

Приложение 1
к Регламенту осуществления клиринговой деятельности
на рынке финансовых инструментов
НКО-ЦК «СПБ Клиринг» (АО)

Временной регламент КЦ

1. Временной регламент проведения клиринга

Далее по тексту используются следующие понятия и термины:

То – время начала основной торговой сессии;

Тс – время окончания основной торговой сессии;

Тд – время окончания торгового дня;

Тр – время окончания периода заключения Договоров в Режиме торгов Аукцион по размещению,

Режиме торгов Адресное размещение, Режиме торгов Аукцион по выкупу и Режиме торгов Адресный выкуп, установленное Организатором торговли/Торговой площадкой.

НАИМЕНОВАНИЕ ОПЕРАЦИИ	Московское время	Время г. Астана, Республика Казахстан
1. Операции со средствами клирингового обеспечения		
Прием поручений Участников клиринга на зачисление ценных бумаг на Субсчета депо, открытые в Расчетном депозитарии*	до 17:45 часов Расчетного дня ¹	до 20:45 часов Расчетного дня ¹
Прием поручений Участников клиринга на списание ценных бумаг с Субсчетов депо, открытых в Расчетном депозитарии*	с То до 16:00	с То до 19:00
Прием поручений от Участников клиринга на перевод ценных бумаг между Субсчетами депо, открытыми в Расчетном депозитарии*	с То до 16:00	с То до 19:00
Зачисление денежных средств на ТКС Участника клиринга при получении от Расчетной организации информации о зачислении средств на Клиринговый денежный счет в НКО АО НРД: **		
• В рублях РФ	с То до 19:00	-
• В иностранной валюте: понедельник - четверг пятница	с То до 13:00 с То до 12:00	-
Зачисление денежных средств на ТКС Участника клиринга при получении от Расчетной организации информации о зачислении средств на Клиринговый денежный счет (за исключением НКО АО НРД)	В течение Расчетного дня	В течение Расчетного дня
Прием заявлений Участников клиринга на вывод денежных средств, являющихся Средствами обеспечения**	с То до 16:00	с То до 13:00
Прием заявлений Участников клиринга на замену валюты денежных средств, учитываемых в качестве Средства обеспечения **	с То до 16:00	с То до 19:00
Прием уведомлений о переводе долга, уступке требований и передаче имущества, от одного Участника клиринга другому Участнику клиринга	с То до 16:00	Не используется
Прием поручений Участников клиринга на регистрацию счетов для вывода денежных средств и ценных бумаг	с То до 18:00	с То до 21:00
Проведение действий по переводу долга/уступке требований и передаче имущества от одного Участника клиринга другому Участнику клиринга	с (Тс+1) до То следующего Расчетного дня	Не используется
Прием поручений Участников клиринга на перевод денежных средств между рынками ****	с То до 10:00	с То до 13:00
2. Операции, связанные с управлением рисками		
Процедура контроля обеспечения	с То до Тд	с То до Тд
Проведение Клиринговой сессии: установление риск-параметров, расчет Гарантийного обеспечения, Дополнительного обеспечения, расчет значений Доступных средств, предъявление Маржинальных требований	11:30 до 11:50	14:30 до 14:50
Срок исполнения Маржинального требования	до 16:00 Расчетного дня, в котором возникло Маржинальное	до 19:00 Расчетного дня, в котором возникло Маржинальное требование

	требование	
Проведение процедуры принудительного закрытия позиций	С момента окончания срока, отведенного под исполнение Маржинального требования, и до момента прекращения данного требования	С момента окончания срока, отведенного под исполнение Маржинального требования, и до момента прекращения данного требования
3. Операции, связанные с проведением клиринга и расчетов по итогам клиринга***		
3.1. Формирование клирингового пула по обязательствам, возникшим из Договоров, Внебиржевых договоров ОТС, Внебиржевых договоров репо ОТС и Пар договоров, и формирование расчетного клирингового пула		
Предоставление Участниками клиринга ценных бумаг/денежных средств, необходимых для исполнения обязательств, возникших из Договоров с наступившими Датами исполнения, Внебиржевых договоров ОТС с наступившими датами исполнения	До 16:00	До 19:00
Определение итоговых нетто-обязательств и нетто-требований по обязательствам, возникшим из Договоров с наступившими Датами исполнения, Внебиржевых договоров ОТС с наступившими датами исполнения	с 16:00 до 22:00	с 19:00 до 01:00
Направление добросовестным Участникам клиринга уведомлений о проведении действий по урегулированию ненадлежащего исполнения обязательств в соответствии с п. 30.4.2 Правил клиринга.	с 16:00 до 20:00	с 19:00 до 23:00
Проведение расчетов по итоговым нетто-обязательствам и нетто-требованиям, определенным по обязательствам, возникшим из Договоров с наступившими Датами исполнения, Внебиржевых договоров ОТС с наступившими датами исполнения.	с 16:00 до 22:00	с 19:00 до 01:00
3.2. Формирование клирингового пула по внутриброкерским Договорам		
Определение итоговых нетто-обязательств и нетто-требований по Внутриброкерским Договорам с наступившими Датами исполнения	с 18:30 до 20:00 с 20:00 до 00:00	с 21:30 до 23:00 с 23:00 до 03:00
3.3. Формирование клирингового пула по Договорам размещения и Выкупа		
Определение итоговых нетто-обязательств и нетто-требований по Договорам, в которых указан Код расчетов Х0 и Код расчетов W0, с наступившими Датами исполнения	с Тр до 18:00	Не используется
Проведение расчетов по итоговым нетто-обязательствам и нетто-требованиям по Договорам, в которых указан Код расчетов Х0 и Код расчетов W0, с наступившими Датами исполнения	с (Тр+2) до 10:00 следующего Расчетного дня	Не используется
3.4. Формирование клирингового пула по договорам, заключаемым без участия Центрального контрагента		
Определение итоговых нетто-обязательств и нетто-требований по Договорам, в которых указан Код расчетов Оп и Код расчетов OkOp, с наступившими Датами исполнения, а также по Внебиржевым договорам с наступившими датами исполнения	с 18:30 до Тс	Не используется
Срок, предназначенный для урегулирования неисполнения итоговых нетто-обязательств Участниками клиринга контрагентами по Внебиржевым договорам	В течение 10 Расчетных дней с даты получения КЦ уведомления о неисполнении	Не используется
3.5. Формирование клирингового пула по Договорам с полным обеспечением с ЦК и клирингового пула по Договорам с полным обеспечением без ЦК		

*Регламент осуществления клиринговой деятельности на рынке финансовых инструментов
Небанковской кредитной организации-центрального контрагента «СПБ Клиринг» (акционерное общество)*

Определение итоговых нетто-обязательств и нетто-требований по Договорам, в которых указан Код расчетов У0, и Договорам, в которых указан Код расчетов У0, с наступившими Датами исполнения	с 16:00 до 22:00	с 19:00 до 01:00
Проведение расчетов по итоговым нетто-обязательствам и нетто-требованиям по Договорам, в которых указан Код расчетов У0, и Договорам, в которых указан Код расчетов У0, с наступившими Датами Исполнения	с 16:00 до 22:00	с 19:00 до 01:00
3.6. Формирование клирингового пула для расчетов по итогам торгов		
Определение итоговых нетто-обязательств и нетто-требований по денежным средствам	с 19:00 до 23:00	с 22:00 до 02:00
3.7. Формирование клирингового пула для расчетов по Премии	Не формируется	Не формируется
3.8. Формирование клирингового пула ПФИ	Не формируется	Не формируется
3.9. Формирование клирингового пула для расчетов по Вариационной марже	Не формируется	Не формируется
3.10. Формирование ликвидационного клирингового пула по обязательствам с участием центрального контрагента	При возникновении оснований, предусмотренных статьей 48 Правил клиринга	При возникновении оснований, предусмотренных статьей 48 Правил клиринга
3.11. Формирование ликвидационного клирингового пула по обязательствам без участия центрального контрагента	При возникновении оснований, предусмотренных статьей 48 Правил клиринга	При возникновении оснований, предусмотренных статьей 48 Правил клиринга
4. Направление клиринговых отчетов и уведомлений Участникам клиринга***		
Содержат окончательную информацию за расчетный день.		
Направление клиринговых отчетов и уведомлений Участникам клиринга	до 00:00	до 03:00
Направление Участникам клиринга уведомлений о проведении действий по определению итоговых нетто-обязательств / итоговых нетто-требований в соответствии с пунктом 29.12 Правил клиринга	с 16:00 до 00:00	с 19:00 до 03:00
Направление Участникам клиринга клирингового отчета о Гарантийном обеспечении, Маржинальном требовании и Задолженности (MFB14) по итогам проведенной Клиринговой сессии	с 11:50 до 12:30	с 14:50 до 15:30
Направление Участниками клиринга-контрагентами по Внебиржевым договорам Отчетов об исполнении / Уведомлений о неисполнении в КЦ	В течение 10 Расчетных дней с даты исполнения / отказа в исполнении итоговых нетто-Обязательств	В течение 10 Расчетных дней с даты исполнения / отказа в исполнении итоговых нетто-Обязательств
Промежуточные отчеты и уведомления:		
MFB98A- Уведомление о размере обязательств/требований по передаче Дохода.	с 06:00 до 07:00	с 09:00 до 10:00
Содержат промежуточную информацию на время формирования отчетов. Формируются списку Участников, заключающим сделки внутриброкерского репо в период до 22:00 часов (московское время), до 01-00 . время г. Астана Республика Казахстан)		
MFB06 -Отчет об обязательствах, допущенных в клиринг (Выписка из реестра договоров, принятых в клиринг)	с 22:00 до 23:00	с 01:00 до 02:00
MFB06С- Выписка из реестра договоров, принятых в клиринг (по договорам, заключенным за счет и по поручению клиентов Участника клиринга);		
MFB23- Отчет об обязательствах по договорам		
MFB23С- Уведомление об обязательствах по Договорам (по договорам, заключенным за счет и по поручению клиентов Участника клиринга);		
MFB15 -Отчет по обязательствам Участника клиринга по комиссионному вознаграждению.		

[†] Расчетный день продолжается в течение временного интервала, начиная с 19 ч. 00 мин. предыдущего Торгового дня до 19 ч. 00 мин. текущего Торгового дня.(московское время) с 21 ч. 00 мин предыдущего Торгового дня до 21 ч. 00 мин.текущего

Торгового дня (время г. Астана Республика Казахстан)

* Для **списания ценных бумаг** с Субсчета депо, открытого в Расчетном депозитарии и перевода ценных бумаг между Субсчетами депо, открытыми в Расчетном депозитарии (операция с типом списание) (в случае если выводимые ценные бумаги должны быть использованы для исполнения обязательств Участника клиринга по итогам клиринга), Участнику клиринга необходимо во временной интервал с То до 18 ч. 00 мин.(московское время), до 21 ч. 00 мин (время г. Астана Республика Казахстан) Расчетного дня, предшествующего планируемому дате вывода, направить в КЦ в свободной форме уведомление о планируемом выводе ценных бумаг, учитываемых в качестве Средств обеспечения, под вывод следующего Расчетного дня, содержащее информацию о количестве выводимых ценных бумаг. Все уведомления, поступившие в КЦ после 18 ч. 00 мин. (московское время), после 21 ч. 00 мин (время г. Астана Республика Казахстан) предыдущего Расчетного дня, принимаются в обработку в течение следующего Расчетного дня.

Обработка поручений на зачисление, списание и перевод ценных бумаг осуществляется КЦ в срок, не превышающий 3 (трех) рабочих дней. В связи с недружественными действиями иностранных государств и международных организаций и последовавшими за этими действиями ограничительными мерами в отношении участников клиринга, повлекшими за собой повышение операционной нагрузки на КЦ при осуществлении клиринговой деятельности, срок выполнения операций может быть увеличен.

** При подаче в КЦ поручений на **вывод денежных средств**, являющихся Средствами обеспечения, на сумму, превышающую 3 000 000 (Три миллиона) долларов США / 2 000 000 (Два миллиона) рублей / 1 000 000 (Один миллион) Евро, Участнику клиринга необходимо во временной интервал с То до 16 ч. 00 мин. (московское время), до 19 ч. 00 мин (время г. Астана Республика Казахстан) Расчетного дня, предшествующего планируемому дате вывода, направить в КЦ в свободной форме уведомление о планируемом выводе денежных средств, учитываемых в качестве Средств обеспечения, содержащее информацию о сумме выводимых средств. Все уведомления, поступившие в КЦ после 16 ч. 00 мин. (московское время), после 19 ч. 00 мин (время г. Астана Республика Казахстан) Расчетного дня, принимаются в обработку в течение следующего рабочего дня.

Обработка вывода денежных средств осуществляется КЦ в срок до 5 (пяти) рабочих дней с даты получения указанного выше уведомления (обработка уведомлений, полученных после 16 ч. 00 мин.(московское время), после 13 ч. 00 мин (время г. Астана Республика Казахстан) Расчетного дня, начинается со следующего рабочего дня). В связи с недружественными действиями иностранных государств и международных организаций и последовавшими за этими действиями ограничительными мерами в отношении участников клиринга, повлекшими за собой повышение операционной нагрузки на КЦ при осуществлении клиринговой деятельности, срок выполнения операций может быть увеличен.

Срок обработки заявлений Участников клиринга на замену валюты денежных средств, учитываемых в качестве Средств обеспечения, составляет до 5 (пяти) рабочих дней.

Поручения и иные необходимые по операциям документы, представленные в КЦ после времени, указанного в настоящем Регламенте, могут быть приняты КЦ в обработку и переданы вышестоящим организациям на исполнение в течение следующего Расчетного дня. При этом сроки исполнения операций вышестоящими организациями определяются внутренними документами вышестоящих организаций.

Все **иные операции** по передаче/получению документов, предусмотренных Правилами клиринга, но не упомянутых в таблице, приведенной выше, передаются в КЦ и/или предоставляются со стороны КЦ в рабочие дни с То до (Тс-1 час).

Документы, подтверждающие исполнение операции от Расчетного депозитария/Расчетной организации, обрабатываются КЦ в дату получения подтверждающих документов от Расчетного депозитария / Расчетной организации, если иное не установлено внутренними документами КЦ.

Документы, подтверждающие исполнение операции по зачислению денежных средств Участника клиринга в рублях РФ на Клиринговый денежный счет, открытый в НКО АО НРД, полученные после 19 ч. 00 мин. (московское время), обрабатываются КЦ на следующий рабочий день (не применимо для рынка Казахстан).

Документы, подтверждающие исполнение операции по зачислению денежных средств Участника клиринга в иностранной валюте на Клиринговый денежный счет, открытый в НКО АО НРД, полученные после 13 ч. 00 мин. (московское время) с понедельника по четверг и после 12 ч. 00 мин (московское время) в пятницу, обрабатываются КЦ на следующий рабочий день (не применимо для рынка Казахстан).

*** В связи с недружественными действиями иностранных государств и международных организаций и последовавшими за этими действиями ограничительными мерами в отношении участников клиринга, повлекшими за собой повышение операционной нагрузки на КЦ при осуществлении клиринговой деятельности, срок выполнения операций может быть увеличен.

**** Обработка перевода денежных средств осуществляется КЦ в срок до 5 (пяти) рабочих дней с даты получения заявления (обработка заявлений, полученных после 10 ч. 00 мин.(московское время), после 13 ч. 00 мин (время г. Астана Республика Казахстан) Расчетного дня, начинается со следующего рабочего дня. В связи с недружественными действиями иностранных государств и международных организаций и последовавшими за этими действиями ограничительными мерами в отношении участников клиринга, повлекшими за собой повышение операционной нагрузки на КЦ при осуществлении клиринговой деятельности, срок выполнения операций может быть увеличен.