**УТВЕРЖДЕНО**

**Советом директоров**

**Публичного акционерного общества**

**“Клиринговый центр МФБ”**

**(протокол № 6/72/2015 от 25.08.2015)**

ПРАВИЛА ОСУЩЕСТВЛЕНИЯ  
КЛИРИНГОВОЙ ДЕЯТЕЛЬНОСТИ  
на рынке ценных бумаг

Публичного акционерного общества

“Клиринговый центр МФБ”

ОГЛАВЛЕНИЕ

[РАЗДЕЛ I. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ 4](#_Toc434318916)

[Статья 1. Определения 4](#_Toc434318917)

[Статья 2. Общие положения 6](#_Toc434318918)

[Статья 3. Порядок проведения клиринга 7](#_Toc434318919)

[Статья 4. Взаимодействие КЦ с Организатором торговли, Расчетной организацией, Расчетным депозитарием и техническим центром 8](#_Toc434318920)

[Статья 5. Общие правила использования информации 8](#_Toc434318921)

[Статья 6. Клиринговые регистры 9](#_Toc434318922)

[Статья 7. Виды торговых и клиринговых счетов 12](#_Toc434318923)

[РАЗДЕЛ II. ПРАВА И ОБЯЗАННОСТИ КЦ И УЧАСТНИКОВ КЛИРИНГА. ТРЕБОВАНИЯ К УЧАСТНИКАМ КЛИРИНГА 18](#_Toc434318924)

[Статья 8. Права, обязанности и ответственность КЦ и Участников клиринга 18](#_Toc434318925)

[Статья 9. Требования к Участникам клиринга, допущенным к клиринговому обслуживанию 19](#_Toc434318926)

[Статья 10. Регистрация в качестве Участника клиринга 20](#_Toc434318927)

[Статья 11. Требования к Участникам клиринга по предоставлению финансовой отчетности в КЦ и их финансовой устойчивости 22](#_Toc434318928)

[Статья 12. Допуск к клиринговому обслуживанию, приостановление, возобновление и прекращение допуска к клиринговому обслуживанию 23](#_Toc434318929)

[Статья 13. Порядок оплаты услуг КЦ, Организатора торговли и технического центра 24](#_Toc434318930)

[РАЗДЕЛ III. МЕРЫ, НАПРАВЛЕННЫЕ НА УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ 26](#_Toc434318931)

[Статья 14. Способы снижения рисков при осуществлении клиринга 26](#_Toc434318932)

[Статья 15. Обеспечение исполнения обязательств Участников клиринга. Условия соглашения об индивидуальном клиринговом обеспечении и коллективном клиринговом обеспечении. 26](#_Toc434318933)

[Статья 16. Порядок расчета величины Доступных средств 28](#_Toc434318934)

[Статья 17. Гарантийные фонды 29](#_Toc434318937)

[РАЗДЕЛ IV. ПОРЯДОК ПРОВЕДЕНИЯ КЛИРИНГА 30](#_Toc434318938)

[Статья 18. Порядок взаимодействия с Организатором торговли при подаче Заявок и заключении Договоров. Прием Поручений на клиринг внебиржевых договоров. Порядок и условия допуска обязательств к клирингу. 30](#_Toc434318939)

[Статья 19. Маржинальные требования 32](#_Toc434318940)

[Статья 20. Порядок внесения, использования и возврата Средств обеспечения 34](#_Toc434318941)

[Статья 21. Порядок внесения и возврата взноса в Гарантийные фонды 38](#_Toc434318942)

[Статья 22. Порядок формирования клиринговых пулов. Порядок исполнения / прекращения обязательств, допущенных к клирингу 39](#_Toc434318943)

[Статья 23. Порядок урегулирования ненадлежащего исполнения обязательств 47](#_Toc434318945)

[Статья 24. Порядок использования и возмещения Гарантийных фондов. 51](#_Toc434318946)

[Статья 25. Договор репо КЦ 53](#_Toc434318947)

[Статья 26. Порядок передачи Доходов по Договорам репо 54](#_Toc434318948)

[Статья 27. Действия, направленные на исполнение обязательств Участников клиринга 57](#_Toc434318949)

[Статья 28. Порядок формирования клирингового пула для расчетов по итогам Торгов. Порядок исполнения / прекращения обязательств по расчетам по итогам Торгов. 61](#_Toc434318950)

[Статья 29. Задолженность по денежному регистру 62](#_Toc434318951)

[РАЗДЕЛ V. ПОРЯДОК И СПОСОБЫ ВЗАИМОДЕЙСТВИЯ КЦ, УЧАСТНИКОВ КЛИРИНГА, РАСЧЕТНОЙ ОРГАНИЗАЦИИ, РАСЧЕТНОГО ДЕПОЗИТАРИЯ, ОРГАНИЗАТОРА ТОРГОВЛИ. ОТЧЕТЫ КЦ 64](#_Toc434318952)

[Статья 30. Порядок взаимодействия КЦ с Расчетной организацией, Расчетным депозитарием 64](#_Toc434318953)

[Статья 31. Порядок взаимодействия КЦ с Организатором торговли 65](#_Toc434318954)

[Статья 32. Способы получения и передачи документов при взаимодействии КЦ с Участниками клиринга, Организатором торговли, Расчетным депозитарием и Расчетной организацией 65](#_Toc434318955)

[Статья 33. Отчеты КЦ и иная информация, которую КЦ вправе предоставлять Участникам клиринга 66](#_Toc434318956)

[РАЗДЕЛ VI. ПРОЧИЕ УСЛОВИЯ 68](#_Toc434318957)

[Статья 34. Порядок действия КЦ при операциях с ценными бумагами вследствие корпоративных событий 68](#_Toc434318958)

[Статья 35. Хранение и учет документов и информации внутреннего учета 69](#_Toc434318959)

[Статья 36. Порядок урегулирования неисполненных обязательств в случае прекращения клирингового обслуживания 70](#_Toc434318960)

Приложение 1. Перечень документов, необходимых для регистрации Заявителя в качестве Участника клиринга 74

Приложение 2. Тарифы за клиринговые услуги 75

Приложение 3. Финансовая отчетность, предоставляемая участниками клиринга в КЦ и сроки ее предоставления 78

1. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ
   * 1. Определения

**Аналог собственноручной подписи/АСП** – реквизит электронного сообщения, направляемого с использованием Клиринговой системы, позволяющий идентифицировать лицо, направившего 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.

**Банк -** Участник клиринга, который является кредитной организацией, включенный в перечень, утвержденный КЦ и опубликованный на Сайте КЦ, с которым Участники клиринга заключают Конверсионные договоры.

**Валюта Доступных средств –** российские рубли и/или иностранная валюта, указанная Участником клиринга для расчета Доступных средств.

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

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

**Депозитарий –** организация, на имя которой открыт Торговый счет депо/Субсчет депо номинального держателя, которая осуществляет депозитарное обслуживание Участника клиринга и (или) клиентов Участника клиринга.

**Договор –** Договор купли-продажи ценных бумаг или Договор репо, заключаемый на Торгах в соответствии с Правилами торгов и настоящими Правилами.

**Доступные средства** - сумма, выраженная в Валюте Доступных средств, рассчитываемая КЦ, используемая для ограничения рисков Участника клиринга.

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

**Задолженность** - Маржинальное требование к Участнику клиринга, не исполненное после применения к такому Участнику клиринга процедуры принудительного закрытия позиций.

**Имя** – пользовательское имя (логин), представляющее собой уникальное условное обозначение, однозначно определяющее Участника клиринга/КЦ, присвоенное Участнику клирингу/КЦ в целях осуществления операций в Клиринговой системе.

**Клиринговая система** – совокупность вычислительных средств, программного обеспечения, баз данных, телекоммуникационных средств и другого оборудования, используемых КЦ, обеспечивающая возможность поддержания, хранения, обработки и раскрытия информации, необходимой для оказания КЦ клиринговых услуг.

**Клиринговый денежный счет -** клиринговый банковский счет, открытый КЦ в кредитной организации, на котором учитываются 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, клиента и (или) клиента клиента Участника клиринга и (или) КЦ, которые могут быть использованы для исполнения и (или) обеспечения исполнения обязательств, допущенных к клирингу.

**Клиринговый счет** – Клиринговый денежный счет или Клиринговый счет депо.

**Конверсионный договор** – договор купли-продажи иностранной валюты, заключаемый Участником клиринга с Банком на основании генерального соглашения с Банком не на организованных торгах.

**Код Участника клиринга / клиента Участника клиринга** – совокупность символов, используемая КЦ для идентификации Участника клиринга / клиента Участника клиринга в Клиринговой системе. В целях взаимодействия с КЦ Участнику клиринга может быть присвоено несколько Кодов Участника клиринга.

**КЦ** – Публичное акционерное общество "Клиринговый центр МФБ".

**Маржинальное требование** - требование КЦ к Участнику клиринга об обеспечении исполнения обязательств по Договорам, заключенным КЦ с Участником клиринга, предъявляемое в порядке и случаях, определенных настоящими Правилами.

**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.

**Организатор торговли** – юридическое лицо, оказывающее услуги по проведению организованных торгов, на которых заключаются Договоры, клиринг обязательств по которым осуществляет КЦ.

**Пароль** – уникальная последовательность случайных букв, и (или) чисел, и (или) иных символов, используемая для аутентификации Участника клиринга/КЦ, присвоенная Участнику клиринга/КЦ в целях осуществления операций в Клиринговой системе.

**Поручение на клиринг внебиржевых договоров -** поручение Участника клиринга, предоставляемое в КЦ с целью осуществления клиринга Конверсионных договоров и регистрации в Клиринговой системе параметров Конверсионного договора.

**Правила торговли** – внутренний документ Организатора торговли, в котором установлен порядок оказания услуг по проведению организованных торгов ценными бумагами.

**Раздел клиринговых регистров** – группа клиринговых регистров, объединяемая во внутреннем учете КЦ общим признаком**.**

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

**Расчетная организация** – кредитная организация, в которой открывается Клиринговый денежный счет 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 Участника клиринга или клиента клиента Участника клиринга, присваиваемый КЦ в соответствии с требованиями Федерального закона «О клиринге и клиринговой деятельности» и принятых в соответствии с ним нормативных актов.

**Регламент клиринга –** внутренний документ 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 подачи 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 и клиринговой деятельности» и принятых в соответствии с ним нормативных актов должны содержаться в настоящих Правилах.

**Сайт КЦ –** сайт в сети "Интернет" по адресу [www.mse.ru](http://www.mse.ru).

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

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

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

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

**Субсчет депо** - составная часть Клирингового счета депо, открываемая Расчетным депозитарием Участнику клиринга, клиенту Участника клиринга, Депозитарию с согласия КЦ и предназначенная для учета ценных бумаг в целях контроля обеспечения по Договорам и проведения расчетов по ценным бумагам по итогам клиринга обязательств из Договоров на основании распоряжений КЦ.

**Торги –** организованные торги ценными бумагами, проводимые Организатором торговли в соответствии с требованиями Правил торговли и настоящих Правил.

**Торговый счет депо** *–* счет депо Участника клиринга, клиента Участника клиринга и (или) Депозитария в Расчетном депозитарии с указанием КЦ в качестве клиринговой организации, на основании распоряжения которой или с согласия которой осуществляются операции по этому счету, предназначенный для учета ценных бумаг и проведения расчетов по ценным бумагам по итогам клиринга обязательств из Договоров на основании распоряжений КЦ.

**ТКС (Торгово-клиринговый счет)** - учетный регистр, устанавливающий однозначное соответствие между определенной позицией по ценным бумагам и определенной позицией по денежным средствам.

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

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

Термины, специально не определенные в настоящих Правилах, используются в значениях, установленных Правилами торговли, внутренними документами КЦ, Федеральным законом «О клиринге и клиринговой деятельности» и принятыми в соответствии с ним нормативными актами.

* + 1. Общие положения
       1. Настоящие Правила разработаны в соответствии с Уставом, другими внутренними документами КЦ, Федеральным законом «О клиринге и клиринговой деятельности» и принятыми в соответствии с ним нормативными актами.
       2. Настоящие Правила устанавливают порядок оказания КЦ клиринговых услуг Участникам клиринга.
       3. Условия договора об оказании клиринговых услуг, заключаемого КЦ с Участниками клиринга, предусмотрены настоящими Правилами.
       4. КЦ оказывает Участникам клиринга клиринговые услуги и иные связанные с клирингом услуги, которые включают в себя следующие:
          - учет, определение и исполнение обязательств, возникших из Договоров и Конверсионных договоров и допущенных к клирингу;
          - установление риск-параметров по каждой ценной бумаге, включённой в Список ценных бумаг;
          - расчет величины Гарантийного обеспечения;
          - расчет и установление для каждого Участника клиринга величины Доступных средств по каждому ТКС и по всем ТКС (в части ТКС, открытых соответствующему Участнику клиринга);
          - определение Участников клиринга, в отношении которых возникли Маржинальные требования, и суммы указанных Маржинальных требований;
          - расчет сумм, подлежащих уплате Участником клиринга в соответствии со статьей 13 настоящих Правил.
       5. 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 и клиринговой деятельности", если больший срок не установлен КЦ в соответствии с указанным Федеральным законом.
       6. Клиринг обязательств по Договорам, заключённым в Режиме основных торгов, Режиме переговорных сделок, Режиме торгов RFQ и Режиме торгов адресное репо, в соответствии с настоящими Правилами осуществляется с участием Центрального контрагента. При этом КЦ является лицом, осуществляющим функции Центрального контрагента.

Клиринг обязательств по Договорам, заключенным в Режиме торгов Аукцион по размещению, Режиме торгов Адресное размещение, Режиме торгов Аукцион по выкупу и Режиме торгов Адресный выкуп, а также по Конверсионным договорам в соответствии с настоящими Правилами осуществляется без участия Центрального контрагента.

* + - 1. КЦ оказывает Участникам клиринга клиринговые услуги каждый Расчетный день. КЦ вправе принять решение об оказании клиринговых услуг в выходной или нерабочий праздничный день, а также решение о неоказании клиринговых услуг в рабочий день. КЦ извещает Участников клиринга об указанных решениях не позднее, чем за 3 (три) рабочих дня до дня, в отношении которого принято соответствующее решение, путем опубликования указанной информации на Сайте КЦ. Опубликование указанной информации на Сайте КЦ считается надлежащим способом информирования Участников клиринга о решении, принятом КЦ в соответствии с настоящим пунктом Правил.
      2. Все споры и разногласия, возникшие между Участниками клиринга, Участником клиринга и КЦ в связи с проведением клиринга (оказанием клиринговых и иных связанных с клирингом услуг) и/или с исполнением обязательств по итогам клиринга в соответствии с настоящими Правилами, подлежат рассмотрению и разрешению в Арбитражном суде города Москвы.
    1. Порядок проведения клиринга
       1. КЦ устанавливает требования к порядку, размеру и срокам предоставления индивидуального клирингового обеспечения, осуществляет контроль достаточности предоставляемого индивидуального клирингового обеспечения в целях подачи Заявок на заключение Договоров и приема Поручений на клиринг внебиржевых договоров к исполнению в порядке, предусмотренном настоящими Правилами. КЦ контролирует достаточность предоставляемого индивидуального клирингового обеспечения для проведения расчетов по денежным средствам и ценным бумагам в порядке и сроки, установленные настоящими Правилами.
       2. Расчеты по денежным средствам и ценным бумагам производятся в Даты исполнения и (или) в даты исполнения, установленные условиями Конверсионных договоров, по итогам неттинга обязательств, допущенных к клирингу, т.е. на основе нетто-обязательств и нетто-требований КЦ и Участников клиринга.
       3. Клиринг по Договорам осуществляется на основании документов от Организатора торговли без получения от Участников клиринга подтверждений о заключении Договоров. КЦ не осуществляет клиринг по Договорам, заключенным на Торгах Организатора торговли, с нарушением требований, установленных настоящими Правилами. КЦ не осуществляет клиринг по Договорам на основании документов от Организатора торговли, в случае нарушения требований к составу и (или) формам представления информации, содержащейся в указанных документах, установленных договором, заключённым между КЦ и Организатором торговли.

КЦ не осуществляет клиринг по договорам, заключенным не на организованных торгах, за исключением договоров, предмет которых соответствует Списку обязательств.

Клиринг по Конверсионным договорам осуществляется на основании Поручений на клиринг внебиржевых договоров.

* + - 1. КЦ осуществляет клиринг по Договорам, заключённым с расчётами в валюте Российской Федерации и иностранной валюте.
      2. Расчеты по результатам клиринга осуществляется в ходе торгов и по итогам торгов.
      3. КЦ контролирует наличие на Торговых счетах депо/Субсчетах депо ценных бумаг и на Клиринговом денежном счете денежных средств, необходимых для расчетов по обязательствам по Договорам и по Конверсионным договорам.
      4. КЦ осуществляет учет на клиринговых регистрах обязательств Участников клиринга из Договоров и Конверсионных договоров, учет информации о ценных бумагах и денежных средствах, являющихся предметом индивидуального клирингового обеспечения, учет информации о ценных бумагах и денежных средствах, предназначенных для исполнения обязательств Участника клиринга из Договоров и Конверсионных договоров.
      5. КЦ осуществляет клиринг обязательств из Договоров, заключенных в отношении ценных бумаг, включенных в Список ценных бумаг. Порядок и условия формирования и изменения указанного списка определяются в договоре, заключенном между КЦ и Организатором торговли.
      6. КЦ вправе в случаях, определенных настоящими Правилами, заключать Договоры без Заявок, а также Договоры в отношении себя лично от имени Участника клиринга, определенного КЦ, без специального полномочия (доверенности), а также без согласия Участника клиринга.
      7. В целях исполнения итоговых нетто-обязательств по ценным бумагам, возникших по итогам клиринга, проводимого в соответствии с настоящими Правилами, КЦ заключает договоры на торгах иностранных бирж, на которых ценные бумаги, по которым в результате проведения клиринга определены итоговые нетто-обязательства, прошли процедуру листинга, а также на проводимых Организатором торговли организованных торгах ценными бумагами в рамках аукциона закрытия Режима основных торгов путем подачи Оффсетных Заявок от своего имени и за свой счет. КЦ, при наличии такой возможности, обеспечивает равенство цен заключения договоров, указанных в настоящем пункте Правил.
      8. Порядок и условия включения обязательств в клиринговый пул установлены в разделе IV настоящих Правил.
    1. Взаимодействие КЦ с Организатором торговли, Расчетной организацией, Расчетным депозитарием и техническим центром
       1. Перечень Организаторов торговли, технических центров, Расчетных организаций и Расчетных депозитариев, взаимодействие с которыми осуществляет КЦ на основании соответствующего договора, указан на Сайте КЦ.
       2. Порядок взаимодействия КЦ с Расчетной организацией, Расчетным депозитарием, Организатором торговли, техническим центром, в том числе перечень документов, которыми обмениваются КЦ и указанные организации в процессе взаимодействия при осуществлении клиринга и расчетов по итогам клиринга, реквизиты и форматы указанных документов, способы и сроки их предоставления, определяются настоящими Правилами и договорами, заключенными между КЦ и указанными организациями.
       3. В случае возникновения обстоятельств, вызывающих и/или создающих предпосылки к возникновению сбоев (отказов) при эксплуатации Клиринговой системы и/или непосредственно препятствующие ее нормальному (штатному) функционированию, в том числе, обстоятельства непреодолимой силы, а также сбои, неисправности и отказы оборудования; сбои и ошибки программного обеспечения; сбои, неисправности и отказы систем связи, энергоснабжения, кондиционирования и других систем жизнеобеспечения, а также иные обстоятельства, такие как случаи нарушения правил разграничения доступа и/или попыток несанкционированного доступа к Клиринговой системе, КЦ незамедлительно уведомляет об этом Организатора торговли и/или Расчетную организацию и/или Расчетный депозитарий любым из доступных средств связи и предпринимает все возможные меры, направленные на устранение указанных обстоятельств.
       4. КЦ не несет ответственности за непроведение расчетов по обязательствам Участников клиринга в случае не исполнения или ненадлежащего исполнения Расчетной организацией и/или Расчетным депозитарием поручений КЦ.
       5. При возникновении чрезвычайных обстоятельств, которые могут препятствовать нормальному осуществлению клиринговой деятельности, КЦ руководствуется внутренним документом, устанавливающим меры, предпринимаемые КЦ в случае возникновения чрезвычайных обстоятельств, которые могут препятствовать нормальному осуществлению клиринговой деятельности, и направленные на обеспечение непрерывности осуществления такой деятельности.
    2. Общие правила использования информации
       1. Настоящей статьей устанавливаются общие положения, касающиеся обеспечения конфиденциальности информации, о которой КЦ стало известно в связи оказанием клиринговых услуг, и предоставляемой КЦ Участниками клиринга, Расчетной организацией, Расчетным депозитарием, Организатором торговли и техническим центром.
       2. К указанной информации относится информация, составляющая коммерческую, банковскую и иную охраняемую [законом](consultantplus://offline/ref=BC817000AFDF0B15702ED2EF02CAA96CAE42B353C43E56BA53214870463AJ) тайну, информация о финансовом состоянии Участников клиринга, об обязательствах, в отношении которых проводится клиринг, о Торговых счетах депо/Субсчетах депо и об операциях по указанным счетам.
       3. Участник клиринга, заключая договор об оказании клиринговых услуг, соглашается с тем, что информация, указанная в пункте 5.2. настоящих Правил, может быть предоставлена Расчетной организации, Расчетному депозитарию, техническому центру и Организатору торговли.
       4. Наличие у КЦ информации, указанной в настоящих Правилах, является необходимым условием осуществления клиринга.
       5. КЦ вправе предоставлять третьим лицам полученную им в связи с осуществлением клиринга информацию в случаях, установленных законодательством Российской Федерации, в частности, самим Участникам клиринга и лицам, перечисленным в пункте 5.3. настоящих Правил, иным лицам с согласия Участников клиринга, уполномоченному государственному органу по запросу, соответствующему требованиям законодательства, 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.
       6. Обеспечение конфиденциальности и защиты информации осуществляется КЦ в соответствии с внутренними документами КЦ.
    3. Клиринговые регистры
       1. При осуществлении клиринговой деятельности КЦ ведет клиринговые регистры Участников клиринга. 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;
          - денежные регистры (в российских рублях или иностранной валюте), на которых учитываются позиции по денежным средствам в российских рублях или иностранной валюте;
          - регистры учета позиций, на которых учитываются допущенные к клирингу обязательства и требования Участника клиринга;
          - регистры учета средств Гарантийных фондов, на которых учитывается взнос в Гарантийный фонд (в случае формирования Гарантийного фонда / Гарантийных фондов).
       2. На клиринговых регистрах КЦ учитывает следующие объекты внутреннего учета (далее – Объекты учета):
          - позиции по ценным бумагам Участника клиринга, за исключением позиций по размещаемым ценным бумагам Участника клиринга, являющегося Участником торгов и выполняющего в интересах и за счет эмитента функции продавца при размещении ценных бумаг (далее - Участник клиринга - Продавец). Указанные позиции учитываются на депо регистрах. Позиция по ценным бумагам рассчитывается для каждого Торгового счета депо/Субсчета депо и по каждому идентификационному коду ценных бумаг на основании информации об остатках ценных бумаг на Торговых счетах депо/Субсчетах депо, полученной от Расчетного депозитария;
          - позиции по размещаемым ценным бумагам Участника клиринга - Продавца. Указанные позиции учитываются на депо регистрах. Позиция по ценным бумагам в указанном случае рассчитывается исходя из остатка ценных бумаг, подлежащих размещению, по Договорам, заключенным в Режиме торгов Аукцион по размещению и Режиме торгов Адресное размещение;
          - позиции по денежным средствам Участника клиринга, составляющим Средства обеспечения. Указанные позиции учитываются по видам валют, учет которых осуществляется на Клиринговом денежном счете, на денежных регистрах;
          - Доступные средства каждого Участника клиринга в разрезе ТКС, рассчитываемые в порядке, предусмотренном настоящими Правилами. Указанные Доступные средства учитываются на денежных регистрах;
          - обязанности и требования Участников клиринга по каждому допущенному к клирингу обязательству по Договору. Указанные обязанности и требования учитываются на регистрах учета позиций;
          - обязанности и требования Участников клиринга по каждому допущенному к клирингу обязательству по Конверсионному договору. Указанные обязанности и требования учитываются на регистрах учета позиций;
          - нетто-обязательства / нетто-требования Участников клиринга по денежным средствам / ценным бумагам по Договорам/Конверсионным договорам в разрезе денежных регистров/ связанных с ним депо регистров, Дат исполнения, валют / 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, в разрезе денежных регистров / связанных с ним депо регистров, валют / кодов ценных бумаг. Указанные нетто-обязательства и нетто-требования учитываются на регистрах учета позиций;
          - итоговые нетто-обязательства / итоговые нетто-требования Участников клиринга по обязательствам, включенным в состав расчетного клирингового пула, в разрезе денежных регистров / связанных с ним депо регистров, валют / кодов ценных бумаг. Указанные нетто-обязательства и нетто-требования учитываются на регистрах учета позиций;
          - обязательства и требования по уплате штрафов, определённых в отношении Участника клиринга и возникающих из клирингового пула для расчетов по итогам Торгов, в разрезе денежных регистров. Указанные обязательства и требования учитываются на регистрах учета позиций;
          - обязательства и требования по уплате штрафа, определенные в отношении Участника клиринга в соответствии с пунктом 22.15 настоящих Правил. Указанные обязательства и требования учитываются на регистрах учета позиций;
          - Маржинальные требования к Участникам клиринга (в случае наличия). Указанные Маржинальные требования учитываются на регистрах учета позиций;
          - взносы Участников клиринга и иных лиц в Гарантийные фонды (в случае формирования Гарантийного фонда / Гарантийных фондов). Указанные взносы учитываются на регистрах учета средств Гарантийных фондов.
       3. Договоры учитываются КЦ на регистрах учета позиций, на которых каждая позиция определяется:
          - стороной обязательств по передаче ценных бумаг (какой стороной в обязательстве по передаче ценных бумаг является Участник клиринга, на регистре которого учитывается такое обязательство);
          - фактом того, заключён ли Договор с участием Центрального контрагента или без участия Центрального контрагента;
          - ценной бумагой, в отношении которой заключен Договор;
          - Датой исполнения;
          - ТКС, с указанием которого заключен Договор;
          - количеством ценных бумаг (в штуках), обязательства по передаче которых учитываются в составе позиции;
          - суммой денежных средств, соответствующей размеру обязательства по оплате ценных бумаг по Договорам, составляющим позицию.
       4. Конверсионные договоры учитываются КЦ на регистрах учета позиций, на которых каждая позиция определяется:
          - стороной обязательств по денежным средствам в соответствующей валюте (какой стороной в обязательстве по передаче денежных средств в соответствующей валюте является Участник клиринга, на регистре которого учитывается такое обязательство);
          - валютой, в отношении которой заключен Конверсионный договор;
          - датой исполнения обязательств по Конверсионному договору;
          - ТКС, указанным в Поручении на клиринг внебиржевых договоров;
          - суммой денежных средств в соответствующей валюте, соответствующей размеру денежного обязательства по Конверсионному договору.
       5. 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.

Позиции по ценным бумагам могут иметь следующие типы: позиция КЦ, позиция Участника клиринга - владельца, позиции по размещаемым ценным бумагам Участника клиринга - Продавца, позиция Участника клиринга – номинального держателя, позиция клиента 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.

* + - 1. КЦ по требованию Участника клиринга осуществляет на отдельных клиринговых регистрах обособленный учет следующих Объектов учета в отношении клиентов Участника клиринга или) клиентов клиента Участника клиринга:
         * позиции по ценным бумагам клиента Участника клиринга или) клиента клиента Участника клиринга. Указанные позиции учитываются на депо регистрах. Позиция по ценным бумагам рассчитывается для каждого Торгового счета депо/Субсчета депо и по каждому идентификационному коду ценных бумаг на основании информации об остатках ценных бумаг на Торговых счетах депо/Субсчетах депо, полученной от Расчетного депозитария;
         * позиции по денежным средствам клиента Участника клиринга или клиента клиента Участника клиринга, составляющим Средства обеспечения. Указанные позиции учитываются по видам валют, учет которых осуществляется на Клиринговом денежном счете, на денежных регистрах;
         * Доступные средства каждого клиента Участника клиринга или клиента клиента Участника клиринга в разрезе ТКС, открытого Участнику клиринга, рассчитываемые в порядке, предусмотренном настоящими Правилами. Указанные Доступные средства учитываются на денежных регистрах;
         * обязанности и требования клиента Участника клиринга или клиента клиента Участника клиринга по каждому допущенному к клирингу обязательству по Договору, заключенному за счет и по поручению указанного клиента. Указанные обязанности и требования учитываются на регистрах учета позиций;
         * обязанности и требования клиента Участника клиринга или клиента клиента Участника клиринга по каждому допущенному к клирингу обязательству по Конверсионному договору, заключенному за счет и по поручению указанного клиента. Указанные обязанности и требования учитываются на регистрах учета позиций;
         * нетто-обязательства / нетто-требования клиента Участника клиринга или клиента клиента Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам по Договорам/Конверсионным договорам в разрезе денежных регистров/ связанных с ним депо регистров, Дат исполнения, валют / кодов ценных бумаг. Указанные нетто-обязательства и нетто-требования учитываются на регистрах учета позиций;
         * итоговые нетто-обязательства / итоговые нетто-требования клиента Участника клиринга или клиента клиента Участника клиринга по обязательствам, включенным в состав клирингового пула по Договорам, в разрезе денежных регистров / связанных с ним депо регистров, валют / кодов ценных бумаг. Указанные нетто-обязательства и нетто-требования учитываются на регистрах учета позиций;
         * итоговые нетто-обязательства / итоговые нетто-требования клиента Участника клиринга или клиента клиента Участника клиринга по обязательствам, включенным в состав расчетного клирингового пула, в разрезе денежных регистров / связанных с ним депо регистров, валют / кодов ценных бумаг. Указанные нетто-обязательства и нетто-требования учитываются на регистрах учета позиций;
         * обязательства и требования по уплате штрафов, определенных в отношении клиента Участника клиринга или клиента клиента Участника клиринга и возникающих из клирингового пула для расчетов по итогам Торгов, в разрезе денежных регистров. Указанные обязательства и требования учитываются на регистрах учета позиций;
         * обязательства и требования по уплате штрафа, определенные в отношении клиента Участника клиринга или клиента клиента Участника клиринга и в соответствии с пунктом 22.15 настоящих Правил. Указанные обязательства и требования учитываются на регистрах учета позиций.
      2. КЦ могут быть открыты следующие типы разделов клиринговых регистров: основной (собственный), клиентский, ДУ.
      3. Участник клиринга должен зарегистрировать ТКС. Регистрация ТКС или изменение параметров ТКС осуществляется КЦ на основании соответствующего заявления Участника клиринга. ТКС регистрируются в рамках каждого Раздела клиринговых регистров. В рамках Раздела клиринговых регистров ТКС учитывает соответственно позиции Участника клиринга, клиента и (или) клиента клиента Участника клиринга.
      4. КЦ открывает депо регистры без дополнительных поручений от Участников клиринга при получении информации о регистрации нового Торгового счета депо/Субсчета депо от Расчетного депозитария.
      5. КЦ открывает денежные регистры без дополнительных поручений от Участников клиринга при получении заявления Участника клиринга на регистрацию нового Торгово-клирингового счета.
      6. КЦ открывает регистры для учета обязательств и требований по денежным средствам и ценным бумагам без дополнительных поручений от Участников клиринга при принятии к учету сведений о Договорах/Конверсионных договорах Участника клиринга, обязательства из которых допущены к клирингу.
      7. КЦ открывает регистры учета средств Гарантийных фондов без дополнительных поручений от Участников клиринга при принятии к учету средств Гарантийных фондов.
      8. Закрытие разделов клиринговых регистров возможно на основании поручения на закрытие разделов клиринговых регистров либо по инициативе КЦ в случае расторжения или прекращения действия договора об оказании клиринговых услуг между Участником клиринга и КЦ при условии отсутствия открытых позиций по Договорам/Конверсионным договорам и при нулевых остатках денежных средств и ценных бумаг, учитываемых на данных разделах клиринговых регистров. Закрытие основного (собственного) раздела клиринговых регистров Участника клиринга осуществляется КЦ после закрытия всех остальных разделов клиринговых регистров данного Участника клиринга.
    1. Виды торговых и клиринговых счетов
       1. Клиринговые денежные счета используются соответственно для учета индивидуального клирингового обеспечения и (или) коллективного клирингового обеспечения в денежных средствах:
          - Для учета индивидуального клирингового обеспечения в денежных средствах в российских рублях и иностранной валюте используются соответствующие Клиринговые денежные счета.
          - 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.
          - Гарантийные фонды учитываются на Клиринговых денежных счетах в российских рублях и (или) иностранной валюте, предназначенных для учета коллективного клирингового обеспечения (в случае формирования Гарантийного фонда/ Гарантийных фондов).
          - КЦ имеет право открыть несколько Клиринговых денежных счетов в одной или нескольких Расчетных организациях.
          - Информация о реквизитах Клиринговых денежных счетов, предназначенных для учета индивидуального клирингового обеспечения и (или) коллективного клирингового обеспечения, 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.
       2. Виды счетов, которые требуется использовать для учета индивидуального клирингового обеспечения и (или) коллективного клирингового обеспечения в ценных бумагах:
          - Для проведения расчетов по ценным бумагам по Договорам, заключенным от своего имени и за свой счет, Участник клиринга обязан иметь Торговый счет депо/Субсчет депо владельца.

Для заключения Договоров в интересах и за счет клиентов Участник клиринга обязан обеспечить открытие отдельного Торгового счета депо/Субсчета депо, на котором учитываются ценные бумаги клиентов такого Участника клиринга.

Участник клиринга и (или) клиент Участника клиринга, имеющий лицензию на осуществление депозитарной деятельности, может открыть Торговый счет депо/Субсчет депо номинального держателя.

Участник клиринга, являющийся доверительным управляющим, обязан в интересах клиентов доверительного управления обеспечить открытие отдельного Торгового счета депо/Субсчета депо доверительного управляющего.

Участник клиринга - Продавец не обязан иметь Торговый счет депо/Субсчет депо для проведения расчетов по ценным бумагам по Договорам, заключенным в Режиме торгов Аукцион по размещению и Режиме торгов Адресное размещение.

* + - * + Участник клиринга может открыть торговые счета депо в Депозитарии при условии, что указанный Депозитарий откроет соответствующие им Торговые счета депо/Субсчета депо номинального держателя Депозитария в Расчетном депозитарии и предоставит согласие на проведение по ним операций по итогам клиринга обязательств указанного Участника клиринга по форме, указанной в Регламенте клиринга.
      1. Проведение операций с ценными бумагами по результатам клиринга обязательств из Договоров осуществляется в зависимости от установленного порядка взаимодействия с Расчетным депозитарием: либо по Торговым счетам депо и Субсчету депо КЦ, либо только по Субсчетам депо на основании поручений КЦ в соответствии с требованиями, установленными во внутренних документах Расчетного депозитария, и в договорах, заключенных между КЦ и Расчетным депозитарием, и настоящих Правил.
      2. Порядок открытия/закрытия и проведения операций по Торговым счета депо регулируется настоящими Правилами, внутренними документами Расчетного депозитария, а также договорами, заключенными между КЦ и Расчетным депозитарием.
      3. Для открытия Субсчета депо Участник клиринга и (или) Депозитарий должен подать в КЦ заявление на открытие Субсчета депо и предоставить в КЦ для дальнейшей передачи в Расчетный депозитарий документы, необходимые для открытия Субсчета депо. Перечень документов, предоставляемых в КЦ для открытия Субсчета депо, указан в Регламенте клиринга.

Депозитарий, в целях открытия Субсчета депо, должен предоставить в КЦ согласие на проведение операций по Субсчету депо по итогам клиринга обязательств Участника клиринга по форме, установленной Регламентом клиринга, предоставить документы, указанные в Приложении №1 к настоящим Правилам, а также соблюдать требования, предъявляемые к Участникам клиринга в соответствии с пунктами 9.1.6. и 9.1.10-9.1.11 настоящих Правил.

* + - 1. Для открытия Субсчета депо клиенту Участника клиринга Участник клиринга должен подать в КЦ заявление на открытие Субсчета депо и предоставить в КЦ для дальнейшей передачи в Расчетный депозитарий документы, необходимые для открытия Субсчета депо. Перечень документов, предоставляемых в КЦ для открытия Субсчета депо, указан в Регламенте клиринга.

Открытие Субсчета депо клиенту Участника клиринга осуществляется КЦ только в случае назначения Участника клиринга попечителем/оператором Субсчета депо.

* + - 1. 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.
      2. Закрытие Субсчета депо возможно по инициативе лица, которому открыт указанный Субсчет депо, или по инициативе КЦ.

Для закрытия Субсчета депо по инициативе лица, которому открыт указанный Субсчет депо, указанное лицо должно подать в КЦ заявление на закрытие Субсчета депо.

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

* + - 1. Открытие и закрытие Субсчета депо, проведение операций по Субсчету депо осуществляется в соответствии с настоящими Правилами, внутренними документами Расчетного депозитария, а также в соответствии с договорами, заключенными между КЦ и Расчетным депозитарием.

КЦ не исполняет поручения лиц, которым открыты Субсчета депо, по зачислению ценных бумаг на указанные Субсчета депо, в случае если указанные ценные бумаги не входят в Список ценных бумаг и не входят в перечень ценных бумаг, внесение которых в качестве Средств обеспечения возможно, и который установлен КЦ в соответствии с пунктом 20.1. настоящих Правил.

* + - 1. Участник клиринга, заключая договор об оказании клиринговых услуг, и Депозитарий, предоставляя в КЦ согласие на проведение операций по Субсчету депо по итогам клиринга обязательств Участника клиринга, тем самым предоставляет КЦ следующие полномочия:
         * получать от Расчетного депозитария информацию о ценных бумагах, учитываемых на Торговом счете депо / Субсчете депо соответствующего Участника клиринга, клиентов Участника клиринга и (или) Депозитария;
         * составлять и подписывать обязательные для исполнения Расчетным депозитарием поручения на проведение операций по Торговым счетам депо/Субсчетам депо соответствующего Участника клиринга, клиентов Участника клиринга и (или) Депозитария.
      2. Участник клиринга должен по факту открытия Торгового счета депо/Субсчета депо зарегистрировать Торгово-клиринговые счета путем подачи в КЦ заявления на регистрацию Торгово-клирингового счета.

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

* + - * + позиция Участника клиринга по денежным средствам и позиция Участника клиринга – владельца по ценным бумагам;
        + позиция Участника клиринга по денежным средствам и позиции по размещаемым ценным бумагам Участника клиринга - Продавца;
        + позиция по денежным средствам Участника клиринга - доверительного управляющего и позиция по ценным бумаг Участника клиринга - доверительного управляющего;
        + клиентская позиция по денежным средствам и позиция по ценным бумагам Участника клиринга - номинального держателя;
        + позиция Участник клиринга по денежным средствам и позиция Участника клиринга - владельца по ценным бумагам, депозитарное обслуживание которого осуществляет Депозитарий;
        + позиция по денежным средствам и позиция по ценным бумагам Участника клиринга - доверительного управляющего, депозитарное обслуживание которого осуществляет Депозитарий;
        + клиентская позиция по денежным средствам и позиция по ценным бумагам Участника клиринга - номинального держателя, депозитарное обслуживание которого осуществляет Депозитарий;
        + клиентская позиция по денежным средствам и позиция по ценным бумагам клиента Участника клиринга.
      1. Участник клиринга вправе зарегистрировать отдельный ТКС для своего клиента в целях отдельного учета имущества клиента Участника клиринга, предоставленного в качестве Средств обеспечения, и обязательств Участника клиринга, возникших из Договоров, заключенных за счет данного клиента. Для целей регистрации отдельного ТКС для своего клиента Участник клиринга обязан в заявлении на регистрацию Торгово-клирингового счета указать Регистрационный код, присвоенный этому клиенту в соответствии с пунктом 10.12 настоящих Правил, и несет риск указания кода, не соответствующего Регистрационному коду указанного клиента.

ТКС может содержать признак, указывающий на осуществление КЦ выделенного учёта Средств обеспечения Участника клиринга, учитываемых в составе данного ТКС. Выделенный 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 выделенного учета Средств обеспечения, участвуют в расчете Доступных средств в порядке, предусмотренном подпунктом 16.4.2. настоящих Правил. Признак выделенного учета Средств обеспечения, учитываемых в составе ТКС, открытого Участнику клиринга – доверительному управляющему, а также в составе ТКС, открытого в целях отдельного учета имущества клиента Участника клиринга, предоставленного в качестве Средств обеспечения, и обязательств Участника клиринга, возникших из Договоров, заключённых за счет данного клиента, проставляется автоматически.

* + - 1. Участник клиринга – Продавец регистрирует ТКС без указания в заявлении на регистрацию Торгово-клирингового счета Торгового счета депо/Субсчета депо. ТКС, зарегистрированный без указания Торгового счета депо/Субсчета депо, предназначен исключительно для заключения Договоров в Режиме торгов Аукцион по размещению и Режиме торгов Адресное размещение.
      2. КЦ вправе отказать в регистрации ТКС или приостановить проведение операций с использованием ТКС в случае, если использование данного ТКС при заключении Договоров и/или расчетах по указанным Договорам приведет к нарушению требований настоящих Правил клиринга.
      3. Участник клиринга вправе осуществлять группировку клиринговых регистров в рамках ТКС, на которых учитываются позиции клиентов Участников клиринга, в целях ведения внутреннего аналитического учета. В указанном случае Участник клиринга подаёт в КЦ заявление, содержащее код, учитывающий указанную группировку (далее – Аналитический ТКС). Аналитический ТКС должен однозначно соответствовать ТКС, в рамках которого данный Аналитический ТКС зарегистрирован.

Аналитический ТКС может указываться в Заявке. Указание в Заявке Аналитического ТКС является однозначным указанием на ТКС, в рамках которого осуществлена группировка клиринговых регистров Аналитического ТКС.

* + - 1. КЦ аннулирует регистрацию ТКС:
         * на основании заявления Участника клиринга, который регистрировал этот ТКС;
         * в случае прекращения действия договора об оказании клиринговых услуг с Участником клиринга, зарегистрировавшим ТКС;
         * при изменении хотя бы для одного из счетов, входящего в состав данного ТКС, лица, для обеспечения исполнения или исполнения обязательств которого используются денежные средства или ценные бумаги, учитываемые на этих счетах;
         * в случае перевода долга/уступки требований одного Участника клиринга по обязательствам, допущенным к клирингу, другому Участнику клиринга;
         * в случае отсутствия операций с использованием указанного ТКС в течение 6 (шести) месяцев подряд.
      2. Участник клиринга обязан зарегистрировать в КЦ на основании заявления на регистрацию счета для вывода денежных средств (форма которого предусмотрена в Регламенте клиринга) расчетный счет в российских рублях или иностранной валюте соответственно (далее – Счет) для возврата денежных средств с Клирингового денежного счета.
      3. 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 нарушения обязанности, предусмотренной настоящим пунктом Правил, несет Участник клиринга.
      4. В случае необходимости закрытия зарегистрированного в КЦ Счета Участник клиринга обязан проинформировать КЦ об этом по форме, установленной в Регламенте клиринга.
      5. 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.
      6. КЦ вправе перевести долг/уступить требования Участника клиринга по допущенным к клирингу обязательствам, возникшим в результате заключения Договоров за счет клиента Участника клиринга, для которого зарегистрирован отдельный ТКС в соответствии с пунктом 7.12 настоящих Правил, а также передать имущество, являющееся Средствами обеспечения и учитываемое по указанному ТКС, другому Участнику клиринга. КЦ осуществляет перевод долга, уступку требований и передачи имущества в сроки, установленные в Регламенте клиринга.
      7. КЦ вправе осуществить перевод долга/уступку требования только в случае получения от клиента Участника клиринга, за счет которого исполняются обязательства и (или) обеспечивается исполнение обязательств, и Участника клиринга, которому переводится долг/уступаются требования и передаётся имущество, являющееся Средствами обеспечения, согласия на такой перевод долга, уступку требований и передачу имущества. Согласие указанных лиц считается полученным, если КЦ получил уведомления в соответствии с пунктом 7.23 настоящих Правил.
      8. КЦ вправе осуществить перевод долга, уступку требований и передачу имущества, являющегося Средствами обеспечения, только при соблюдении следующих условий:

Клиент 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, являющегося Средствами обеспечения, с указанием ТКС, зарегистрированного для данного клиента в соответствии с пунктом 7.12 настоящих Правил, и с указанием ТКС, зарегистрированного другим Участником клиринга для указанного клиента;

Участник клиринга, которому переводится долг, уступаются требования и передаётся имущество, являющееся Средствами обеспечения, направляет в КЦ уведомление в бумажной форме, содержащее согласие на осуществление указанных действий. В этом уведомлении должно содержаться указание на ТКС, открытый данным Участником клиринга, на который будет осуществлён перевод долга, уступка требований и передача имущества, являющегося Средствами обеспечения клиента Участника клиринга;

Участник клиринга, которому переводится долг, уступаются требования и передается имущество, являющееся Средствами обеспечения, обязан до момента осуществления указанных действий в порядке, предусмотренным пунктом 10.12 настоящих Правил, осуществить регистрацию клиента, за счет которого исполняются обязательства, по которым переводится долг и уступаются требования, и (или) обеспечивается исполнение таких обязательств, а также зарегистрировать для этого клиента ТКС в соответствии с пунктом 7.12 настоящих Правил.

* + - 1. После получения документов, указанных в пункте 7.23 настоящих Правил, КЦ, для проведения процедуры перевода долга, уступки требований и передачи имущества, являющегося Средствами обеспечения, в сроки, установленные в Регламенте клиринга:
         * осуществляет проверку наличия регистрации клиента и ТКС, предусмотренных подпунктом 7.23..3 настоящих Правил;
         * осуществляет перевод допущенных к клирингу обязательств и требований по денежным средствам и (или) ценным бумагам, учитываемых в отношении денежного регистра/ Торгового счета депо/Субсчета депо, относящимся к ТКС, указанному в уведомлении для перевода долга и уступки требований, по каждому Договору, заключенному с указанием данного ТКС, на ТКС Участника клиринга, которому переводится долг и уступаются требования. В результате такого перевода обязательства и требования по денежным средствам и (или) ценным бумагам, учитываемые в отношении денежного регистра/ Торгового счета депо/Субсчета депо, относящимся к ТКС Участника клиринга, с которого был осуществлён перевод/уступка, прекращаются и начинают учитываться в отношении денежного регистра/Торгового счета депо/Субсчета депо, относящемуся к ТКС Участника клиринга, на который был осуществлён перевод/уступка;
         * 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 перевода долга и уступки требований, 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 переводится долг и уступаются требования, 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 переводится долг и уступаются требования, увеличивается на указанную величину;
         * осуществляет передачу имущества, являющегося Средствами обеспечения в ценных бумагах, учитываемых на Торговом счете депо/Субсчете депо, относящемся к ТКС, указанному в уведомлении для перевода долга и уступки требований, 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 Торговом счете депо/Субсчете депо, и их зачисление в том же количестве на Торговый счет депо/Субсчет депо, относящийся к ТКС Участника клиринга, которому переводится долг и уступаются требования. После получения от Расчетного депозитария отчета, подтверждающих исполнение поданного поручения, КЦ уменьшает Средства обеспечения Участника клиринга, учитываемые на клиринговых регистрах, соответствующих Торговому счету депо/Субсчету депо, с которого производится списание ценных бумаг, на списанное количество ценных бумаг, и увеличивает Средства обеспечения Участника клиринга, учитываемые на клиринговых регистрах, соответствующих Торговому счету депо/Субсчету депо, на который производится зачисление ценных бумаг, на количество зачисленных ценных бумаг.
      2. Перевод долга, уступка требований и передача имущества, являющегося Средствами обеспечения, от одного Участника клиринга другому Участнику клиринга считается завершённым с момента отражения указанных операций на клиринговых регистрах данных Участников клиринга.
      3. В случае если в период осуществления КЦ действий, направленных на перевод долга, уступку требований и передачу имущества, являющегося Средствами обеспечения, будет подана Заявка с указанием ТКС, с которого осуществляется перевод долга и уступка требований, КЦ уведомляет Организатора торговли о невозможности регистрации такой Заявки в реестре Заявок.
      4. По завершении перевода долга, уступки требований и передачи имущества, являющегося Средствами обеспечения, КЦ аннулирует ТКС, на котором учитывались обязательства, по которым был осуществлён перевод долга и уступка требований, и переданное имущество, являющееся Средствами обеспечения.

1. ПРАВА И ОБЯЗАННОСТИ КЦ И УЧАСТНИКОВ КЛИРИНГА. ТРЕБОВАНИЯ К УЧАСТНИКАМ КЛИРИНГА
   * 1. Права, обязанности и ответственность КЦ и Участников клиринга
        1. Порядок взаимодействия Участников клиринга и КЦ, права и обязанности КЦ и Участников клиринга определяются настоящими Правилами и договором об оказании клиринговых услуг, заключенным между Участником клиринга и КЦ, по форме, установленной в Регламенте клиринга.
        2. Размер оплаты клиринговых и иных связанных с клирингом услуг, оказываемых КЦ Участникам клиринга в соответствии с настоящими Правилами, определен Тарифами КЦ, являющимися Приложением №2 к настоящим Правилам (далее – Тарифы). Порядок оплаты клиринговых услуг Клирингового центра определен статьей 13 настоящих Правил.
        3. Участник клиринга и КЦ несут ответственность за не исполнение или ненадлежащее исполнение своих обязанностей, предусмотренных настоящими Правилами, в соответствии с законодательством Российской Федерации.
        4. КЦ не несет ответственности за:
           + неисполнение или ненадлежащее исполнение своих обязанностей, предусмотренных настоящими Правилами, вызванное действием или бездействием Участника клиринга, в результате которого КЦ не мог выполнить свои обязанности в соответствии с настоящими Правилами;
           + неисполнение или ненадлежащее исполнение условий настоящих Правил, вызванное представлением Участником клиринга недостоверных данных, содержащихся в документах, представленных Участником клиринга при заключении договора об оказании клиринговых услуг, а также в соответствии с порядком, определенным настоящими Правилами, или несвоевременном уведомлении КЦ об изменении таких данных;
           + убытки Участника клиринга, если они возникли вследствие умысла или грубой неосторожности Участника клиринга;
           + убытки Участника клиринга, которые могут возникнуть в связи с нарушением клирингового обслуживания Участников клиринга в случае признания ситуации чрезвычайной;
           + неисполнение Расчетной организацией, Расчетным депозитарием, другими лицами своих обязательств по обеспечению правильности, своевременности и достоверности информации, передаваемой КЦ от указанных лиц;
           + неисполнение Расчетным депозитарием и/или Расчетной организацией своих обязательств перед Участником клиринга, в том числе не проведение расчетов по обязательствам Участников клиринга в случае неисполнения Расчетной организацией и/или Расчетным депозитарием поручений КЦ;
           + неисполнение Организатором торговли своих обязательств перед Участником клиринга;
           + последствия прекращения Торгов Организатором торговли.
        5. КЦ не несет ответственности по обязательствам Участника клиринга перед третьими лицами.
        6. Участник клиринга и КЦ (далее в настоящем пункте Правил – Стороны) освобождаются от ответственности за частичное или полное неисполнение обязательств, предусмотренных настоящими Правилами, при условии действия обстоятельств исключающих ответственность Сторон (форс-мажор).
           + Ни одна из Сторон не несет ответственности в случае невыполнения, несвоевременного или ненадлежащего выполнения ею какого-либо ее обязательства, предусмотренного настоящими Правилами, если указанное невыполнение, несвоевременное или ненадлежащее выполнение обусловлены исключительно наступлением и/или действием обстоятельств непреодолимой силы (форс-мажорных обстоятельств), в том числе технических сбоев, неисправностей, ошибок и отказов в оборудовании и программном обеспечении, пожаров, аварий, актов террора, диверсий и саботажа, забастовок, смены политического режима и другие политических осложнений, изменений законодательства Российской Федерации, военных действий, массовых беспорядков и других непредвиденных обстоятельств, неконтролируемых Сторонами.
           + Перечисленные в настоящем пункте обстоятельства исключают ответственность Сторон, если только причиной их наступления не явились виновные действия стороны, как умышленные, так и неумышленные, которые выгодны виновной Стороне для наступления какого-либо из перечисленных обстоятельств.
           + Затронутая форс-мажорными обстоятельствами Сторона незамедлительно, но не позднее дня, следующего за днем наступления события, информирует другую Сторону об этих обстоятельствах и об их последствиях и принимает все возможные меры с целью максимально ограничить отрицательные последствия, вызванные указанными форс-мажорными обстоятельствами.
           + Сторона, для которой создались форс-мажорные обстоятельства, должна незамедлительно, но не позднее дня следующего за днем наступления события, известить другую сторону о прекращении этих обстоятельств.
           + Неизвещение или несвоевременное извещение другой Стороны Стороной, для которой создалась невозможность исполнения обязательства, предусмотренного настоящими Правилами, о наступлении форс-мажорных обстоятельств, влечет за собой утрату права ссылаться на эти обстоятельства.
        7. Участник клиринга вправе в одностороннем порядке отказаться от исполнения договора об оказании клиринговых услуг, письменно уведомив КЦ не менее чем за 10 (десять) дней до даты прекращения действия указанного договора, при условии отсутствия у Участника клиринга имущественных обязательств по указанному договору, а также неисполненных им обязательств, допущенных к клирингу.
        8. КЦ вправе в одностороннем порядке отказаться от исполнения договора об оказании клиринговых услуг:
           + в случае если Участник клиринга в течение 6 (шести) месяцев с момента заключения договора об оказании клиринговых услуг не получил допуска к клиринговому обслуживанию, либо в течение 6 (шести) месяцев подряд Участник клиринга не имел допуска к клиринговому обслуживанию в связи с приостановлением / неполучением им допуска к клиринговому обслуживанию;
           + в случае прекращения допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию;
           + в случаях, предусмотренных статьей 36 настоящих Правил, а также в случае реорганизации Участника клиринга при условии, что деятельность Участника клиринга в результате реорганизации прекращается.
        9. Действие договора об оказании клиринговых услуг, заключенного с Участником клиринга, не может быть прекращено в случае, если до даты прекращения действия указанного договора Участник клиринга являлся стороной Договора репо в период после исполнения обязательств по передаче ценных бумаг по первой части указанного Договора репо и до исполнения обязательств по передаче ценных бумаг по второй части указанного Договора репо. Действие договора об оказании клиринговых услуг с Участником клиринга прекращается только после выполнения всех действий, связанных с передачей Дохода в соответствии со статьей 26 настоящих Правил.
     2. Требования к Участникам клиринга, допущенным к клиринговому обслуживанию
        1. Клиринговые услуги оказываются Участникам клиринга, допущенным в соответствии с настоящими Правилами к клиринговому обслуживанию. Участник клиринга, допущенный к клиринговому обслуживанию, обязан одновременно соблюдать следующие требования:

Участник клиринга должен быть зарегистрирован в качестве Участника клиринга соответствии с настоящими Правилами;

Участник клиринга должен внести взнос в Гарантийный фонд в соответствии с требованиями настоящих Правил (в случае формирования Гарантийного фонда/ Гарантийных фондов);

Участнику клиринга или Депозитарию, у которого Участнику клиринга открыт торговый счет депо, должен быть открыт Торговый счет депо/Субсчет депо, который входит в состав ТКС;

у Участника клиринга исходя из отчетности, представленной в соответствии со статьей 11 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 по Договорам и/или иные обязательства Участника клиринга, возникающие из настоящих Правил;

Участник клиринга должен соответствовать требованиям к финансовой устойчивости, установленным статьей 11 настоящих Правил;

Участник клиринга должен иметь доступ к Системе электронного документооборота на основании договора, заключенного с техническим центром, определённым КЦ, и информация о котором раскрыта на Сайте КЦ;

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

Участник клиринга, являющийся брокером, дилером или управляющим, должен являться членом Некоммерческого партнёрства развития финансового рынка РТС (если это предусмотрено решением КЦ);

Участник клиринга должен представить КЦ все документы (информацию), предусмотренные в статье 10 настоящих Правил (с учетом пункта 10.4 настоящих Правил);

Участник клиринга должен обеспечивать актуальность, достоверность и полноту документов, предоставляемых в КЦ в целях его идентификации, а также своевременное предоставление изменений и дополнений в такие документы;

Участник клиринга должен надлежащим образом исполнять обязанности по представлению КЦ информации и документов в соответствии с требованиями Федерального закона «О клиринге и клиринговой деятельности» и принятых в соответствии с ним нормативных актов.

* + 1. Регистрация в качестве Участника клиринга
       1. Допуск к клиринговому обслуживанию предоставляется лицам, зарегистрированным в соответствии с настоящими Правилами, в качестве Участников клиринга.
       2. Лицо, намеревающееся стать Участником клиринга (далее - Заявитель), должно представить в КЦ следующие документы:

1. анкету Заявителя по форме, установленной Регламентом клиринга (далее - Анкета);
2. два экземпляра договора об оказании клиринговых услуг, подписанного Заявителем, по форме, установленной Регламентом клиринга;
3. оригинал или заверенную копию доверенности, подтверждающей полномочия лица, подписавшего от имени Заявителя документы, указанные в подпунктах 1-2 настоящего пункта, а также оригинал подписанного указанным лицом согласия на обработку КЦ его персональных данных по форме, установленной КЦ и опубликованной на Сайте КЦ (представляются, если документы, указанные в подпунктах 1-2 настоящего пункта, подписаны лицом, действующим от имени Заявителя на основании доверенности).
   * + 1. Для рассмотрения вопроса о регистрации Заявителя в качестве Участника клиринга в КЦ, помимо документов, указанных в пункте 10.2 настоящих Правил, представляются документы, указанные в Приложении №1 к настоящим Правилам, за исключением случаев, предусмотренных пунктом 10.4. настоящих Правил.
       2. Документы, указанные в Приложении № 1 к настоящим Правилам, могут не представляться в КЦ в следующих случаях:

10.4.1. если КЦ, Организатор торговли и (или) технический центр располагают соответствующими документами;

10.4.2. если информация, содержащаяся в документах, раскрывается Заявителем в соответствии со статьёй 30 Федерального закона «О рынке ценных бумаг».

* + - 1. КЦ вправе потребовать представления Заявителем иных документов (информации), помимо предусмотренных пунктом настоящих Правил и Приложением №1 к настоящим Правилам, в том числе документов (информации), подтверждающих финансовое состояние Заявителя. Заявитель обязан представить документы (информацию), указанные в требовании КЦ, в установленные КЦ срок и порядке.
      2. Решение о регистрации Заявителя в качестве Участника клиринга или об отказе в такой регистрации принимается КЦ в течение 5 (пяти) рабочих дней с даты получения всех надлежащим образом оформленных документов, предусмотренных пунктом настоящих Правил и Приложением № 1 к настоящим Правилам (с учетом положения пункта настоящих Правил), и всех документов (информации), истребованных в соответствии с пунктом настоящих Правил.
      3. Решение о регистрации Заявителя в качестве Участника клиринга может быть принято при условии соответствия Заявителя всем требованиям, предусмотренным пунктами - настоящих Правил. При этом КЦ оставляет за собой право отказать Заявителю в регистрации в качестве Участника клиринга без объяснения причин.
      4. КЦ информирует Заявителя о принятом решении путем направления уведомления адресу, указанному в Анкете, или путем направления уведомления в форме Электронного документа, подписанного Электронной подписью.
      5. 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.
      6. Заявитель считается зарегистрированным в качестве Участника клиринга с даты вступления в силу заключенного с ним договора об оказании клиринговых услуг. С указанной даты Заявитель становится Участником клиринга и информация о нем включается в реестр Участников клиринга.

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.

* + - 1. 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. В целях регистрации Заявителя в качестве Участника клиринга КЦ присваивает Заявителю Регистрационный код, а также Код Участника клиринга. Указанные коды формируются КЦ в порядке, указанном в Регламенте клиринга. Регистрационный код и Код Участника клиринга, присвоенные КЦ, указываются в уведомлении, предусмотренном пунктом настоящих Правил.
      2. Участник клиринга вправе регистрировать своих клиентов и клиентов своих клиентов в порядке, предусмотренном настоящими Правилами. КЦ не осуществляет клиринг по Договорам и Конверсионным договорам, расчеты по которым осуществляются за счет клиентов и (или) клиентов клиента Участника клиринга, не зарегистрированных КЦ.

Регистрация клиентов и (или) клиентов клиентов Участника клиринга осуществляется на основании заявления на регистрацию клиентов. В указанном заявлении Участник клиринга указывает буквенно-цифровой код (краткий код клиента Участника клиринга), используемый для подачи Заявок и заключения Договоров. Порядок формирования краткого кода клиента Участника клиринга Участником клиринга предусматривается в Регламенте клиринга.

Регистрация клиентов и (или) клиентов клиентов Участников клиринга означает присвоение указанным клиентам Регистрационного кода. Регистрационный код клиента и (или) клиента клиента Участника клиринга присваивается КЦ в течение 5 (пяти) рабочих дней с даты представления Участником клиринга заявления на регистрацию клиентов. Информация о присвоенных кодах клиентам и (или) клиентам клиентов Участника клиринга доводится до сведения Участника клиринга путем направления уведомления адресу, указанному в Анкете, или путем направления уведомления в форме Электронного документа, подписанного Электронной подписью.

Для целей предоставления допуска к участию в Торгах КЦ вправе передать Организатору торговли информацию об Участнике клиринга, его клиенте и (или) клиенте его клиента, которой обладает КЦ и которая может быть использована Организатором торговли в целях предоставления допуска к участию в Торгах, включая информацию о Регистрационных кодах Участника клиринга, клиента и (или) клиента клиента Участника клиринга, а также о Коде Участника клиринга/клиента Участника клиринга и (или) кратком коде клиента Участника клиринга.

Регистрация клиентов и (или) клиентов клиентов Участника клиринга может осуществляться КЦ на основании информации, полученной от Организатора торговли и (или) технического центра и содержащей все необходимые сведения без предоставления заявления, предусмотренного настоящим пунктом Правил.

Регистрация клиента и (или) клиента клиента Участника клиринга означает внесение информации об указанном клиенте в реестр клиентов Участников клиринга.

Клиент и (или) клиент клиента Участника клиринга может быть исключен из реестра клиентов Участников клиринга на основании заявления на дерегистрацию клиента. В указанном заявлении указывается Регистрационный код клиента и (или) клиента клиента Участника клиринга, а также может быть указана дата, начиная с которой клиент и (или) клиент клиента Участник клиринга должен быть исключен из реестра клиентов Участников клиринга.

КЦ вправе самостоятельно аннулировать регистрацию клиента и (или) клиента клиента Участника клиринга в случае несоблюдения требований, установленных настоящими Правилами.

* + - 1. КЦ ведет реестр Участников клиринга, который содержит следующие сведения:
         * полное наименование Участника клиринга;
         * Регистрационный код Участника клиринга;
         * ИНН/КПП Участника клиринга;
         * место нахождения Участника клиринга;
         * контактная информация Участника клиринга;
         * фамилия, имя, отчество (при наличии) и должность руководителя (единоличного исполнительного органа) Участника клиринга и контролера;
         * дата регистрации в качестве Участника клиринга;
         * информация об исключении Участника клиринга из реестра Участников клиринга.
      2. Сведения о клиентах и (или) клиентах клиента Участников клиринга заносятся КЦ в реестр клиентов Участников клиринга, который содержит следующие сведения:
         * Регистрационный код Участника клиринга;
         * полное наименование Участника клиринга;
         * Регистрационный код клиента и (или) клиента клиента Участника клиринга.
    1. Требования к Участникам клиринга по предоставлению финансовой отчетности в КЦ и их финансовой устойчивости
       1. В целях оказания клиринговых услуг КЦ предъявляет к Участникам клиринга требования к финансовой устойчивости.

11.1.1. Участники клиринга - кредитные организации должны соответствовать следующим требованиями к финансовой устойчивости:

* + - * + соблюдать обязательные нормативы Банка России, установленные для кредитных организаций;
        + соблюдать требования Банка России к минимальному размеру собственных средств (капитала), установленные для кредитных организаций;
        + иметь в соответствии с отчетом о финансовых результатах кредитной организации положительный финансовый результат;
        + в деятельности Участников клиринга - кредитных организаций должны отсутствовать основания для осуществления мер по предупреждению банкротства в соответствии с законодательством Российской Федерации о несостоятельности (банкротстве) кредитных организаций, а также основания для отзыва Банком России лицензии на осуществление банковских операций в соответствии с законодательством Российской Федерации о банковской деятельности.

11.1.2. Участники клиринга - некредитные организации должны соответствовать следующим требованиями к финансовой устойчивости:

* + - * + иметь в соответствии с показателями отчета о финансовых результатах положительный финансовый результат (чистая прибыль);
        + соблюдать требования Банка России к минимальному размеру собственных средств установленные для профессиональных участников рынка ценных бумаг;
        + в деятельности Участников клиринга должны отсутствовать основания для осуществления мер по предупреждению банкротства в соответствии с законодательством Российской Федерации о несостоятельности (банкротстве).
      1. Участники клиринга должны соответствовать требованиям к финансовой устойчивости, приведенным в пунктах 11.1.1.-11.1.2. настоящих Правил, в течение всего времени допуска к клиринговому обслуживанию.
      2. Участники клиринга обязаны незамедлительно уведомлять КЦ о своем несоответствии требованиям, указанным в настоящей статье Правил.
      3. Участники клиринга обязаны предоставлять в КЦ финансовую отчетность, предусмотренную Приложением №3 к настоящим Правилам, в сроки, установленные указанным приложением.

11.4.1. Отчетность, указанная в Приложении №3 настоящих Правил, предоставляется КЦ в виде Электронного документа, подписанного Электронной подписью, или в бумажном виде, за исключением случаев, предусмотренных пунктами 11.4.2 и 11.4.3 настоящих Правил.

11.4.2. В случае если отчетность Участников клиринга – кредитных организаций, указанная в Приложении №3 к настоящим Правилам, в соответствии с требованиями Банка России раскрывается на официальном сайте Банка России в сети Интернет, то указанная отчетность считается предоставленной КЦ с момента ее размещения на указанном сайте.

11.4.3. В случае если отчетность Участников клиринга – некредитных организаций, указанная в Приложении №3 к настоящим Правилам, в соответствии с требованиями Банка России раскрывается на сайте указанного Участника клиринга в сети Интернет, то указанная отчетность считается предоставленной КЦ с момента ее размещения на указанном сайте при условии, что адрес такого сайта указан в анкете Заявителя, предоставленной КЦ в соответствии с пунктом 10.2 настоящих Правил.

11.4.4. Участники клиринга по запросу КЦ обязаны в срок, указанный в запросе, предоставить отчетность, указанную в Приложении № 3 к настоящим Правилам, способами, указанными в пункте 11.4.1. настоящих Правил.

* + 1. Допуск к клиринговому обслуживанию, приостановление, возобновление и прекращение допуска к клиринговому обслуживанию
       1. Допуск к клиринговому обслуживанию предоставляется Участнику клиринга при одновременном соблюдении требований, указанных в пунктах 9.1.1. – 9.1.10 настоящих Правил. КЦ принимает решение о допуске Участника клиринга к клиринговому обслуживанию в течение 5 (пяти) Расчетных дней с даты выполнения Участником клиринга требований, предусмотренных в пунктах 9.1.1.- 9.1.10 настоящих Правил.

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

* + - 1. КЦ имеет право приостановить допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию в следующих случаях:
         * при нарушении Участником клиринга установленных настоящими Правилами требований;
         * невнесения взноса в Гарантийный фонд участников или внесения взноса в Гарантийный фонд участников в неполном объеме (в случае формирования Гарантийного фонда / Гарантийных фондов);
         * на основании уведомления Организатора торговли о приостановлении допуска к участию в Торгах Участника клиринга;
         * наличие в деятельности Участника клиринга оснований для осуществления мер по предупреждению банкротства в соответствии с законодательством Российской Федерации о несостоятельности (банкротстве), а также основания для отзыва уполномоченным органом исполнительной власти лицензии на осуществление соответствующего вида деятельности в соответствии с законодательством Российской Федерации;
         * невыполнения требований, предусмотренных статьей 9 настоящих Правил;
         * 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 11 настоящих Правил;
         * при отсутствии у Участника клиринга хотя бы одного зарегистрированного ТКС;
         * при закрытии Участнику клиринга Торгового счета/Субсчета депо, входящего в состав зарегистрированного ТКС;
         * при получении КЦ от Участника клиринга заявления о приостановлении клирингового обслуживания.
      2. В случае приостановления допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию КЦ продолжает осуществлять клиринг и иные функции, связанные с осуществлением клиринга по обязательствам данного Участника клиринга, возникшим по Договорам/Конверсионным договорам, заключенным данным Участником клиринга до момента приостановления допуска к клиринговому обслуживанию.
      3. КЦ возобновляет допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию с момента устранения причин, послуживших основанием для такого приостановления или с момента получения письма Участника клиринга о возобновлении допуска к клиринговому обслуживанию, при условии соблюдения им требований, предусмотренных статьей 9 настоящих Правил.
      4. КЦ прекращает допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию по любому из следующих оснований:
         * в случае прекращения действия договора об оказании клиринговых услуг;
         * неисполнение требований, предусмотренных статьей 9 настоящих Правил, в течение 6 (шести) месяцев подряд;
         * в случае отзыва (аннулирования) Банком России лицензии на осуществление банковских операций у Участника клиринга – кредитной организации;
         * в случае назначения временной администрации или принятия арбитражным судом решения о введении в отношении Участника клиринга одной из процедур банкротства;
         * ликвидации Участника клиринга, а также в случае реорганизации Участника клиринга при условии, что деятельность Участника клиринга в результате реорганизации прекращается;
         * при поступлении в КЦ уведомления от Организатора торговли о прекращении допуска Участника клиринга к участию в Торгах;
         * при получении КЦ от Участника клиринга заявления о прекращении клирингового обслуживания.
      5. 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 назначения временной администрации или принятия арбитражным судом решения о введении в отношении Участника клиринга, не являющегося кредитной организацией, одной из процедур банкротства, определен в статье 36 настоящих Правил.
      6. КЦ извещает Участника клиринга и Организатора торговли о приостановлении, возобновлении и прекращении допуска соответствующего Участника клиринга к клиринговому обслуживанию в течение 1 (одного) рабочего дня после принятия соответствующего решения КЦ путем направления соответствующего уведомления в адрес Участника клиринга и Организатора торговли в виде Электронного документа, подписанного Электронной подписью, и (или) в бумажном виде.
      7. 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.
      8. Прекращение допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию означает исключение информации об Участнике клиринга и клиентах, и (или) клиентах клиентов Участника клиринга из реестра Участников клиринга и реестра клиентов Участников клиринга соответственно. КЦ не оказывает Участнику клиринга клиринговых услуг с момента исключения Участника клиринга из реестра Участников клиринга.
      9. В случае прекращения допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию, КЦ возвращает Участнику клиринга имущество, являющееся индивидуальным клиринговым обеспечением, а в случае формирования Гарантийного фонда участников, имущество, являющееся коллективным клиринговым обеспечением и составляющее взнос Участника клиринга в Гарантийный фонд участников, учитываемый на дату прекращения допуска к клиринговому обслуживанию. Возврат денежных средств осуществляется не позднее 3 (трех) рабочих дней с даты прекращения допуска к клиринговому обслуживанию, за исключением случаев, указанных в статье 36 настоящих Правил. Ценные бумаги, являющиеся индивидуальным клиринговым обеспечением, возвращаются Участнику клиринга путем предоставления согласия КЦ на вывод указанных ценных бумаг.
    1. Порядок оплаты услуг КЦ, Организатора торговли и технического центра
       1. КЦ взимает с Участников клиринга:
          - сумму платы за оказание клиринговых услуг (далее – клиринговый сбор);
          - сумму платы за оказание услуг по проведению Торгов - в пользу Организатора торговли (далее - Торговый сбор);
          - сумму платы за предоставление программного обеспечения, необходимого для участия в Торгах - в пользу технического центра (далее – Технический сбор);
          - суммы иных платежей, которые могут взиматься в пользу Организатора торговли в соответствии с Правилами торговли.
       2. Размер клирингового сбора, подлежащего уплате Участником клиринга, рассчитывается КЦ в соответствии с тарифами, являющимися Приложением №2 к настоящим Правилам.
       3. Размер Торгового сбора, иных платежей в пользу Организатора торговли, а также Технического сбора рассчитывается КЦ в соответствии с тарифами Организатора торговли и технического центра соответственно на основании договоров, заключённых КЦ с указанными организациями.
       4. Обязательства по оплате сборов, указанных в пункте настоящих Правил, допускаются к клирингу на основании информации о размерах сборов, указанных в пункте настоящих Правил, а также на основании информации, полученной КЦ от Организатора торговли и технического центра. Обязательства по оплате сборов, связанных с заключением Договоров и указанных в пункте настоящих Правил, допускаются к клирингу с момента получения КЦ информации о регистрации соответствующего Договора в реестре Договоров; обязательства по оплате сборов, не связанных с заключением Договоров и указанных в пункте настоящих Правил, допускаются к клирингу с момента возникновения оснований для взимания соответствующих сборов.
       5. Если иное не предусмотрено в соответствии в пунктом настоящих Правил, обязательства по оплате сборов, взимаемых в связи с заключением Участниками клиринга Договоров и указанных в пункте настоящих Правил, допущенные к клирингу в соответствии с пунктом настоящих Правил, включаются в клиринговый пул по расчетам по итогам Торгов в дату заключения Участниками клиринга соответствующих Договоров.
       6. Обязательства по оплате сборов, взимаемых в связи с заключением Участниками клиринга Договоров (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 в соответствии с пунктом 22.2. настоящих Правил), и указанных в пункте настоящих Правил, допущенные к клирингу в соответствии с пунктом настоящих Правил, могут быть включены в расчетный клиринговый пул, указанный в пункте 22.3 настоящих Правил, в Дату исполнения Договора, в связи с заключением которого взимаются соответствующие сборы, по заявлению Участника клиринга, подаваемого в КЦ по форме, установленной в Регламенте клиринга.

1. МЕРЫ, НАПРАВЛЕННЫЕ НА УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ
   * 1. Способы снижения рисков при осуществлении клиринга
        1. В целях снижения рисков, связанных с осуществлением клиринга, КЦ:
           + предъявляет требования к финансовой устойчивости Участников 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 и при подаче Поручений на клиринг внебиржевых договоров, в которых указан данный Участник клиринга;
           + осуществляет расчет и контроль Доступных средств при подаче Заявок и при подаче Поручений на клиринг внебиржевых договоров, при заключении Договоров, при принятии Поручений на клиринг внебиржевых договоров к исполнению, при исполнении/ прекращении обязательств по Договорам и Конверсионным договорам, при возврате Средств обеспечения;
           + устанавливает лимиты в соответствии с Методикой установления и изменения риск-параметров;
           + не реже, чем каждый Расчетный день, осуществляет переоценку величины Гарантийного обеспечения, а также величины Средств обеспечения, и контроль достаточности Доступных средств, в случае недостаточности – предъявляет Участнику клиринга Маржинальное требование;
           + обеспечивает контроль за проведением Расчетным депозитарием операций по Торговым счета депо/Субсчетам депо на основании поручений КЦ;
           + принимает меры, направленные на снижение рисков осуществления клиринговой деятельности, в соответствии с требованием внутренних документов КЦ.
           + вправе формировать Гарантийные фонды для обеспечения исполнения обязательств, допущенных к клирингу.
     2. Обеспечение исполнения обязательств Участников клиринга. Условия соглашения об индивидуальном клиринговом обеспечении и коллективном клиринговом обеспечении.
        1. Обязательства Участников клиринга, допущенные к клирингу, обеспечиваются индивидуальным клиринговым обеспечением и (или) коллективным клиринговым обеспечением.
        2. Условием обеспечения исполнения допущенных к клирингу обязательств Участников клиринга выступает обязательное предварительное резервирование Участниками клиринга на Клиринговых денежных счетах денежных средств и/или на Торговых счетах депо/Субсчетах депо ценных бумаг для прохождения процедуры контроля обеспечения в порядке, определенном статьей 18 настоящих Правил.
        3. Денежные средства в российских рублях и иностранной валюте, зачисленные на Клиринговые денежные счета, являются индивидуальным клиринговым обеспечением и включаются в состав Средств обеспечения. При этом доходы от денежных средств, являющихся предметом индивидуального клирингового обеспечения, не зачисляются в индивидуальное клиринговое обеспечение.
        4. Ценные бумаги, зачисленные на Торговые счета депо/Субсчета депо, являются индивидуальным клиринговым обеспечением только при условии включения данных ценных бумаг в состав Средств обеспечения в соответствии со статьей 20 настоящих Правил. При этом доходы по ценным бумагам, являющимся предметом индивидуального клирингового обеспечения, не зачисляются в индивидуальное клиринговое обеспечение.
        5. Имущество, являющееся предметом индивидуального клирингового обеспечения, может использоваться для обеспечения исполнения и (или) исполнения обязательств, допущенных к клирингу, в том числе итоговых нетто-обязательств.
        6. Условием обеспечения исполнения обязательств Участника клиринга является передача имущества, составляющего индивидуальное клиринговое обеспечение, до заключения Договоров/подачи Поручения на клиринг внебиржевых договоров.
        7. Передача имущества, предназначенного для индивидуального клирингового обеспечения, осуществляется путем зачисления денежных средств на Клиринговые денежные счета, а ценных бумаг - на Торговые счета депо/Субсчета депо, указанные в статье 7 настоящих Правил.
        8. Имущество, зачисленное в соответствии с требованиями настоящих Правил на Торговый счет депо/Субсчет депо и (или) Клиринговый денежный счет, включается КЦ в состав индивидуального клирингового обеспечения и учитывается в качестве Средств обеспечения с момента получения подтверждения о зачислении денежных средств и ценных бумаг на соответствующие счета.
        9. Особенности внесения и возврата Средств обеспечения определены в статье 20 настоящих Правил.
        10. Объем имущества, передаваемого в индивидуальное клиринговое обеспечение, определяется Участником клиринга исходя из объема Договоров и Конверсионных договоров, планируемых к заключению соответствующим Участником клиринга и объема имеющихся неисполненных обязательств по ранее заключенным Договорам/Конверсионным договорам, с учетом следующего:
            + при недостаточности Доступных средств Участника клиринга, рассчитываемых в соответствии со статьей 16 настоящих Правил, Заявка, поданная Участником клиринга, не регистрируется в реестре Заявок, Поручение на клиринг внебиржевых договоров, подаваемое данным Участником клиринга, не принимается к исполнению;
            + при отрицательном значении Доступных средств Участника клиринга, указанному Участнику клиринга может быть выставлено Маржинальное требование;
            + итоговые нетто-обязательства Участника клиринга должны обеспечиваться индивидуальным клиринговым обеспечением на Дату исполнения и (или) на дату исполнения Конверсионного договора в полном объеме: итоговое нетто-обязательство по денежным средствам в российских рублях или иностранной валюте в размере нетто-обязательства - денежными средствами в российских рублях или иностранной валюте, итоговое нетто-обязательство по ценным бумагам в размере нетто-обязательства - ценными бумагами того же эмитента, вида, категории, типа, выпуска.
        11. Наличие достаточного количества имущества, являющегося индивидуальным клиринговым обеспечением, на Торговых счета депо/Субсчетах депо и Клиринговых денежных счетах обеспечивается Участниками клиринга.
        12. 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.
        13. КЦ в целях обеспечения исполнения обязательств, допущенных к клирингу, любого из Участников клиринга, вправе сформировать Гарантийный фонд/Гарантийные фонды. Гарантийный фонд/Гарантийные фонды формируются в соответствии с настоящим пунктом Правил и со статьей 17 настоящих Правил.
        14. Особенности внесения и возврата взноса в Гарантийный фонд/Гарантийные фонды определены в статье 21 настоящих Правил.
        15. Передача имущества, предназначенного для коллективного клирингового обеспечения, осуществляется путем зачисления денежных средств в российских рублях и (или) иностранной валюте на Клиринговые денежные счета, указанные в статье 7 настоящих Правил.
        16. Взносы в Гарантийные фонды, зачисленные в соответствии с требованиями настоящих Правил на Клиринговые денежные счета, включаются КЦ в состав коллективного клирингового обеспечения и учитываются на клиринговых регистрах в виде взносов в Гарантийные фонды с момента получения подтверждения о зачислении денежных средств на соответствующие Клиринговые денежные счета.
        17. 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.
        18. КЦ вправе размещать денежные средства, составляющие коллективное клирингового обеспечение, во вклады в кредитных организациях при условии соответствия указанных кредитных организаций требованиям Федерального закона «О клиринге и клиринговой деятельности» и принятыми в соответствии с ним нормативными правовыми актами. Доходы по таким вкладам не включаются в состав коллективного клирингового обеспечения.
        19. Обращение взыскания на имущество Участника клиринга или иного лица, находящееся на Торговом счете депо/Субсчете депо/Клиринговом счете, а также приостановление операций по Торговому счету депо/Субсчету депо/Клиринговому счету не допускаются в отношении имущества, которое необходимо для исполнения (прекращения) обязательств, допущенных к клирингу, не позднее дня, следующего за днём, когда КЦ получил документ, являющийся основанием для указанного обращения взыскания или приостановления операций. Такое обращение взыскания или приостановление операций может быть осуществлено в отношении имущества должника, оставшегося после исполнения (прекращения) обязательств Участника клиринга по итогам клиринга, не позднее дня, следующего за днём, когда КЦ получил указанные документы.
        20. В соответствии с законодательством РФ, наложение ареста на имущество должника, находящееся на Торговом счете депо/Субсчете депо/Клиринговом счете, не препятствует совершению по распоряжению КЦ операций, необходимых для исполнения (прекращения) обязательств, допущенных к клирингу, не позднее дня, следующего за днём, когда КЦ получил информацию о наложении ареста.
     3. Порядок расчета величины Доступных средств
        1. Величина Доступных средств используется для проверки возможности подачи Участником клиринга Заявок в целях заключения Договоров, приема к исполнению Поручений на клиринг внебиржевых договоров, исполнения / прекращения обязательств по Договорам/Конверсионным договорам, возврата Участнику клиринга Средств обеспечения, выставления Маржинального требования и контроля за его погашением. Указанная проверка осуществляется исходя из анализа изменения величины Доступных средств Участника клиринга как до, так и после совершения действий, указанных в пункте настоящих Правил.
        2. КЦ рассчитывает величину Доступных средств при изменении размера Средств обеспечения Участника клиринга, при подаче Участником клиринга Заявок на заключение Договоров, при заключении Участником клиринга Договоров, при подаче и приеме к исполнению Поручений на клиринг внебиржевых договоров, исполнении / прекращении обязательств по Договорам/Конверсионным договорам, изменении риск-параметров.
        3. Величина Доступных средств Участника клиринга рассчитывается с учетом объявленных Заявок данного Участника клиринга.
        4. КЦ осуществляет расчет следующих величин:

16.4.1. Величина Доступных средств по каждому ТКС Участника клиринга:

, где

– величина оценочной стоимости Средств обеспечения по данному ТКС, в Валюте Доступных средств;

- величина Гарантийного обеспечения по позициям, учтенным по регистру учета позиций, и объявленным Заявкам, содержащих данный ТКС, в Валюте Доступных средств.

16.4.2. Величина Доступных средств Участника клиринга по всем ТКС:

, где

- величина Доступных средств по ТКС Участника клиринга, в Валюте Доступных средств;

сумма по всем ТКС данного Участника клиринга, для которых не применяется выделенный способ учета Средств обеспечения;

сумма по всем ТКС данного Участника клиринга, для которых применяется выделенный способ учета Средств обеспечения

* + - 1. Величина Гарантийного обеспечения рассчитывается по совокупности позиций и объявленных Заявок с использованием риск-параметров, определенных в соответствии с Методикой установления и изменения риск-параметров.
      2. Изменение риск-параметров приводит к перерасчету Гарантийного обеспечения.
      3. Перечень Валют Доступных средств устанавливается КЦ и раскрывается на Сайте КЦ. Участник клиринга обязан выбрать одну валюту из перечня Валют Доступных средств путем подачи заявления на регистрацию Валюты Доступных средств по форме, предусмотренной Регламентом клиринга, в которой будет осуществляться расчет Доступных средств, Гарантийного обеспечения, а так же Средств обеспечения.
    1. Гарантийные фонды
       1. КЦ вправе формировать Гарантийный фонд/Гарантийные фонды за счет взносов Участников клиринга и (или) иных лиц, не являющихся Участниками клиринга (далее - Гаранты). В качестве взносов в Гарантийные фонды могут быть внесены денежные средства в российских рублях и (или) иностранной валюте.
       2. КЦ самостоятельно принимает решение о дате начала формирования Гарантийного фонда/Гарантийных фондов, о чем информирует Участников клиринга и (или) Гарантов, не позднее, чем за 10 (десять) рабочих дней до даты начала формирования Гарантийных фондов, путем направления уведомлений Участникам клиринга и (или) Гарантам в виде Электронного документа, подписанного Электронной подписью, и (или) в бумажном виде.
       3. Перечень иностранных валют, внесение которых в качестве взносов в Гарантийные фонды возможно, устанавливается внутренним документом КЦ, определяющим методику выбора и оценки иностранных валют и (или) ценных бумаг, принимаемых в качестве обеспечения.
       4. Предельная доля иностранной валюты, принимаемой в качестве взноса в Гарантийные фонды, составляет 100%.
       5. КЦ вправе формировать следующие Гарантийные фонды: Гарантийный фонд участников, формируемый за счет взносов Участников клиринга, и (или) специальный Гарантийный фонд, формируемый за счет взносов Гарантов.
       6. Гаранты вправе вносить взносы в специальный Гарантийный фонд только после заключения договора с КЦ.
       7. Совокупный размер Гарантийных фондов определяется КЦ исходя из необходимости поддержания совокупного размера Гарантийных фондов на уровне не ниже размера потенциальных убытков КЦ в случае неисполнения или ненадлежащего исполнения допущенных к клирингу обязательств двух Участников клиринга с наибольшим объемом указанных обязательств. При этом размер потенциальных убытков определяется с допущением вероятности их возникновения, соответствующей уровню надежности 99 процентов.
       8. Для целей определения совокупного размера Гарантийных фондов, удовлетворяющего пункту настоящих Правил, КЦ проводит процедуру стресс-тестирования в соответствии с мерами, направленными на снижение рисков В случае если 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. 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.
       9. Размер взноса в Гарантийный фонд участников и (или) специальный Гарантийный фонд определяется КЦ самостоятельно на основании совокупного размера Гарантийных фондов, определенного в соответствии с пунктами - настоящих Правил. Информация о размерах взносов в Гарантийные фонды и размере соответствующего Гарантийного фонда размещается на Сайте КЦ. КЦ может использовать информацию о торговой активности Участников клиринга для определения размера взноса в Гарантийный фонд участников. КЦ в порядке настоящих Правил и по форме, указанной в Регламенте клиринга, уведомляет Участников клиринга о доле имущества соответствующего Участника клиринга в коллективном клиринговом обеспечении.
       10. Лицо, не исполнившее или ненадлежащим образом исполнившее обязательство по внесению взноса в Гарантийный фонд участников и (или) Специальный гарантийный фонд, обязано возместить убытки, причиненные КЦ и Участникам клиринга в результате неисполнения или ненадлежащего исполнения им указанного обязательства.

1. ПОРЯДОК ПРОВЕДЕНИЯ КЛИРИНГА
   * 1. Порядок взаимодействия с Организатором торговли при подаче Заявок и заключении Договоров. Прием Поручений на клиринг внебиржевых договоров. Порядок и условия допуска обязательств к клирингу.
        1. При подаче Участником торгов Заявки, за исключением Заявок, в отношении которых Организатором торговли не предусмотрено проведение проверки возможности регистрации в реестре Заявок, осуществляется автоматизированный электронно-цифровой обмен запросами между Системой проведения торгов Организатора торговли и Клиринговой системой КЦ в целях проверки, что у Участника торгов, указанного в Заявке есть действующий допуск к клиринговому обслуживанию, и подача указанной Заявки не приведет к нарушению следующих условий:
           + ценная бумага включена в Список ценных бумаг;
           + величина Доступных средств Участника клиринга по ТКС, определяемому поданной Заявкой а также величина Доступных средств Участника клиринга по всем ТКС, рассчитанные с учетом поданной Заявки, не стали отрицательными;
           + если величина Доступных средств по ТКС, определяемому поданной Заявкой, а также величина Доступных средств Участника клиринга по всем ТКС, были отрицательными до момента подачи Заявки, то указанные величины Доступных средств, рассчитанные с учетом указанной поданной Заявки, не стали меньше величин Доступных средств, рассчитанных до момента подачи указанной Заявки.
        2. При выполнении условий, указанных в пункте настоящих Правил, КЦ подтверждает возможность регистрации Заявки в реестре Заявок. В этом случае КЦ в качестве Доступных средств по ТКС, определяемому поданной Заявкой, а также Доступных средств Участника клиринга по всем ТКС, учитывает величины, рассчитанные с учетом указанной объявленной Заявки.
        3. При невыполнении хотя бы одного из условий, указанных в пункте настоящих Правил, КЦ уведомляет Организатора торговли о невозможности регистрации Заявки в реестре Заявок. В указанном случае величины Доступных средств Участника клиринга, указанного в Заявке, не пересчитываются и считаются равными последним рассчитанным величинам.
        4. Уведомление о возможности или невозможности регистрации Заявки в реестре Заявок направляется КЦ Организатору торговли в виде электронного сообщения, подписанного АСП.
        5. Положительный результат проверки, осуществляемой КЦ и указанной в пункте настоящих Правил, означает, что подаваемая Заявка является обеспеченной.
        6. В случае отзыва объявленной Заявки или удаления объявленной Заявки, Организатор торговли извещает КЦ об указанном факте. В указанном случае величина Доступных средств по ТКС, определяемому поданной Заявкой, подлежащая отзыву или удалению, а также величина Доступных средств Участника клиринга, указанного в Заявке, по всем ТКС, пересчитываются без учета указанной Заявки.
        7. В случае неисполнения или ненадлежащего исполнения Участником клиринга обязательств, допущенных к клирингу, КЦ вправе заключать Договоры без подачи Заявок. В указанном случае Договор считается заключенным в момент получения Организатором торговли информации от КЦ о неисполнении или ненадлежащем исполнении обязательств Участника клиринга, путем внесения записи о заключении Договора в реестр Договоров.
        8. После регистрации Договора в реестре Договоров Организатором торговли осуществляется автоматизированный электронно-цифровой обмен информацией между Системой проведения торгов Организатора торговли и Клиринговой системой КЦ. Организатор торговли направляет в КЦ информацию о регистрации Договора, на основании чего КЦ:
           + рассчитывает величину Доступных средств по ТКС, определяемому поданной Заявкой, на основании которой был заключен Договор, а также величину Доступных средств Участника клиринга по всем ТКС Участника клиринга без учета Заявки, на основании которой был заключен Договор, но с учетом указанного Договора;
           + изменяет с учетом указанного заключенного Договора нетто-обязательство и/или нетто-требование Участника клиринга по Договорам в российских рублях или иностранной валюте и ценных бумагах с указанием даты исполнения соответствующей Дате исполнения по заключенному Договору, учитываемые по регистру учета позиций, соответствующему ТКС, определяемому поданной Заявкой, на основании которой заключен указанный Договор.
        9. Обязательства, возникшие из Договоров, допускаются к клирингу с момента получения КЦ информации о регистрации соответствующего Договора в реестре Договоров. Обязательства, допущенные к клирингу, и требования по этим обязательствам принимаются КЦ к учету с момента их допуска к клирингу на основании информации о регистрации заключенного Договора в реестре Договоров, получаемой КЦ от Организатора торговли.
        10. Обязательства, возникшие из Договоров, допущенные к клирингу в соответствии с настоящей статьей Правил, за исключением обязательств, указанных в абзацах втором и третьем настоящего пункта, включаются в клиринговый пул по Договорам в соответствии со статьей 22 настоящих Правил.

Обязательства из Договоров, заключаемых на основании Заявок, в которых указаны одинаковые ТКС, включаются в клиринговый пул по внутриброкерским Договорам в соответствии со статьей 22 настоящих Правил.

Обязательства из Договоров, заключаемых в Режиме торгов Аукцион по размещению, Режиме торгов Адресное размещение, Режиме торгов Аукцион по выкупу и Режиме торгов Адресный выкуп, включаются в расчетный клиринговый пул по Договорам, заключаемым в Режиме торгов Аукцион по размещению, Режиме торгов Адресное размещение, Режиме торгов Аукцион по выкупу и Режиме торгов Адресный выкуп в соответствии со статьей 22 настоящих Правил.

* + - 1. Для целей осуществления клиринга по Конверсионным договорам и приема Поручений на клиринг внебиржевых договоров КЦ получает информацию о заключении, изменении и прекращении действия генеральных соглашений, заключенных между Участником клиринга и Банком, определяющих общие условия заключения Конверсионных договоров с Банком, от Банка по форме, установленной в Регламенте клиринга. До момента получения от Банка информации о заключении генерального соглашения, определяющего общие условия заключения Конверсионных договоров, КЦ не принимает Поручения на клиринг внебиржевых договоров в отношении указанных Конверсионных договоров к исполнению и не допускает обязательства, возникшие из указанных Конверсионных договоров, к клирингу. Если КЦ не уведомлён об ином, то при приеме Поручений на клиринг внебиржевых договоров КЦ руководствуется генеральными соглашениями, определяющими общие условия заключению Конверсионных договоров, о заключении которых он был уведомлен в соответствии с настоящим пунктом.
      2. Для осуществления клиринга Конверсионных договоров Участники клиринга подают в КЦ Поручения на клиринг внебиржевых договоров по форме, установленной в Регламенте клиринга.

Поручение на клиринг внебиржевых договоров считается поданным в момент регистрации в Клиринговой системе параметров Конверсионного договора.

Поручения на клиринг внебиржевых договоров подлежат исполнению в дату исполнения Конверсионного договора.

* + - 1. Поручения на клиринг внебиржевых договоров направляются в КЦ в виде электронного сообщения, подписанного АСП.
      2. В Поручении на клиринг внебиржевых договоров могут содержаться данные по одному или нескольким Конверсионным договорам.
      3. КЦ вправе отказать в приеме Поручения на клиринг внебиржевых договоров в случае, если его исполнение приведет к нарушению требований законодательства Российской Федерации и (или) требований настоящих Правил.
      4. КЦ принимает Поручение на клиринг внебиржевых договоров к исполнению от Участников клиринга, получивших допуск к клиринговому обслуживанию, если прием указанного поручения к исполнению и (или) его исполнение не приведет к нарушению следующих условий:
         * предмет обязательств Конверсионного договора, указанного в Поручении на клиринг внебиржевого договора соответствует предмету обязательств и иным условиям, содержащимся в Списке обязательств;
         * Участник клиринга заключил с Банком генеральное соглашение, определяющее общие условия Конверсионных договоров;
         * дата подачи Поручений на клиринг внебиржевых договоров не позднее даты исполнения по Конверсионному договору;
         * реквизиты Конверсионного договора, содержащиеся в Поручение на клиринг внебиржевых договоров одного Участник клиринга, совпадают с реквизитами Конверсионного договора, содержащимися в Поручении на клиринг внебиржевых договоров Участника клиринга – контрагента по договору;
         * к моменту включения обязательств из Конверсионных договоров в расчетный клиринговый пул КЦ получил Поручения на клиринг по внебиржевым договорам от двух Участников клиринга – сторон по указанному Конверсионному договору;
         * величина Доступных средств Участника клиринга по ТКС, с указанием которого было подано Поручение на клиринг внебиржевых договоров, а также величина Доступных средств Участника клиринга по всем открытым ему ТКС, рассчитанные с учетом поданного Поручения на клиринг внебиржевых договоров, не стали отрицательными;
         * если величина Доступных средств по ТКС, с указанием которого была подано было подано Поручение на клиринг внебиржевых договоров, а также величина Доступных средств Участника клиринга по всем ТКС, были отрицательными до момента подачи Поручения на клиринг внебиржевых договоров, то указанные величины Доступных средств, рассчитанные с учетом указанного поданного Поручения на клиринг внебиржевых договоров, не стали меньше величин Доступных средств, рассчитанных до момента подачи указанного Поручения на клиринг внебиржевых договоров.
      5. При выполнении условий, указанных в пункте настоящих Правил, КЦ принимает к исполнению Поручение на клиринг внебиржевых договоров и в качестве Доступных средств по ТКС, с указанием которого было подано Поручение на клиринг внебиржевых договоров, а также Доступных средств Участника клиринга по всем открытым ему ТКС, учитывает величины, рассчитанные с учетом указанного поданного Поручения на клиринг внебиржевых договоров.
      6. При невыполнении хотя бы одного из условий, указанных в пункте настоящих Правил, Поручение на клиринг внебиржевых договоров к исполнению не принимается. В указанном случае величины Доступных средств Участников клиринга, подавших указанное Поручение на клиринг внебиржевых договоров, не пересчитываются и считаются равными последним рассчитанным величинам.
      7. Положительный результат проверки, осуществляемой КЦ и указанной в пункте настоящих Правил, означает, что подаваемое Поручение на клиринг внебиржевых договоров может быть принято к исполнению.
      8. 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 по всем открытым ему ТКС;
         * изменяет с учетом Конверсионного договора, указанного в Поручении на клиринг внебиржевых договоров, нетто-обязательство и/или нетто-требование Участника клиринга по Конверсионным договорам в российских рублях или иностранной валюте с указанием даты исполнения в соответствии с условиями Конверсионного договора, учитываемые по регистру учета позиций, соответствующему ТКС, указанному в Поручении на клиринг внебиржевых договоров, в котором был указан этот Конверсионный договор.
      9. КЦ допускает обязательства из Конверсионного договора, в отношении которого подано Поручение на клиринг внебиржевых договоров, к клирингу после приема к исполнению указанного Поручения на клиринг внебиржевых клиринг. Обязательства, допущенные к клирингу, и требования по этим обязательствам принимаются КЦ к учету с момента их допуска к клирингу.
      10. Обязательства, возникшие из Конверсионных договоров, допущенные к клирингу на основании соответствующих Поручений на клиринг внебиржевых договоров в соответствии с пунктом настоящих Правил, в дату исполнения Конверсионного договора включаются в расчетный клиринговый пул в соответствии со статьей 22 настоящих Правил.
    1. Маржинальные требования
       1. Маржинальное требование возникает у Участника клиринга, Доступные средства которого стали отрицательными. Сумма Маржинального требования равна абсолютному значению отрицательных Доступных средств Участника клиринга.
       2. Маржинальное требование, возникшее у Участника клиринга по итогам клиринговой сессии, должно быть исполнено Участником клиринга не позднее 17.00 по московскому времени Расчетного дня, следующего за днём возникновения Маржинального требования.
       3. Маржинальное требование должно быть исполнено Участником клиринга путем внесения Средств обеспечения в порядке, установленном статьей 20 настоящих Правил. Маржинальное требование может быть также исполнено полностью или частично в случаях:
          - исполнения обязательств по Договорам с наступившей Датой исполнения;
          - отзыва объявленных Заявок, в результате чего уменьшится величина Гарантийного обеспечения Участника клиринга
          - заключения Договоров, приводящих к увеличению Доступных средств Участника клиринга.
       4. Маржинальное требование считается исполненным, когда значение Доступных средств Участника клиринга станет неотрицательным.
       5. В случае неисполнения Участником клиринга Маржинального требования в срок, установленный пунктом настоящих Правил, КЦ применяет процедуру принудительного закрытия. Процедура принудительного закрытия осуществляется в порядке, предусмотренном в пунктах - настоящих Правил.
       6. При осуществлении процедуры принудительного закрытия КЦ вправе заключать Договоры в отношении себя лично от имени Участника клиринга, у которого возникло Маржинальное требование, без специального полномочия (доверенности), а также без согласия Участника клиринга, и (или) заключать Договоры без подачи Заявок. КЦ осуществляет процедуру принудительного закрытия до момента исполнения Маржинального требования.
       7. Заключение Договоров без подачи Заявок при применении процедуры принудительного закрытия осуществляется, в том числе при соблюдении следующих условий:
          - Договоры без подачи Заявок заключаются с Участниками клиринга, на регистрах учета позиций которых учитывается позиция противоположная позиции Участника клиринга, у которого возникло Маржинальное требование, и с Участниками клиринга, у которых возникло Маржинальное требование;
          - Договоры заключаются в объемах, пропорциональных объему позиции по данной ценной бумаге каждого Участника клиринга, с которым КЦ заключает Договоры;
          - Цена заключения Договора, покупателем (продавцом) в которых является Участник клиринга, у которого возникло Маржинальное требование, считается равной Верхней (Нижней) цене принудительного закрытия, рассчитанной во время последней клиринговой сессии с соответствии с Методикой установления и изменения риск-параметров.
       8. Договоры, заключаемые при применении процедуры принудительного закрытия, учитываются при расчете нетто-обязательств / нетто-требований Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам по Договорам по соответствующим Датам исполнения.
       9. Если после выполнения процедуры принудительного закрытия, у Участника клиринга осталось неисполненное Маржинальное требование, указанное неисполненное Маржинальное требование учитывается как Задолженность.
       10. В случае наличия у Участника клиринга Средств обеспечения в валюте, отличной от Валюты Доступных средств (далее – иная валюта), КЦ использует Средства обеспечения Участника клиринга в указанной иной валюте для удовлетворения требований КЦ по Задолженности Участника клиринга путем продажи указанной иной валюты за Валюту Доступных средств.

Удовлетворение требований КЦ по Задолженности Участника клиринга осуществляется путем продажи КЦ иной валюты за Валюту Доступных средств через кредитную организацию, которую устанавливает КЦ и раскрывает на Сайте КЦ. Курс продажи иной валюты определяется указанной кредитной организацией на дату совершения операции.

* + - 1. Удовлетворение требований КЦ за счет Средств обеспечения Участника клиринга в иной валюте осуществляется КЦ без предварительного уведомления Участника клиринга.
      2. Сумма, полученная в результате сделки, указанной в пункте 19.10 настоящих Правил, засчитывается КЦ в счет погашения Задолженности Участника клиринга.
      3. Размер Средств обеспечения Участника клиринга в иной валюте по соответствующему денежному регистру уменьшается на сумму Средств обеспечения Участника клиринга в иной валюте, использованных в соответствии с пунктом 19.10 настоящих Правил.
      4. В случае наличия у Участника клиринга Средств обеспечения в ценных бумагах КЦ по своему усмотрению использует Средства обеспечения Участника клиринга в указанных ценных бумагах для целей погашения Задолженности Участника клиринга путем продажи указанных ценных бумаг за Валюту Доступных средств, за исключением случая, указанного в пункте 19.16 настоящих Правил.
      5. Продажа ценных бумаг осуществляется КЦ на Торгах Организатора торговли путем заключения Договоров в отношении себя лично от имени Участника клиринга, Средства обеспечения которого используются для погашения Задолженности, без специального полномочия (доверенности), а также без согласия Участника клиринга.
      6. В случае если продажа ценных бумаг на Торгах Организатора торговли  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 пунктом 19.10 настоящих Правил.
      7. Удовлетворение требований за счет Средств обеспечения Участника клиринга в ценных бумагах осуществляется КЦ без предварительного уведомления Участника клиринга.
      8. Сумма денежных средств, полученная в результате продажи ценных бумаг как указано в пункте настоящих Правил, засчитывается КЦ в счет погашения Задолженности Участника клиринга.
      9. Выбор используемого в целях погашения Задолженности Участника клиринга Средства обеспечения осуществляется КЦ самостоятельно без предварительного уведомления Участника клиринга.
      10. В случае отсутствия у Участника клиринга Средств обеспечения в иной валюте и (или) ценных бумагах либо если в результате использования КЦ Средств обеспечения Участника клиринга в иной валюте и (или) ценных бумагах Задолженность Участника клиринга не погашена полностью и Участник клиринга не внес имущество, являющееся Средством обеспечения, для погашения Задолженности, КЦ вправе требовать от такого Участника клиринга погашения Задолженности в судебном порядке и (или) вправе использовать средства Гарантийных фондов, в случае их формирования, в порядке, предусмотренном статьёй 24 настоящих Правил.
    1. Порядок внесения, использования и возврата Средств обеспечения
       1. В качестве Средств обеспечения могут быть внесены денежные средства в российских рублях и иностранной валюте, зачислены ценные бумаги, включенные в Список ценных бумаг, и иные ценные бумаги.

Перечень ценных бумаг, включённых в Список ценных бумаг, и иных ценных бумаг (далее – Перечень ценных бумаг, включаемых в Средства обеспечения) и перечень иностранных валют, внесение которых в качестве Средств обеспечения возможно, определяется решением КЦ и подлежит опубликованию на сайте КЦ.

* + - 1. Предельная доля иностранной валюты, принимаемой в Средства обеспечения, составляет 100%. Предельная доля ценных бумаг, включённых в Список ценных бумаг и входящих в Перечень ценных бумаг, включаемых в Средства обеспечения, составляет 100%. Предельная доля иных ценных бумаг, входящих в Перечень ценных бумаг, включаемых в Средства обеспечения, устанавливается решением КЦ. Дробные части ценных бумаг не учитываются в качестве Средств обеспечения.
      2. КЦ вправе устанавливать максимальное количество ценных бумаг и 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.
      3. Средства обеспечения в российских рублях и иностранной валюте используются в следующей очередности:

1. для погашения Задолженности;
2. для обеспечения исполнения обязательств Участника клиринга по Договорам/Конверсионным договорам;
3. для исполнения обязательств Участника клиринга в российских рублях и иностранной валюте по Договорам с наступившей Датой исполнения/Конверсионным договорам с наступившей датой исполнения, установленной условиями Конверсионного договора.
   * + 1. Средства обеспечения в ценных бумагах используются в следующей очередности:
4. для погашения Задолженности;
5. для обеспечения исполнения обязательств Участника клиринга по Договорам;
6. для исполнения обязательств Участника клиринга по передаче ценных бумаг по Договорам с наступившей Датой исполнения.
   * + 1. Внесение Средств обеспечения в российских рублях и иностранной валюте Участником клиринга возможно следующими способами:
          - путем перевода денежных средств на соответствующий Клиринговый денежный счет;
          - путем перевода денежных средств между денежными регистрами на основании поручения на перевод денежных средств, поданного Участником клиринга с использованием Клиринговой системы, как указано в пункте настоящих Правил;
          - путем перевода денежных средств между денежными регистрами на основании заявления на замену валюты денежных средств, учитываемых в качестве Средств обеспечения, как указано в пункте настоящих Правил;
          - 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, являющегося Средствами обеспечения, в порядке, предусмотренном пунктом 7.23 настоящих Правил.
       2. Перевод денежных средств Участником клиринга на Клиринговый денежный счет КЦ с целью их последующего учета в качестве Средств обеспечения должен осуществляться с обязательным указанием в назначении платежа цели перевода денежных средств, номера договора об оказании клиринговых услуг и соответствующего ТКС.

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

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

* + - 1. Перевод денежных средств между денежными регистрами/между денежным регистром и денежным регистром обеспечения, используемым для учета средств обеспечения в целях заключения договоров, являющихся производными финансовыми инструментами, на проводимых Организатором торговли организованных торгах, 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 / денежному регистру обеспечения, используемым для учета средств обеспечения в целях заключения договоров, являющихся производными финансовыми инструментами, на проводимых Организатором торговли организованных торгах, на который зачисляются денежные средства, увеличивается на сумму переводимых денежных средств.

* + - 1. Поручение на списание ценных бумаг, не включенных в Перечень ценных бумаг, включаемых в Средства обеспечения, в соответствии с настоящей статьей Правил, с Торгового счета депо/Субсчета депо исполняется при условии, что количество ценных бумаг, подлежащих списанию, не превышает значения соответствующей позиции по ценным бумагам Участника клиринга.

Поручение на списание ценных бумаг, включенных в Перечень ценных бумаг, включаемых в Средства обеспечения,  в соответствии с настоящей статьей Правил, с Торгового счета депо/Субсчета депо исполняется при условии, что:

* + - * + количество ценных бумаг, подлежащих списанию, не превышает значения соответствующей позиции по ценным бумагам Участника клиринга;
        + величина Доступных средств Участника клиринга по ТКС, в состав которого входит соответствующая позиция по ценным бумагам, а также величина Доступных средств Участника клиринга по всем ТКС, в результате такого списания не стали отрицательными;
        + если величина Доступных средств Участника клиринга по ТКС, в состав которого входит соответствующая позиция по ценным бумагам, а также величина Доступных средств Участника клиринга по всем ТКС, были отрицательными до момента такого списания, то указанные величины Доступных средств, рассчитанные с учетом такого списания, не стали меньше величин Доступных средств, рассчитанных до момента такого списания.
      1. В момент зачисления Участником клиринга денежных средств на Клиринговый денежный счет и учета их в качестве Средств обеспечения по денежному регистру, у КЦ возникает обязательство вернуть денежные средства Участнику клиринга в размере, определяемом в соответствии с пунктом 20.11.3. настоящих Правил.
      2. Возврат КЦ Участнику клиринга денежных средств, учитываемых в качестве Средств обеспечения, осуществляется на основании поручения на возврат денежных средств.

20.11.1. Денежные средства, учитываемые в качестве Средств обеспечения по денежному регистру Участника клиринга, возвращаются на зарегистрированный в КЦ в соответствии с пунктом 7.17. настоящих Правил расчетный счет.

20.11.2. 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 Клиринговой системы или в форме Электронного документа, подписанного Электронной подписью.

20.11.3. Возврат КЦ Участнику клиринга денежных средств в соответствии с поручением на возврат денежных средств из Средств обеспечения исполняется в случае, 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, а так же величина Доступных средств Участника клиринга по всем ТКС, в результате такого списания не станут отрицательными и величина оценочной стоимости Средств обеспечения Участника клиринга не станет меньше размера обязательств по передаче Дохода, рассчитанного КЦ в соответствии с пунктом настоящих Правил, в случае наличия у Участника клиринга таких обязательств.

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

* + - 1. 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.
      2. КЦ вправе осуществить в любое время зачет денежных требований Участника клиринга по возврату ему денежных средств, учитываемых в качестве Средств обеспечения, с денежными требованиями КЦ к этому Участнику клиринга.
      3. Участник клиринга вправе в порядке, установленном настоящим пунктом, заменить денежные средства в рублях (в иностранной валюте), составляющие предмет индивидуального клирингового обеспечения, денежными средствами в иностранной валюте (в рублях). В целях настоящих Правил указанная замена имущества, составляющего предмет индивидуального клирингового обеспечения, именуется заменой валюты денежных средств, учитываемых в качестве Средств обеспечения.

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

Поручение 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 обеспечение, установленное пунктом настоящих Правил. Исполнение указанного поручения 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:

* + - * + Поручение на замену денежных средств, учитываемых в качестве Средств обеспечения, направляется Участником клиринга в форме Электронного документа, подписанного Электронной подписью. Указанное поручение 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 путем продажи через кредитные организации иностранной валюты (рублей Российской Федерации), составляющей Средства обеспечения, за рубли Российской Федерации (иностранную валюту). Курс продажи валют определяется кредитной организацией на дату совершения данной операции. Список кредитных организаций, в которых могут осуществляться указанные операции, устанавливается КЦ и раскрывается на Сайте КЦ. Участник клиринга выбирает одну из кредитных организаций, путем указания такой организации в поручении на замену валюты денежных средств, учитываемых в качестве Средств обеспечения.
        + КЦ исполняет поручение на замену валюты денежных средств, учитываемых в качестве Средств обеспечения, не позднее сроков, указанных в Регламенте клиринга.
        + Полученные в результате продажи валют денежные средства КЦ учитывает в качестве Средств обеспечения по денежному регистру, относящему к тому же ТКС, что и денежный регистр, на котором учитывались денежные средства до осуществления процедуры замены валюты денежные 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, указанную в Приложении № 2 к настоящим Правилам.
      1. Внесение Средств обеспечения в ценных бумагах возможно путем зачисления ценных бумаг на Торговый счет/Субсчет депо.
      2. Зачисление ценных бумаг на Торговый счет депо осуществляется на основании поручения лица, которому открыт указанный счет, поданного в Расчетный депозитарий и составленного в соответствии с внутренними документами Расчетного депозитария

Зачисление ценных бумаг на Субсчет депо осуществляется на основании поручения КЦ, поданного в Расчетный депозитарий и составленного на основании поручения лица, которому открыт указанный Субсчет депо, поданного в КЦ. Исполнение поручения КЦ на зачисление ценных бумаг на Субсчет депо осуществляется Расчетным депозитарием в соответствии с внутренними документами Расчетного депозитария.

Зачисление на Торговый счет депо/Субсчет депо ценных бумаг, учитываемых в составе ТКС, зарегистрированного Участником клиринга в целях отдельного учета имущества клиента Участника клиринга, являющегося Средствами обеспечения, в случае осуществления КЦ перевода долга, уступки требований и передачи имущества, являющегося Средствами обеспечения, в соответствии с пунктом 7.23 настоящих Правил, осуществляется на основании поручения КЦ, поданного в Расчетный депозитарий, без поручения лица, которому открыт Торговый счет депо/Субсчет депо.

КЦ учитывает на соответствующих клиринговых регистрах информацию о зачислении ценных бумаг на Торговый счет депо/Субсчет депо после получения от Расчетного депозитария отчета, подтверждающих зачисление ценных бумаг на соответствующие счета.

* + - 1. Списание ценных бумаг с Торгового счета депо осуществляется на основании поручения лица, которому открыт указанный счет, поданного в Расчетный депозитарий, составленного в соответствии с внутренними документами Расчетного депозитария.

Списание ценных бумаг с Субсчета депо осуществляется на основании поручения КЦ, поданного в Расчетный депозитарий и составленного на основании поручения лица, которому открыт указанный Субсчет депо, поданного в КЦ. Исполнение поручения КЦ на списание ценных бумаг с Субсчета депо осуществляется Расчетным депозитарием в соответствии с внутренними документами Расчетного депозитария.

Списание с Торгового счета депо/Субсчета депо ценных бумаг, учитываемых в составе ТКС, зарегистрированного Участником клиринга в целях отдельного учета имущества клиента Участника клиринга, являющегося Средствами обеспечения, в случае осуществления КЦ перевода долга, уступки требований и передачи имущества, являющегося Средствами обеспечения, в соответствии с пунктом 7.23 настоящих Правил, осуществляется на основании поручения КЦ, поданного в Расчетный депозитарий, без поручения лица, которому открыт Торговый счет депо/Субсчет депо.

КЦ, получив запрос на проведение операции списания ценных бумаг с Торгового счета депо от Расчетного депозитария/поручение на списание ценных бумаг с Субсчета депо от лица, которому открыт указанный счет, уменьшает Средства обеспечения Участника клиринга, учитываемые на соответствующих клиринговых регистрах, и дает согласие/поручение Расчетному депозитарию на списание ценных бумаг с Торгового счета депо/Субсчета депо, при условии, что:

* + - * + количество ценных бумаг, подлежащих списанию, не превышает значения соответствующей позиции по ценным бумагам Участника клиринга;
        + величина Доступных средств Участника клиринга по ТКС, в состав которого входит соответствующая позиция по ценным бумагам, а также величина Доступных средств Участника клиринга по всем ТКС, в результате такого списания не стали отрицательными;
        + если величина Доступных средств Участника клиринга по ТКС, в состав которого входит соответствующая позиция по ценным бумагам, а также величина Доступных средств Участника клиринга по всем ТКС, были отрицательными до момента такого списания, то указанные величины Доступных средств, рассчитанные с учетом такого списания, не стали меньше величин Доступных средств, рассчитанных до момента такого списания.
      1. Сроки предоставления поручений на зачисление/списание ценных бумаг установлены Регламентом клиринга. При предоставлении поручения на зачисление/списание ценных бумаг позднее времени, указанного в Регламенте клиринга, поручение на зачисление/списание ценных бумаг принимается к исполнению в следующий рабочий день КЦ и Расчетного депозитария.
      2. Информация о размере Средств обеспечения и об изменении размера Средств обеспечения передается Участнику клиринга в составе сведений, предоставляемых КЦ Участникам клиринга в соответствии со статьей 33 настоящих Правил.
    1. Порядок внесения и возврата взноса в Гарантийные фонды
       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, за счет которых будут сформированы Гарантийные фонды, в сумме, не меньшей установленного КЦ размера взноса в соответствующий Гарантийный фонд (далее - Размер взноса), установленного КЦ и указанного в уведомлении.
       2. Участники клиринга и (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», номера и даты договора об оказании клиринговых услуг (для Участников клиринга) или номера и даты договора, заключенного между Гарантом и КЦ в соответствии с пунктом 17.6. настоящих Правил.
       3. В случае внесения Участником клиринга и (или) Гарантом в соответствующий Гарантийный фонд денежных средств в сумме, превышающей Размер взноса, в качестве взноса в соответствующий Гарантийный фонд учитываются вся сумма внесённых денежных средств. Участник клиринга и (или) Гарант вправе на основании заявления о возврате взноса в Гарантийный фонд потребовать возврата суммы денежных средств, превышающей Размер взноса. В указанном случае положения пунктов 21.10.1. – 21.10.4. настоящих Правил к Участнику клиринга не применяются.
       4. В случае поступления денежных средств на Клиринговые денежные счета по платежным 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.
       5. КЦ учитывает взносы Участников клиринга и (или) Гарантов в качестве коллективного клирингового обеспечения после получения выписки от Расчетной организации, содержащей информацию об указанном зачисление, в том числе размере взноса и лица, предоставившего указанные взносы.
       6. В момент зачисления Участником клиринга и (или) Гарантом денежных средств на Клиринговые денежные счета, предназначенные для учета коллективного клирингового обеспечения, и учета их в качестве взноса в Гарантийные фонды, у КЦ возникает обязательство вернуть лицам, перечислившим денежные средства, указанные денежные средства в размере их взноса в Гарантийные фонды.
       7. В случае принятия решения об увеличении Размера взноса КЦ уведомляет Участников 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 взноса. В качестве дополнительных средств при увеличении Размера взноса может быть внесено имущество, указанное в пункте 17.1 настоящих Правил. Информация об увеличении Размера взноса, о необходимости внесения дополнительных денежных средств в российских рублях и (или) иностранной валюте для увеличения текущего размера взноса в соответствующий Гарантийный фонд до вновь установленного Размера взноса, а так же о сроке вступления измененного Размера взноса в силу размещается на Сайте КЦ, а также путем направления каждому Участнику клиринга и Гаранту соответствующего информационного сообщения в форме Электронного документа, подписанного Электронной подписью, и (или) в бумажном виде.
       8. Дополнительные денежные средства в российских рублях и (или) иностранной валюте, внесенные Участником клиринга и (или) Гарантом в соответствии с пунктом настоящих Правил, увеличивают учитываемый КЦ размер взноса Участника клиринга и (или) Гаранта в соответствующий Гарантийный фонд и размер обязательства КЦ по возврату денежных средств в российских рублях и (или) иностранной валюте в размере взноса, внесенного соответствующим лицом.
       9. Возврат Участнику клиринга его взноса в Гарантийный фонд участников осуществляется в случае прекращения действия договора об оказании клиринговых услуг в порядке, предусмотренном пунктом 12.10 настоящих Правил.
       10. Участник клиринга и Гарант вправе предоставить КЦ заявление о возврате взноса в Гарантийные фонды.

21.10.1. При получении от Участника клиринга заявления о возврате взноса в Гарантийный фонд участников КЦ незамедлительно информирует об этом Организатора торговли с целью прекращения допуска к участию в Торгах.

21.10.2. Заявление о возврате взноса 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 Задолженности и/или неисполненные обязательства, допущенные к клирингу.

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

21.10.4.Возврат денежных средств взноса в Гарантийный фонд участников осуществляется на счета, предварительно зарегистрированные Участником клиринга в КЦ. Возврат денежных средств взноса в специальный Гарантийный фонд осуществляется на счета, указанные Гарантами в заявлении о возврате взноса в Гарантийный фонд, или на счета, указанные в договоре между Гарантом и КЦ, заключённом в соответствии с пунктом 17.6 настоящих Правил.

21.10.5.При исполнении заявления о возврате взноса в Гарантийные фонды КЦ уменьшает размер взноса заявителя в соответствующий Гарантийный фонд и размер своего обязательства по возврату заявителю денежных средств в размере его взноса в этот Гарантийный фонд на сумму возвращённых денежных средств.

* + 1. Порядок формирования клиринговых пулов. Порядок исполнения / прекращения обязательств, допущенных к клирингу
       1. Для определения итоговых нетто-обязательств/нетто-требований по Договорам КЦ формирует клиринговый пул по Договорам. В клиринговый пул по Договорам включаются обязательства, возникшие из Договоров, допущенные к клирингу в соответствии со статьей 18 настоящих Правил, с наступившими Датами исполнения.
       2. По наступлении Даты исполнения Договоров в срок, установленный Регламентом клиринга:

1. КЦ включает в клиринговый пул по Договорам:
   * + - * обязательства и требования Участника клиринга и КЦ по денежным средствам и ценным бумагам по Договорам с наступившей Датой исполнения;
         * обязательства по передаче / требования по получению Дохода, определенные в соответствии со статьей 26 настоящих Правил;
2. обязательства зачитываются со встречными однородными требованиями Участника клиринга и КЦ по денежным средствам и ценным бумагам по Договорам с наступившей Датой исполнения, обязательства по которым учитываются на определенных регистрах учета позиций, обязательства по передаче Дохода зачитываются со встречными однородными требованиями по получению Дохода, определенные в соответствии со статьей 26 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 и КЦ по каждому денежному разделу / Торговому счету депо/Субсчету депо, через которые будет осуществляться исполнение итоговых нетто-обязательств и/или итоговых нетто-требований.
   * + 1. Итоговые нетто-обязательства / итоговые нетто-требования по денежным средствам / ценным бумагам, возникшие по итогам клиринга обязательств в клиринговом пуле по Договорам, включаются в формируемый КЦ расчетный клиринговый пул, по которому не осуществляется централизованный клиринг. В расчетный клиринговый пул также включаются обязательства и требования по денежным средствам, возникшие из Конверсионных договоров, допущенные к клирингу в соответствии со статьей 18 настоящих Правил, с наступившими датами исполнения, а также обязательства по уплате сборов, указанных в пункте 13.6 настоящих Правил. Размер обязательств по уплате указанных сборов подлежит математическому округлению с точностью до двух знаков после запятой, и при наличии хотя бы одного Договора взимается не менее 0,01 (одной сотой) валюты соответствующего сбора.

КЦ по обязательствам, включенным в расчетный клиринговый пул, проводит неттинг (зачет), по итогам которого определяются итоговые нетто-обязательства и (или) итоговые нетто-требования по денежным средствам / ценным бумагам каждого Участника клиринга и КЦ по каждому денежному разделу / Торговому счету депо/Субсчету депо, через которые будет осуществляться исполнение итоговых нетто-обязательств и (или) итоговых нетто-требований.

* + - 1. Участник клиринга обязан исполнить свои итоговые нетто-обязательства по денежным средствам и (или) ценным бумагам, возникшие по итогам клиринга обязательств из расчетного клирингового пула, 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, о чем известить Участников клиринга посредством Клиринговой системы, Сайта КЦ и (или) в форме Электронного документа, подписанного Электронной подписью.

Исполнение итоговых нетто-обязательств и итоговых нетто-требований осуществляется в порядке, определенном в пункте настоящих Правил. Прекращение указанных итоговых нетто-обязательств и итоговых нетто-требований может также осуществляться путем включения указанных итоговых нетто-обязательств и итоговых нетто-требований в другой клиринговый пул, формируемый в соответствии с настоящими Правилами.

* + - 1. Осуществление итоговых нетто-требований Участника клиринга, определенных в отношении денежного регистра/Торгового счета депо/Субсчета депо, относящихся к определенному ТКС, возможно только после исполнения Участником клиринга итоговых нетто-обязательств, определённых по денежному регистру/Торговому счету депо/Субсчету депо, относящихся к тому же ТКС.
      2. Для исполнения итогового нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам, учитываемых в отношении определенного денежного регистра/Торгового счета/ Субсчета депо, используются денежные средства / ценные бумаги, учитываемые по тому же денежному регистру/Торговому счету депо/Субсчету депо.
      3. Итоговое нетто-обязательство Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам может быть исполнено по денежному регистру/ Торговому счету депо/Субсчету депо, в отношении которого оно определено, если размер денежных средств / ценных бумаг по тому же денежному регистру/ Торговому счету депо/Субсчету депо не меньше, чем итоговое нетто-обязательство Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам, учитываемое по денежному регистру/ Торговому счету депо/Субсчету депо.

КЦ исполняет итоговые нетто-обязательства и итоговые нетто-требования по денежным средствам и ценным бумагам, указанные в пункте настоящих Правил в следующем порядке:

1) КЦ исполняет указанные итоговые нетто-обязательства по денежным средствам 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. Итоговое нетто-требование Участника клиринга по денежным средствам, учитываемое в отношении денежного регистра, прекращается возникновением обязательства КЦ по возврату Участнику клиринга соответствующих денежных средств, учитываемых в качестве Средств обеспечения по тому же денежному регистру, в размере итогового нетто-требования по денежным средствам. При этом размер Средств обеспечения Участника клиринга в соответствующих денежных средствах по денежному регистру увеличивается на сумму прекращаемого итогового нетто-требования. После исполнения (прекращения) итогового нетто-требования Участника клиринга по денежным средствам обязательство КЦ по возврату Участнику клиринга денежных средств в российских рублях или иностранной валюте, учитываемых в качестве Средств обеспечения по денежному регистру, зачитывается с требованиями КЦ к Участнику клиринга по погашению его задолженности перед КЦ в российских рублях или иностранной валюте (в случае наличия у Участника клиринга такой задолженности). При этом размер Средств обеспечения в денежных средствах по денежному регистру уменьшается на сумму указанного требования КЦ к Участнику клиринга. Расчеты по денежным средства считаются завершенными с момента их отражения в учете на клиринговых регистрах Участника клиринга.

2) КЦ для исполнения итоговых нетто-обязательств по ценным бумагам передает поручение в Расчетный депозитарий на проведение расчетов по Торговым счетам депо/Субсчетам депо. Итоговые нетто-обязательства и нетто-требования Участника клиринга по ценным бумагам, учитываемые в отношении Торговых счетов депо/Субсчетов депо, прекращаются в расчетном клиринговом пуле. Подтверждением прекращения итоговых нетто-обязательства и нетто-требования в расчетном клиринговом пуле 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 по итогам клиринга считаются завершенными. Информация о прекращении обязательств отражается в учете на клиринговых регистрах Участника клиринга.

3) В случае наличия итоговых нетто-обязательств Участника клиринга перед другим Участником клиринга исполнение указанных обязательств 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 соответственно. КЦ отражает исполнение итоговых нетто-требований / итоговых нетто-обязательств Участников клиринга в учете на клиринговых регистрах Участников клиринга. Расчеты по денежным средства считаются завершенными с момента их отражения в учете на клиринговых регистрах Участника клиринга.

* + - 1. В случае ненадлежащего исполнения Участником клиринга перед КЦ итогового нетто-обязательства по ценным бумаг, определенного КЦ в соответствии с пунктом настоящих Правил и подлежащего исполнению в соответствии с пунктом настоящих Правил, в результате недостаточности ценных бумаг, учитываемых в отношении определенного Торгового счета депо / Субсчета депо, данный Участник клиринга признается недобросовестным Участником клиринга и КЦ выполняет действия, направленные на исполнение указанных итоговых нетто-обязательств, в порядке, определённом статьей 23 настоящих Правил.
      2. КЦ, после проведения в соответствии со статьей 23 настоящих Правил процедуры урегулирования исполнения итоговых нетто-обязательств по Договорам, по которым было допущено ненадлежащее исполнение Участником клиринга, формирует клиринговый пул по Договорам.

1. КЦ включает в клиринговый пул по Договорам:
   * + - * обязательства и требования Участника клиринга и КЦ по денежным средствам и ценным бумагам по Договорам с наступившей Датой исполнения, заключенным в соответствии со статьей 23 настоящих Правил;
         * обязательства / требования Участника клиринга и КЦ по Договорам репо КЦ, заключенным в соответствии со статьей 25 настоящих Правил.
2. обязательства зачитываются со встречными однородными требованиями Участника клиринга и КЦ по денежным средствам и ценным бумагам по Договорам с наступившей Датой исполнения, обязательства по которым учитываются на определенных регистрах учета позиций, а в части, в которой обязательства и требования не были зачтены, КЦ определяет итоговые нетто-обязательства и/или итоговые нетто-требования по денежным средствам / ценным бумагам каждого Участника клиринга и КЦ по каждому денежному разделу / Торговому счету депо/Субсчету депо, через которые будет осуществляться исполнение итоговых нетто-обязательств и/или итоговых нетто-требований.
3. КЦ после проведения действий, указанных в подпунктах 1-2 настоящего пункта, формирует расчетный клиринговый пул, по которому не осуществляется централизованный клиринг. КЦ включает в расчетный клиринговый пул:
   * + - * итоговые нетто-обязательства / итоговые нетто-требования по денежным средствам / ценным бумагам, возникшие по итогам клиринга обязательств в клиринговом пуле по Договорам в соответствии с подпунктами 1-2 настоящего пункта;
         * обязательства по оплате сборов, указанных в пункте 13.6 настоящих Правил. При этом размер обязательств по оплате указанных сборов подлежит математическому округлению с точностью до двух знаков после запятой, и при наличии хотя бы одного Договора взимается не менее 0,01 (одной сотой) валюты соответствующего сбора;
         * итоговые нетто-обязательства / итоговые нетто-требования по денежным средствам / ценным бумагам, определенные в соответствии с пунктом настоящих Правил.
4. КЦ по обязательствам, включенным в расчетный клиринговый пул, проводит неттинг (зачет), по итогам которого определяются итоговые нетто-обязательства и (или) итоговые нетто-требования по денежным средствам / ценным бумагам каждого Участника клиринга и КЦ по каждому денежному разделу / Торговому счету депо/Субсчету депо, через которые будет осуществляться исполнение итоговых нетто-обязательств и (или) итоговых нетто-требований.
5. По обязательствам, включенным в расчетный клиринговый пул в соответствии с подпунктом 3 настоящего пункта, КЦ повторно осуществляет действия, описанные в пунктах - настоящей статьи Правил, в целях определения итоговых нетто-обязательств и/или итоговых нетто-требований по денежным средствам / ценным бумагам каждого Участника клиринга и КЦ по каждому денежному регистру / Торговому счету депо/Субсчету депо, через которые будет осуществляться исполнение итоговых нетто-обязательств и/или итоговых нетто-требований, проверки возможности их исполнения и исполнения.
   * + 1. В случае недостаточности денежных средств, учитываемых в отношении определенного денежного регистра, для исполнения итогового нетто-обязательства Участника клиринга, по денежным средствам в определенной валюте (далее - валюта нехватки), но при наличии денежных средств в иной валюте, учитываемых на указанном денежном регистре, Участник клиринга может заключить Конверсионный договор и подать Поручение на клиринг внебиржевых договоров в сроки, установленные в Регламенте клиринга.

Если Участник клиринга подал Поручение на клиринг внебиржевых договоров, в котором указан Конверсионный договор, в сроки, установленные в Регламенте клиринга, и оно может быть принято к исполнению, а обязательства из Конверсионного договора, указанного в Поручении на клиринг внебиржевых договоров, допущены к клирингу в соответствии со статьей 18 настоящих Правил, КЦ формирует расчетный клиринговый пул, по которому не осуществляется централизованный клиринг. В расчетный клиринговый пул включаются следующие обязательства:

* + - * + итоговые нетто-обязательства / итоговые нетто-требования по денежным средствам / ценным бумагам, определенные в соответствии с пунктом настоящих Правил или в соответствии с подпунктом 4 пункта настоящих Правил;
        + обязательства и требования Участника клиринга по денежным средствам по Конверсионным договорам с наступившей датой исполнения, заключенным в соответствии с настоящим пунктом.

22.10.2. По результатам осуществления клиринга по обязательствам, включенным в расчетный клиринговый пул в соответствии с пунктом настоящих Правил, КЦ повторно осуществляет действия, описанные в пунктах - 22.7. настоящих Правил в целях определения итоговых нетто-обязательств и/или итоговых нетто-требований по денежным средствам / ценным бумагам каждого Участника клиринга и КЦ по каждому денежному регистру / Торговому счету депо/Субсчету депо, через которые будет осуществляться исполнение итоговых нетто-обязательств и/или итоговых нетто-требований, проверки возможности их исполнения и исполнения.

* + - 1. В случае недостаточности денежных средств, учитываемых в отношении определенного денежного регистра, для исполнения соответствующего итогового нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам, в первую очередь исполняются обязательства Участника клиринга перед КЦ, а во вторую очередь - обязательства Участника клиринга перед другими Участниками клиринга.

В случае ненадлежащего исполнения Участником клиринга перед КЦ итогового нетто-обязательства по денежным средствам, определенного КЦ в соответствии с пунктом 22.10.2 настоящих Правил и подлежащего исполнению в соответствии с пунктом настоящих Правил, в результате недостаточности денежных средств, данный Участник клиринга признается недобросовестным Участником клиринга и КЦ выполняет действия, направленные на исполнение обязательств, которые были неисполнены, в порядке, определенном статьей 23 настоящих Правил.

* + - 1. КЦ, после проведения в соответствии со статьей 23 настоящих Правил процедуры урегулирования исполнения итоговых нетто-обязательств по Договорам, по которым было допущено ненадлежащее исполнение Участником клиринга, формирует клиринговый пул по Договорам. В клиринговый пул по Договорам включаются обязательства, возникающие из Договоров с наступившей Датой исполнения и допущенные к клирингу в соответствии со статьей 18 настоящих Правил:
         * обязательства и требования Участника клиринга и КЦ по денежным средствам и ценным бумагам по Договорам с наступившей Датой исполнения, заключенным в соответствии со статьей 23 настоящих Правил;
         * обязательства / требования Участника клиринга и КЦ по Договорам репо КЦ, заключенным в соответствии со статьей 25 настоящих Правил.

По обязательствам, включенным в клиринговый пул по Договорам в соответствии с настоящим пунктом Правил, КЦ повторно осуществляет действия, описанные в подпункте 2 пункта . настоящих Правил, в целях определения итоговых нетто-обязательств и/или итоговых нетто-требований по денежным средствам / ценным бумагам каждого Участника клиринга и КЦ по каждому денежному регистру / Торговому счету депо/Субсчету депо.

* + - 1. КЦ после проведения действий, указанных в пункте настоящих Правил, формирует расчетный клиринговый пул, по которому не осуществляется централизованный клиринг. В расчетный клиринговый пул включаются следующие обязательства:
         * итоговые нетто-обязательства / итоговые нетто-требования по денежным средствам / ценным бумагам, определенные в соответствии с пунктом 22.3. настоящих Правил, или итоговые нетто-обязательства / итоговые нетто-требования по денежным средствам / ценным бумагам, определенные в соответствии с подпунктом 3 пункта настоящих Правил, или итоговые нетто-обязательства / итоговые нетто-требования по денежным средствам / ценным бумагам, определенные в соответствии с пунктом 22.10.2. настоящих Правил;
         * обязательства по оплате сборов, указанных в пункте 13.6. настоящих Правил. При этом размер обязательств по оплате указанных сборов подлежит математическому округлению с точностью до двух знаков после запятой, и при наличии хотя бы одного Договора взимается не менее 0,01 (одной сотой) валюты соответствующего сбора;
         * итоговые нетто-обязательства / итоговые нетто-требования по денежным средствам / ценным бумагам, определенные в соответствии с пунктом 22.12. настоящих Правил.

По результатам осуществления клиринга по обязательствам, включенным в расчетный клиринговый пул в соответствии с настоящим пунктом Правил, КЦ повторно осуществляет действия, описанные в пунктах 22.3.1.-22.7. настоящих Правил в целях определения итоговых нетто-обязательств и/или итоговых нетто-требований по денежным средствам / ценным бумагам каждого Участника клиринга и КЦ по каждому денежному регистру / Торговому счету депо/Субсчету депо, через которые будет осуществляться исполнение итоговых нетто-обязательств и/или итоговых нетто-требований, проверки возможности их исполнения и исполнения.

* + - 1. В случае ненадлежащего исполнения Участником клиринга итоговых нетто-обязательств по денежным средствам перед КЦ и невозможности совершения действия, указанный в пунктах - настоящих Правил, КЦ учитывает величину превышения итогового нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам по денежному регистру над размером денежных средств по тому же денежному регистру в качестве задолженности по данному денежному регистру.
      2. В случае невозможности исполнения итоговых нетто-обязательств по денежным средствам перед другим Участником клиринга, итоговые нетто-обязательства считаются прекращенными, а КЦ списывает с Участника клиринга, не исполнившего обязательства, в пользу другого Участника клиринга штраф.
         * Величина штрафа рассчитывается по следующей формуле:

, где

Penalty – величина штрафа;

Liability – величина неисполненных обязательств в соответствующей валюте;

Forfeit\_rate– штрафная ставка, установленная КЦ для валюты неисполненных обязательств 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 является обязательством, допущенным к клирингу. Обязательно по уплате штрафа включается в клиринговый пул для расчётов по итогам Торгов в дату возникновения указанного обязательства.

* + - 1. Обязательства/требования по уплате штрафов, возникшие в соответствии с пунктом настоящих Правил, рассчитываются по окончанию основной торговой сессии каждый Расчетный день, и на основании информации о размерах указанных штрафов, допускаются к клирингу и включаются в состав обязательств клирингового пула для расчетов по итогам Торгов в соответствии со статьей 28 настоящих Правил.
         * КЦ исполняет обязательства/требования Участника клиринга, определенные в отношении денежного регистра, относящемуся к определённому ТКС.
         * Для исполнения обязательства Участника клиринга по денежным средствам, учитываемых в отношении определенного денежного регистра, используются денежные средства, учитываемые по тому же денежному регистру.
         * Обязательство Участника клиринга по денежным средствам может быть исполнено по денежному регистру, в отношении которого оно определено, если размер денежных средствах по тому же денежному регистру не меньше, чем обязательство Участника клиринга по денежным средствам, учитываемое по денежному регистру.
         * В случае если обязательство Участника клиринга по денежным средствам по денежному регистру превышает размер денежных средствах по тому же денежному регистру, КЦ учитывает такое превышение в качестве задолженности Участника клиринга перед другим Участников клиринга по данному денежному регистру.
      2. Для определения итоговых нетто-обязательств/нетто-требований по Договорам, заключенным на основании Заявок, в которых указаны одинаковые ТКС, КЦ формирует клиринговый пул по внутриброкерским Договорам. В клиринговый пул по внутриброкерским Договорам включаются обязательства, возникшие из Договоров, заключенных на основании Заявок, в которых указаны одинаковые ТКС, допущенные к клирингу в соответствии со статьей 18 настоящих Правил, с наступившими Датами исполнения.
      3. Клиринговый пул по внутриброкерским Договорам формируется КЦ после проведения действий по определению итоговых нетто-обязательств / итоговых нетто-требований по денежным средствам / ценным бумагам в соответствии с пунктом настоящих Правил. В ходе формирования клирингового пула по внутриброкерским Договорам осуществляются следующие действия:
         * КЦ включает в клиринговый пул по внутриброкерским Договорам обязательства и требования Участника клиринга и КЦ по денежным средствам и ценным бумагам по Договорам заключенным на основании Заявок, в которых указаны одинаковые ТКС, с наступившей Датой исполнения;
         * обязательства зачитываются со встречными однородными требованиями Участника клиринга и КЦ по денежным средствам и ценным бумагам по Договорам, заключенным на основании Заявок, в которых указаны одинаковые ТКС, с наступившей Датой исполнения, обязательства по которым учитываются на определенных регистрах учета позиций.
      4. Обязательства и требования Участника клиринга и КЦ по денежным средствам и ценным бумагам по Договорам, заключенным на основании Заявок, в которых указаны одинаковые ТКС, прекращаются зачетом в клиринговом пуле по внутриброкерским Договорам.
      5. Для определения итоговых нетто-обязательств/нетто-требований по Договорам, заключенным в Режиме торгов Аукцион по размещению, Режиме торгов Адресное размещение, Режиме торгов Аукцион по выкупу и Режиме торгов Адресный выкуп, КЦ формирует расчетный клиринговый пул по указанным Договорам. В этот расчетный клиринговый пул включаются допущенные к клирингу обязательства, возникшие из Договоров, заключенных в Режиме торгов Аукцион по размещению, Режиме торгов Адресное размещение, Режиме торгов Аукцион по выкупу и Режиме торгов Адресный выкуп, с наступившими Датами исполнения.
      6. Сроки, в которые КЦ формирует расчетный клиринговый пул по Договорам, заключенным в Режиме торгов Аукцион по размещению, Режиме торгов Адресное размещение, Режиме торгов Аукцион по выкупу и Режиме торгов Адресный выкуп, устанавливаются Регламентом клиринга. КЦ вправе установить срок, отличный от срока, установленного в Регламенте клиринга, известив Участников клиринга об изменении срока посредством Клиринговой системы, Сайта КЦ и (или) в форме Электронного документа, подписанного Электронной подписью.
      7. В установленный в соответствии с пунктом настоящих Правил срок:
         * КЦ включает в расчетный клиринговый пул по Договорам, заключенным в Режиме торгов Аукцион по размещению, Режиме торгов Адресное размещение, Режиме торгов Аукцион по выкупу и Режиме торгов Адресный выкуп, обязательства и требования Участников клиринга по денежным средствам и ценным бумагам по указанным Договорам с наступившей Датой исполнения;
         * обязательства зачитываются со встречными однородными требованиями Участников клиринга по денежным средствам и ценным бумагам по Договорам, заключенным в Режиме торгов Аукцион по размещению, Режиме торгов Адресное размещение, Режиме торгов Аукцион по выкупу и Режиме торгов Адресный выкуп, с наступившей Датой исполнения, обязательства по которым учитываются на определенных регистрах учета позиций, 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 разделу / позиции по ценным бумагам Участника клиринга – Продавца/ Торговому счету депо/Субсчету депо, через которые будет осуществляться исполнение итоговых нетто-обязательств и/или итоговых нетто-требований.
      8. Участник клиринга обязан исполнить свои итоговые нетто-обязательства по денежным средствам и (или) ценным бумагам, возникшие по итогам клиринга обязательств из расчетного клирингового пула по Договорам, заключенным в Режиме торгов Аукцион по размещению, Режиме торгов Адресное размещение, Режиме торгов Аукцион по выкупу и Режиме торгов Адресный выкуп, 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 Клиринговой системы, Сайта КЦ и (или) в форме Электронного документа, подписанного Электронной подписью.

* + - 1. Исполнение итоговых нетто-обязательств и итоговых нетто-требований осуществляется в порядке, определенном в пунктах - настоящих Правил.
      2. Исполнение итоговых нетто-требований Участника клиринга, определенных в отношении денежного регистра/позиции по ценным бумагам Участника клиринга-Продавца / Торгового счета депо/Субсчета депо, относящемуся к определенному ТКС, возможно только после исполнения Участником клиринга итоговых нетто-обязательств, определенных по денежному регистру/ позиции по ценным бумагам Участника клиринга–Продавца/ Торговому счету депо/Субсчету депо, относящихся к тому же ТКС.
      3. 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/ Торгового счета депо (Субсчета депо), используются денежные средства / ценные бумаги, учитываемые по тому же денежному регистру/ позиции по ценным бумагам Участника клиринга–Продавца/Торговому счету депо/Субсчету депо.
      4. Итоговое нетто-обязательство Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам может быть исполнено по денежному регистру / позиции по ценным бумагам Участника клиринга–Продавца/ Торговому счету депо/Субсчету депо, в отношении которого оно определено, если размер денежных средств / ценных бумаг по тому же денежному регистру/ позиции по ценным бумагам Участника клиринга–Продавца/Торговому счету депо/Субсчету депо не меньше, чем итоговое нетто-обязательство Участника клиринга по денежным средствам / ценным бумагам, учитываемое по денежному регистру/ позиции по ценным бумагам Участника клиринга–Продавца/Торговому счету депо/Субсчету 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/Торговым счетам депо. Для исполнения итоговых нетто-обязательств и итоговых нетто-требований, возникших из Договоров, заключенных в Режиме торгов Аукцион по размещению и в Режиме торгов Адресное размещение, КЦ направляет поручение в Расчетный депозитарий только после получения от Расчетного депозитария информации о зачислении всех ценных бумаг, подлежащих размещению, на счет депо номинального держателя Расчетного депозитария, открытый в депозитарии, которому присвоен статус центрального депозитария. Подтверждением исполнения итоговых нетто-обязательств и нетто-требований является получение КЦ от Расчетного депозитария отчета, подтверждающего исполнение направленного в Расчетный депозитарий сводного поручения депо. С момента получения КЦ от Расчетного депозитария указанного отчета, расчеты по ценным бумагам считаются завершёнными. Информация о прекращении обязательств отражается в учете на клиринговых регистрах Участника клиринга.

* + - 1. 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 33 настоящих Правил.
      2. Итоговые нетто-обязательства / итоговые нетто-требования, возникшие в результате осуществления КЦ действий, указанных в настоящей статье Правил, рассчитываются и подлежат исполнению в валюте, используемой для расчётов по Договорам в соответствии с Правилами торговли.
      3. Обязательства Участника клиринга - кредитной организации, у которой отозвана лицензия на осуществление банковских операций, и (или) 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 клиринговые пулы, формируемые в соответствии с настоящей статьей Правил. Прекращение указанных обязательств осуществляется в порядке, предусмотренном статьей 36 настоящих Правил.
    1. Порядок урегулирования ненадлежащего исполнения обязательств
       1. В случае наличия указанных в пунктах и настоящих Правил обязательств Участника клиринга перед КЦ, между КЦ и недобросовестным Участником клиринга, без подачи заявок на Торгах Организатора торгов заключается Договор репо с исполнением второй части Договора репо в Расчетный день, следующий за датой заключения первой части Договора репо.
       2. Договор репо с недобросовестным Участником клиринга заключаются при соблюдении следующих условий:

а) у Участника клиринга не отозвана 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 в отношении Участника клиринга, перечисленных в пункте 12.5 настоящих Правил, при наступлении которых клиринговое обслуживание Участника клиринга может быть приостановлено;

в) КЦ не менее чем за 4 (четыре) Расчетных дня до даты заключения Договора репо не известил Участника клиринга посредством Электронного документа, подписанного Электронной подписью, о не заключении Договора репо в целях исполнения Участником клиринга итогового нетто-обязательства по денежным средствам или итогового нетто-обязательства по соответствующим ценным бумагам, учитываемого в отношении определенного денежного регистра/ Торгового счета депо/Субсчета депо;

г) отсутствует решение об исключении ценной бумаги, по которой учитывается итоговое нетто-обязательство, из Списка ценных бумаг со следующего Расчетного дня;

д) отсутствует решение КЦ о не заключении Договоров репо в соответствии с настоящей статьей Правил в отношении ценной бумаги в связи с их консолидацией, а также в связи с реорганизацией эмитента ценных бумаг в форме слияния, присоединения или разделения;

е) отсутствует решение эмитента или лица, выдавшего ценные бумаги, о выплате Дохода ценными бумагами.

* + - 1. Договоры репо, заключаемые в соответствии с пунктом 23.1. настоящих Правил, заключаются между КЦ и недобросовестным Участником клиринга с учетом следующих особенностей:
         * в случае наличия у Участника клиринга итогового нетто-обязательства по ценным бумагам, которое может быть не исполнено:
         * по первой части Договора репо у Участника клиринга возникают требования по соответствующим ценным бумагам, противоположные указанному нетто-обязательству Участника клиринга по ценным бумагам, которое может быть не исполнено, в объеме, равном итоговому нетто-обязательству Участника клиринга по ценным бумагам, которое может быть не исполнено;
         * в случае наличия у Участника клиринга итогового нетто-обязательства по денежным средствам, которое может быть не исполнено:
         * по первой части Договора репо у Участника клиринга возникают требования по денежным средствам, противоположные итоговому нетто-обязательству Участника клиринга по денежным средствам, которое может быть не исполнено, и обязательства по ценным бумагам в объеме, равном количеству ценных бумаг, не превышающему суммы объема итогового нетто-требования по ценным бумагам, соответствующего итоговому нетто-обязательству Участника клиринга по денежным средствам, которое может быть не исполнено;
         * первая часть Договора репо исполняется в день его заключения;
         * вторая часть Договора репо исполняется в Расчетный день, следующий за днем его заключения;
         * ставка Договора репо равна нулю;

КЦ взимает штраф с недобросовестного Участника клиринга.

Величина штрафа рассчитывается по следующей формуле:

в случае наличия у Участника клиринга итогового нетто-обязательства по ценным бумагам, которое может быть не исполнено:

в случае наличия у Участника клиринга итогового нетто-обязательства по денежным средствам, которое может быть не исполнено:

, где

Penalty –величина штрафа;

SP – расчетная цена ценной бумаги, определенная в результате проведения последней клиринговой сессии;

Q – количество ценных бумаг, являющееся предметом Договора, шт. (без учета знака);

fine\_short, fine\_long – штрафные ставки, установленные КЦ для каждой ценной бумаги, включенной в Список ценных бумаг, в соответствии с Методикой установления и изменения риск-параметров;

T365 – количество календарных дней между Датой исполнения первой части Договора репо и Датой исполнения второй части Договора репо, приходящихся на календарный год, состоящий из 365 дней;

T366 - количество календарных дней между Датой исполнения первой части Договора репо и Датой исполнения второй части Договора репо, приходящихся на календарный год, состоящий из 366 дней.

Обязательство Участника клиринга по уплате штрафа является обязательством, допущенным к клирингу. Обязательно по уплате штрафа включается в клиринговый пул для расчетов по итогам Торгов в дату заключения Договора репо.

При наличии у Участника клиринга итогового нетто-обязательства по денежным средствам, которое может быть не исполнено, и учитываемого в отношении определенного денежного регистра, Договор репо в соответствии с настоящим пунктом Правил заключается в отношении ценных бумаг, которые учитываются на депо регистре, входящим в тот же ТКС, что и указанный денежный регистр.

В случае невозможности исполнения Участником клиринга своих итоговых нетто-обязательств по денежным средствам / ценным бумагам вследствие непреодолимой силы или сбоя в платежной системе Банка России, с недобросовестного Участника клиринга штраф не взимается. Под обстоятельствами непреодолимой силы понимаются:

* военные действия, акты террора, диверсии и саботажа, массовые беспорядки, забастовки, смена политического режима и другие политические осложнения;
* изменения законодательных или иных актов государственных органов Российской Федерации, решений законодательных и исполнительных органов власти;
* пожары или иные несчастные случаи, разрушения или значительные повреждения занимаемых Участником клиринга помещений;
* любые иные обстоятельства, которые создают или могут создать угрозу жизни или здоровью работников Участника клиринга.

О возникновении обстоятельств непреодолимой силы, вследствие которых исполнение Участником клиринга своих итоговых нетто-обязательств по денежным средствам / ценным бумагам невозможно, Участник клиринга обязан уведомить КЦ любыми доступными средствами связи до установленного Регламентом клиринга времени исполнения итоговых нетто-обязательств по денежным средствам / ценным бумагам.

Участник клиринга обязан предоставить КЦ документы, подтверждающие обстоятельства непреодолимой силы в течение 7 (семи) дней. В случае непредоставления Участником клиринга КЦ таких документов в указанный срок с Участника клиринга по решению КЦ взыскивается неустойка в размере штрафа, рассчитанного в соответствии с настоящим пунктом Правил в расчете на количество календарных дней между Датой исполнения первой части Договора репо и датой расчета неустойки.

* + - 1. При наличии обязательств, определенных в пункте настоящих Правил, и несоблюдении условий, указанных в пункте 23.2 Правил клиринга, в ходе прекращения обязательств по Договорам, проводимого в соответствии с настоящей статьей Правил, КЦ осуществляет процедуру принудительного закрытия до момента прекращения обязательств по Договорам, на условиях, описанных в пунктах - настоящих Правил, если иное не предусмотрено настоящим пунктом Правил.

КЦ осуществляет процедуру принудительного закрытия, описанную в пунктах - настоящих Правил, при соблюдении следующих условий:

* + - * + при исполнении итоговых нетто-требований, указанных в пункте настоящих Правил, Договоры без подачи Заявок заключаются с недобросовестным Участником клиринга;
        + цена одной ценной бумаги по Договору, предметом которого являются ценные бумаги, относящиеся к Группе инструментов «российские ценные бумаги», равна расчетной цене данной ценной бумаги, определенной в результате проведения последней клиринговой сессии;
        + цена одной ценной бумаги по Договору, предметом которого являются ценные бумаги, относящиеся к Группе инструментов «иностранные ценные бумаги», равна цене последнего проведённого аукциона закрытия;
        + в случае заключения Договора, предметом которого являются ценные бумаги, относящиеся к Группе инструментов «иностранные ценные бумаги», КЦ рассчитывает сумму компенсации при изменении цены указанных ценных бумаг, полученной в результате проведения аукциона закрытия в день, следующий за днем заключения Договора.

Компенсация рассчитывается по следующей формуле:

, где

Refund – величина компенсации при изменении цены ценных бумаг, относящихся к Группе инструментов «иностранные ценные бумаги»;

– цена аукциона закрытия, проведенного в день, следующий за днем заключения Договора;

– цена последнего проведённого аукциона закрытия в день заключения Договора.

Если сумма компенсации, рассчитанная по указанной формуле, является положительной величиной, то указанная сумма подлежит удержанию с Участника клиринга, в случае наличия у него итогового нетто-обязательства по ценным бумагам, которое может быть не исполнено, и зачисляется Участнику клиринга, в случае наличия у него итогового нетто-обязательства по денежным средствам, которое может быть не исполнено.

Если сумма компенсации, рассчитанная по указанной формуле, является отрицательной величиной, то абсолютное значение этой величины зачисляется Участнику клиринга в случае наличия у него итогового нетто-обязательства по ценным бумагам, которое может быть не исполнено, и списывается с Участника клиринга, в случае наличия у него итогового нетто-обязательства по денежным средствам, которое может быть не исполнено.

Обязательство по уплате /требование по получению компенсации является обязательством, допущенным к клирингу. Обязательство по уплате/требование по получению компенсации включается в клиринговый пул для расчетов по итогам Торгов в дату, следующую за датой заключения Договора, указанного в настоящем пункте Правил.

КЦ удерживает с недобросовестного Участника клиринга штраф, указанный в подпункте 23.3. настоящих Правил.

* + - 1. При наличии недобросовестных Участников клиринга, итоговые нетто-требований по денежным средствам / ценным бумагам добросовестных Участников клиринга перед КЦ удовлетворяются путем выполнения КЦ действий в следующей последовательности:

23.5.1. использование свободных собственных денежных средств и (или)ценных бумаг КЦ;

23.5.2. в случае недостаточности свободных собственных ценных бумаг заключение Договора репо КЦ, условия которых определены статьей 25 настоящих Правил;

23.5.3. в случае недостаточности свободных собственных денежных средств и/или невозможности заключения Договора репо КЦ в соответствии со статьей 25 настоящих Правил, КЦ без подачи заявок на Торгах Организатора торговли заключает Договоры репо с добросовестным Участником клиринга:

* в случае недостаточности у КЦ ценных бумаг для исполнения итоговых нетто-требований добросовестного Участника клиринга по первой части Договора репо у добросовестного Участника клиринга возникают обязательства по соответствующим ценным бумагам, противоположные указанному итоговому нетто-требованию добросовестного Участника клиринга по ценным бумагам, которое может быть не исполнено, в объеме, равном итоговому нетто-требованию добросовестного Участника клиринга по ценным бумагам, которое может быть не исполнено;
* в случае недостаточности у КЦ денежных средств для исполнения итоговых нетто-требований добросовестного Участника клиринга по первой части Договора репо у добросовестного Участника клиринга возникают обязательства по денежным средствам, противоположные указанному итоговому нетто-требованию добросовестного Участника клиринга по денежным средствам, которое может быть не исполнено, и требования по ценным бумагам в объеме, равном итоговому нетто-обязательству добросовестного Участника клиринга по ценным бумагам, соответствующему итоговому нетто-требованию добросовестного Участника клиринга по денежным средствам, которое может быть не исполнено;
* первая часть Договора репо исполняется в день ее заключения;
* вторая часть Договора репо исполняется в Расчетный день, следующий за днем ее заключения;
* ставка Договора репо равна нулю.

КЦ уплачивает добросовестному Участнику клиринга штраф.

Величина штрафа рассчитывается по следующей формуле:

в случае наличия у КЦ итогового нетто-обязательства по ценным бумагам, которое может быть не исполнено:

в случае наличия у КЦ итогового нетто-обязательства по денежным средствам, которое может быть не исполнено:

, где

Penalty –величина штрафа;

SP – расчетная цена ценной бумаги, определенная в результате проведения последней клиринговой сессии;

Q – количество ценных бумаг, являющееся предметом Договора, шт. (без учета знака);

ch\_fine\_short, ch\_fine\_long – штрафные ставки, установленные КЦ для каждой ценной бумаги, включенной в Список ценных бумаг, в соответствии с Методикой установления и изменения риск-параметров;

T365 – количество календарных дней между Датой исполнения первой части Договора репо и Датой исполнения второй части Договора репо, приходящихся на календарный год, состоящий из 365 дней;

T366 - количество календарных дней между Датой исполнения первой части Договора репо и Датой исполнения второй части Договора репо, приходящихся на календарный год, состоящий из 366 дней.

Обязательство КЦ по уплате штрафа является обязательством, допущенным к клирингу. Обязательно по уплате штрафа включается в клиринговый пул для расчетов по итогам Торгов в дату заключения Договора репо.

* + - 1. Договоры репо, указанные в подпункте 23.5.3. настоящих Правил, могут заключаться КЦ с добросовестным Участником клиринга до момента полного удовлетворения итоговых нетто-требований по денежным средствам / ценным бумагам добросовестного Участника клиринга перед КЦ. КЦ вправе известить Участника клиринга о незаключении Договоров репо за 4 (четыре) Расчетных дня до даты заключения указанных Договоров, посредством Электронного документа, подписанного Электронной подписью.

В случае невозможности КЦ исполнить итоговые нетто-требования по ценной бумаге добросовестного Участника клиринга в течение срока, указанного в настоящем пункте Правил, КЦ заключает на Торгах с указанным Участником клиринга Договор с Датой исполнения T+0 без подачи Заявок, на условиях, которые соответствуют условиям первой части Договора репо, определенным в пункте 23.5.3. настоящих Правил, а также при соблюдении следующих условий:

* + - * + Цена заключения Договора, предметом которого являются ценные бумаги, относящиеся к Группе инструментов «российские ценные бумаги», равна расчетной цене данной ценной бумаги, определенной в результате проведения последней клиринговой сессии;
        + Цена заключения Договора, предметом которого являются ценные бумаги, относящиеся к Группе инструментов «иностранные ценные бумаги», равна цене последнего проведенного аукциона закрытия;
        + КЦ выплачивает добросовестному Участнику клиринга штраф, указанный в подпункте 23.5.3. настоящих Правил.
      1. Обязательства, возникшие из Договоров, заключаемых в соответствии с подпунктами 23.3., 23.4., 23.5.2., 23.5.3. настоящих Правил, являются обязательствами, допущенными в клиринг, и включаются в клиринговый пул по Договорам в Дату исполнения.
      2. В дату заключения Договоров, заключаемых в соответствии с подпунктами 23.3., 23.4., 23.5.2., 23.5.3. настоящих Правил, информация об указанных Договорах включается в состав сведений, предоставляемых КЦ Участникам клиринга в соответствии со статьей 33 настоящих Правил.
    1. Порядок использования и возмещения Гарантийных фондов.
       1. Средства Гарантийных фондов, в случае их формирования, используются КЦ для исполнения неисполненных или ненадлежащим образом исполненных обязательств любого из Участников клиринга в случае наличия у Участника клиринга Задолженности, определенной в соответствии с пунктом настоящих Правил.

В первую очередь для погашения Задолженности используется взнос Участника клиринга, у которого возникла Задолженность (далее - Должник), в Гарантийный фонд участников, во вторую очередь используются взносы Гарантов в специальный Гарантийный фонд в объёме Размера взноса, в третью очередь используются взносы других Участников клиринга, помимо Должника, в Гарантийный фонд участников в объёме Размера взноса.

* + - 1. Взнос Должника в Гарантийный фонд участников используется для удовлетворения требований КЦ по Задолженности Должника путем перечисления денежных средств, составляющих указанный взнос, в счет удовлетворения указанных требований.

В случае использования для удовлетворения требований КЦ по Задолженности Должника взноса Должника в Гарантийный фонд участников, 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.

Удовлетворение требований КЦ по Задолженности Должника за счет взноса Должника в Гарантийный фонд участников осуществляется КЦ без согласия и предварительного уведомления Должника.

Взнос Должника в Гарантийный фонд участников уменьшается на сумму средств, использованную для удовлетворения требований КЦ по Задолженности Должника.

* + - 1. В случае недостаточности взноса Должника в Гарантийный фонд участников для удовлетворения всех требований КЦ по Задолженности Должника для удовлетворения оставшихся требований используются взносы Гарантов в специальный Гарантийный фонд путем перечисления денежных средств, составляющих указанные взносы, в счет удовлетворения указанных требований.

В случае использования для удовлетворения требований КЦ по 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.

Использование взносов Гарантов в специальный Гарантийный фонд для удовлетворения требований КЦ по Задолженности Должника осуществляется пропорционально Размеру взноса каждого из Гарантов в специальный Гарантийный фонд.

Удовлетворение требований КЦ по Задолженности Должника за счет взносов Гарантов в специальный Гарантийный фонд осуществляется КЦ без согласия и предварительного уведомления таких Гарантов.

Взносы Гарантов в специальный Гарантийный фонд уменьшаются на сумму средств, использованную для удовлетворения требований КЦ по Задолженности Должника.

* + - 1. В случае недостаточности взноса Должника в Гарантийный фонд участников и взносов Гарантов в специальный Гарантийный фонд для удовлетворения всех требований КЦ по Задолженности Должника, КЦ в целях прекращения требований КЦ по Задолженности Должника использует взносы других Участников клиринга, помимо Должника, в Гарантийный фонд участников. Размер взносов других Участников клиринга, помимо Должника, в Гарантийный фонд участников, используемых в целях погашения Задолженности Должника перед КЦ, определяется исходя из величины, рассчитанной как положительная разность между общим размером Задолженности Должника и размером взноса Должника в Гарантийный фонд участников, размером взносов Гарантов в специальный Гарантийный фонд и величиной собственных свободных средств КЦ, установленной КЦ и опубликованной на Сайте КЦ, суммарно.
      2. Взносы других Участников клиринга, помимо Должника, в Гарантийный фонд участников используются для удовлетворения оставшихся требований КЦ по Задолженности Должника путем перечисления денежных средств, составляющих взносы, в счет удовлетворения указанных требований.

В случае использования для удовлетворения оставшихся требований КЦ по Задолженности Должника взноса другого Участника клиринга, помимо Должника, в Гарантийный фонд участников, 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.

Удовлетворение оставшихся требований КЦ по Задолженности Должника осуществляется пропорционально Размеру взноса каждого из Участников клиринга, помимо Должника, в Гарантийный фонд участников.

Удовлетворение оставшихся требований КЦ по Задолженности Должника за счет взносов других Участников клиринга, помимо Должника, в Гарантийный фонд участников осуществляется КЦ без согласия и предварительного уведомления таких Участников клиринга.

Взносы других Участников клиринга, помимо Должника, в Гарантийный фонд участников уменьшается на сумму средств, использованных для удовлетворения требований КЦ по Задолженности Должника.

* + - 1. Требования КЦ по Задолженности Должника, оставшейся после использования взносов Участников клиринга в Гарантийный фонд участников и взносов Гарантов в специальный Гарантийный фонд прекращаются.
      2. В случае использования для удовлетворения требований КЦ по Задолженности Должника взносов в Гарантийные фонды Должник обязан в течение 2 (двух) Расчетных дней после прекращения требований КЦ по Задолженности Должника возместить использованные средства Гарантийных фондов. 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 требовать от Должника возмещения указанных средств в судебном порядке.

* + - 1. КЦ использует средства, возмещенные Должником, для увеличения размера взносов в Гарантийные фонды в следующей очередности: в первую очередь увеличивается размер взносов других Участников клиринга, помимо Должника, в Гарантийный фонд участников, во вторую очередь - размер взносов Гарантов в специальный Гарантийный фонд, в третью очередь – размер взноса Должника в Гарантийный фонд участников. 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 Участников клиринга, помимо Должника, в Гарантийный фонд участников в рамках первой очереди, увеличение размера указанных взносов осуществляется пропорционально суммам взносов Участников клиринга, использованным для удовлетворения требований КЦ по 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 удовлетворения требований КЦ по Задолженности Должника.

* + - 1. В случае если Должник в срок, установленный пунктом 24.7 настоящих Правил, не возместил в полном объеме использованные средства Гарантийных фондов, каждое лицо, помимо Должника, взносы которого в Гарантийный фонд были использованы для удовлетворения требований КЦ по Задолженности Должника, обязано в течение 2 (двух) Расчетных дней после направления ему КЦ соответствующего уведомления внести денежные средства в счет увеличения своего взноса в Гарантийный фонд до Размера взноса.
      2. Должник обязан в течение 2 (двух) Расчетный дней после использования для целей погашения Задолженности Должника взносов других Участников клиринга, помимо Должника, в Гарантийный фонд участников, погасить свою Задолженность в объеме, определенном как положительная разность между общей величиной Задолженности Должника и размером использованных в целях погашения указанной Задолженности взноса Должника в Гарантийный фонд участников, взносов Гарантов в специальный Гарантийный фонд, взносов других Участников клиринга, помимо Должника, 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 требовать от Должника погашения указанной Задолженности в судебном порядке.
    1. Договор репо КЦ
       1. Договор репо КЦ заключается без подачи Заявок на Торгах Организатора торговли между КЦ и Участником клиринга в случае, установленном пунктом 23.5.2. настоящих Правил.
       2. Предметом Договора репо КЦ могут являться ценные бумаги, включенные в Список ценных бумаг.
       3. Продавцом по первой части Договора репо КЦ является Участник клиринга, покупателем по первой части Договора репо КЦ является КЦ. Продавцом по второй части Договора репо КЦ является КЦ, а покупателем по второй части Договора репо КЦ является Участник клиринга.
       4. Для предоставления КЦ возможности заключения Договора репо КЦ, Участник клиринга предоставляет КЦ заявление о ТКС и объемах ценных бумаг, доступных для заключения Договоров репо КЦ по форме и в порядке, установленной Регламентом клиринга, в виде Электронного документа, подписанного Электронной подписью. Участник клиринга, предоставляя указанное заявление КЦ, гарантирует, что обладает всеми необходимыми поручениями и полномочиями на заключение указанных Договоров репо КЦ в отношении ценных бумаг, учитываемых на Торговом счете депо/Субсчете депо, указанном в заявлении.
       5. Выбор Участника клиринга, с которым в случае необходимости заключается Договор репо КЦ а также определение количества ценных бумаг, выраженное в штуках, в отношении которых заключается Договор репо КЦ, осуществляется КЦ с учетом информации полученной от Участника клиринга согласно пункту настоящих Правил.
       6. Условия Договора репо КЦ:

1. по первой части Договора репо КЦ у Участника клиринга возникают обязательства по соответствующим ценным бумагам, в количестве, определенном КЦ;
2. первая часть Договора репо КЦ исполняется в день его заключения;
3. вторая часть Договора репо КЦ исполняется в Расчетный день, следующий за днем его заключения;
4. ставка Договора репо равна нулю.

КЦ уплачивает Участнику клиринга штраф.

Величина штрафа рассчитывается по следующей формуле:

, где

Penalty –величина штрафа;

SP – расчетная цена ценной бумаги, определенная в результате проведения последней клиринговой сессии;

Q – количество ценных бумаг, являющееся предметом Договора, шт. (без учета знака);

ch\_fine\_borrow – штрафная ставка, установленная КЦ для каждой ценной бумаги, включенной в Список ценных бумаг, в соответствии с Методикой установления и изменения риск-параметров;

T365 – количество календарных дней между Датой исполнения первой части Договора репо и Датой исполнения второй части Договора репо КЦ, приходящихся на календарный год, состоящий из 365 дней;

T366 - количество календарных дней между Датой исполнения первой части Договора репо и Датой исполнения второй части Договора репо КЦ, приходящихся на календарный год, состоящий из 366 дней.

Обязательство КЦ по уплате штрафа является обязательством, допущенным к клирингу. Обязательно по уплате штрафа включается в клиринговый пул для расчетов по итогам Торгов в дату заключения Договора репо КЦ.

* + - 1. КЦ заключает Договоры репо КЦ в объеме не более, чем указано в заявлении в соответствии с пунктом настоящих Правил, в случае недостаточности у КЦ ценных бумаг 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 Торговом счете депо/Субсчете депо, входящим в данный ТКС, учитываются недостающие у КЦ ценные бумаги.
      2. Обязательства, возникшие из Договоров, заключаемых в соответствии с настоящей статьей Правил, являются обязательствами, допущенными в клиринг, и включаются в клиринговый пул по Договорам в Дату исполнения.
      3. В дату заключения Договора репо КЦ информация об указанных Договорах включается в состав сведений, предоставляемых КЦ Участникам клиринга в соответствии со статьей 33 настоящих Правил.
    1. Порядок передачи Доходов по Договорам репо
       1. КЦ определяет размер обязательств по ценным бумагам, определяемый с целью передачи Дохода, как разницу между определяемой в отношении каждого ТКС соответствующего Торгового счета депо/Субсчета депо Участника клиринга суммой требований и суммой обязательств Участника клиринга по ценным бумагам, по которым принято решение о выплате Дохода, по не исполненным на дату составления списка лиц, имеющих право на получение Дохода, Договорам репо, в том числе Договорам репо КЦ. Для Договоров репо под не исполненными Договорами понимаются Договоры в период после исполнения обязательств по передаче ценных бумаг по первой части Договора репо и до исполнения обязательств по передаче ценных бумаг по второй части Договора репо.

КЦ не позднее Расчетного дня, следующего за Расчетным днем, в который в целях передачи Доходов были определены обязательства в соответствии с настоящей статьей Правил, направляет Участникам клиринга, заключившим не исполненные на дату составления списка лиц, имеющих право на получение Дохода, Договоры репо, в том числе Договоры репо КЦ, уведомление в виде Электронного документа, подписанного Электронной подписью, о размере рассчитанных обязательств в порядке, предусмотренном статьей 33 настоящих Правил.

* + - 1. Если размер обязательства по ценным бумагам, определяемый с целью передачи Дохода, определенный в соответствии с пунктом настоящих Правил, в период после исполнения обязательств по передаче ценных бумаг по первой части Договора репо и до исполнения обязательств по передаче ценных бумаг по второй части Договора репо в отношении каждого ТКС соответствующего Торгового счета депо/Субсчета депо Участника клиринга, отрицательный, такой Участник клиринга обязан передать Доход КЦ.
      2. Если размер обязательства по ценным бумагам, определяемый с целью передачи Дохода, определенный в соответствии с пунктом настоящих Правил, в период после исполнения обязательств по передаче ценных бумаг по первой части Договора репо и до исполнения обязательств по передаче ценных бумаг по второй части Договора репо в отношении каждого ТКС соответствующего Торгового счета депо/Субсчета депо Участника клиринга, положительный, КЦ обязан передать Доход такому Участнику клиринга.
      3. Если иное не предусмотрено настоящими Правилами, передача Дохода происходит по истечении 30 (тридцати) дней с даты раскрытия эмитентом информации о факте исполнения (полностью или частично) своих обязательств по выплате Дохода, в случае если тридцатый день приходится не на Расчетный день, то передача Дохода происходит в следующий за ним Расчетный день.
      4. По Договорам, предметом которых являются ценные бумаги, за исключением облигаций, в случае если эмитентом принято решение о выплате Дохода денежными средствами или ценными бумагами или только денежными средствами, размер обязательства по передаче Дохода в форме денежных средств рассчитывается по формуле:

|  |  |
| --- | --- |
| Inc = N × d × (1-tx), где | |
| Inc | размер обязательства по передаче Дохода; |
| N | абсолютное значение размера обязательства по ценным бумагам, определяемого с целью передачи Дохода, определенное в отношении каждого ТКС соответствующего Торгового счета депо / Субсчета депо Участника клиринга; |
| d | сумма начисления на одну ценную бумагу, установленная эмитентом ценных бумаг или иным лицом, обязанным по ценным бумагам (в валюте цены Договора репо); |
| tx | Налоговая ставка, равная налоговой ставке, применяемой к КЦ, в случае если бы КЦ был стороной, обязанной передать Доход. |

* + - 1. По Договорам, предметом которых являются облигации, размер обязательства по передаче Дохода в форме денежных средств рассчитывается по формуле:

|  |  |
| --- | --- |
| Inc = N × (n+a+p), где | |
| Inc | размер обязательства по передаче Дохода (в российских рублях); |
| N | абсолютное значение размера обязательства по ценным бумагам, определяемого с целью передачи Дохода, определенное в отношении каждого ТКС соответствующего Торгового счета депо / Субсчета депо Участника клиринга (в штуках); |
| n | размер начисленного купонного дохода на одну облигацию, установленный эмитентом ценных бумаг (в российских рублях); |
| a | сумма номинальной стоимости облигации либо ее часть, выплачиваемая эмитентом при погашении (в российских рублях); |
| p | размер премии, выплачиваемой эмитентом при досрочном погашении облигации (в российских рублях). |

* + - 1. По Договорам, предметом которых являются ценные бумаги, в случае если эмитентом принято решение о выплате Дохода ценными бумагами, размер обязательства по передаче Дохода определяется исходя из следующих условий:

в случае если ценные бумаги, которые подлежат передаче в виде Дохода, допущены к организованным торгам, проводимым Организатором торговли, передача Дохода осуществляется в форме ценных бумаг и размер обязательств по передаче указанного Дохода рассчитывается по следующей формуле:

|  |  |
| --- | --- |
| Inc = N × d, где | |
| Inc | размер обязательства по передаче Дохода (в штуках); |
| N | абсолютное значение размера обязательства по ценным бумагам, определяемого с целью передачи Дохода, определенное в отношении каждого ТКС соответствующего Торгового счета депо / Субсчета депо Участника клиринга; |
| d | определенное эмитентом количество ценных бумаг, составляющих Доход, в расчете на одну ценную бумагу, являющуюся предметом Договора (в штуках). |

в случае если ценные бумаги, которые подлежат передаче в виде Дохода, не допущены к организованным торгам, проводимым Организатором торговли, но допущены к торгам, проводимым иностранной биржей, передача Дохода осуществляется в форме денежных средств и размер обязательств по передаче указанного Дохода определяется исходя из цены закрытия ценной бумаги, которая подлежит передачи в виде Дохода. Цена закрытия указанной ценной бумаги определяется на последний день, в который торги по ценной бумаге, являющейся предметом Договора, проводятся на иностранной бирже с правом получения Дохода приобретателем таких ценных бумаг.

в случае если ценные бумаги, которые подлежат передаче в виде Дохода, не допущены к организованным торгам, проводимым Организатором торговли, и не допущены к торгам, проводимым иностранной биржей, передача Дохода осуществляется в форме денежных средств и размер обязательств по передаче указанного Дохода определяется исходя разницы между ценой закрытия ценной бумаги, являющейся предметом Договора, и ценой открытия указанной ценной бумаги. При этом цена закрытия определяется на последний день, в который торги по данной ценной бумаге проводятся на иностранной бирже с правом получения Дохода приобретателем ценных бумаг, а цена открытия определяется в первый день, в который торги по данной ценной бумаги проводятся на иностранной бирже без права получения Дохода приобретателем ценных бумаг;

в случае невозможности определить размер обязательств по выплате Дохода в соответствии с пунктами 26.7.2. – 26.7.3 настоящих Правил, размер указанных обязательств определяется КЦ, с учетом, в частности, предполагаемой денежной оценки размера Дохода, подлежащего выплате, на основании решения эмитента.

* + - 1. Передача Дохода, размер которого определяется в соответствии с пунктом настоящих Правил, осуществляется не позднее чем по истечении 30 (тридцати) дней с даты раскрытия эмитентом информации о факте исполнения (полностью или частично) своих обязательств по выплате Дохода.
      2. В течение 5 (пяти) рабочих дней после раскрытия эмитентом ценных бумаг информации о факте исполнения (полностью или частично) своих обязательств по выплате Дохода, на основании информации о Договорах репо в период после исполнения обязательств по передаче ценных бумаг по первой части Договора репо и до исполнения обязательств по передаче ценных бумаг по второй части Договора репо, не исполненных на дату составления списка лиц, имеющих право на получение Дохода, КЦ допускает рассчитанные обязательства по передаче и/или требования по получению Дохода каждого Участника клиринга к клирингу.
      3. В дату, определённую в пункте настоящих Правил или в пункте настоящих Правил, обязательства по передаче Дохода включаются в клиринговый пул по Договорам и исполняются в порядке, установленном статьей 22 настоящих Правил.
      4. 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, установленном в Регламенте клиринга.
    1. Действия, направленные на исполнение обязательств Участников клиринга
       1. Для целей исполнения обязательств по Договорам Участник клиринга обязан заключить Договоры на Торгах, а так же на торгах иного организатора торговли в соответствии с настоящей статьей Правил. Список ценных бумаг, по которым осуществляются вышеописанные операции, а также наименование иного организатора торговли, на торгах которого подлежат заключению договоры, определяются КЦ.
       2. Участник клиринга должен предоставить информацию о Кодах клиентов, которые должны быть указаны в Заявках, на основании которых будут заключены Договоры на Торгах, в соответствии с пунктом настоящих Правил по форме, установленной Регламентом клиринга, в виде Электронного документа, подписанного Электронной подписью.

КЦ вправе использовать информацию о Кодах клиентов, представленную в соответствии с настоящим пунктом, также для целей осуществления процедуры принудительного закрытия и урегулирования случаев возможного не исполнения обязательств по Договорам.

* + - 1. Участник клиринга должен предоставить информацию об идентификаторе участника торгов на торгах иного организатора торгов, присвоенного данному Участнику клиринга иным организатором торговли, по форме, установленной Регламентом клиринга, в виде Электронного документа, подписанного Электронной подписью.
      2. Участник клиринга должен предоставить информацию о ТКС и объеме средств, доступных для использования в случае урегулирования ситуаций возможного не исполнения обязательств по заключению договоров на торгах иного организатора торговли в соответствии с пунктом 27.1 настоящих Правил, по форме, установленной Регламентом клиринга, в виде Электронного документа, подписанного Электронной подписью. Суммарный объем средств, предполагаемых для использования, который указан Участником клиринга для всех предоставленных ТКС, не должен быть меньше величины DV, определенной в соответствии с Методикой установления и изменения риск-параметров.
      3. КЦ формирует и передает Участнику клиринга с использованием Клиринговой системы в виде электронного сообщения, подписанного АСП, информацию о Заявках, которые должны быть объявлены на Торгах; цена Заявок определяется КЦ на основании Методики установления и изменения риск – параметров; Идентификатор адресных сделок Участника торгов, которому адресована Заявка, указанный в Заявке, должен идентифицировать КЦ; в Заявке должен быть указан Код клиента, полученный от Участника клиринга в соответствии с пунктом настоящих Правил; Заявка может быть отозвана только по окончании Торгового дня подачи.

Информация о Заявках формируется таким образом, чтобы позиция по ценным бумагам, учтенная по каждому ТКС, в результате заключения Договоров стала равна нулю.

Договоры на Торгах Организатора торговли заключаются в Режиме переговорных сделок в соответствии с Правилами торговли.

Информация о Заявках, которые Участник клиринга обязан подать на Торгах, может передаваться Участнику клиринга в виде отчета, подписанного Электронной подписью.

* + - 1. После объявления Заявок на Торгах в соответствии с информацией, сформированной в соответствии с пунктом 27.5. настоящих Правил, КЦ формирует и передает Участнику клиринга с использованием Клиринговой системы информацию о договорах, которые Участник клиринга обязан заключить на торгах иного организатора торговли. Вид договоров, подлежащих заключению на торгах иного организатора торговли, противоположен виду Договоров, заключённых на основании Заявок, объявленных в соответствии с пунктом 27.5. настоящих Правил. Иные параметры договоров, подлежащих заключению на торгах иного организатора торговли, идентичны параметрам договоров, заключённых на основании Заявок, объявленных в соответствии с пунктом 27.5. настоящих Правил. Информация о договорах, подлежащих заключению на торгах иного организатора торговли, может передаваться Участнику клиринга в виде отчета, подписанного Электронной подписью. При формировании информации о договорах, которые Участник клиринга обязан заключить на торгах иного организатора торговли, используется информация об идентификаторах участника торгов на торгах иного организатора торгов, присвоенного данному Участнику клиринга иным организатором торговли.
      2. КЦ устанавливает соответствие между каждым договором, содержащимся в представленной Участнику клиринга информации о договорах, которые Участник клиринга обязан заключить на торгах иного организатора торговли, и каждой Заявкой, которые Участник клиринга обязан подать на Торгах в соответствии с пунктом 27.5 настоящих Правил.
      3. В случае заключения договора на торгах иного организатора торговли на основании информации, сформированной в порядке, указанном в пункте 27.6. настоящих Правил, КЦ подает Заявку противоположной направленности, являющейся встречной по отношению к Заявке, указанной в пункте 27.5. настоящих Правил и соответствующей договору, заключённому на торгах иного организатора торговли как указано в пункте 27.7. настоящих Правил.
      4. В случае если Заявки, сформированные КЦ в соответствии с пунктом 27.5. настоящих Правил, не были поданы, или договоры, подлежащие заключению на торгах иного организатора торговли не были заключены (далее - Незаключенные договоры), КЦ с использованием Клиринговой системы в виде электронного сообщения, подписанного АСП, предоставляет Участнику клиринга, на имя которого зарегистрирован ТКС, указанный в списке ТКС в соответствии с пунктом 27.4. настоящих Правил (далее – ТКС-донор), информацию о Заявках, которые данный Участник клиринга с использованием ТКС-донор, должен подать на Торгах.

Информация о Заявках, которые данный Участник клиринга с использованием ТКС-донор, должен подать на Торгах содержит информацию о Заявках идентичную информации о неподанных Заявках, сформированных КЦ в соответствии с пунктом 27.5. настоящих Правил.

Информация о Заявках, которые Участник клиринга с использованием ТКС-донор, должен подать на Торгах, может передаваться Участнику клиринга в виде отчета, подписанного Электронной подписью.

* + - 1. ТКС-донор, который будет использован в целях, указанных в пункте 27.9. настоящих Правил, выбирается из списка ТКС-доноров по решению КЦ.
      2. При выборе ТКС-донора КЦ учитывает объем доступных средств таким образом, чтобы оценочный объем обеспечения, предполагаемого к возникновению в случае заключения договоров на торгах иного организатора торговли, соответствующих Заявкам, поданных на Торгах с указанием данного ТКС-донора, не превышал суммарного объема средств, предполагаемых для использования и указанных Участником клиринга.

Оценочный объем обеспечения, предполагаемого к возникновению, рассчитывается по следующей формуле:

, где:

EIMS - оценочный объем обеспечения, предполагаемого к возникновению в случае заключения договоров на торгах иного организатора торговли, соответствующих Заявкам, поданных на Торгах с указанием данного ТКС-донора;

IMCoeffi – коэффициент, определенный в соответствии с Методикой установления и изменения риск-параметров, в отношении ценной бумаги, являющейся предметом i-ого договора на торгах иного организатора торговли, предполагаемого к заключению;

Pi – цена i-ого договора на торгах иного организатора торговли, предполагаемого к заключению;

Qi – объем i-ого договора на торгах иного организатора торговли, предполагаемого к заключению (без учета знака).

* + - 1. После объявления Участником торгов с использованием ТКС-донора Заявок на Торгах в соответствии с информацией отчетом, сформированной в соответствии с пунктом 27.9. настоящих Правил, КЦ формирует и передает с использованием Клиринговой системы в виде электронного сообщения, подписанного АСП, Участнику клиринга, использующему ТКС-донор, информацию о договорах, которые указанный Участник клиринга обязан заключить на торгах иного организатора торговли. Информация о договорах, которые должны быть заключены на торгах иного организатора торговли, формируется КЦ в соответствии с пунктом 27.6. настоящих Правил. Договоры, которые Участник клиринга, использующий ТКС-донор, заключает на торгах иного организатора торговли, именуются Донорскими договорами.

КЦ устанавливает соответствие между договорами и Заявками, предполагаемыми к заключению и подаче Участником клиринга с использованием ТКС-донора.

Информация о договорах, которые Участник клиринга обязан заключить на торгах иного организатора торговли, может передаваться Участнику клиринга в виде отчета, подписанного Электронной подписью.

* + - 1. После объявления Участником торгов с использованием ТКС-донора Заявок на Торгах в соответствии с информацией, сформированной в соответствии с пунктом 27.9. настоящих Правил, КЦ формирует и передает с использованием Клиринговой системы в виде электронного сообщения, подписанного АСП, Участнику клиринга, который должен был являться контрагентом по Незаключенным договорам корректирующую информацию о договорах, которые указанный Участник клиринга обязан заключить на торгах иного организатора торговли. Информация о договорах, которые указанный Участник клиринга обязан заключить на торгах иного организатора торговли формируется КЦ в соответствии с пунктом 27.6. настоящих Правил.

В корректирующей информации о договорах, которые указанный Участник клиринга обязан заключить на торгах иного организатора торговли, информация о контрагенте по указанным договорам содержит идентификатор участника торгов, присвоенный иным организатором торговли, идентифицирующий Участника клиринга, использующего ТКС-донора.

* + - 1. В случае заключения Донорского договора на торгах иного организатора торговли на основании информации, сформированной в порядке, указанном в пункте 27.12. настоящих Правил, КЦ подает Заявку противоположной направленности, являющейся встречной по отношению к Заявке, объявленной Участником клиринга с указанием ТКС-донора.
      2. В случае неподачи Участником торгов с использованием ТКС-донора Заявок на Торгах в соответствии с информацией, сформированной в соответствии с пунктом 27.9. настоящих Правил, или не заключения Донорского договора на основании информации, сформированной в порядке, указанном в пункте 27.12. настоящих Правил, КЦ выбирает нового Участника клиринга из списка Участников клиринга, использующих ТКС-донор.

Участник клиринга, использующий ТКС-донор и выбранный КЦ, должен подать Заявки и заключить договоры на торгах иного организатора торговли в соответствии с настоящей статьей Правил.

* + - 1. КЦ взимает штраф с Участника клиринга, использующего ТКС-донора, не подавшего Заявки или не заключившего Донорские договоры, рассчитываемый по следующей формуле:

,где:

fine\_donor – штрафная ставка, определенная в соответствии с Методикой установления и изменения риск-параметров;

P – цена, указанная в неподанной Заявке, или цена договора, подлежащего заключению на торгах иного организатора торговли;

Q – объем неподанной Заявки или объем договора, подлежащего заключению на торгах иного организатора торговли (без учета знака).

Обязательство Участника клиринга, использующего ТКС-донор, по уплате штрафа является обязательством, допущенным к клирингу. Обязательно по уплате штрафа включается в клиринговый пул для расчетов по итогам Торгов в дату расчета суммы штрафа.

* + - 1. В случае не исполнения Участником клиринга обязательств по подаче Заявок или заключении договоров на торгах иного организатора торговли как указано в пункте 27.9 настоящих Правил, КЦ вправе заключать в отношении себя лично от имени недобросовестного Участника клиринга без специального полномочия (доверенности), а также без согласия данного Участника клиринга, Договоры репо (два Договора купли-продажи с расчетами T+n, T+n+1) на следующих условиях:

1. Вид первой части Договора репо (Договора купли-продажи с расчетом T+n) идентичен направлению оферт, содержащихся в неподанной Заявке;
2. Объем первой части Договора репо (Договора купли-продажи с расчетом T+n) идентичен объему неподанной Заявки;
3. Дата исполнения первой части Договора репо (Договора купли-продажи с расчетом T+n) равна Дате исполнения Незаключенного договора;
4. вторая часть Договора репо (Договора купли-продажи с расчетом T+n+1) исполняется в Расчетный день, следующий за Датой исполнения первой части Договора репо (Договора купли-продажи с расчетом T+n);
5. ставка Договора репо равна нулю;

цена Договора купли-продажи с расчетом и Договора купли-продажи с расчетом T+n+1 равна цене Незаключенного договора;

1. КЦ удерживает с Участника клиринга штраф.

Величина штрафа рассчитывается по следующей формуле:

Для ситуации, когда в результате заключения Незаключенного договора у недобросовестного Участника клиринга возникли бы требования по ценным бумагам:

Для ситуации, когда в результате заключения Незаключенного договора у недобросовестного Участника клиринга возникли бы обязательства по ценным бумагам:

где:

Penalty – величина штрафа;

Q – объем Незаключенного договора (без учета знака);

P – цена Незаключенного договора;

sUp, sDown – штрафная ставка, установленная КЦ в Методике установления и изменения риск-параметров, для каждой ценной бумаги, в отношении которой заключаются Договоры репо (два Договора купли-продажи с расчетами T+n, T+n+1);

T365 – количество календарных дней между Датой исполнения первой части Договора репо и Датой исполнения второй части Договора репо (Датой исполнения Договора купли-продажи с расчетом и Датой исполнения Договора купли-продажи с расчетом T+n+1), приходящихся на календарный год, состоящий из 365 дней;

T366 - количество календарных дней между Датой исполнения первой части Договора репо и Датой исполнения второй части Договора репо (Датой исполнения Договора купли-продажи с расчетом и Датой исполнения Договора купли-продажи с расчетом T+n+1), приходящихся на календарный год, состоящий из 366 дней.

Обязательство недобросовестного Участника клиринга по уплате штрафа является обязательством, допущенным к клирингу. Обязательно по уплате штрафа включается в клиринговый пул для расчетов по итогам Торгов в дату заключения Договора репо (двух Договоров купли-продажи с расчетами T+n, T+n+1).

* + - 1. В случае не исполнения Участником клиринга обязательств по подаче Заявок или заключении договоров на торгах иного организатора торговли как указано в пункте 27.9 настоящих Правил, КЦ вправе заключать Договоры в отношении себя лично от имени Участника клиринга, использующего ТКС-донор, без специального полномочия (доверенности), а также без согласия данного Участника клиринга, Договоры репо (два Договора купли-продажи с расчетами T+n, T+n+1) на следующих условиях:

1. Вид первой части Договора репо (Договора купли-продажи с расчетом T+n) идентичен виду Донорского договора;
2. Объем первой части Договора репо (Договора купли-продажи с расчетом T+n) идентичен объему Донорского договора;
3. Дата исполнения первой части Договора репо (Договора купли-продажи с расчетом T+n) равна Дате исполнения Донорского договор.
4. вторая часть Договора репо (Договора купли-продажи с расчетом T+n+1) исполняется в Расчетный день, следующий за Датой исполнения первой части Договора репо (Договора купли-продажи с расчетом T+n).
5. ставка Договора репо равна нулю;

цена Договора купли-продажи с расчетом и Договора купли-продажи с расчетом T+n+1 равна цене Донорского договора;

1. КЦ выплачивает Участнику клиринга штраф.

Величина штрафа рассчитывается по следующей формуле:

Для ситуации, когда в результате заключения Донорского договора у Участника клиринга, использующего ТКС-донор, возникли бы требования по ценным бумагам:

Для ситуации, когда в результате заключения Донорского договора у Участника клиринга, использующего ТКС-донор, возникли бы обязательства по ценным бумагам:

где

Penalty – величина штрафа;

Q – объем Донорского договора (без учета знака);

P – цена Донорского договора;

sUp, sDown – штрафная ставка, установленная КЦ в Методике установления и изменения риск-параметров, для каждой ценной бумаги, в отношении которой заключаются Донорские договоры;

T365 – количество календарных дней между Датой исполнения первой части Договора репо и Датой исполнения второй части Договора репо (Датой исполнения Договора купли-продажи с расчетом и Датой исполнения Договора купли-продажи с расчетом T+n+1), приходящихся на календарный год, состоящий из 365 дней;

T366 - количество календарных дней между Датой исполнения первой части Договора репо и Датой исполнения второй части Договора репо (Датой исполнения Договора купли-продажи с расчетом и Датой исполнения Договора купли-продажи с расчетом T+n+1), приходящихся на календарный год, состоящий из 366 дней.

Обязательство КЦ по уплате штрафа является обязательством, допущенным к клирингу. Обязательно по уплате штрафа включается в клиринговый пул для расчетов по итогам Торгов в дату заключения Договора репо (двух Договоров купли-продажи с расчетами T+n, T+n+1).

* + - 1. В случае когда договор, подлежащий заключению на торгах иного организатора торговли, не был заключен по вине обоих контрагентов, КЦ заключает Договор репо (два Договора купли-продажи с расчетами T+n, T+n+1) в порядке и на условиях, указанных в пункте 27.17. настоящих Правил.
      2. В случае невозможности заключения договоров на торгах иного организатора торговли, КЦ вправе заключать в отношении себя лично от имени Участников клиринга, являющихся контрагентами по Незаключенному договору, дата исполнения которого приходится на следующий после текущего Расчетный день, без специального полномочия (доверенности), а также без согласия данных Участников клиринга, Договоры репо (два Договора купли-продажи с расчетами T+n, T+n+1) в порядке и на условиях, указанных в пункте 27.17. настоящих Правил.
    1. Порядок формирования клирингового пула для расчетов по итогам Торгов. Порядок исполнения / прекращения обязательств по расчетам по итогам Торгов.
       1. По окончании основной торговой сессии в каждый Расчетный День, КЦ:
          - включает в клиринговый пул для расчетов по итогам Торгов:
          - обязательства по уплате Торгового, клирингового, Технического и иных сборов, определенные в соответствии со статьей 13 настоящих Правил. Размер обязательств по оплате указанных сборов подлежит математическому округлению с точностью до двух знаков после запятой, и при наличии хотя бы одного Договора взимается не менее 0,01 (одной сотой) валюты соответствующего сбора;
          - обязательства по уплате/требования по получению штрафов, возникших при не исполнении обязательств Участниками клиринга перед другими Участниками клиринга в соответствии со статьей 22 настоящих Правил;
          - обязательства по уплате/требования по получению штрафов и компенсаций, возникших при урегулировании случаев исполнения обязательств по Договорам, которые могут быть не исполнены в соответствии со статьей 23 настоящих Правил;
          - требования по получению штрафов, возникших при заключении Договоров репо КЦ в соответствии со статьей 25 настоящих Правил;
          - обязательства по уплате / требования по получению штрафов, возникшие при выполнении действий, направленных на исполнение обязательств Участников клиринга в соответствии со статьей 27 настоящих Правил;
          - обязательства по уплате штрафов, возникшие при наличии у Участника клиринга задолженности по денежным регистрам в соответствии со статьей 29 настоящих Правил.
          - 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 по каждому денежному разделу, через который будет осуществляться исполнение итоговых нетто-обязательств и/или итоговых нетто-требований.
       2. КЦ исполняет итоговые нетто-требования Участника клиринга, определенные в отношении денежного регистра, относящемуся к определенному ТКС, при условии исполнения Участником клиринга своих итоговых нетто-обязательств, по денежному регистру, относящихся к тому же ТКС.
       3. Для исполнения итогового нетто-обязательства Участника клиринга по денежным средствам, учитываемых в отношении определенного денежного регистра, используются денежные средства, учитываемые по тому же денежному регистру.
       4. Итоговое нетто-обязательство Участника клиринга по денежным средствам может быть исполнено по денежному регистру, в отношении которого оно определено, если размер денежных средствах по тому же денежному регистру не меньше, чем итоговое нетто-обязательство Участника клиринга по денежным средствам, учитываемое по денежному регистру.
       5. В случае если итоговое нетто-обязательство Участника клиринга по денежным средствам по денежному регистру превышает размер денежных средствах по тому же денежному регистру, КЦ учитывает такое превышение в качестве задолженности по данному денежному регистру.
       6. Обязательства Участника клиринга – кредитной организации, у которого отозвана лицензия на осуществление банковских операций, и (или) 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 36 настоящих Правил.
    2. Задолженность по денежному регистру
       1. В случае если итоговое нетто-обязательство Участника клиринга перед КЦ по денежным средствам, определенное по денежному регистру, в результате проведения клиринга в соответствии со статьями 22 и 28 настоящих Правил, превышает размер денежных средств, учитываемых по тому же денежному регистру, КЦ учитывает такое превышение в качестве задолженности по данному денежному регистру
       2. Участник клиринга погашает возникшую задолженность 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 до момента начала клиринга по итогам Торгов.
       3. В случае если задолженность по денежному регистру не была погашена в срок, указанный в пункте 29.2. настоящих Правил, КЦ взимает штраф, рассчитываемый по следующей формуле:

,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 является обязательством, допущенным к клирингу. Обязательно по уплате штрафа включается в клиринговый пул для расчетов по итогам Торгов в дату возникновения указанного обязательства.

КЦ вправе потребовать от Участника клиринга, у которого учитывается задолженность 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 производит действия, описанные в пунктах - настоящих Правил.

1. ПОРЯДОК И СПОСОБЫ ВЗАИМОДЕЙСТВИЯ КЦ, УЧАСТНИКОВ КЛИРИНГА, РАСЧЕТНОЙ ОРГАНИЗАЦИИ, РАСЧЕТНОГО ДЕПОЗИТАРИЯ, ОРГАНИЗАТОРА ТОРГОВЛИ. ОТЧЕТЫ КЦ
   * 1. Порядок взаимодействия КЦ с Расчетной организацией, Расчетным депозитарием
        1. КЦ взаимодействует с Расчетной организацией для целей открытия/закрытия и совершения операций по Клиринговому денежному счету на основании заключенного договора и (или) регламента взаимодействия.
        2. КЦ взаимодействует с Расчетным депозитарием в целях открытия/закрытия и совершения операций по Торговым счетам депо/Субсчета депо в соответствии с заключенными договорами, регламентами взаимодействия и внутренними документами Расчетного депозитария.
        3. После открытия каждого Торгового счета депо/Субсчета депо Расчетный депозитарий представляет в КЦ уведомление об открытии соответствующего Торгового счета депо/Субсчета депо. При открытии Торгового счета депо/Субсчета депо клиенту и (или) клиенту клиента Участника клиринга Расчетный депозитарий в уведомлении, представляемом в КЦ, указывает информацию об Участнике клиринга, являющемся попечителем (оператором) соответствующего счета депо, подтверждая таким образом предоставление КЦ полномочий, указанных в пункте 7.10. настоящих Правил.
        4. О блокировании проведения операций по Торговому счету депо/Субсчету депо, прекращении полномочий попечителя/оператора счета Расчетный депозитарий сообщает в КЦ не позднее рабочего дня, предшествующего дате указанного события и проводят указанную операцию после получения согласия КЦ.
        5. Закрытие Торгового счета депо в Расчетном депозитарии осуществляется с согласия КЦ. Закрытие Субсчета депо в Расчетном депозитарии осуществляется на основании поручения КЦ, при условии предоставления лицом, которому открыт указанный Субсчет депо, заявления в соответствии с пунктом 7.8.настоящих Правил. КЦ дает согласие/поручение на закрытие Торгового счета депо/Субсчета депо при условии отсутствии открытых позиций по Договорам/Конверсионным договорам и нулевых остатках денежных средств и ценных бумаг, учитываемых на ТКС, в которые входит закрываемый Торговый счет депо/Субсчет депо.
        6. КЦ согласовывает с Расчетным депозитарием список и коды ценных бумаг, обязательства из Договоров с которыми могут быть допущены к клирингу. Расчетный депозитарий подтверждает КЦ возможность осуществления учета указанных ценных бумаг на Торговых счетах депо/Субсчетах депо. В отношении ценных бумаг иностранных эмитентов Расчетный депозитарий принимает обязательство по оказанию владельцам Торговых счетов депо/Субсчетов депо услуг, связанных с получением доходов по ценным бумагам иностранных эмитентов и иных выплат, причитающихся владельцам таких ценных бумаг.
        7. КЦ соглашается с проведением любых операций зачисления на Торговый счет депо на основании распоряжений лица, которому открыт такой Торговый счет депо.
        8. В случае если торговые счета депо Участников клиринга, клиентов Участника клиринга и иных лиц открыты в депозитарии, открывшем в Расчетном депозитарии Торговый счет депо/Субсчет депо номинального держателя, КЦ соглашается с проведением любых операций по таким торговым счетам депо, включая закрытие таких торговых счетов депо. Указанное согласие КЦ действует до момента его отзыва КЦ в указанном депозитарии или до момента направления КЦ указанному депозитарию распоряжения, устанавливающего иные условия проведения операций по таким торговым счетам депо.
        9. По факту проведения операций, а также в сроки, установленные Регламентом клиринга, Расчетный депозитарий формирует и передает в КЦ выписку по состоянию Торговых счетов депо/Субсчетов депо, содержащую информацию о ценных бумагах, учитываемых на Торговых счетах депо/Субсчетах депо. С момента формирования выписки по состоянию Торговых счетов депо для КЦ и до момента получения от КЦ подтверждения завершения расчетов по итогам этого Расчетного дня Расчетный депозитарий может проводить операции по списанию ценных бумаг с Торговых счетов депо только по поручению КЦ, либо по поручению лиц, которым открыты указанные счета, с согласия КЦ. Направление Расчетному депозитарию подтверждения завершения расчетов по итогам Расчетного дня означает согласие КЦ на проведение любых операций по Торговым счетам депо по распоряжениям (поручениям) лиц, которым открыты указанные счета, до момента формирования выписки по состоянию Торговых счетов депо следующего Расчетного дня.
        10. На основании полученных от Расчетного депозитария выписок по состоянию Торговых счетов депо/Субсчетов депо, КЦ изменяет значения депо регистров.
        11. Для проведения расчетов по ценным бумагам по результатам клиринга КЦ в сроки, установленные в Регламенте клиринга, направляет в Расчетный депозитарий - сводное поручение депо.
        12. Исполнение сводного поручения депо по Договорам осуществляется Расчетным депозитарием по Торговым счетам депо/Субсчетам депо в корреспонденции с Субсчетом депо КЦ, открытым в рамках Клирингового счета депо в Расчетном депозитарии.
        13. 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.
        14. Согласие/поручение КЦ и иные документы, указанные в настоящей статье Правил, предоставляется в электронном виде в форме Электронных документов, подписанных Электронной подписью.
     2. Порядок взаимодействия КЦ с Организатором торговли
        1. КЦ уведомляет Организатора торговли об Участниках клиринга, клиентах Участников клиринга, в том числе о Кодах и Регистрационных кодах указанных лиц, а также о зарегистрированных ТКС. КЦ может предоставлять Организатору торговли дополнительную информацию. В соответствии с настоящей статьей КЦ направляет уведомления Организатору торговли посредством Клиринговой системы в виде электронного сообщения, подписанного АСП, или в виде Электронного документа, подписанного Электронной подписью.
        2. Организатор торговли информирует КЦ о допуске, приостановлении, возобновлении и прекращении допуска ценных бумаги к Торгам, а также об установлении и (или) изменении параметров ценной бумаги путем направления уведомлений о ценных бумагах в виде Электронного документа, подписанного Электронной подписью, и (или) в бумажном виде. КЦ не осуществляет клиринг обязательств, возникших из Договоров, заключенных в отношении ценных бумаг, о допуске к Торгам которых КЦ не был извещен.
        3. При получении от Организатора торговли информации о дате допуска ценной бумаги к Торгам, начиная с которой возможно заключение Договоров, КЦ устанавливает риск-параметры для этой ценной бумаги. КЦ вправе изменять риск-параметры в порядке, установленном Методикой установления и изменения риск-параметров.
        4. Каждый Расчетный день до начала Торгов у Организатора торговли КЦ передает Организатору торговли посредством Клиринговой системы в виде электронного сообщения, подписанного АСП, сводные отчеты о Средствах обеспечения Участников клиринга, значения Доступных средств, значения расчетной цены по каждой ценной бумаге, значения риск – параметров, рассчитываемых в соответствии с Методикой установления и изменения риск – параметров, а также, по согласованию с Организатором торговли, иную дополнительную информацию.
        5. В случае изменения значений, перечисленных в пункте настоящих Правил, КЦ незамедлительно передает Организатору торговли указанные измененные значения.
     3. Способы получения и передачи документов при взаимодействии КЦ с Участниками клиринга, Организатором торговли, Расчетным депозитарием и Расчетной организацией
        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.
        2. Документооборот между КЦ, Участниками клиринга, Организатором торговли, Расчетной организацией и Расчетным депозитарием (далее – участники электронного документооборота) осуществляется в электронном виде путем направления Электронных документов, подписанных Электронной подписью, если иные способы обмена сообщениями не установлены настоящими Правилами. При этом допускается передача отдельных документов на бумажных носителях.
        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).
        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 Клиринговую 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 Клиринговой системы.
           + Процедура аутентификации осуществляется техническим центром с использованием Клиринговой системы при осуществлении технического доступа Участника клиринга/КЦ в Клиринговую 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 Клиринговой системе. Аутентификация Участника торгов/КЦ осуществляется автоматическим способом при каждом входе Участника клиринга/КЦ в Клиринговую систему.
           + Участник клиринга/КЦ 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 Клиринговой системы, а также подтверждают соответствие электронного сообщения содержанию копии электронного сообщения, изготовленного (распечатанного) на бумажном носителе.
        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.
        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.
        7. Документы, полученные на бумажном носителе, вводятся в Клиринговую систему сотрудниками КЦ. Дальнейшая обработка документов производится в Клиринговой системе автоматически.
     4. Отчеты КЦ и иная информация, которую КЦ вправе предоставлять Участникам клиринга
        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, исключенных из клирингового пула;
           + 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.
        2. Отчеты, указанные в пункте настоящих Правил, предоставляются Участнику клиринга в форме Электронных документов, подписанных Электронной подписью, в течение 1 (одного) часа с момента формирования расчетного клирингового пула, указанного в пункте 22.3. настоящих Правил, или в течение 1 (одного) часа с момента формирования клирингового пула для расчетов по итогам Торгов, указанного в пункте 28.1. настоящих Правил.
        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.
2. ПРОЧИЕ УСЛОВИЯ
   * 1. Порядок действия КЦ при операциях с ценными бумагами вследствие корпоративных событий
        1. Уведомления и учет информации при проведении операции объединения дополнительных выпусков эмиссионных ценных бумаг.
           + КЦ не позднее даты проведения операции объединения выпусков получает от Расчетного депозитария уведомление о проведении операции объединения выпусков, 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 дня, следующего за днем получения уведомления от Расчетного депозитария, КЦ направляет уведомление Организатору торговли, которое должно содержать:
* полное наименование эмитента, объединение выпусков которого проведено;
* индивидуальные номера (коды) объединяемых выпусков ценных бумаг и индивидуальный номер (код) объединенного выпуска;
* дату проведения операции объединения выпусков ценных бумаг эмитента.
  + - 1. Уведомления и учет информации при проведении операции аннулирования кода дополнительного выпуска эмиссионных ценных бумаг.
         * КЦ не позднее даты проведения операции аннулирования кода дополнительного выпуска получает от Расчетного депозитария уведомление о проведении операции аннулирования кода дополнительного выпуска, которое должно содержать:
* полное наименование эмитента;
* индивидуальный номер (код) дополнительного выпуска ценных бумаг и индивидуальный номер (код) выпуска, по отношению к которому данный выпуск является дополнительным;
* дату проведения операции аннулирования кода.
  + - * + Не позднее дня, следующего за днем получения уведомления от Расчетного депозитария, КЦ направляет Организатору торговли уведомление в виде Электронного документа, подписанного Электронной подписью, которое должно содержать:
* полное наименование эмитента;
* индивидуальный номер (код) дополнительного выпуска ценных бумаг и индивидуальный номер (код) выпуска, по отношению к которому данный выпуск является дополнительным;
* дату проведения операции аннулирования кода.
  + - 1. 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.
      2. После завершения операции объединения выпусков/аннулирования кода дополнительного выпуска и присвоения объединенным выпускам нового номера поручения Участников клиринга, содержащие старый номер выпуска, не принимаются.
      3. 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.
      4. Если иное не предусмотрено настоящими Правилами, информация по Договорам, предметом которых являются ценные бумаги, в отношении которых была осуществлена процедура дробления и (или) консолидации, может быть скорректирована с учетом проведённой процедуры, в течение Торгового дня, следующего за днем проведения процедуры дробления и (или) консолидации соответственно, на основании информации, полученной от эмитента ценных бумаг.
      5. В случае если между датой заключения Договора и Датой исполнения Договора в отношении ценных бумаг, которые являются предметом Договора, происходят корпоративные события, включающие в том числе реорганизацию эмитента ценных бумаг, конвертацию и (или) дробление ценных бумаг, проводимую без реорганизации эмитента ценных бумаг, или иные действия, влияющие на исполнение обязательств по Договору, в том числе которые приводят к изменению предмета Договора, КЦ вправе принять в отношении указанного Договора одно из следующих решений:

34.7.1. об изменении КЦ в одностороннем порядке условий Договоров, обязательства по которым не исполнены, и (или) порядка исполнения обязательств по Договорам, с учетом условий реорганизации эмитента ценных бумаг или условий иных действий (событий), происходящих с эмитентом и (или) ценными бумагами эмитента;

34.7.2. о признании наступившей Даты исполнения Договора в Расчетный день, предшествующий дню приостановления операций с ценными бумагами по счетам депо, проводимого в связи с корпоративными действиями, в случае если информация о таком приостановление получена КЦ от Расчётного депозитария и (или) из иных доступных источников информации.

* + - 1. КЦ при совершении действия, указанного в пункте 34.7.2. настоящих Правил, осуществляет действия, направленные на определение подлежащих исполнению обязательств в соответствии с настоящими Правилами.
      2. Информация о решении, принятом КЦ в соответствии с пунктом настоящих Правил, раскрывается на Сайте КЦ, а также направляется Участникам клиринга в виде Электронного документа, подписанного Электронной подписью.
    1. Хранение и учет документов и информации внутреннего учета
       1. КЦ осуществляет хранение и учет документов, связанных с осуществлением клиринговой деятельности, и информации внутреннего учета, связанных с осуществлением внутреннего учета, в том числе:
          - документов и (или) информации, полученных от Организатора торговли;
          - документов, полученных от Участников клиринга и иных лиц (договоры, поручения, иные документы);
          - документов, полученных от Расчетной организации и Расчетного депозитария;
          - копий поручений КЦ, направленных Расчетной организации и Расчетному депозитарию;
          - документов и (или) информации о денежных средствах и ценных бумагах, которые предназначены для исполнения обязательств, допущенных к клирингу;
          - документов и (или) информации о денежных средствах и ценных бумагах, которые являются предметом обеспечения обязательств, допущенных к клирингу;
          - иных документов и информации по усмотрению КЦ.
       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 и реестр клиентов Участника клиринга в соответствии со статьей 9 настоящих Правил;
          - иные реестры и журналы, ведение которых позволяет группировать документы и информацию внутреннего учета.
       3. КЦ хранит документы, связанные с осуществлением им клиринговой деятельности, в течение 5 лет. При этом указанный срок в отношении документов, связанных с клирингом обязательств, исчисляется с даты прекращения и (или) исполнения этого обязательства по итогам клиринга, либо исключения этого обязательства из клирингового пула в случаях, предусмотренных настоящими Правилами.
       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.
    2. Порядок урегулирования неисполненных обязательств в случае прекращения клирингового обслуживания
       1. В случае отзыва Банком России у Участника клиринга – кредитной организации лицензии на осуществление банковских операций или в случае введения в отношении Участника клиринга процедур банкротства Даты исполнения обязательств из Договоров и из Конверсионных договоров считаются наступившими и указанные обязательства прекращаются в дату, следующую за датой отзыва лицензии (датой принятия арбитражным судом решения о признании Участника клиринга банкротом и об открытии конкурсного производства).

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.

В случаях, предусмотренных настоящим пунктом, обязательства Участника клиринга, у которого отозвана лицензия на осуществления банковских операций или в отношении которого введены процедуры банкротства (далее в настоящей статье - Ликвидант), из Договоров, за исключением Договоров, заключенных в Режиме торгов Аукцион по размещению, Режиме торгов Адресное размещение, Режиме торгов Аукцион по выкупу и Режиме торгов Адресный выкуп, прекращаются в ликвидационном клиринговом пуле, формируемом в соответствии с пунктом настоящих Правил, а допущенные к клирингу обязательства Ликвиданта из Конверсионных договоров и из Договоров, заключенных в Режиме торгов Аукцион по размещению, Режиме торгов Адресное размещение, Режиме торгов Аукцион по выкупу и Режиме торгов Адресный выкуп (далее в настоящей статье - Договоры, заключаемые без участия Центрального контрагента), прекращаются в порядке, предусмотренном пунктом 36.3.настоящих Правил. При этом обязательства Ликвиданта из Договоров, за исключением Договоров, заключенных в Режиме торгов Аукцион по размещению, Режиме торгов Адресное размещение, Режиме торгов Аукцион по выкупу и Режиме торгов Адресный выкуп, прекращаются возникновением нетто-обязательства Ликвиданта в отношении КЦ, рассчитанного в соответствии с пунктом 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 36.3 настоящих Правил.

В случаях, предусмотренных настоящим пунктом, Договоры/Договоры, заключенные без участия Центрального контрагента, заключённые 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, заключённым 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) и Торгового, клирингового и иных сборов, за исключением технического сбора, указанных в статье 13 настоящих Правил, в общем порядке, предусмотренном законодательством Российской Федерации о несостоятельности (банкротстве).

КЦ направляет Ликвиданту уведомление о прекращении обязательств по Договорам/ Договорам, заключённым 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 и 36.3 настоящих Правил нетто-обязательствах Ликвиданта в отношении КЦ или в отношении Участника клиринга – контрагента. Одновременно с указанным уведомлением КЦ также направляет Ликвиданту в форме Электронного документа, подписанного Электронной подписью, уведомление о прекращении действия заключенного с ним договора об оказании клиринговых услуг.

Уведомления о прекращении обязательств по Договорам, заключённым без участия Центрального контрагента, содержащие информацию о рассчитанных в соответствии с настоящей статьей нетто-обязательствах / нетто-требованиях Участников клиринга - контрагентов по указанным договорам, направляются указанным Участникам клиринга – контрагентам в том же порядке и в те же сроки.

Возврат денежных средств Ликвиданту осуществляется КЦ не позднее 3 (трех) Расчетных 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, зарегистрированный для возврата денежных средств в соответствующей валюте, либо по реквизитам, указанным в письме Ликвиданта о возврате денежных средств, содержащего 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.

Возврат, в том числе включение в конкурсную массу, денежных средств в российских рублях/денежных средств в иностранной валюте/ценных бумаг Ликвиданта, оставшихся у КЦ после исполнения нетто-обязательств, определенных в соответствии с пунктом или 36.3 настоящих Правил, подлежат возврату КЦ Ликвиданту в сумме, оставшейся после исполнения соответствующего нетто-обязательства. Ценные бумаги Ликвиданта, оставшиеся после исполнения его нетто-обязательств в порядке, предусмотренном пунктомили 36.3. настоящих Правил, возвращаются Участнику клиринга путем предоставления согласия КЦ на вывод указанных ценных бумаг.

В случае нехватки Средств обеспечения Ликвиданта и (или) его взноса в Гарантийный фонд участников для исполнения нетто-обязательства, определённого в соответствии с пунктом или 36.3 настоящих Правил, КЦ вправе предъявить к Ликвиданту требование об исполнении указанного нетто-обязательства в общем порядке, предусмотренном законодательством о несостоятельности (банкротстве).

* + - 1. В целях определения нетто-обязательства Ликвиданта КЦ осуществляет следующие действия.

36.2.1. В дату, следующую за датой отзыва у Ликвиданта лицензии на осуществление банковских операций или за датой принятия арбитражным судом решения о признании Ликвиданта банкротом и об открытии конкурсного производства, по всем Договорам, заключённым Ликвидантом:

1) КЦ включает в ликвидационный клиринговый пул:

* + - * + обязательства и требования по денежным средствам и ценным бумагам по Договорам, не исполненные по состоянию на день отзыва у Ликвиданта лицензии на осуществление банковских операций, или по состоянию на день принятия арбитражным судом решения о признании Ликвиданта банкротом и об открытии конкурсного производства;
        + обязательства по уплате Технического сбора, определенные в соответствии со статьей 13 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 по уплате Задолженности или задолженности, определённой в соответствии со статьёй 29 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 КЦ по передаче Ликвиданту 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;

2) обязательства по ценным бумагам по Договорам, не исполненные по состоянию на день отзыва у Ликвиданта лицензии на осуществление банковских операций или по состоянию на день принятия арбитражным судом решения о признании Ликвиданта банкротом и об открытии конкурсного производства, зачитываются со встречными однородными требованиями КЦ, обязательства по передаче Дохода в форме ценных бумаг, не исполненные по состоянию на указанный день, зачитываются со встречными однородными требованиями по получению Дохода в форме ценных бумаг, определёнными в соответствии со статьей 26 настоящих Правил, и в части, в которой обязательства и требования не были прекращены зачетом, КЦ определяет итоговые обязательства Ликвиданта по ценным бумагам;

3) итоговые обязательства Ликвиданта по ценным бумагам, определённые в соответствии с подпунктом 2 настоящего пункта, переводятся в валюту расчётов путем умножения количества ценных бумаг, составляющих итоговые обязательства Ликвиданта по ценным бумагам, на Верхнюю (Нижнюю) цену принудительного закрытия, рассчитанную во время 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 итоговых обязательств Ликвиданта по ценным бумагам, предусматривающих приобретение Ликвидантом ценных бумаг, а Нижняя цены принудительного закрытия используется в целях перевода в валюту расчетов итоговых обязательств Ликвиданта по ценным бумагам, предусматривающих отчуждение Ликвидантом ценных бумаг;4) в целях определения нетто-обязательства Ликвиданта размер обязательств по передаче Дохода в форме денежных средств определяется в соответствии с пунктами 26.5., 26.6., 26.7.2. – 26.7.4 настоящих Правил;

5) обязательства с учётом положений подпунктов 2-4 настоящего пункта, возникшие до даты отзыва у Ликвиданта лицензии на осуществление банковских операций или до даты принятия арбитражным судом решения о признании Ликвиданта банкротом и об открытии конкурсного производства, зачитываются со встречными однородными требованиями по денежным средствам, и в части, в которой обязательства и требования не были прекращены зачетом, КЦ определяет итоговые обязательства Ликвиданта по денежным средствам;

6) в целях определения нетто-обязательства Ликвиданта КЦ вправе пересчитать итоговые обязательства по денежным средствам, определенные в соответствии с подпунктом 5 настоящего пункта, имеющие отрицательные значения, в валюту, в которой выражены итоговые обязательства по денежным средствам, определенные в соответствии с подпунктом 5 настоящего пункта, имеющие положительные значения, учитывая при указанном пересчете валюту, в которой выражены денежные средства, учитываемые в качестве Средств обеспечения, и (или) взнос Ликвиданта в Гарантийный фонд участников, используя для указанного пересчета Нижнюю цену принудительного закрытия, рассчитанную во время последней клиринговой сессии в соответствии с Методикой установления и изменения риск-параметров;

7) в результате действий, указанных в подпункте 6 настоящего пункта, КЦ определяет нетто-обязательство Ликвиданта по денежным средствам.

36.2.2. 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) Расчётных дней с даты определения указанного нетто-обязательства, в следующем порядке:

1) исполнение нетто-обязательства по денежным средствам осуществляется путем уменьшения размера Средств обеспечения в денежных средствах, выраженных в той же валюте, что и валюта, в которой выражено указанное нетто-обязательство, на размер исполняемого нетто-обязательства;

2) использование взноса Ликвиданта в Гарантийный фонд участников в денежных средствах, выраженных в той же валюте, что и валюта, в которой выражено нетто-обязательство Ликвиданта, осуществляется путем перечисления денежных средств, составляющих взнос Ликвиданта в Гарантийный фонд участников, в счет исполнения его нетто-обязательства;

3) осуществление действий, направленных на продажу КЦ через кредитные организации иностранной валюты (рублей Российской Федерации), составляющей Средства обеспечения, за рубли Российской Федерации (иностранную валюту). Курс продажи валют определяется кредитной организацией на дату совершения данной операции. Список кредитных организаций, в которых могут осуществляться указанные операции, устанавливается КЦ и раскрывается на Сайте КЦ;

4) осуществление действий, направленных на продажу КЦ через кредитные организации иностранной валюты (рублей Российской Федерации), составляющей взнос Ликвиданта в Гарантийный фонд участников, за рубли Российской Федерации (иностранную валюту). Курс продажи валют определяется кредитной организацией на дату совершения данной операции. Список кредитных организаций, в которых могут осуществляться указанные операции, устанавливается КЦ и раскрывается на Сайте КЦ;

5) если в результате действий, указанных в подпунктах 1-4 настоящего пункта, нетто-обязательство Ликвиданта не прекратились в полном объеме, Ликвидант признается не исполнившим нетто-обязательство по денежным средствам. В этом случае КЦ вправе совершить действия, направленные на прекращение нетто-обязательства Ликвиданта по денежным средствам, включая заключение договоров, в том числе в отношении себя лично, от имени Ликвиданта без специального полномочия (доверенности), а также без согласия Ликвиданта.

При наличии у Ликвиданта Средств обеспечения в ценных бумагах КЦ по своему усмотрению использует их в целях прекращения нетто-обязательства Ликвиданта по денежным средствам путем продажи указанных ценных бумаг. Сумма денежных средств, полученная в результате их продажи, 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 или на сумму использованных денежных средств Гарантийного фонда участников из взноса Ликвиданта.

Расчеты по денежным средства считаются завершёнными с момента их отражения в учете на клиринговых регистрах Ликвиданта.

36.3. КЦ рассчитывает размер нетто-обязательства Ликвиданта по Договорам, заключённым без участия Центрального контрагента, в отношении других Участников клиринга – его контрагентов в следующем порядке: нетто-обязательство Ликвиданта по денежным средствам в каждой валюте в отношении каждого Участника клиринга – контрагента по Договорам, заключённым без участия Центрального контрагента, рассчитывается по Договорам, заключённым без участия Центрального контрагента, в соответствующей валюте, заключенным с данным Участником клиринга как разница суммы требований и суммы обязательств Ликвиданта по денежным средствам в соответствующей валюте; нетто-обязательство Ликвиданта по ценным бумагам в отношении каждого Участника клиринга – контрагента по Договорам, заключённым без участия Центрального контрагента, рассчитывается по Договорам, заключённым без участия Центрального контрагента, заключенным с данным Участником клиринга как разница объема требований и объема обязательств Ликвиданта по ценным бумагам.

Приложение № 1

к Правилам осуществления клиринговой деятельности

на рынке ценных бумаг

Публичного акционерного общества

"Клиринговый центр МФБ"

Перечень

документов, необходимых для регистрации Заявителя в качестве Участника клиринга

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **№** | **Наименование документа** | **Форма предоставления** |
|  | Зарегистрированные учредительные документы Заявителя с действующими изменениями и дополнениями | нотариально заверенная или заверенная уполномоченным сотрудником Заявителя копия |
|  | Свидетельство о внесении в Единый государственный реестр юридических лиц записи о Заявителе при создании, или лист записи о внесении в Единый государственный реестр юридических лиц записи о Заявителе при создании | нотариально заверенная или заверенная уполномоченным сотрудником Заявителя копия |
|  | Свидетельство о государственной регистрации Заявителя (в случае если Заявитель создан до 01 июля 2002 года) | нотариально заверенная или заверенная уполномоченным сотрудником Заявителя копия |
|  | Свидетельство о постановке российской организации на учет в налоговом органе по месту нахождения на территории Российской Федерации | нотариально заверенная или заверенная уполномоченным сотрудником Заявителя копия |
|  | Карточка с образцами подписей должностных лиц Заявителя и оттиска печати Заявителя (по форме, установленной Банком России для предоставления при открытии банковского счета) | оригинал или нотариально заверенная копия |
|  | Документ, подтверждающий факт избрания (назначения) на должность лица, имеющего право действовать от имени Заявителя без доверенности | оригинал, нотариально заверенная или заверенная уполномоченным сотрудником Заявителя копия |
|  | Лицензия на осуществление банковских операций (для кредитных организаций) | нотариально заверенная или заверенная уполномоченным сотрудником Заявителя копия |
|  | Лицензия профессионального участника рынка ценных бумаг на осуществление брокерской деятельности, на осуществление дилерской деятельности, на осуществление деятельности по управлению ценными бумагами (для брокеров, дилеров и управляющих) | нотариально заверенная или заверенная уполномоченным сотрудником Заявителя копия |
|  | Лицензия управляющей компании на осуществление деятельности по управлению инвестиционными фондами, паевыми инвестиционными фондами и негосударственными пенсионными фондами (для управляющих компаний инвестиционных фондов, паевых инвестиционных фондов, негосударственных пенсионных фондов) | нотариально заверенная или заверенная уполномоченным сотрудником Заявителя копия |

Приложение № 2

к Правилам осуществления клиринговой деятельности

на рынке ценных бумаг

Публичного акционерного общества

"Клиринговый центр МФБ"

Тарифы  
за клиринговые услуги

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| № | Наименование услуги | Стоимость\* | Порядок оплаты |
|  | Ведение клиринговых регистров Участника клиринга, допущенного к клиринговому обслуживанию | 100 (Сто) рублей в месяц | Взимается ежемесячно вне зависимости от количества открытых клиринговых регистров Участника клиринга, от проведения по ним операций в течение месяца и времени действия клиринговых регистров в течение месяца одним из следующих способов по усмотрению КЦ:  1. путем выставления счета за оказанные услуги до 5 (пятого) числа месяца, следующего за отчетным;  2. путем включения обязательств по уплате указанного сбора в последний Расчетный день отчетного месяца в клиринговый пул для расчетов по итогам Торгов. |
|  | Ведение клиринговых регистров Участника клиринга в целях ведения отдельного учета в рамках ТКС, зарегистрированного для отдельного клиента Участника клиринга | 50 000 (Пятьдесят тысяч) рублей в месяц | Взимается ежемесячно за каждый ТКС вне зависимости от поведения операций в течение месяца и времени действия клиринговых регистров в течение месяца одним из следующих способов по усмотрению КЦ:  1. путем выставления счета за оказанные услуги до 5 (пятого) числа месяца, следующего за отчетным;  2. путем включения обязательств по уплате указанного сбора в последний Расчетный день отчетного месяца в клиринговый пул для расчетов по итогам Торгов.  Указанный тариф не взимается с Участника клиринга, в случае перевода долга, уступки требования и передачи имущества клиента данного Участника клиринга другому Участнику клиринга, за месяц, в течение которого были осуществлены указанные действия. |
|  | Процедура принудительного закрытия позиций при проведении клиринга, за Договор | 0.05% от суммы Договора, заключаемого в целях открытия / закрытия позиций при выполнении указанной процедуры, но не менее 10 000 (Десяти тысяч) рублей (в случае если валюта цены Договора выражена в российских рублях) или 200 (Двухсот) долларов США (в случае если валюта цены Договора выражена в долларах США) за выполнение процедуры, НДС не облагается. | Взимается с Участника клиринга, к которому была применена указанная процедура, в дату проведения процедуры.  Указанная плата взимается путем включения обязательства по уплате указанного сбора в клиринговый пул для расчетов по итогам Торгов в Расчетный день, когда была применена указанная процедура.  Взимается с денежного регистра, код которого соответствует регистрам учета позиций, на которых учитываются / учитывались открытые / закрытые позиции по Договорам. |
|  | Обработка Заявления на открытие Субсчета депо, открываемого в интересах Участника клиринга, на Клиринговом счете депо КЦ в Расчетном депозитарии.  Обработка поручений Участника клиринга на внесение и возврат Средств обеспечения в ценных бумагах и/или ценных бумаг на/c Субсчета депо.  Учет ценных бумаг на клиринговых регистрах  Исполнение обязательств по поставке/получению ценных бумаг по итогам клиринга | Сумма денежных средств равная сумме денежных средств, уплаченных КЦ Расчётному депозитарию, в связи с обслуживанием в интересах Участника клиринга Субсчета депо Клирингового счета депо в Расчетном депозитарии. | Взимается с Участника клиринга или Депозитария\_ путем выставления счета за оказанные услуги до 5 (пятого) числа месяца, следующего за месяцем, в котором были оказаны услуги. |
|  | Возврат Средств обеспечения Участника клиринга в иностранной валюте | Сумма денежных средств равная сумме денежных средств, уплаченных КЦ Расчетной организации, в связи с исполнением поручения на возврат денежных средств. | Взимается путем выставления счета за оказанные услуги до 5 (пятого) числа месяца, следующего за месяцем, в котором были оказаны услуги |
|  | Замена валюты денежных средств, учитываемых в качестве Средств обеспечения | 0,0015 % от размера денежных средств, выраженных в рублях Российской Федерации, продаваемых / покупаемых за иностранную валюту, в связи с заменой валюты денежных средств | Взимается путем включения обязательства по уплате указанного сбора в клиринговый пул для расчетов по итогам Торгов в Расчетный день, когда была произведена замена валюты денежных средств, учитываемых в качестве Средств обеспечения. |
|  | Списание с Торгового счета/Субсчета депо ценных бумаг иностранного эмитента, учитываемых в качестве Средств обеспечения Участника клиринга, на основании поручения на списание ценных бумаг в количестве, превышающем совокупное количество ценных бумаг данного иностранного эмитента, внесенных в качестве Средств обеспечения данным Участником клиринга, а также полученных на Торговый счет/Субсчет депо в результате осуществления глобальной операции с ценными бумагами | 25 000 (Двадцать пять тысяч) рублей | Взимается путем включения обязательства по уплате указанного сбора в клиринговый пул для расчетов по итогам Торгов в Расчетный день, когда была произведена обработка поручения на списание ценных бумаг. |

\* НДС, начисляемый КЦ за оказанные услуги, взимается по ставке, установленной законодательством Российской Федерации на дату оказания услуг, в случае если уплата указанного налога предусмотрена действующим законодательством Российской Федерации о налогах и сборах.

Приложение № 3

к Правилам осуществления клиринговой деятельности

на рынке ценных бумаг

Публичного акционерного общества

"Клиринговый центр МФБ"

ФИНАНСОВАЯ ОТЧЕТНОСТЬ,   
ПРЕДОСТАВЛЯЕМАЯ УЧАСТНИКАМИ КЛИРИНГА В КЦ  
И СРОКИ ЕЁ ПРЕДОСТАВЛЕНИЯ

1. **Отчетность Участников клиринга – кредитных организаций:**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Наименование и форма отчетности** | **Периодичность предоставления** | **Сроки предоставления** |
| Оборотная ведомость по счетам бухгалтерского учета кредитной организации (форма 0409101) | ежемесячно | не позднее 15 рабочего дня месяца, следующего за отчетным месяцем |
| Отчет о финансовых результатах кредитной организации (форма 0409102) | ежеквартально | не позднее 15 рабочего дня месяца, следующего за отчетным кварталом; |
| Расчет собственных средств (капитала) (“Базель III”) (форма 0409123) | ежемесячно; | не позднее 15 рабочего дня месяца, следующего за отчетным месяцем; |
| Информацию об обязательных нормативах и о других показателях деятельности кредитной организации (форма 0409135) | ежемесячно | не позднее 15 рабочего дня месяца, следующего за отчетным месяцем; |

**2. Отчетность Участников клиринга-некредитных организаций:**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Наименование и форма отчетности** | **Периодичность предоставления** | **Сроки предоставления** |
| Расчет размера собственных средств для профессиональных участников рынка ценных бумаг | ежемесячно | не позднее одного календарного месяца, следующего за отчетным месяцем; |
| "Показатели отчета о финансовых результатах" (форма 0420411) | ежеквартально | не позднее последнего дня месяца следующего за отчетным[[1]](#footnote-1) кварталом; |

1. За исключением отчета за 4 квартал, который предоставляется не позднее 30 марта года, следующего за отчетным. [↑](#footnote-ref-1)