депо / НФИ со Счета учета НФИ осуществляется Расчетным депозитарием в соответствии с внутренними документами Расчетного депозитария.

Списание ценных бумаг с Субсчета депо / НФИ со Счета учета НФИ, 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 лица, которому открыт Субсчет депо/Счет учета НФИ, либо его уполномоченного представителя.

КЦ, получив поручение на списание ценных бумаг с Субсчета депо/НФИ со Счета учета НФИ от лица, которому открыт Субсчет депо / Счет учета НФИ, либо его уполномоченного представителя, уменьшает Средства обеспечения Участника клиринга, учитываемые на соответствующих клиринговых регистрах, и дает поручение Расчетному депозитарию на списание ценных бумаг с Субсчета депо/НФИ со Счета учета НФИ, при соблюдении следующих условий:

1) при списании ценных бумаг, которые не входят в Перечень ценных бумаг, включаемых в Средства обеспечения, с Субсчета депо / НФИ со Счета учета НФИ - количество ценных бумаг / НФИ, подлежащих списанию, не превышает значения соответствующей позиции по ценным бумагам / НФИ Участника клиринга, учитываемой на депо регистре / регистре учета НФИ.

При списании ценных бумаг, которые входят в Перечень ценных бумаг, включаемых в Средства обеспечения, с Субсчета депо:

- 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 на рынке КЦ, для которого зарегистрирован этот ТКС, в результате такого списания не станут 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 на рынке КЦ, для которого зарегистрирован этот ТКС, 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;

- 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, 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.

Поручение на списание ценных бумаг с Субсчета депо / НФИ со Счета учета НФИ лица, которому открыт Субсчет депо / Счет учета НФИ, либо его уполномоченного представителя считается исполненным с момента получения КЦ от Расчетного депозитария информации о списании ценных бумаг с Субсчета депо / НФИ со Счета учета

НФИ, обязательство КЦ по возврату ценных бумаг/НФИ в количестве списанных ценных бумаг/НФИ считается прекращенным.

23.16. КЦ вправе потребовать от лица, которому открыт Субсчет депо / Счет учета НФИ, либо его уполномоченного представителя, направившего поручение на списание ценных бумаг / НФИ, предоставления документов и (или) информации, требуемых Расчетным депозитарием при списании ценных бумаг с Субсчета депо /НФИ со Счета учета НФИ. Если лицо, которому открыт Субсчет депо/Счет учета НФИ, либо его уполномоченный представитель 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 /НФИ со Счета учета НФИ. Порядок и срок предоставления указанных документов и информации указывается КЦ в соответствующем запросе.

23.17. КЦ вправе отказать лицу, которому открыт Субсчет депо/Счет учета НФИ, либо его уполномоченному представителю в приеме поручения на зачисление ценных бумаг на Субсчет депо / НФИ на Счет учета НФИ, списание ценных бумаг с Субсчета депо/НФИ со Счета учета НФИ или перевод ценных бумаг между Субсчетами депо / НФИ между Счетами учета НФИ при проведении корпоративного события, в результате которого изменяется количество ценных бумаг. В случае принятия решения об установлении ограничений по приему указанных поручений КЦ информирует о таком решении Участников клиринга путем направления Электронного документа, подписанного Электронной подписью, либо на Сайте КЦ.

23.18. КЦ не осуществляет учет на клиринговых регистрах ТКС денежных средств и (или) ценных бумаг и (или) НФИ в дату регистрации ТКС и (или) в дату регистрации Субсчета депо / Счета учета НФИ.

23.19. Сроки предоставления поручений на зачисление / на списание ценных бумаг / НФИ установлены Регламентом клиринга. При предоставлении поручения на зачисление/списание ценных бумаг / НФИ позднее времени, указанного в Регламенте клиринга, поручение на зачисление/списание ценных бумаг / НФИ 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.

23.20. 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 Депозитарию, 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, клиента 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.

Статья 24. Порядок внесения и возврата взноса в Гарантийные фонды

24.1. После уведомления КЦ о дате начала формирования Гарантийных 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 Гарантийные фонды, в сумме, не меньшей установленного КЦ Размера взноса в соответствующий Гарантийный 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 23.15 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 вноса, в качестве вноса 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 вноса в Гарантийный фонд потребовать возврата суммы денежных средств и (или) ценных бумаг, в размере превышения Размера вноса.

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 Гарантийных фондов.

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

Информация об увеличении Размера вноса, о необходимости внесения дополнительных денежных средств в российских рублях и (или) иностранной валюте, а также ценных бумаг для увеличения текущего размера вноса в соответствующий Гарантийный фонд до вновь установленного Размера вноса, а также о сроке вступления измененного Размера вноса 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 вноса Участника клиринга или Гаранта в соответствующий Гарантийный фонд и размер обязательства КЦ по возврату денежных средств в российских рублях и (или) иностранной валюте, а также ценных бумаг в размере вноса, внесенного соответствующим лицом.

24.8. Возврат Участнику клиринга его вноса в соответствующий Гарантийный фонд осуществляется по усмотрению КЦ в виде имущества, составляющего взнос Участника клиринга в соответствующий Гарантийный фонд, или денежных средств, стоимость которых определяется исходя из стоимости имущества, составляющего соответствующий Гарантийный 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 вноса в Гарантийный фонд.

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

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

Заявление о возврате вноса в специальный Гарантийный 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 Гарантийный фонд осуществляется на счета, предварительно

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

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

24.10. При расторжении договора между КЦ и Гарантом возврат Гаранту его взноса 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 / Торговой площадкой при подаче Заявок / Заявок Торговой площадки и заключении Договоров / Внебиржевых договоров ОТС. Порядок и условия допуска обязательств к клирингу

25.1. При подаче Участником торгов Заявки / Участником торгов Торговой площадки Заявки Торговой площадки осуществляется автоматизированный электронно-цифровой обмен запросами между Системой проведения торгов Организатора торговли / Системой проведения торгов Торговой площадки и Клиринговой системой в целях проверки, что:

- у Участника торгов / Участника торгов Торговой площадки, подавшего Заявку / Заявку Торговой площадки, есть действующий допуск к клиринговому обслуживанию;
- по поданной Заявке ценная бумага включена в Список ценных бумаг, валюта включена в Список валют или ПФИ включен в Список ПФИ;
- по поданной Заявке Торговой площадки предметы обязательств включены в Список обязательств.

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

- величина Доступных средств Участника клиринга по ТКС, определяемому Поданной Заявкой / Заявкой Торговой площадки, а также величина Доступных средств Участника клиринга на рынке КЦ, для которого зарегистрирован этот ТКС, рассчитанные с учетом Поданной Заявки / Заявки Торговой площадки, не станут отрицательными;
- если величина Доступных средств по ТКС, определяемому Поданной Заявкой / Заявок Торговой площадки, а также величина Доступных средств Участника клиринга на рынке КЦ, для которого зарегистрирован этот ТКС, были отрицательными до момента подачи Заявки / Заявки Торговой площадки, то указанные величины Доступных средств, рассчитанные с учетом указанной Поданной Заявки / Заявки Торговой площадки, не

станут меньше величин Доступных средств, рассчитанных до момента подачи указанной Заявки / Заявки Торговой площадки.

При подаче Участником торгов Заявки / Заявки Торговой площадки, в которой указан Код расчетов Х0, КЦ проверяет, чтобы размер денежных средств, учитываемых на денежном регистре, входящем в состав ТКС, указанного в данной Заявке / Заявке Торговой площадки, не был меньше размера денежных средств, требуемого для исполнения обязательств, возникающих из Договора / Внебиржевого договора ОТС, заключенного на основании указанной Заявки / Заявки Торговой площадки.

При подаче Заявки / Заявки Торговой площадки, 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 / Заявке Торговой площадки, не был меньше размера денежных средств и количества ценных бумаг, требуемых для исполнения обязательств, возникающих из Договора / Внебиржевого договора ОТС, заключенного на основании указанной Заявки / Заявки Торговой площадки.

При подаче Участником клиринга Заявки / Заявки Торговой площадки 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 / Заявке Торговой площадки, не были меньше количества ценных бумаг, требуемых для исполнения обязательств, возникающих из Договора / Внебиржевого договора ОТС, заключенного на основании указанной Заявки / Заявки Торговой площадки.

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 единовременную 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.

КЦ вправе установить в отношении Участника клиринга лимит в отношении размера денежных средств, в пределах которого при подаче Заявок на заключение Договоров ПФИ КЦ не проводит проверку, указанную в предыдущем абзаце настоящего пункта. В случае принятия решения об установлении лимитов, указанных в настоящем абзаце, определение размера лимита для каждого Участника клиринга производится с учетом финансового состояния Участника клиринга в порядке, определенном Методикой определения внутренних рейтингов Контрагентов.

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

При невыполнении хотя бы одного из условий, указанных в пункте 25.1 настоящих Правил, КЦ уведомляет Организатора торговли / Торговую площадку о невозможности регистрации Поданной Заявки / Заявки Торговой площадки в реестре Заявок / Заявок Торговой площадки. В указанном случае величины Доступных средств

Участника клиринга, указанного в Поданной Заявке / Заявке Торговой площадки, не пересчитываются и считаются равными последним рассчитанным величинам.

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

25.4. В случае отзыва Объявленной Заявки / Заявки Торговой площадки или аннулирования Объявленной Заявки / Заявки Торговой площадки Организатор торговли / Торговая площадка извещает КЦ об указанном факте. В указанном случае величина Доступных средств по ТКС, определяемому Объявленной Заявкой / Заявкой Торговой площадки, подлежащей отзыву или аннулированию, а также величина Доступных средств Участника клиринга на рынке КЦ, для которого зарегистрирован этот ТКС, указанного в Заявке / Заявке Торговой площадки, пересчитываются без учета указанной Объявленной Заявки / Заявки Торговой площадки.

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

- рассчитывает величину Доступных средств по ТКС, определяемому Объявленной Заявкой / Заявкой Торговой площадки, на основании которой был заключен Договор / Договор Торговой площадки, а также величину Доступных средств Участника клиринга на рынке КЦ, для которого зарегистрирован этот ТКС, без учета Объявленной Заявки / Заявки Торговой площадки, на основании которой был заключен Договор / Договор Торговой площадки, но с учетом указанного Договора / Договора Торговой площадки, за исключением случаев, когда обязательства, возникшие из Договоров / Договоров Торговой площадки, 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 / Внебиржевого договора купли-продажи ОТС / Внебиржевого договора репо ОТС нетто-обязательство и (или) нетто-требование Участника клиринга из Договоров / Внебиржевых договоров ОТС (Договоров Торговой площадки) в российских рублях и (или) иностранной валюте и ценных бумагах с указанием даты исполнения, соответствующей Дате исполнения по заключенному Договору / Внебиржевому договору ОТС, учитываемые по регистру учета позиций, соответствующему ТКС, определяемому Объявленной Заявкой / Заявкой Торговой площадки, на основании которой заключен указанный Договор / Внебиржевой договор ОТС;

- изменяет с учетом указанного заключенного Договора купли-продажи иностранной валюты / Валютного свопа / Внебиржевого договора купли-продажи иностранной валюты ОТС / Внебиржевого валютного свопа ОТС нетто-обязательство и (или) нетто-требование Участника клиринга из Договоров / Внебиржевых договоров ОТС в российских рублях и (или) иностранной валюте с указанием даты исполнения, соответствующей Дате исполнения по заключенному Договору / Внебиржевому договору ОТС, учитываемые по регистру учета позиций, соответствующему ТКС, определяемому Объявленной Заявкой / Заявкой Торговой площадки, на основании которой заключен указанный Договор / Внебиржевой договор ОТС;

- 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 / Внебиржевых договоров ОТС, допускаются к клирингу с момента получения КЦ информации о регистрации соответствующего Договора / Договора Торговой площадки в реестре Договоров / Договоров Торговой площадки. Указанные обязательства принимаются КЦ к учету с момента их допуска к клирингу на основании информации о регистрации заключенного Договора / Договора Торговой площадки в реестре Договоров / Договоров Торговой площадки, получаемой КЦ от Организатора торговли / Торговой площадки.

25.7 В отношении заключенных Внебиржевых договоров ОТС (Договоров Торговой площадки) применяются положения пункта 27.19 настоящих Правил.

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 на рынке КЦ, для которого зарегистрирован этот

ТКС, 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 на рынке КЦ, для которого зарегистрирован этот ТКС, 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 на рынке КЦ, для которого зарегистрирован этот ТКС, 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 на рынке КЦ, для которого зарегистрирован этот ТКС, 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 на основании Оферт ОТС

27.1. Направление Оферт ОТС осуществляется с использованием Системы.

Заключение Внебиржевого договора купли-продажи иностранной валюты ОТС и Внебиржевого валютного свопа ОТС на основании Оферт ОТС и Акцептов ОТС не допускается.

КЦ вправе определить перечень (перечни) ценных бумаг / НФИ, 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.

Для каждой ценной бумаги, в отношении которой может быть направлена Оферта ОТС, КЦ устанавливаются валюты, в которых определяются цены этой ценной бумаги, а также валюты, в которых осуществляются расчеты по Внебиржевым договорам ОТС по указанным ценным бумагам (далее - валюта расчетов) и публикует указанную информацию на Сайте КЦ.

КЦ вправе приостанавливать или прекращать направление Оферт ОТС, в том числе Оферт ОТС в отношении определенных ценных бумаг / НФИ 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 / НФИ, в отношении которой (ого) направлена Оферта ОТС, включен(а) в перечень предметов обязательств в Списке обязательств, а также в перечень ценных бумаг / НФИ, 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 на рынке КЦ, для которого зарегистрирован этот ТКС, 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 на рынке КЦ, для которого зарегистрирован этот ТКС, 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.

При направлении Участником клиринга Оферты ОТС для заключения 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 Внебиржевому договору ОТС и объем нетто-требований по ценным бумагам, учитываемых на клиринговых регистрах, входящих в состав ТКС, указанного в данной Оферты ОТС, не были меньше количества ценных бумаг, требуемых для исполнения обязательств, возникающих из Внебиржевого договора ОТС, заключенного на основании указанной Оферты ОТС.

27.3. При выполнении условий, указанных в пункте 27.2 настоящих Правил, 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 / НФИ, 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 / НФИ.

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 / НФИ, которые будут являться предметом Внебиржевого договора ОТС;

- цена за одну ценную бумагу / НФИ, указанная в Акцепте ОТС, направленном на покупку ценных бумаг / НФИ, не меньше, чем цена ценной бумаги / НФИ, указанная в Оферте ОТС, направленной на продажу ценных бумаг / НФИ, или

- цена за одну ценную бумагу / НФИ, указанная в Акцепте ОТС, направленном на продажу ценных бумаг / НФИ, не больше, чем цена ценной бумаги / НФИ, указанная в Оферте ОТС, направленной на покупку ценных бумаг / НФИ (для заключения Внебиржевых договоров купли-продажи ОТС, если в Оферте ОТС указана цена ценной бумаги / НФИ);

- Ставка репо, указанная в Акцепте ОТС, направленном на покупку ценных бумаг / НФИ, не больше, чем Ставка репо, указанная в Оферте ОТС, направленной на продажу ценных бумаг / НФИ, или Ставка репо, указанная в Акцепте ОТС, направленном на продажу ценных бумаг / НФИ, не меньше, чем Ставка репо, указанная в Оферте ОТС, направленной на покупку ценных бумаг / НФИ (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 / НФИ, 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 / НФИ, считается наибольшая из них, а лучшей из цен, указанных в Акцептах ОТС, направленных на продажу ценных бумаг / НФИ, считается наименьшая из них.

Для целей заключения Внебиржевого договора ОТС под Акцептом ОТС, направленным на покупку ценных бумаг / НФИ, 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 / НФИ, 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 / НФИ, 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 / НФИ, 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 / НФИ, 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 / НФИ 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 / НФИ, 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 / НФИ по Внебиржевому договору ОТС выражается в национальной валюте Российской Федерации/ 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 на рынке КЦ, для которого зарегистрирован этот ТКС;

- 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 / национальной валюте Российской Федерации 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 репозитарий - ПАО «СПБ Биржа» (далее в целях настоящего пункта - Репозитарий) 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 Репозитарий, является КЦ. Участники клиринга, заключая Внебиржевой договор репо ОТС, тем самым предоставляют КЦ своё безотзывное и безусловное согласие на передачу КЦ Репозитария 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, и обязательств, учитываемых на клиринговых регистрах ТКС-DVP), обязательства по уплате Премии, возникшие из Договоров ПФИ, включаются в клиринговый пул по Договорам в соответствии со статьей 29 настоящих Правил;

- обязательства, возникшие из Договоров, в которых указан Код расчетов Тп и Код расчетов ТкТп, и из Внебиржевых договоров ОТС, учитываемые на клиринговых регистрах ТКС-DVP (за исключением обязательств, возникших из Внутриброкерских договоров и Внутриброкерских Внебиржевых договоров ОТС), включаются в клиринговый пул DVP 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 статьей 32 настоящих Правил;

- обязательства, возникшие из Договоров, в которых указан Код расчетов Оп и Код расчетов OkOp, включаются в клиринговый пул по договорам, заключаемым без участия Центрального контрагента, в соответствии со статьей 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 статьей 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 статьей 34 настоящих Правил;

- обязательства, возникшие из Внебиржевых договоров ОТС (за исключением обязательств, учитываемых на клиринговых регистрах ТКС-DVP), включаются в клиринговый пул ОТС в соответствии со статьей 29 настоящих Правил;

- обязательства, возникшие из Внебиржевых договоров, включаются в клиринговый пул по договорам, заключаемым без участия Центрального контрагента, в соответствии со статьей 33 настоящих Правил;

- обязательства, определенные статьей 29 настоящих Правил, включаются в расчетный клиринговый пул в соответствии со статьей 29 настоящих Правил;
- обязательства, указанные в статье 35 настоящих Правил, включаются в клиринговый пул для расчетов по итогам Торгов в соответствии со статьей 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 статьей 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 статьей 38 настоящих Правил;
- обязательства по Вариационной марже, возникшие из Договоров ПФИ, включаются в клиринговый пул для расчетов по Вариационной марже в соответствии со статьей 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 Оп, Код расчетов OkOp 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 Оп, Код расчетов OkOp 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, клирингового пула DVP 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 статьями 25 и 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 расчётов 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, ценным бумагам и НФИ, 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, ценным бумагам и НФИ в отношении КЦ и каждого Участника клиринга по каждому денежному регистру / Субсчету депо / Счету учета НФИ.

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 / НФИ, 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;

- итоговые нетто-обязательства / итоговые нетто-требования по денежным средствам / ценным бумагам / НФИ, определенные в порядке, установленном пунктом 29.18. настоящих Правил, в случае их ненадлежащего исполнения в Дату исполнения/ дату исполнения, определенную при заключении Договора купли-продажи/ Внебиржевого договора ОТС.

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, ценным бумагам и НФИ КЦ в отношении каждого Участника клиринга, а также нетто-обязательства / нетто-требования по денежным средствам, ценным бумагам и НФИ каждого Участника клиринга в отношении КЦ. Указанные нетто-обязательства / нетто-требования определяются по каждому денежному регистру / Субсчету депо / Счету учета НФИ. Определённые в соответствии с настоящим пунктом нетто-обязательства /

нетто-требования Участника клиринга в отношении КЦ 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, ценных бумаг и НФИ, полученных в результате исполнения итоговых нетто-обязательств Участников клиринга, а также, за исключением исполнения итоговых нетто-обязательств, являющихся результатом прекращения обязательств, возникших из Договоров и Внебиржевых договоров ОТС, предметом которых являются Ценные бумаги эмитентов Гонконга, свободных денежных средств, 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.

29.7. Удовлетворение итоговых нетто-требований Участника клиринга, определенных в отношении денежного регистра / Субсчета депо / Счета учета НФИ, относящихся к определенному ТКС, возможно только после исполнения этим Участником клиринга итоговых нетто-обязательств, определённых по денежному регистру / Субсчету депо / Счету учета НФИ, относящихся к тому же ТКС.

29.8. Для исполнения итогового нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам / НФИ, учитываемого в отношении определённого денежного регистра / Субсчета депо / Счета учета НФИ, используются денежные средства / ценные бумаги / НФИ, учитываемые по тому же денежному регистру / Субсчету депо / Счету учета НФИ.

29.9. Если иное не предусмотрено настоящей статьёй, итоговое нетто-обязательство Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам / НФИ может быть исполнено по денежному регистру / Субсчету депо / Счету учета НФИ, в отношении которого оно определено, в случае если сумма денежных средств / количество ценных бумаг / количество НФИ, учитываемых по тому же денежному регистру / Субсчету депо / Счету учета НФИ, не меньше, чем размер итогового нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам / НФИ, определённого по денежному регистру / Субсчету депо / Счету учета НФИ.

КЦ исполняет итоговые нетто-обязательства / итоговые нетто-требования по денежным средствам, ценным бумагам и НФИ 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;

- в случае наличия у Участника клиринга задолженности перед КЦ в российских рублях или иностранной валюте, указанная задолженность прекращается (полностью или частично) зачетом встречного однородного итогового нетто-требования по денежным средствам. Итоговое нетто-требование по денежным средствам, с учетом прекращения задолженности, 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 / НФИ КЦ передает в Расчетный депозитарий сводное поручение депо на проведение расчетов по Субсчетам депо / Счетам учета НФИ. 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 / НФИ считается исполненным с момента получения КЦ от Расчетного депозитария отчета об исполнении сводного поручения депо на проведение расчетов по Субсчетам депо / Счетам учета НФИ. 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 / НФИ, определенного в соответствии с пунктом 29.5.1. настоящих Правил, в результате недостаточности ценных бумаг / НФИ, учитываемых на депо регистрах в отношении определенного Субсчета депо / Счета учета НФИ, или определенного в соответствии пунктом 29.21 настоящих Правил, в результате действий, указанных в пункте 29.22 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.

29.11. После проведения в соответствии со статьей 30 настоящих Правил процедуры урегулирования исполнения итоговых нетто-обязательств / итоговых нетто-требований по ценным бумагам / НФИ, 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, а также обязательств / требований по денежным средствам по первой части (Первому договору) Донорских договоров, являющиеся Договорами репо и Парами договоров, первая часть (Первый договор) и вторая часть (Второй договор) по которым исполняются в Расчетный день, в который осуществлялось заключение соответствующего Донорского договора);

2) КЦ включает в клиринговый пул ОТС:

- обязательства / требования Участников клиринга и КЦ по денежным средствам, ценным бумагам и НФИ 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 31 настоящих Правил, с наступившей датой исполнения (кроме обязательств, указанных в пункте 29.16 настоящих Правил а также обязательств / требований по денежным средствам по первой части (Первому договору) Донорских договоров, являющиеся Внебиржевыми договорами репо ОТС и Парами договоров, первая часть (Первый договор) и вторая часть (Второй договор) по которым исполняются в Расчетный день, в который осуществлялось заключение соответствующего Донорского договора);

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, ценным бумагам и НФИ в отношении КЦ и каждого Участника клиринга по каждому денежному регистру / Субсчету депо / Счету учета НФИ;

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, ценным бумагам и НФИ, 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, ценным бумагам и НФИ, определенные в соответствии с пунктом 29.5.1 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, ценным бумагам и НФИ КЦ в отношении каждого Участника клиринга, а также нетто-обязательства / нетто-требования по денежным средствам, ценным бумагам и НФИ каждого Участника клиринга в отношении КЦ. Указанные нетто-обязательства / нетто-требования определяются по каждому денежному регистру / Субсчету депо / Счету учета НФИ. Определенные в соответствии с настоящим подпунктом нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в отношении КЦ 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 ТкТп, в Дату исполнения Первых договоров, составляющих Пары договоров, в дату исполнения первой части Внебиржевых договоров репо ОТС, в Дату исполнения Первых договоров купли-продажи иностранной валюты, составляющих Валютный своп / Первых договоров купли-продажи иностранной валюты ОТС, составляющих Внебиржевой валютный своп 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 ТкТп, и из Пар биржевых договоров с наступившей Датой исполнения, заключенным в соответствии со статьей 30 настоящих Правил;

- обязательства / требования Участников клиринга и КЦ по денежным средствам из Валютного свопа с наступившей Датой исполнения, заключенным в соответствии со статьей 30 настоящих Правил;

- обязательства / требования Участника клиринга и КЦ по Донорским договорам, являющимся Парами биржевых договоров, а также Валютным свопом, заключенным в соответствии со статьей 31 настоящих Правил, с наступившей Датой исполнения, за исключением Донорских договоров, исполнение первой части (Первого договора) и второй части (Второго договора) по которым производится в Расчетный день, в который осуществляется заключение соответствующего Донорского договора;

2) КЦ включает в клиринговый пул ОТС:

- обязательства / требования Участников клиринга и КЦ по денежным средствам, ценным бумагам и НФИ 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 денежным средствам из Внебиржевого валютного свопа 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, по Донорским договорам купли-продажи, являющимся Парами внебиржевых договоров ОТС, и по Донорским внебиржевым валютным свопам 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, ценным бумагам и НФИ в отношении КЦ и каждого Участника клиринга по каждому денежному регистру/Субсчету депо/Счету учета НФИ.

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, ценным бумагам и НФИ, определенные в соответствии с пунктом 29.5.1. настоящих Правил, или неисполненные итоговые нетто-обязательства / итоговые

нетто-требования по денежным средствам, ценным бумагам и НФИ, определенные в соответствии с подпунктом 6 пункта 29.11 настоящих Правил;

- нетто-обязательства / нетто-требования по денежным средствам, ценным бумагам и НФИ, определенные в соответствии с подпунктами 3 и 4 пункта 29.13. настоящих Правил;

- нетто-обязательства / нетто-требования по денежным средствам, ценным бумагам и НФИ, определенные в соответствии с абзацем 3 пункта 29.17 настоящих Правил;

- обязательства / требования по денежным средствам по первой части (Первому договору) Донорских договоров, являющиеся Договорами репо, Внебиржевыми договорами репо ОТС и Парами договоров, первая часть (Первый договор) и вторая часть (Второй договор) по которым исполняются в Расчетный день, в который осуществлялось заключение соответствующего Донорского договора).

По обязательствам / требованиям, включенным в указанный расчетный клиринговый пул, КЦ проводит неттинг (зачет), по итогам которого определяет нетто-обязательства / нетто-требования по денежным средствам, ценным бумагам и НФИ КЦ в отношении каждого Участника клиринга, а также нетто-обязательства / нетто-требования по денежным средствам, ценным бумагам и НФИ 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/Счету учета НФИ. Определенные в соответствии с настоящим пунктом нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в отношении КЦ 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, Валютные свопы, Внебиржевые валютные свопы ОТС 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.

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, ценным бумагам и НФИ по Внутриброкерским Договорам и Внутриброкерским Внебиржевым договорам ОТС, заключенным с указанием ТКС, в состав которого входят несколько позиций по ценным бумагам / НФИ, 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, ценным бумагам и НФИ, возникшие из Внутриброкерских Договоров, допущенные к клирингу в соответствии со статьей 25 настоящих Правил, с наступившими Датой 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, ценным бумагам и НФИ 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 / НФИ, 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 / НФИ, в клиринговый пул по указанным Внутриброкерским договорам включаются обязательства / требования по денежным средствам, ценным бумагам и НФИ, возникшие из указанных Внутриброкерских Договоров, допущенные к клирингу в соответствии со статьей 25 настоящих Правил, с наступившими Датой 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, ценным бумагам и НФИ по Внутриброкерским Договорам и по Внутриброкерским Внебиржевым договорам ОТС, заключенных с указанием ТКС, в состав которого входят несколько позиций по ценным бумагам / НФИ, прекращаются зачетом в клиринговом пуле по указанным Внутриброкерским договорам, а в оставшейся части КЦ определяет нетто-обязательства / нетто-требования по денежным средствам, ценным бумагам и НФИ в отношении КЦ и каждого Участника клиринга по каждому денежному регистру / Субсчету депо / Счету учета НФИ.

Определенные по итогам формирования такого клирингового пула нетто-обязательства / нетто-требования по денежным средствам, ценным бумагам и НФИ 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, в том числе Донорские договоры, являющиеся Договорами репо, Внебиржевыми договорами репо ОТС, а также Парам договоров, первая часть (Первый договор) и вторая часть (Второй договор) по которым исполняются в Расчетный день, в который осуществлялось заключение соответствующего Донорского договора, 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 статьей, 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 / НФИ в порядке, установленном статьей 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 статьей. Прекращение указанных обязательств осуществляется в порядке, предусмотренном статьей 48 настоящих Правил.

29.21. В срок, установленный Регламентом клиринга, КЦ в целях определения итоговых нетто-обязательств по обязательствам, учитываемым на клиринговых регистрах ТКС-DVP (далее – итоговые нетто-обязательства DVP), осуществляет формирование клирингового пула DVP.

В клиринговый пул DVP включаются обязательства, возникшие из Договоров, в которых указан Код расчетов Tn или Код расчетов TkTn, допущенные к клирингу в соответствии со статьями 25 настоящих Правил, с Датами исполнения / Датами расчетов на следующий Расчетный день и обязательства, возникшие из Внебиржевых договоров ОТС допущенные к клирингу в соответствии со статьей 27 настоящих Правил, с датами исполнения на следующий Расчетный день.

По обязательствам / требованиям, включенным в клиринговый пул DVP, КЦ проводит неттинг (зачет) **с учетом положений, описанных в Регламенте клиринга**, по итогам которого определяет итоговые нетто-обязательства / итоговые нетто-требования по денежным средствам, ценным бумагам КЦ в отношении каждого Участника клиринга, а также итоговые нетто-обязательства / итоговые нетто-требования по денежным средствам, ценным бумагам каждого Участника клиринга в отношении КЦ. Указанные итоговые нетто-обязательства / итоговые нетто-требования определяются по каждому денежному регистру / Субсчету депо.

На основании итоговых нетто-обязательств DVP в порядке и сроки, установленные Регламентом клиринга, КЦ формирует документы для исполнения этих итоговых нетто-обязательств DVP по денежным счетам DVP и счетам депо DVP (далее - инструкции) и направляет в Расчетный депозитарий. Инструкции для исполнения итоговых нетто-обязательств DVP подлежат исполнению в дату исполнения итоговых нетто-обязательств DVP.

Если в соответствии с порядком, установленном Регламентом клиринга, для итоговых нетто-обязательств инструкции для исполнения не формируются, то такие итоговое нетто-обязательства подлежат исполнению в соответствии с пунктом 29.15 настоящих Правил.

29.22. В дату исполнения итоговых нетто-обязательств DVP КЦ осуществляет определение исполнения / неисполнения итоговых нетто-обязательств DVP на основании информации, полученной от Расчетного депозитария. На момент времени, указанный в Регламенте клиринга:

- при наличии информации от Расчетного депозитария об исполнении инструкции для исполнения итоговых нетто-обязательств DVP итоговые нетто-обязательства DVP, для исполнения которых была сформирована такая инструкция, признаются исполненными;

- при наличии информации от Расчетного депозитария о неисполнении инструкции для исполнения итоговых нетто-обязательств DVP или отсутствии информации от Расчетного депозитария об исполнении инструкции для исполнения итоговых нетто-обязательств DVP итоговые нетто-обязательства DVP, для исполнения которых была сформирована такая инструкция, признаются неисполненными.

Дальнейшие действия для исполнения (прекращения) неисполненных итоговых нетто-обязательств DVP осуществляются в порядке, установленном пунктами 29.10 – 29.15 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, Пары договоров, Валютный своп и (или) Внебиржевой валютный своп ОТС на условиях и в порядке, определенных настоящей статьей.

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 статьей производится путем заключения Пары договоров; или

- законодательством Российской Федерации не допускается заключение Договоров репо и Внебиржевых договоров репо ОТС с ценными бумагами / НФИ, в отношении которых наступили основания для заключения указанных договоров.

Первый договор, составляющий Пару договоров / Первый договор купли-продажи иностранной валюты, составляющий Валютный своп / Первый договор купли-продажи иностранной валюты ОТС, составляющий Внебиржевой валютный своп ОТС, заключаемые в соответствии с настоящей статьей, исполняется в день его заключения ($k=0$), а Второй договор / Второй договор купли-продажи иностранной валюты / Второй договор купли-продажи иностранной валюты ОТС исполняется в следующий Расчетный день ($n=1$). В соответствии с настоящей статьей:

- 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 / Валютный своп заключаются на Торгах без подачи Заявок;

- Внебиржевой валютный своп ОТС заключается на Торгах Торговой площадки без подачи Заявок Торговой площадки;

- 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 или итогового нетто-обязательства по соответствующим НФИ, учитываемого в отношении определенного денежного регистра / Субсчета депо / Счета учета НФИ;

г) отсутствует решение об исключении ценной бумаги, по которой учитывается итоговое нетто-обязательство, из Списка ценных бумаг / валюты, по которой учитывается итоговое нетто-обязательство, из Списка валют 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 / НФИ в связи с консолидацией, дроблением ценных бумаг / НФИ, в связи с реорганизацией эмитента ценных бумаг / лица, выдавшего ценные бумаги / НФИ в форме слияния, присоединения, выделения или разделения, в связи с изменением параметров ценной бумаги / НФИ, а также в связи с получением от Организатора торговли / Торговой площадки 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 / НФИ, о выплате Дохода ценными бумагами / НФИ.

30.3. Договоры, предусмотренные пунктом 30.1 настоящих Правил, заключаются между КЦ и недобросовестным Участником клиринга в следующих случаях:

- в случае ненадлежащего исполнения Участником клиринга итогового нетто-обязательства по ценным бумагам / НФИ, КЦ заключает с этим Участником клиринга Договоры репо, Внебиржевые договоры репо ОТС и (или) Пары договоров.

Договоры репо, Внебиржевые договоры репо ОТС и (или) Пары договоров заключаются КЦ на следующих условиях:

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 / НФИ, являющиеся предметом итогового нетто-обязательства, в количестве, равном количеству, в отношении которого итоговое нетто-обязательство не было исполнено, а Участник клиринга обязан принять их и оплатить. Для Договоров репо и Пар биржевых договоров указанное количество устанавливается кратным Лоту, определенному Организатором торговли / Торговой площадкой, с округлением в большую сторону. В случае ненадлежащего исполнения нетто-обязательств по ценным бумагам / НФИ, учитываемым на регистре или регистрах учета позиций по ТКС, в состав которого входят несколько позиций по ценным бумагам / НФИ, количество ценных бумаг / НФИ, которое КЦ обязан передать Участнику клиринга, определяется как разница между суммой позиций по ценным бумагам / НФИ, входящим в состав ТКС, и суммой нетто-обязательств по ценным бумагам / НФИ, определенным по каждому Субсчету депо / Счету учета НФИ, соответствующим депо регистрам / регистрам учета НФИ, 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 / НФИ, 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 КЦ заключает с этим Участником клиринга Договоры репо, Внебиржевые договоры репо ОТС, Пары договоров, Валютный своп, и (или) Внебиржевой валютный своп ОТС.

Договоры репо, Внебиржевые договоры репо ОТС и (или) Пары договоров заключаются КЦ на следующих условиях:

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 / НФИ в количестве, не превышающем количества ценных бумаг / НФИ, определенного исходя из суммы неисполненной части итогового денежного обязательства и цены одной ценной бумаги / НФИ, а КЦ обязан принять их и оплатить. Для Договоров репо и Пар биржевых договоров указанное количество устанавливается кратным Лоту, определенному Организатором торговли / Торговой площадкой, с округлением в большую сторону;

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 / НФИ, 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 / НФИ, 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 / НФИ;

- цена одной ценной бумаги / НФИ 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 / НФИ.

- цена одной ценной бумаги / НФИ 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 / НФИ 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 / НФИ 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 / НФИ 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 / НФИ 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.

Валютный своп / Внебиржевой валютный своп ОТС заключается КЦ на следующих условиях:

А) по Первому договору купли-продажи иностранной валюты, составляющему Валютный своп / по Первому договору купли-продажи иностранной валюты ОТС, составляющему Внебиржевой валютный своп ОТС, КЦ обязан передать Участнику клиринга иностранную валюту (национальную валюту Российской Федерации), являющуюся валютой неисполненного итогового нетто-обязательства, в количестве, не превышающем количества, в отношении которого итоговое нетто-обязательство не было исполнено, а Участник клиринга обязан передать КЦ другую валюту в количестве, определенному исходя из суммы неисполненной части итогового денежного обязательства и цены этой валюты. Количество иностранной валюты, являющейся предметом Валютного свопа / Внебиржевого валютного свопа ОТС, устанавливается кратным Лоту, определенному Организатором торговли / Торговой площадкой, с округлением в большую сторону;

Б) по Второму договору купли-продажи иностранной валюты, составляющему Валютный своп / по Второму договору купли-продажи иностранной валюты ОТС, составляющему Внебиржевой валютный своп ОТС, Участник клиринга обязан передать КЦ иностранную валюту (национальную валюту Российской Федерации), полученную по Первому договору купли-продажи иностранной валюты / по Первому договору купли-продажи иностранной валюты ОТС, в том же количестве, а КЦ обязан принять указанную иностранную валюту (национальную валюту Российской Федерации) и оплатить;

В) КЦ по своему усмотрению определяет валюту, в которой производится оплата за валюту неисполненного итогового нетто-обязательства по денежным средствам. При этом Участник клиринга считается согласившимся заключить Валютный своп / Внебиржевой валютный своп ОТС в отношении такой валюты;

- цена единицы иностранной валюты (национальной валюты Российской Федерации), передаваемой КЦ Участнику клиринга по Первому договору купли-продажи иностранной валюты, составляющего Валютный своп / по Первому договору купли-продажи иностранной валюты ОТС, составляющему Внебиржевой валютный своп ОТС, считается равной Цене урегулирования исполнения обязательств по этой валюте;

- цена единицы иностранной валюты (национальной валюты Российской Федерации) по Второму договору купли-продажи иностранной валюты, составляющего Валютный своп / по Второму договору купли-продажи иностранной валюты ОТС, составляющему Внебиржевой валютный своп ОТС, определяется исходя из цены Первого договора купли-продажи иностранной валюты / Первого договора купли-продажи иностранной валюты ОТС, сроков исполнения обязательств по Первому и Второму договорам купли-продажи иностранной валюты, составляющим Валютный своп / по Первому и Второму договорам купли-продажи иностранной валюты ОТС, составляющим Внебиржевой валютный своп ОТС, и Ставки свопа;

- Ставка свопа устанавливается КЦ и раскрывается на Сайте КЦ;

- обязательства по передаче иностранной валюты (национальной валюты Российской Федерации), являющейся предметом Валютного свопа / Внебиржевого валютного свопа ОТС, и их оплате по Первому договору купли-продажи иностранной валюты, составляющему Валютный своп / по Первому договору купли-продажи иностранной валюты ОТС, составляющему Внебиржевой валютный своп ОТС, подлежат исполнению в день заключения соответствующего договора;

- обязательства по передаче иностранной валюты (национальной валюты Российской Федерации), являющихся предметом Валютного свопа / Внебиржевого валютного свопа ОТС, и их оплате по Второму договору купли-продажи иностранной валюты, составляющему Валютный своп / по Второму договору купли-продажи иностранной валюты ОТС, составляющему Внебиржевой валютный своп ОТС, подлежат

исполнению в Расчетный день, следующий за днем заключения соответствующего договора;

- определение и исполнение обязательств по Валютным свопам / Внебиржевым валютным свопам ОТС 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 / НФИ:

$$\text{Penalty} = \text{Sum} \times \text{fine_short} \times \left(\frac{T_{365}}{365} + \frac{T_{366}}{366} \right),$$

Б) в случае ненадлежащего исполнения Участником клиринга итогового нетто-обязательства по денежным средствам (при заключении КЦ с недобросовестным Участником клиринга Договоров репо, Внебиржевых договоров репо ОТС, Пар договоров):

$$\text{Penalty} = \text{Sum} \times \text{fine_long} \times \left(\frac{T_{365}}{365} + \frac{T_{366}}{366} \right),$$

В) в случае ненадлежащего исполнения Участником клиринга итогового нетто-обязательства по денежным средствам (при заключении КЦ с недобросовестным Участником клиринга Валютного свопа / Внебиржевого валютного свопа ОТС):

$$\text{Penalty} = \text{Sum} \times \text{Forfeit_rate} \times \left(\frac{T_{365}}{365} + \frac{T_{366}}{366} \right),$$

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, или Первого договора купли-продажи иностранной валюты, составляющего Валютный своп / Первого договора купли-продажи иностранной валюты ОТС, составляющего Внебиржевой валютный своп ОТС, и количества ценных бумаг / НФИ / количества иностранной валюты (национальной валюты Российской Федерации), 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 / НФИ, включенных в Список ценных бумаг / Список обязательств, в соответствии с Методикой установления и изменения риск-параметров;

Forfeit_rate – штрафные ставки, установленные КЦ для каждой валюты, включенной в Список валют, 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, датой исполнения Первого договора, составляющего Пару внебиржевых договоров ОТС, или Датой исполнения Первого договора купли-продажи иностранной валюты, составляющего Валютный своп / Первого договора купли-продажи иностранной валюты ОТС, составляющего Внебиржевой валютный своп 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, датой исполнения Второго договора, составляющего Пару внебиржевых договоров ОТС, или Датой исполнения Второго договора купли-продажи иностранной валюты, составляющего Валютный своп / Второго договора купли-продажи иностранной валюты

ОТС, составляющего Внебиржевой валютный своп 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, датой исполнения Первого договора, составляющего Пару внебиржевых договоров ОТС, или Датой исполнения Первого договора купли-продажи иностранной валюты, составляющего Валютный своп / Первого договора купли-продажи иностранной валюты ОТС, составляющего Внебиржевой валютный своп 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, датой исполнения Второго договора, составляющего Пару внебиржевых договоров ОТС, или Датой исполнения Второго договора купли-продажи иностранной валюты, составляющего Валютный своп / Второго договора купли-продажи иностранной валюты ОТС, составляющего Внебиржевой валютный своп 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, Пара договоров, Валютный своп или Внебиржевой валютный своп ОТС в соответствии с настоящим пунктом заключается в отношении ценных бумаг / НФИ/ валюты, которые учитываются на депо регистре / регистре учета НФИ/ денежном 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 / НФИ 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, Пары внебиржевых договоров ОТС, Валютного свопа или заключение КЦ с добросовестным Участником клиринга без подачи Заявок Торговой площадки на Торгах Торговой площадки Внебиржевого валютного свопа ОТС в следующих случаях:

- в случае ненадлежащего исполнения КЦ итогового нетто-обязательства по ценным бумагам / НФИ КЦ заключает с добросовестным Участником клиринга Договоры репо, Внебиржевые договоры репо ОТС и (или) Пары договоров.

Договоры репо, Внебиржевые договоры репо ОТС и (или) Пары договоров заключаются КЦ на следующих условиях:

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 / НФИ, являющиеся предметом итогового нетто-обязательства, в количестве, равном количеству, в отношении которого итоговое нетто-

обязательство не было исполнено, а КЦ обязан принять их и оплатить. Для Договоров репо и Пар биржевых договоров указанное количество устанавливается кратным Лоту, определенному Организатором торговли / Торговой площадкой, с округлением в большую сторону;

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 / НФИ, 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, КЦ заключает с добросовестным Участником клиринга Договоры репо, Внебиржевые договоры репо ОТС, Пары договоров, Валютный своп и (или) Внебиржевой валютный своп ОТС.

Договоры репо, Внебиржевые договоры репо ОТС и (или) Пары договоров заключаются КЦ на следующих условиях:

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 / НФИ в количестве, не превышающем количества ценных бумаг / НФИ, определенного исходя из суммы неисполненной части итогового денежного обязательства и цены одной ценной бумаги / НФИ, а Участник клиринга обязан принять их и оплатить. Для Договоров репо и Пар биржевых договоров указанное количество устанавливается кратным Лоту, определенному Организатором торговли / Торговой площадкой, с округлением в большую сторону;

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 / НФИ, являющиеся предметом соответствующего договора, в том же количестве, а КЦ обязан принять их и оплатить;

В) КЦ по своему усмотрению определяет ценные бумаги / НФИ, 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 / НФИ;

- цена одной ценной бумаги / НФИ 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 / НФИ;

- цена одной ценной бумаги / НФИ 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 / НФИ 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 / НФИ 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 / НФИ 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 / НФИ 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.

Валютный своп / Внебиржевой валютный своп ОТС заключается КЦ на следующих условиях:

А) по Первому договору купли-продажи иностранной валюты, составляющему Валютный своп / по Первому договору купли-продажи иностранной валюты ОТС, составляющему Внебиржевой валютный своп ОТС, Участник клиринга обязан передать КЦ иностранную валюту (национальную валюту Российской Федерации), являющуюся валютой неисполненного итогового нетто-обязательства, в количестве, не превышающем количества, в отношении которого итоговое нетто-обязательство не было исполнено, а КЦ обязан передать Участнику клиринга другую валюту в количестве, определенном исходя из суммы неисполненной части итогового денежного обязательства и цены этой валюты. Количество иностранной валюты, являющейся предметом Валютного свопа / Внебиржевого валютного свопа ОТС, устанавливается кратным Лоту, определенному Организатором торговли / Торговой площадкой, с округлением в большую сторону;

Б) по Второму договору купли-продажи иностранной валюты, составляющему Валютный своп / по Второму договору купли-продажи иностранной валюты ОТС, составляющему Внебиржевой валютный своп ОТС, КЦ обязан передать Участнику клиринга иностранную валюту (национальную валюту Российской Федерации), полученную по Первому договору купли-продажи иностранной валюты / по Первому договору купли-продажи иностранной валюты ОТС, в том же количестве, а Участник клиринга обязан принять указанную иностранную валюту (национальную валюту Российской Федерации) и оплатить;

В) КЦ по своему усмотрению определяет валюту, в которой производится оплата за валюту неисполненного итогового нетто-обязательства по денежным средствам. При этом Участник клиринга считается согласившимся заключить Валютный своп / Внебиржевой валютный своп ОТС в отношении такой валюты;

- цена единицы иностранной валюты (национальной валюты Российской Федерации), передаваемой Участником клиринга КЦ по Первому договору купли-продажи иностранной валюты, составляющего Валютный своп / по Первому договору купли-продажи иностранной валюты ОТС, составляющему Внебиржевой валютный своп ОТС, считается равной Цене урегулирования исполнения обязательств по этой валюте;

- цена единицы иностранной валюты (национальной валюты Российской Федерации) по Второму договору купли-продажи иностранной валюты, составляющего Валютный своп / по Второму договору купли-продажи иностранной валюты ОТС, составляющему Внебиржевой валютный своп ОТС, определяется исходя из цены Первого договора купли-продажи иностранной валюты. сроков исполнения обязательств по Первому и Второму договорам купли-продажи иностранной валюты, составляющим Валютный своп / по Первому и Второму договору купли-продажи иностранной валюты ОТС, составляющим Внебиржевой валютный своп ОТС, и Ставки свопа;

- Ставка свопа устанавливается КЦ и раскрывается на Сайте КЦ;

- обязательства по передаче иностранной валюты (национальной валюты Российской Федерации), являющейся предметом Валютного свопа / Внебиржевого валютного свопа ОТС, и их оплате по Первому договору купли-продажи иностранной валюты, составляющему Валютный своп / по Первому договору купли-продажи иностранной валюты ОТС, составляющему Внебиржевой валютный своп ОТС, подлежат исполнению в день заключения соответствующего договора;

- обязательства по передаче иностранной валюты (национальной валюты Российской Федерации), являющейся предметом Валютного свопа / Внебиржевого валютного свопа ОТС, и их оплате по Второму договору купли-продажи иностранной валюты, составляющему Валютный своп / / по Второму договору купли-продажи

иностранной валюты ОТС, составляющему Внебиржевой валютный своп ОТС, подлежат исполнению в Расчетный день, следующий за днем заключения соответствующего договора;

- определение и исполнение обязательств по Валютному свопу / Внебиржевому валютному свопу ОТС, 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 / НФИ:

$$\text{Penalty} = \text{Sum} \times \text{ch_fine_short} \times \left(\frac{T_{365}}{365} + \frac{T_{366}}{366} \right),$$

Б) в случае ненадлежащего исполнения КЦ итогового нетто-обязательства по денежным средствам (при заключении КЦ с добросовестным Участником клиринга Договоров репо, Внебиржевых договоров репо ОТС, Пар договоров):

$$\text{Penalty} = \text{Sum} \times \text{ch_fine_long} \times \left(\frac{T_{365}}{365} + \frac{T_{366}}{366} \right),$$

В) в случае ненадлежащего исполнения КЦ итогового нетто-обязательства по денежным средствам (при заключении КЦ с добросовестным Участником клиринга Валютного свопа / Внебиржевого валютного свопа ОТС):

$$\text{Penalty} = \text{Sum} \times \text{ch_forfeit_rate} \times \left(\frac{T_{365}}{365} + \frac{T_{366}}{366} \right),$$

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, или Первого договора купли-продажи иностранной валюты, составляющего Валютный своп / Первого договора купли-продажи иностранной валюты ОТС, составляющего Внебиржевой валютный своп ОТС, и количества ценных бумаг / НФИ / иностранной валюты (национальной валюты Российской Федерации), 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 / НФИ, включенных в Список ценных бумаг/Список обязательств, в соответствии с Методикой установления и изменения риск-параметров;

ch_forfeit_rate – штрафные ставки, установленные КЦ для каждой валюты, включенной в Список валют, 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, датой исполнения Первого договора, составляющего Пару внебиржевых договоров ОТС, или Датой исполнения Первого договора купли-продажи иностранной валюты, составляющего Валютный своп / Первого договора купли-продажи иностранной валюты ОТС, составляющего Внебиржевой валютный своп 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, датой исполнения Второго договора, составляющего Пару внебиржевых договоров ОТС, или Датой исполнения Второго договора купли-продажи иностранной валюты, составляющего Валютный своп / Второго договора купли-продажи иностранной валюты

ОТС, составляющего Внебиржевой валютный своп 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, датой исполнения Первого договора, составляющего Пару внебиржевых договоров ОТС, или Датой исполнения Первого договора купли-продажи иностранной валюты, составляющего Валютный своп / Первого договора купли-продажи иностранной валюты ОТС, составляющего Внебиржевой валютный своп 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, датой исполнения Второго договора, составляющего Пару внебиржевых договоров ОТС, или Датой исполнения Второго договора купли-продажи иностранной валюты, составляющего Валютный своп / Второго договора купли-продажи иностранной валюты ОТС, составляющего Внебиржевой валютный своп 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, в котором указан Код расчетов ТкТп, Внебиржевого договора репо ОТС, Пары договоров, Валютного свопа или Внебиржевого валютного свопа ОТС.

30.5. В случае невозможности исполнения Участником клиринга своих итоговых нетто-обязательств по денежным средствам / ценным бумагам / НФИ вследствие обстоятельств непреодолимой силы и (или) сбоя в платежной 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 / НФИ.

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 расчете 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 датой исполнения Первого договора, составляющего Пару внебиржевых договоров ОТС, или Первого договора купли-продажи иностранной валюты, составляющего Валютный своп / Первого договора купли-продажи иностранной валюты ОТС, составляющего Внебиржевой валютный своп ОТС, и датой расчета 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, Пары договоров, Валютного свопа или Внебиржевого валютного свопа ОТС 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 / валюты, по которой учитывается итоговое нетто-обязательство, из Списка валют и (или) принятие решения об исключении обязательств, возникших из Внебиржевых договоров репо ОТС или Пар внебиржевых договоров, из Списка обязательств со следующего Расчетного дня;
- консолидации, дробления ценных бумаг, реорганизации эмитента ценных бумаг / лица, выдавшего ценные бумаги / НФИ, в форме слияния, присоединения, выделения

или разделения, изменения параметров ценной бумаги / НФИ, а также получения от Организатора торговли / Торговой площадки 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 / НФИ, о выплате Дохода ценными бумагами / НФИ;

- принятия решения КЦ о незаключении Договора репо, Внебиржевого договора репо ОТС, Пар договоров, Валютный своп, Внебиржевой валютный своп ОТС с обязательным уведомлением Участника клиринга за 4 (четыре) Расчетных 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, Валютного свопа, Внебиржевого валютного свопа ОТС 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, Валютного свопа, Внебиржевого валютного свопа ОТС 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, Валютного свопа, Внебиржевого валютного свопа ОТС;

- цена одной ценной бумаги по Договору / Внебиржевому договору ОТС равна Цене урегулирования исполнения обязательств по данной ценной бумаге / валюте;

- 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, Парой договоров, Валютным свопом, Внебиржевым валютным свопом ОТС.

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 Расчетный день, в который осуществлялось заключение Первого договора, составляющего Пару договоров ($n=0$) или в следующий Расчетный день ($n=1$). Первый договор купли-продажи иностранной валюты, составляющий Валютный своп / Первый договор купли-продажи иностранной валюты ОТС, составляющий Внебиржевой валютный своп ОТС, заключаемый в соответствии с настоящей статьей, исполняется в день его заключения ($k=0$), а Второй договор купли-продажи иностранной валюты / Второй договор купли-продажи иностранной валюты ОТС 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 ТкТп при условии, что исполнение второй части Договора репо осуществляется в Расчетный день, в который осуществлялось заключение Договора репо, либо в Расчетный день, следующий за датой заключения указанного Договора репо;

- Пара биржевых договоров/ Валютный своп заключается на Торгах без подачи Заявок;

- Внебиржевой валютный своп ОТС заключается на Торгах Торговой площадки без подачи Заявок Торговой площадки;

- 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, в который осуществлялось заключение Внебиржевого договора репо ОТС, либо 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.

Донорские договоры, исполнение первой части (Первого договора) и второй части (Второго договора) по которым производится в Расчетный день, в который осуществляется заключение соответствующего Донорского договора, заключаются КЦ только в случае недостаточности у КЦ ценных бумаг для исполнения итогового нетто-обязательства перед добросовестным Участником клиринга.

КЦ вправе по своему усмотрению определить заключить ли с Участником клиринга Донорские договоры, исполнение первой части (Первого договора) и второй части (Второго договора) по которым производится в Расчетный день, в который осуществляется заключение соответствующего Донорского договора или Донорские договоры, исполнение второй части (Второго договора) по которым производится на следующий Расчетный день.

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), а также валюта, включенная в Список валют.

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.

В случае недостаточности у КЦ денежных средств для исполнения нетто-обязательств перед добросовестным Участником клиринга, КЦ может быть также заключен договор, являющийся Донорским валютным свопом / Донорским внебиржевым валютным свопом ОТС. При этом продавцом иностранной валюты (национальной валюты Российской Федерации) по Первому договору купли-продажи иностранной валюты, составляющему Донорский валютный своп / по Первому договору купли-продажи иностранной валюты ОТС, составляющему Донорский внебиржевой валютный своп ОТС является Участник клиринга, а покупателем является КЦ. По Второму договору купли-продажи иностранной валюты, составляющему Донорский валютный своп / по Второму договору купли-продажи иностранной валюты ОТС, составляющему Донорский внебиржевой валютный своп ОТС, продавцом иностранной валюты (национальной валюты Российской Федерации) является КЦ, а покупателем является Участник клиринга.

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 ценных бумаг для исполнения итогового нетто-обязательства перед добросовестным Участником клиринга, КЦ заключает Донорские договоры, являющиеся Договорами репо, Внебиржевыми договорами репо ОТС и (или) Парами договоров.

Донорские договоры, являющиеся Договорами репо, Внебиржевыми договорами репо ОТС и (или) Парами договоров, заключаются КЦ на следующих условиях:

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 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. Для Договоров репо и Пар биржевых договоров указанное количество устанавливается кратным Лоту, определенному Организатором торговли / Торговой площадкой, с округлением в большую сторону;

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 недостаточности у КЦ денежных средств для исполнения итогового нетто-обязательства перед добросовестным Участником клиринга, КЦ заключает Донорские договоры, являющиеся Договорами репо, Внебиржевыми договорами репо ОТС, Парами договоров, Валютным свопом и (или) Внебиржевым валютным свопом ОТС.

Донорские договоры, являющиеся Договорами репо, Внебиржевыми договорами репо ОТС и (или) Парами договоров, заключаются КЦ на следующих условиях:

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. Для Договоров репо и Пар биржевых договоров указанное количество устанавливается кратным Лоту, определенному Организатором торговли / Торговой площадкой, с округлением в большую сторону;

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;

- 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, в который осуществлялось заключение соответствующего договора или в Расчетный день, следующий за днем заключения соответствующего договора. Сроки исполнения обязательств по передаче ценных бумаг и их оплате по второй части соответствующего договора определяются КЦ при его заключении с Участником клиринга;

- определение и исполнение обязательств по Донорскому договору осуществляется в соответствии с настоящими Правилами.

Донорские договоры, являющиеся Валютным свопом / Внебиржевым валютным свопом ОТС, заключаются КЦ на следующих условиях:

А) по Первому договору купли-продажи иностранной валюты, составляющему Валютный своп / по Первому договору купли-продажи иностранной валюты ОТС, составляющему Внебиржевой валютный своп ОТС, Участник клиринга обязан передать КЦ иностранную валюту (национальную валюту Российской Федерации), являющуюся предметом итогового нетто-обязательства КЦ перед добросовестным Участником клиринга, в количестве, определенном исходя из суммы нехватки денежных средств КЦ для исполнения итогового нетто-обязательства перед добросовестным Участником клиринга, а КЦ обязан передать Участнику клиринга другую валюту в количестве, определенном исходя из суммы неисполненной части итогового денежного обязательства и цены этой валюты. Количество иностранной валюты, являющейся предметом Валютного свопа / Внебиржевого валютного свопа ОТС, устанавливается кратным лоту, определенному Организатором торговли / Торговой площадкой, с округлением в большую сторону;

Б) по Второму договору купли-продажи иностранной валюты, составляющему Валютный своп / по Второму договору купли-продажи иностранной валюты ОТС, составляющему Внебиржевой валютный своп ОТС, КЦ обязан передать Участнику клиринга иностранную валюту (национальную валюту Российской Федерации), полученную по Первому договору купли-продажи иностранной валюты / по Первому договору купли-продажи иностранной валюты ОТС, в том же количестве, а Участник клиринга обязан принять указанную иностранную валюту (национальную валюту Российской Федерации) и оплатить;

- цена единицы иностранной валюты (национальной валюты Российской Федерации), передаваемой Участником клиринга КЦ по Первому договору купли-продажи иностранной валюты, составляющего Валютный своп / по Первому договору купли-продажи иностранной валюты ОТС, составляющему Внебиржевой валютный своп ОТС, считается равной Цене урегулирования исполнения обязательств по этой валюте;

- цена единицы иностранной валюты (национальной валюты Российской Федерации) по Второму договору купли-продажи иностранной валюты, составляющего Валютный своп / по Второму договору купли-продажи иностранной валюты ОТС, составляющему Внебиржевой валютный своп ОТС, определяется исходя из цены Первого договора купли-продажи иностранной валюты / Первого договора купли-продажи иностранной валюты ОТС, сроков исполнения обязательств по Первому и Второму договорам купли-продажи иностранной валюты, составляющим Валютный своп / по Первому и Второму договорам купли-продажи иностранной валюты ОТС, составляющим Внебиржевой валютный своп ОТС, и Ставки своп;

- Ставка своп устанавливается КЦ и раскрывается на Сайте КЦ;

- обязательства по передаче иностранной валюты (национальной валюты Российской Федерации). являющейся предметом Валютного свопа / Внебиржевого валютного свопа ОТС, и их оплате по Первому договору купли-продажи иностранной

валюты, составляющему Валютный своп / по Первому договору купли-продажи иностранной валюты ОТС, составляющему Внебиржевой валютный своп ОТС, подлежат исполнению в день заключения соответствующего договора;

- обязательства по передаче иностранной валюты (национальной валюты Российской Федерации), являющихся предметом Валютного свопа / Внебиржевого валютного свопа ОТС, и их оплате по Второму договору купли-продажи иностранной валюты, составляющему Валютный своп / по Второму договору купли-продажи иностранной валюты ОТС, составляющему Внебиржевой валютный своп ОТС, подлежат исполнению в Расчетный день, следующий за днем заключения соответствующего договора;

- определение и исполнение обязательств по Валютному свопу / Внебиржевому валютному свопу ОТС, осуществляется в соответствии с настоящими Правилами.

КЦ уплачивает Участнику клиринга штраф.

Величина штрафа рассчитывается по следующей формуле:

А) в случае недостаточности у КЦ ценных бумаг для исполнения итогового нетто-обязательства перед добросовестным Участником клиринга:

$$\text{Penalty} = \text{Sum} \times \text{ch}_{\text{fine_borrow_security}} \times \left(\frac{T_{365}}{365} + \frac{T_{366}}{366} \right),$$

Б) в случае недостаточности у КЦ денежных средств для исполнения итогового нетто-обязательства перед добросовестным Участником клиринга (при заключении КЦ Донорских договоров, являющихся Договорами репо, Внебиржевыми договорами репо ОТС, Парам договорами):

$$\text{Penalty} = \text{Sum} \times \text{ch}_{\text{fine_borrow_money}} \times \left(\frac{T_{365}}{365} + \frac{T_{366}}{366} \right),$$

В) в случае недостаточности у КЦ денежных средств для исполнения итогового нетто-обязательства перед добросовестным Участником клиринга (при заключении КЦ Донорских договоров, являющихся Валютными свопами / Внебиржевыми валютными свопами ОТС):

$$\text{Penalty} = \text{Sum} \times \text{ch}_{\text{forfeit_rate_borrow_money}} \times \left(\frac{T_{365}}{365} + \frac{T_{366}}{366} \right),$$

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, или Первого договора купли-продажи иностранной валюты, составляющего Валютный своп / Первого договора купли-продажи иностранной валюты ОТС, составляющего Внебиржевой валютный своп ОТС, и количества ценных бумаг / иностранной валюты (национальной валюты Российской Федерации), 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;

ch_forfeit_borrow_money – штрафная ставка, установленная КЦ для каждой валюты, включенной в Список валют, 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, датой

исполнения Первого договора, составляющего Пару внебиржевых договоров ОТС, или Датой исполнения Первого договора купли-продажи иностранной валюты, составляющего Валютный своп / Первого договора купли-продажи иностранной валюты ОТС, составляющего Внебиржевой валютный своп 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, датой исполнения Второго договора, составляющего Пару внебиржевых договоров ОТС, или Датой исполнения Второго договора купли-продажи иностранной валюты, составляющего Валютный своп / Второго договора купли-продажи иностранной валюты ОТС, составляющего Внебиржевой валютный своп 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, датой исполнения Первого договора, составляющего Пару внебиржевых договоров ОТС, или Датой исполнения Первого договора купли-продажи иностранной валюты, составляющего Валютный своп / Первого договора купли-продажи иностранной валюты ОТС, составляющего Внебиржевой валютный своп 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, датой исполнения Второго договора, составляющего Пару внебиржевых договоров ОТС, или Датой исполнения Второго договора купли-продажи иностранной валюты, составляющего Валютный своп / Второго договора купли-продажи иностранной валюты ОТС, составляющего Внебиржевой валютный своп 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, Пары договоров, Валютного свопа или Внебиржевого валютного свопа ОТС.

31.8. КЦ заключает Договоры репо, Пары договоров, Валютный своп или Внебиржевой валютный своп ОТС 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 в 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 Датами 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 Х0, 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 Х0, 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 завершенными. 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 статьей.

Прекращение указанных обязательств осуществляется в порядке, предусмотренном статьей 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 Датами 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 статьей 26 настоящих Правил, с наступившими датами исполнения;

- обязательства по передаче / требования по получению Дохода, определенные в соответствии со статьей 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 статьей 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 статьей 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 на рынке КЦ, для которого зарегистрированы ТКС, на клиринговых регистрах которых учитывались итоговые нетто-обязательства / итоговые нетто-требования, 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 Датойми 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;

- обязательства по уплате суммы, эквивалентной сумме Транзакционного налога, определенной в соответствии со статьей 46 настоящих Правил;

- обязательство по уплате суммы, равной сумме Сбора Торговой площадки, определенной в соответствии со статьей 14 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 расчетов 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

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.

Обязательства по передаче Дохода возникают у покупателя по первой части Договора репо / Внебиржевого договора репо ОТС / Первому договору, составляющему Пару договоров. Требования по получению Дохода возникают у продавца по первой части Договора репо / Внебиржевого договора репо ОТС / Первому договору, составляющему Пару договоров. Обязательства по передаче / требования по получению Дохода определяются по каждому Договору репо / Внебиржевому договору репо ОТС / Паре договоров .

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 / НФИ по первой части соответствующего договора и не исполнено обязательство по передаче ценных бумаг / НФИ 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 / НФИ по Первому договору, составляющему Пару договоров, и не исполнено обязательство по передаче ценных бумаг / НФИ 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, именуется Договорами 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, 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:

$\text{Inc} = \text{ROUND}(N \times d; 2) - \text{ROUND}(N \times d \times tx \times \max((D1 - D2); 0) / D1; 2)$, где:	
Inc	размер обязательства по передаче Дохода;
N	количество ценных бумаг, подлежащих передаче по Договору репо, Внебиржевому договору репо ОТС, Парам договоров (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 НФИ в случае если эмитентом (лицом выдавшим ценную бумагу / НФИ) принято решение о выплате Дохода денежными средствами и (или) ценными бумагами / НФИ (кроме случая, предусмотренного пунктом 37.5 настоящих Правил), размер обязательства по передаче Дохода в форме денежных средств рассчитывается по формуле:

$\text{Inc} = \text{ROUND}(N \times d; 2) - \text{ROUND}(N \times d \times tx; 2)$, где:	
---	--

Inc	размер обязательства по передаче Дохода;
N	количество ценных бумаг / НФИ, подлежащих передаче по Договору репо, Внебиржевому договору репо ОТС, Пары договоров (в штуках);
d	сумма начисления на одну ценную бумагу / НФИ, установленная эмитентом ценных бумаг или иным лицом, обязанным по ценным бумагам / НФИ (в валюте, установленной эмитентом);
tx	налоговая ставка, применимая к доходам в виде дивидендов по ценным бумагам / НФИ в соответствии с налоговым законодательством страны, резидентом которой является эмитент ценной бумаги или иное лицо, обязанное по ценным бумагам / НФИ.

В случае если валюта сумм начислений, установленная эмитентом, отличается от валюты цены Договора репо, Внебиржевого договора репо ОТС, Пары договоров, КЦ вправе принять решение об определении обязательств по передаче Дохода в валюте цены Договора репо, Внебиржевого договора репо ОТС, Пары договоров, 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 «СПБ Клиринг» (акционерное общество), который утверждается КЦ и раскрывается на Сайте КЦ (далее – Регламент налогового администрирования по доходам).

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:

$Inc = ROUND(N \times (n+p); 2)$, 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:

$Inc = ROUND(N \times (n + p); 2) - ROUND(N \times n \times tx; 2)$, 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 / НФИ, в случае если эмитентом (лицом обязанным по ценным бумагам / НФИ) принято решение о выплате Дохода исключительно ценными бумагами / НФИ, размер обязательства по передаче Дохода определяется исходя из следующих условий:

37.5.1. в случае если ценные бумаги / НФИ, которые подлежат передаче в виде Дохода, допущены к Торгам, передача Дохода осуществляется в форме ценных бумаг / НФИ и размер обязательств по передаче указанного Дохода рассчитывается по следующей формуле:

Inc = N × d, где:	
Inc	размер обязательства по передаче Дохода (в штуках);
N	количество ценных бумаг / НФИ, подлежащих передаче по Договору репо, Внебиржевому договору репо ОТС или Пары договоров (в штуках);
d	определенное эмитентом количество ценных бумаг / НФИ, составляющих Доход, в расчете на одну ценную бумагу / НФИ, являющиеся предметом Договора репо или Пары биржевых договоров (в штуках).

37.5.2. в случае если ценные бумаги / НФИ, которые подлежат передаче в виде Дохода, на дату, на которую Расчетный депозитарий производит распределение Дохода по итогам корпоративного события, 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 / НФИ, которая подлежит передаче в виде Дохода. Цена закрытия указанной ценной бумаги / НФИ определяется на последний день, в который торги по ценной бумаге / НФИ проводятся на иностранной бирже с правом получения Дохода приобретателем таких ценных бумаг / НФИ;

37.5.3. в случае если ценные бумаги / НФИ, которые подлежат передаче в виде Дохода, на дату, на которую Расчетный депозитарий производит распределение Дохода по итогам корпоративного события, 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.

37.5.4. Передача указанных в пункте 37.3. и 37.5. Доходов осуществляется с учетом положений Регламента налогового администрирования по доходам.

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 / НФИ 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 / НФИ 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.

37.9. 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 расчетного Договора ПФИ в размере и сроки, определенные условиями этого договора;

- обязательство Продавца по заключению с Покупателем Договора купли-продажи, предметом которого являются ценные бумаги, являющиеся базисным активом по поставочному Договору ПФИ в случае реализации Покупателем по Договору ПФИ, являющемуся Поставочным опционным договором, права на заключение указанного в настоящем абзаце Договора купли-продажи.

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 учете на клиринговых регистрах Участников клиринга.

38.6. Обязательства / требования Участников клиринга и КЦ по передаче / получению суммы денежных средств при исполнении расчетного Договора ПФИ (далее - обязательства / требования по исполнению расчетного Договоров ПФИ) подлежат исполнению в Дату исполнения расчетного Договора ПФИ. Если Спецификацией не установлено иное Дата исполнения расчетного Договора ПФИ приходится на второй Расчетный день после получения КЦ от Участника клиринга, являющегося Покупателем, заявления на исполнение расчетного 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 расчетных Договоров ПФИ КЦ формирует клиринговый пул ПФИ, в который включаются обязательства, возникшие из расчетных Договоров ПФИ и допущенные к клирингу в соответствии со статьей 25 настоящих Правил, с наступившими Датой исполнения. КЦ формирует клиринговый пул ПФИ в срок, установленный Регламентом клиринга.

КЦ включает в клиринговый пул ПФИ:

- обязательства Участников клиринга, являющихся Продавцами по расчетным Договорам ПФИ, и КЦ по денежным средствам в сумме, подлежащей уплате по условиям расчетного Договора ПФИ при его исполнении;

- требования Участников клиринга, являющихся Покупателями по расчетным Договорам ПФИ, и КЦ по денежным средствам в сумме, причитающейся им по условиям расчетного Договора ПФИ при его исполнении.

Обязательства зачитываются со встречными однородными требованиями Участников клиринга по денежным средствам по расчетным 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. КЦ исполняет обязательства/требования по Договорам ПФИ, являющимся Поставочными опционными договорами «в деньгах» в случае если Участником клиринга, являющимся Покупателем по поставочному Договору ПФИ не направлено в КЦ уведомление об отказе от исполнения Договора ПФИ в порядке, определенном пунктом 38.16 настоящих Правил. КЦ исполняет обязательства по поставочным Договорам ПФИ, являющимся Поставочными опционными договорами «около денег» и Поставочными опционными договорами «вне денег» в случае направления Участником клиринга, являющимся Покупателем по поставочному Договору ПФИ, в КЦ заявления на исполнение поставочного Договора ПФИ в порядке, определенном пунктом 38.12 настоящих Правил.

Исполнение указанных в настоящем пункте поставочных Договоров ПФИ осуществляется в дату, определенную Спецификацией соответствующего Договора ПФИ во время, установленное Регламентом клиринга.

В целях настоящей статьи Поставочным опционным договором «в деньгах» именуется поставочный опционный договор, являющийся колл–опционом, Цена исполнения (в целях настоящей статьи и статьи 39 настоящих Правил Ценой исполнения является цена, по которой в соответствии с условиями Договора ПФИ этот договор подлежит исполнению) которого ниже цены, определенной в соответствии с Правилами торговли, ценной бумаги, являющейся базисным активом данного Договора ПФИ, или являющийся пут-опционом, Цена исполнения которого выше цены, определенной в соответствии с Правилами торговли, ценной бумаги, ценной бумаги, являющейся базисным активом данного Договора ПФИ. Поставочным опционным договором «вне денег» именуется поставочный опционный договор, являющийся колл–опционом, Цена исполнения которого выше цены, определенной в соответствии с Правилами торговли, ценной бумаги, ценной бумаги, являющейся базисным активом данного Договора ПФИ, или являющийся пут-опционом, Цена исполнения которого ниже цены, определенной в соответствии с Правилами торговли, ценной бумаги, ценной бумаги, являющейся базисным активом данного Договора ПФИ. Поставочным опционным договором «около денег» именуется поставочный опционный договор, являющийся колл–опционом или пут-опционом, Цена исполнения которого равна цене, определенной в соответствии с Правилами торговли, ценной бумаги, ценной бумаги, являющейся базисным активом данного Договора ПФИ.

38.12. Исполнение поставочных Договоров ПФИ осуществляется в дату, определенную Спецификацией соответствующего Договора ПФИ.

В случаях, предусмотренных Спецификацией, допускается досрочное исполнение поставочных Договоров ПФИ. В этом случае Участник клиринга направляет в КЦ заявление на исполнение поставочного Договора ПФИ по форме и в сроки, определенные Регламентом клиринга. Указанное заявление направляется Участником клиринга в КЦ в

виде электронного сообщения, подписанного АСП, или в виде Электронного документа, подписанного Электронной подписью.

В целях исполнения поставочных Договоров ПФИ, КЦ в Дату исполнения поставочных Договоров ПФИ определяет позицию Участников клиринга по Договорам ПФИ, имеющим одинаковую Цену исполнения в порядке, определенном пунктом 6.4 настоящих Правил и заключает с Участниками клиринга Договор купли-продажи без подачи Заявок с Кодом расчетов Тп.

38.13. В случае, если между Участниками клиринга заключены Поставочные опционные договоры, являющиеся колл–опционами, 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 поставочных Договоров ПФИ, по которым у данного Участника клиринга учитывается обязательство по исполнению поставочного Договора ПФИ;

- КЦ обязан оплатить указанные ценные бумаги по Цене исполнения;

- количество ценных бумаг, подлежащих передаче по Договору купли-продажи, является равным позиции по Договорам ПФИ на момент заключения Договора купли-продажи в отношении Поставочного опционного договора с определенным идентификационным кодом ПФИ, Датой исполнения и Ценой исполнения;

- Договор купли-продажи заключается в Дату исполнения в период до окончания Торгового дня Организатора торговли, на Торгах которого заключается Договор купли-продажи в соответствии с настоящей статьей.

В случае, если между Участниками клиринга заключены Поставочные опционные договоры, являющиеся пут–опционами, КЦ заключает с Участником клиринга - Продавцом по Договорам ПФИ Договор купли-продажи с кодом расчетов Тп на следующих условиях:

- КЦ обязан передать Участнику клиринга ценные бумаги, являющиеся базисным активом поставочных Договоров ПФИ, по которым у данного Участника клиринга учитывается обязательство по исполнению поставочного Договора ПФИ;

- Участник клиринга обязан оплатить указанные ценные бумаги по Цене исполнения;

- количество ценных бумаг, подлежащих передаче по Договору купли-продажи, является равным позиции по Договорам ПФИ на момент заключения Договора купли-продажи в отношении Поставочного опционного договора с определенным идентификационным кодом ПФИ, Датой исполнения и Ценой исполнения;

- Договор купли-продажи заключается в Дату исполнения в период до окончания Торгового дня Организатора торговли, на Торгах которого заключается Договор купли-продажи в соответствии с настоящей статьей.

38.14. В случае, если между Участниками клиринга заключены Поставочные опционные договоры, являющиеся колл–опционами, КЦ заключает с Участником клиринга - Покупателем по Договору ПФИ Договор купли-продажи с Кодом расчетов Тп на следующих условиях:

- КЦ обязан передать Участнику клиринга ценные бумаги, являющиеся базисным активом поставочных Договоров ПФИ, по которым у данного Участника клиринга учитывается требование по исполнению поставочного Договора ПФИ;

- Участник клиринга обязан оплатить указанные ценные бумаги по Цене исполнения;

- количество ценных бумаг, подлежащих передаче по Договору купли-продажи, является равным позиции по Договорам ПФИ на момент заключения Договора купли-продажи в отношении Поставочного опционного договора с определенным идентификационным кодом ПФИ, Датой исполнения и Ценой исполнения;

- Договор купли-продажи заключается в Дату исполнения в период до окончания Торгового дня Организатора торговли, на Торгах которого заключается Договор купли-продажи в соответствии с настоящей статьей.

В случае, если между Участниками клиринга заключены Поставочные опционные договоры, являющиеся пут-опционами, КЦ заключает с Участником клиринга - Покупателем по Договорам ПФИ Договор купли-продажи с Кодом расчетов Tn на следующих условиях:

- Участник клиринга обязан передать КЦ ценные бумаги, являющиеся базисным активом поставочных Договоров ПФИ, по которым у данного Участника клиринга учитывается требование по исполнению поставочного Договора ПФИ;

- КЦ обязан оплатить указанные ценные бумаги по Цене исполнения;

- количество ценных бумаг, подлежащих передаче по Договору купли-продажи, является равным позиции по Договорам ПФИ на момент заключения Договора купли-продажи в отношении Поставочного опционного договора с определенным идентификационным кодом ПФИ, Датой исполнения и Ценой исполнения;

- Договор купли-продажи заключается в Дату исполнения в период до окончания Торгового дня Организатора торговли, на Торгах которого заключается Договор купли-продажи в соответствии с настоящей статьей.

38.15. Договоры купли-продажи, заключенные в соответствии с пунктами 38.13 и 38.14 настоящих Правил, 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.

38.16. Участник клиринга – Покупатель вправе отказаться от исполнения поставочного Договора ПФИ, направив в КЦ соответствующее уведомление по форме, определенной Регламентом клиринга. Указанное уведомление направляется Участником клиринга – покупателем в КЦ в виде электронного сообщения, подписанного АСП, или в виде Электронного документа, подписанного Электронной подписью в срок, определенный Регламентом клиринга.

38.17. 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 и Договоров репо (Внебиржевых договоров репо ОТС) с ЦК без подачи заявок

39.1. В случаях и порядке, предусмотренных настоящей статьей, КЦ заключает с Участниками клиринга Договоры купли-продажи и Договоры РЕПО (Внебиржевые договоры репо ОТС) без подачи заявок.

39.2. При наличии согласия Участника клиринга, являющегося Продавцом по расчетному Договору ПФИ, если данный Участник клиринга был выбран КЦ в качестве контрагента Участника клиринга, являющегося Покупателем по расчетному Договору ПФИ, при получении от указанного Покупателя поручения на исполнение расчетного Договора ПФИ КЦ заключает с Участником клиринга - Продавцом по расчетному Договору ПФИ Договор купли-продажи с кодом расчетов Tn на следующих условиях:

- Участник клиринга обязан передать КЦ ценные бумаги, являющиеся базисным активом расчетных Договоров ПФИ, по которым у данного Участника клиринга учитывается обязательство по исполнению расчетного Договора ПФИ;

- КЦ обязан оплатить указанные ценные бумаги по цене, по которой в соответствии с условиями расчетного Договора ПФИ этот договор подлежит исполнению ;

- количество ценных бумаг, подлежащих передаче по Договору купли-продажи, определяется путем деления размера обязательства Участника клиринга, являющегося Продавцом по расчетному Договору ПФИ, по исполнению соответствующего расчетного 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 расчетного 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. При наличии согласия Участника клиринга, КЦ заключает с указанным Участником клиринга Договор репо, Внебиржевой договор репо ОТС с кодом расчетов ТкТп на следующих условиях:

- по первой части Договора репо, Внебиржевого договора репо ОТС Участник клиринга обязан передать КЦ ценные бумаги, определенные решением КЦ;

- по второй части Договора репо, Внебиржевого договора репо ОТС 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, Внебиржевого договора ОТС считается равной Цене урегулирования исполнения обязательств по этой ценной бумаге;

- цена одной ценной бумаги по второй части Договора репо, Внебиржевого договора репо ОТС определяется исходя из цены одной ценной бумаги по первой части Договора репо, Внебиржевого договора репо ОТС, из сроков исполнения обязательств по передаче ценных бумаг по первой и второй частям Договора репо, Внебиржевого договора репо ОТС 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, Внебиржевого договора репо ОТС подлежат исполнению в день заключения договора;

- обязательства по передаче ценных бумаг и их оплате по второй части Договора репо, Внебиржевого договора репо ОТС подлежат исполнению в Расчетный день, следующий за днем заключения договора;

- предметом Договора репо могут являться исключительно ценные бумаги, включенные в Список ценных бумаг, а предметом Внебиржевого договора репо ОТС – исключительно ценные бумаги, включенные в Список обязательств.

39.5. Заключение указанных в пункте 39.4 настоящих Правил договоров осуществляется с Участниками клиринга, направившими в КЦ согласие на заключение Договоров репо, Внебиржевых договоров репо ОТС 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.

39.6. 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, ТОРГОВОЙ ПЛОЩАДКИ. 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 / Счетов учета НФИ, совершения операций с ценными бумагами, учитываемыми на Субсчетах депо / НФИ, учитываемыми на Счетах учета НФИ, получения информации о движении ценных бумаг / НФИ 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 / Счетов учета НФИ определяется в статье 7 настоящих Правил.

После открытия каждого Субсчета депо Расчетный депозитарий представляет в КЦ уведомление об открытии соответствующего Субсчета депо / Счета учета НФИ.

40.4. За исключением случая закрытия Субсчета депо по инициативе КЦ, закрытие Субсчета депо / Счета учета НФИ в Расчетном депозитарии осуществляется на основании поручения КЦ, при условии предоставления лицом, которому открыт указанный Субсчет депо / Счет учета НФИ, соответствующего заявления.

40.5. КЦ дает поручение на закрытие Субсчета депо / Счета учета НФИ при условии отсутствия открытых позиций по Договорам / Внебиржевым договорам ОТС, учитываемых на регистре учета позиций, и нулевых остатках ценных бумаг / НФИ, учитываемых на ТКС, в который входит закрываемый Субсчет депо / Счет учета НФИ.

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 Депозитарии 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 / Счетов учета НФИ, содержащую информацию о ценных бумагах / НФИ, учитываемых на Субсчетах депо / Счетах учета НФИ. На основании полученных от Расчетного депозитария выписок о состоянии Субсчетов депо / Счетов учета НФИ, КЦ изменяет значения депо регистров.

40.8. Для проведения расчетов по ценным бумагам / НФИ по результатам клиринга КЦ в сроки, установленные в Регламенте клиринга, направляет в Расчетный депозитарий сводное поручение депо / сводное поручение.

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.

Исполнение сводного поручения осуществляется Расчетным депозитарием по Счетам учета НФИ в корреспонденции со Счетом учета НФИ КЦ 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 / Торговой площадкой

41.1. КЦ взаимодействует с Организатором торговли / Торговой площадкой на основании договора.

КЦ уведомляет Организатора торговли / Торговую площадку 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 / Торговой площадке дополнительную информацию.

КЦ направляет уведомления Организатору торговли / Торговой площадке посредством Клиринговой системы в виде электронного сообщения, подписанного АСП, или в виде Электронного документа, подписанного Электронной подписью.

41.2. Организатор торговли / Торговая площадка информирует КЦ о включении / исключении ценной бумаги в / из Список ценных бумаг / Списка ценных бумаг, приостановлении, возобновлении и прекращении Торгов / Торгов Торговой площадки ценной бумагой, а также об установлении и (или) изменении параметров ценной бумаги.

Организатор торговли информирует КЦ о включении / исключении валюты в / из Список валют / Списка валют, приостановлении, возобновлении и прекращении Торгов валютой.

Организатор торговли / Торговая площадка информирует КЦ о присвоении Участнику торгов / Участнику торгов Торговой площадки категории А (как указанная категория определена Правилами допуска к участию в организованных торгах ценными бумагами Организатора торговли). Организатор торговли / Торговая площадка также направляет в КЦ перечень ценных бумаг, в отношении которых Участник клиринга выполняет функции Маркет-мейкера. Уведомление направляется Организатором торговли / Торговой площадкой в виде электронного сообщения, подписанного АСП, или в виде Электронного документа, подписанного Электронной подписью.

Организатор торговли / Торговая площадка вправе предоставлять КЦ дополнительную информацию.

Организатор торговли / Торговая площадка направляет уведомления КЦ в виде Электронного документа, подписанного Электронной подписью, и (или) в бумажном виде.

КЦ не осуществляет клиринг обязательств, возникших из Договоров / Внебиржевых договоров ОТС / Договоров ПФИ, заключенных в отношении ценных

бумаг/ ПФИ/валюты, о допуске к Торгам / Торгам Торговой площадки которых КЦ не был извещен.

41.3. При получении от Организатора торговли / Торговой площадки информации о дате допуска ценной бумаги / ПФИ / валюты к Торгам / Торгам Торговой площадки, начиная с которой возможно заключение Договоров / Внебиржевых договоров ОТС, КЦ устанавливает риск-параметры по этим ценной бумаге/ПФИ/валюте.

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 / Торгов Торговой площадки КЦ передает Организатору торговли / Торговой площадке посредством Клиринговой системы в виде электронного сообщения, подписанного АСП, информацию о Средствах обеспечения Участников клиринга, значения Доступных средств, значения расчетной цены по каждой ценной бумаге/ПФИ/валюте, значения риск – параметров, рассчитываемых в соответствии с Методикой установления и изменения риск – параметров, а также, по согласованию с Организатором торговли / Торговой площадкой, иную дополнительную информацию.

41.5. В случае изменения значений, перечисленных в пункте 41.4 настоящих Правил, КЦ незамедлительно передает Организатору торговли / Торговой площадке указанные измененные значения.

Статья 42. Способы получения и передачи документов при взаимодействии КЦ с Участниками клиринга, Организатором торговли, Торговой площадкой, 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, Торговой площадкой, 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 введённых 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 / НФИ 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 / Торговой площадке, 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 / Торговой площадке 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 / Внебиржевым договорам ОТС, предметом которых являются ценные бумаги / НФИ, 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 / лица, выдавшего ценные бумаги / НФИ.

44.7. В случае если между датой заключения Договора / Внебиржевого договора ОТС и Датой исполнения Договора / Внебиржевого договора ОТС в отношении ценных бумаг / НФИ, которые являются предметом Договора купли-продажи / Договора репо / Внебиржевого договора купли-продажи ОТС / Внебиржевого договора репо ОТС, или базисным активом Договора ПФИ, происходят корпоративные события, включающие в том числе реорганизацию эмитента ценных бумаг / лица, выдавшего ценные бумаги / НФИ, конвертацию и (или) дробление ценных бумаг / НФИ, проводимую без реорганизации эмитента ценных бумаг / лица, выдавшего ценные бумаги / НФИ, или иные действия, влияющие на исполнение обязательств по Договору купли-продажи / Договору репо / Внебиржевому договору купли-продажи ОТС / Внебиржевому договору репо ОТС / Договору ПФИ, в том числе которые приводят к изменению предмета Договора купли-продажи / Договора репо / Внебиржевого договора купли-продажи ОТС / Внебиржевого договора репо ОТС или базисного актива Договора ПФИ, КЦ вправе принять в отношении указанного Договора / Внебиржевого договора ОТС одно из следующих решений:

44.7.1. об изменении КЦ в одностороннем порядке условий Договоров / Внебиржевых договоров ОТС, обязательства по которым не исполнены, и (или) порядка исполнения обязательств по Договорам / Внебиржевым договорам ОТС, с учетом условий реорганизации эмитента ценных бумаг / лица, выдавшего ценные бумаги / НФИ или условий иных действий (событий), происходящих с эмитентом / лицом, выдавшим ценные бумаги / НФИ и (или) ценными бумагами эмитента / НФИ;

44.7.2. о признании наступившей Датой исполнения Договора / Внебиржевого договора ОТС в Расчетный день, предшествующий дню приостановления операций с ценными бумагами / НФИ по счетам депо / Счетам учета НФИ, 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, ценным бумагам и НФИ, учитываемых в отношении денежного регистра / депо регистра / регистра учета НФИ / Субсчета депо / Счета учета НФИ, 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, ценным бумагам и НФИ, учитываемые в отношении денежного регистра/ депо регистра / регистра учета НФИ / Субсчета депо / Счета учета НФИ, относящимся к ТКС Участника клиринга, с которого был осуществлён перевод долга / уступка требований, прекращаются и начинают учитываться в отношении денежного регистра / депо регистра / регистра учета НФИ / Субсчета депо / Счета учета

НФИ, 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 / Заявка Торговой площадки / 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 / Торговую площадку о невозможности регистрации такой Заявки / Заявки Торговой площадки в реестре Заявок / Заявок Торговой площадки, 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, а также обязательств по уплате Транзакционного налога

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 «СПБ Клиринг» (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, полученных в том числе по Договорам ПФИ, 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, полученных в том числе по Договорам ПФИ, 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 по доходам, в порядке, определенном Регламентом налогового администрирования по доходам.

46.3. Права, обязанности и ответственность Участников клиринга при взаимодействии с КЦ при исполнении налоговых обязательств по Доходам, полученным по Ценным бумагам иностранных эмитентов и ПФИ, определены Регламентом налогового раскрытия и Регламентом налогового администрирования по доходам.

46.4. В случаях, указанных в Регламенте налогового администрирования по транзакционным налогам, при заключении Договоров, Внебиржевых договоров ОТС или при иных способах передачи и осуществления прав на ценные бумаги у Участников клиринга возникает обязательство по уплате Транзакционного налога.

В случае заключения Участником клиринга Договора, Внебиржевого договора ОТС, в результате которого у Участника клиринга возникает обязательство по уплате Транзакционного налога, у КЦ и Участника клиринга возникают следующие обязательства:

- у КЦ, действующего от имени Участника клиринга или от имени КЦ, но в интересах Участника клиринга возникает обязательство осуществить фактические и юридические действия по уплате Транзакционного налога (далее – услуги по уплате Транзакционного налога). Конкретный перечень действий КЦ устанавливается Регламентом налогового администрирования по транзакционным налогам;

- у Участника клиринга возникает обязательство по уплате КЦ суммы, эквивалентной сумме Транзакционного налога;

- у Участника клиринга возникает обязательство оплатить КЦ услуги по уплате Транзакционного налога, в размере, порядке и сроки, установленные тарифами КЦ.

Обязательство Участника клиринга по уплате КЦ суммы, эквивалентной сумме Транзакционного налога, допускается к клирингу с момента его возникновения и подлежит включению в клиринговый пул, формируемый в порядке, определенном статьей 35 настоящих Правил. Порядок определения суммы, эквивалентной сумме Транзакционного налога, срок и порядок исполнения обязательства по ее уплате устанавливаются Регламентом налогового администрирования по транзакционным налогам.

Уплата КЦ Транзакционного налога осуществляется в порядке и сроки, установленные Регламентом налогового администрирования по транзакционным налогам

с учетом требований налогового законодательства страны, в которой уплачивается Транзакционный налог.

Участник клиринга обязуется предоставлять в КЦ все документы и информацию, необходимые для надлежащего исполнения КЦ своих обязанностей по уплате Транзакционного налога. Заключение Участником клиринга Договора / Внебиржевого договора ОТС или при иных способах передачи и осуществления прав на ценные бумаги, прямо указанных в Регламенте налогового администрирования по транзакционным налогам, в результате которого у Участника клиринга возникает обязательство по уплате Транзакционного налога, считается заверением Участника клиринга о том, что Участник клиринга уполномочивает КЦ на уплату Транзакционного налога и передает КЦ на хранение документы, подтверждающие расчет и уплату такого налога, а также что Участник клиринга имеет все необходимые разрешения от его клиентов и Субклиентов (включая согласия на обработку и передачу персональных данных клиентов – физических лиц), которые могут потребоваться КЦ для исполнения своих обязанностей уполномоченного агента по уплате Транзакционного налога, в том числе в случае необходимости предоставления ответов и комментариев на запросы налоговых или иных уполномоченных органов, предоставления документов и информации в налоговые или иные уполномоченные органы, проведения проверок налоговыми или иными уполномоченными органами, в иных случаях, связанных с уплатой Транзакционного налога. 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.

Документы, подтверждающие уплату Транзакционного налога Участником клиринга, предоставляются КЦ Участнику клиринга по его требованию в порядке и сроки, установленные Регламентом налогового администрирования по транзакционным налогам.

В случаях, установленных Регламентом налогового администрирования по транзакционным налогам, условия настоящих Правил об уплате КЦ Транзакционного налога не применяются.

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 / Торговой площадки;
- 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, ценных бумагах и НФИ, которые предназначены для исполнения обязательств, допущенных к клирингу;
- документов и (или) информации о денежных средствах, ценных бумагах и НФИ, 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 Участника клиринга

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 Х0, 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 Х0, 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 статьёй 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 / НФИ 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 купли-продажи / Договорам репо, 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, по Договорам купли-продажи иностранной валюты / Валютному свопу / Внебиржевой договор купли-продажи иностранной валюты ОТС / Внебиржевой валютный своп 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 и требования по денежным средствам, ценным бумагам и НФИ 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, определенной 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 / НФИ, в том числе обязательства по передаче Дохода в форме ценных бумаг / НФИ, зачитываются со встречными однородными требованиями по получению ценных бумаг / НФИ, и в части, в которой обязательства не были прекращены зачетом, КЦ определяет итоговые обязательства (требования) Ликвиданта по ценным бумагам / НФИ;

3) итоговые обязательства (требования) Ликвиданта по ценным бумагам / НФИ, определённые в соответствии с подпунктом 2 настоящего пункта, переводятся в валюту расчётов путем умножения количества ценных бумаг / НФИ, 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 / НФИ, 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 / Торгах Торговой площадки и (или) на внебиржевых торгах. В случае невозможности заключения Договоров / Внебиржевых договоров ОТС на торгах Организатора торговли / Торгах Торговой площадки и (или) на внебиржевых торгах КЦ вправе заключать Договоры / Внебиржевые договоры ОТС с Участниками клиринга без подачи Заявок / Заявок Торговой площадки, 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) Расчетных дней с даты определения указанного нетто-обязательства.

Статья 49. Существенные события

49.1. Существенным событием признается следующее событие, наступление которого создаст препятствия в клиринговом обслуживании Участника клиринга / Участников клиринга и (или) будет препятствовать исполнению КЦ своих обязательств перед Участником клиринга / Участниками клиринга:

- решения и действия органов государственной власти, Банка России, иных органов, учреждений и организаций Российской Федерации (в том числе внесение изменений в законодательство Российской Федерации, издание предписания Банка России в отношении КЦ), а также органов государственной власти, регуляторов на финансовом рынке, учреждений и (или) организаций иностранных государств;

- получение сообщения Организатора торговли / Торговой площадки о возникновении событий (обстоятельств), которые могут привести к нарушению клирингового обслуживания Участника клиринга / Участников клиринга;

- прекращение / приостановление оказания услуг со стороны третьих лиц, необходимых для клирингового обслуживания Участника клиринга / Участников клиринга, включая прекращение / приостановление обслуживания клирингового счета депо Расчетным депозитарием и (или) клирингового денежного счета / Банковского счета КЦ Расчетной организацией;

- действия / бездействия банков (включая юридических лиц, являющихся нерезидентами, которые на основании специального разрешения (лицензии или иного основания) уполномоченного органа государства учреждения имеют право осуществлять банковские операции, предусмотренные личным законом такого лица) или небанковских кредитных организаций (включая юридических лиц, являющихся нерезидентами, которые на основании специального разрешения (лицензии или иного основания) уполномоченного органа государства учреждения имеют право осуществлять определенные таким разрешением банковские операции, предусмотренные личным законом данного лица), в том числе в которых Расчетным организациям открыты денежные счета, повлекшие невозможность исполнения КЦ обязательств перед Участником клиринга / Участниками клиринга, определенных по итогам клиринга, а также по возврату денежных средств в иностранной валюте Участнику клиринга / Участникам клиринга по не зависящим от КЦ, Расчетной организации и (или) Участника

клиринга / Участников клиринга причинам, включая случаи введения вышеуказанными организациями специальных режимов переводов денежных средств и (или) ограничений проведения операций с денежными средствами;

- действия / бездействия депозитариев и (или) иностранных учетных институтов, осуществляющих учет и переход прав на ценные бумаги, учитываемые на клиринговом счете депо в Расчетном депозитарии, повлекшие невозможность исполнения КЦ обязательств перед Участником клиринга / Участниками клиринга, определенных по итогам клиринга, а также обязательств по возврату ценных бумаг, учитываемых на клиринговом счете депо, Участнику клиринга / Участникам клиринга по не зависящим от КЦ, Расчетного депозитария и (или) Участника клиринга / Участников клиринга причинам, включая случаи введения вышеуказанными организациями специальных режимов переводов ценных бумаг и (или) ограничений проведения операций с ценными бумагами;

- действия банков (включая юридических лиц, являющихся нерезидентами, которые на основании специального разрешения (лицензии или иного основания) уполномоченного органа государства учреждения имеют право осуществлять банковские операции, предусмотренные личным законом такого лица) или небанковских кредитных организаций (включая юридических лиц, являющихся нерезидентами, которые на основании специального разрешения (лицензии или иного основания) уполномоченного органа государства учреждения имеют право осуществлять определенные таким разрешением банковские операции, предусмотренные личным законом данного лица), в том числе в которых Расчетным организациям открыты денежные счета, повлекшие списание денежных средств в иностранной валюте с клиринговых денежных / Банковских счетов КЦ в Расчетной организации;

- действия депозитариев и (или) иностранных учетных институтов, осуществляющих учет и переход прав на ценные бумаги, учитываемые на клиринговом счете депо в Расчетном депозитарии, повлекшие списание ценных бумаг с клирингового счета депо в Расчетном депозитарии;

- иные обстоятельства, препятствующие клиринговому обслуживанию Участника клиринга / Участников клиринга, которые находятся вне контроля КЦ.

49.2. Признание события существенным осуществляется по решению КЦ. Событие может быть признано существенным в отношении одного или нескольких Участников клиринга.

49.3. В случае признания КЦ наступления существенного события, КЦ предпринимает следующие действия:

- извещает Организатора торговли / Торговую площадку имеющимися доступными средствами связи о возникновении существенного события и о мерах, необходимых, по мнению КЦ, для его устранения;

- извещает Участника клиринга / Участников клиринга, в отношении которых событие признано существенным, Расчетную организацию / Расчетный депозитарий имеющимися доступными ему в данной ситуации средствами связи о возникновении существенного события и предпринимаемых в связи с этим действиях.

49.4 В качестве мер по урегулированию существенного события (при необходимости по согласованию с Банком России и Организатором торговли / Торговой площадкой) КЦ могут быть приняты следующие решения:

49.4.1. об изменении порядка и сроков осуществления документооборота в процессе взаимодействия КЦ с Участниками клиринга, Расчетной организацией, Расчетным депозитарием и Организатором торговли / Торговой площадкой;

49.4.2. о прекращении учета (полностью или в части) ценных бумаг / НФИ / иностранной валюты, определенных решением КЦ, в качестве Средств обеспечения Участника клиринга / Участников клиринга, в отношении которого / которых событие

признано существенным (далее – Блокировка обеспечения Участника клиринга / Участников клиринга);

49.4.3. о прекращении учета (полностью или в части) в качестве Средств обеспечения с одновременным уменьшением обязательств КЦ по возврату ценных бумаг / иностранной валюты, определенных таким решением, Участнику клиринга / Участникам клиринга, в отношении которого / которых событие признано существенным (далее – Списание обеспечения Участника клиринга / Участников клиринга);

49.4.4. об изменении способа, порядка исполнения и (или) Даты исполнения Договора / даты исполнения Внебиржевого договора / даты исполнения Внебиржевого договора ОТС / Даты расчетов Договора ПФИ по обязательствам Участника клиринга / Участников клиринга и (или) КЦ;

49.4.5. об изменении способа, порядка и (или) срока исполнения КЦ обязательства по возврату Участникам клиринга денежных средств / ценных бумаг, определенных таким решением, учитываемых в качестве Средств обеспечения;

49.4.6 о приостановлении / прекращении клирингового обслуживания Участника клиринга / Участников клиринга (при необходимости по согласованию с Банком России и (или) Организатором торговли / Торговой площадкой);

49.4.7. об осуществлении иных действий, направленных на урегулирование существенного события.

Информация о принятых КЦ решениях доводится до Участников клиринга имеющимися доступными ему в каждой конкретной ситуации средствами связи.

После принятия КЦ соответствующих решений по урегулированию существенного события в Клиринговой системе производится корректировка соответствующих клиринговых регистров.

49.5. В решении КЦ, принятом в соответствии с пунктом 49.4.2 настоящих Правил, о Блокировке обеспечения в отношении Участников клиринга указывается сумма иностранной валюты / количество ценных бумаг, которое прекращает учитываться в качестве Средств обеспечения каждого из Участников клиринга, в отношении которых событие признано существенным. КЦ также вправе принять иные решения, необходимые для обеспечения реализации решения о прекращении учета иностранной валюты / ценных бумаг в качестве Средств обеспечения Участников клиринга.

После прекращения обстоятельств, являющихся основанием признания события существенным, КЦ принимает решение о возобновлении учета (полностью или в части) в качестве Средств обеспечения иностранной валюты / ценных бумаг, учет которой(-ых) в качестве Средств обеспечения Участников клиринга ранее был прекращен решением КЦ, принятым в соответствии с пунктом 49.4.2 настоящих Правил (далее - Снятие блокировки обеспечения Участников клиринга).

49.5.1. Сумма иностранной валюты, учет которой в качестве Средств обеспечения Участников клиринга прекращен решением КЦ, принятым в соответствии с пунктом 49.4.2 настоящих Правил, распределяется и учитывается КЦ на Блокировочных регистрах, открытых КЦ в рамках тех же ТКС, на которых на момент начала Блокировки обеспечения Участников клиринга иностранная валюта учитывалась в качестве Средств обеспечения. Одновременно с началом учета иностранной валюты на Блокировочном регистре ТКС на соответствующую сумму уменьшается сумма денежных средств в этой иностранной валюте, учитываемая на денежном регистре того же ТКС.

49.5.2. Количество ценных бумаг, учет которых в качестве Средств обеспечения Участников клиринга прекращен решением КЦ, принятым в соответствии с пунктом 49.4.2. настоящих Правил, распределяется и переводится Расчетным депозитарием по поручению КЦ с раздела «Торговый» на раздел «Неторговый» субсчетов депо, открытых Участникам клиринга в рамках клирингового счета депо, на которых на момент начала Блокировки обеспечения Участников клиринга ценные бумаги учитывалась в качестве Средств обеспечения. Одновременно с переводом ценных бумаг на раздел «Неторговый»

субсчета депо, открытого Участнику клиринга в рамках клирингового счета депо, на соответствующее количество уменьшается количество ценных бумаг, учитываемых на депо регистре ТКС, зарегистрированного с указанием такого субсчета депо.

В случае если решением КЦ предусматривается прекращение учета в качестве Средств обеспечения НФИ, учитываемых на Счетах учета НФИ Участников клиринга, открытых в Расчетном депозитарии, на соответствующее количество уменьшается количество НФИ, учитываемых на депо регистре ТКС, зарегистрированного с указанием такого Счета учета НФИ.

49.5.3. Снятие блокировки обеспечения Участника клиринга в иностранной валюте в размере суммы, определенной решением КЦ о Снятии блокировки обеспечения Участников клиринга, осуществляется путем прекращения учета указанной суммы на Блокировочном регистре ТКС с одновременным увеличением на указанную сумму значения денежного регистра на том же ТКС.

49.5.4. Снятие блокировки обеспечения Участника клиринга в ценных бумагах в количестве, определенном решением КЦ о Снятии блокировки обеспечения Участников клиринга, осуществляется путем перевода указанного количества ценных бумаг Расчетным депозитарием по поручению КЦ с раздела «Неторговый» на раздел «Торговый» субсчета депо, открытого Участнику клиринга в рамках клирингового счета депо, с одновременным увеличением на указанное количество ценных бумаг значения депо регистра ТКС, зарегистрированного с указанием такого субсчета депо.

Снятие блокировки обеспечения Участника клиринга в НФИ в количестве, определенном решением КЦ о Снятии блокировки обеспечения Участников клиринга, осуществляется путем зачисления соответствующего количества НФИ на депо регистр ТКС, зарегистрированного с указанием Счета учета НФИ.

49.6. В решении КЦ, принятом в соответствии с пунктом 49.4.3 настоящих Правил, о Списании обеспечения Участников клиринга указывается сумма иностранной валюты / количество ценных бумаг, которая(-о) прекращает учитываться в качестве Средств обеспечения с одновременным уменьшением обязательства КЦ по возврату каждому из Участников клиринга, в отношении которых событие признано существенным.

49.6.1. Сумма иностранной валюты, указанная в решении КЦ, принятым в соответствии с пунктом 49.4.3 настоящих Правил, распределяется КЦ и уменьшает значения денежных и (или) Блокировочных регистров ТКС, на которых на момент начала Списания обеспечения Участников клиринга учитывалась иностранная валюта, с одновременным уменьшением на соответствующую величину обязательства КЦ по возврату иностранной валюты Участникам клиринга.

49.6.2. Количество ценных бумаг, указанных в решении КЦ, принятым в соответствии с пунктом 49.4.3 настоящих Правил, распределяется КЦ и списывается Расчетным депозитарием по поручению КЦ с раздела «Торговый» и (или) с раздела «Неторговый» субсчетов депо, открытых Участникам клиринга в рамках клирингового счета депо, с одновременным уменьшением на соответствующую величину обязательства КЦ по возврату ценных бумаг Участникам клиринга.

49.7. Маржинальное требование и (или) Задолженность Участника клиринга, в отношении которого событие признано существенным, в том числе возникшие в результате признания события существенным в отношении такого Участника клиринга и (или) исполнения мер по урегулированию существенного события, принятых КЦ, должны быть исполнены Участником клиринга в порядке и сроки, установленные настоящими Правилами.

49.8. В случае неисполнения Участником клиринга, в отношении которого событие признано существенным, обязательств, предусмотренных настоящими Правилами, в том числе возникших в результате признания события существенным в отношении такого Участника клиринга и (или) исполнения мер по урегулированию

существенного события, принятых КЦ, КЦ урегулирует данные неисполненные обязательства в порядке, предусмотренном настоящими Правилами, в том числе использует уровни защиты центрального контрагента, предусмотренные настоящими Правилами об ограничении размера ответственности КЦ, а также уменьшение размера обязательства по возврату Средств обеспечения Добросовестным Участникам клиринга на сумму, равную оставшейся непогашенной Задолженности Должника, предусмотренное настоящими Правилами.

49.9. При принятии решений по урегулированию существенных событий (при необходимости по согласованию с Организатором торговли / Торговой площадкой) КЦ вправе:

- устанавливать сроки и порядок исполнения своих решений Участником клиринга / Участниками клиринга;
- обуславливать порядок вступления в силу своих решений определенными обстоятельствами.

49.10. О мерах, предпринятых по решению КЦ в целях урегулирования существенного события, Участник клиринга / Участники клиринга, в отношении которых событие признано существенным, Организатор торговли / Торговая площадка и Банк России (при необходимости) оповещаются имеющимися доступными средствами связи не позднее дня принятия данных мер.

49.11. КЦ освобождается и не несет ответственности за убытки, которые могут возникнуть в связи с неосуществлением клирингового обслуживания Участника клиринга / Участников клиринга в соответствии с настоящими Правилами / неисполнением своих обязательств перед Участником клиринга / Участниками клиринга в соответствии с настоящими Правилами / применением мер по урегулированию существенного события в случае признания события существенным в связи с обстоятельствами, предусмотренными пунктом 0 настоящих Правил.